

# Relatório Analítico dos Investimentos em junho, 2º Trimestre e 1º semestre de 2016



Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	3.938.595,44	5,39%	167	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.418.411,38	11,51%	602	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.461.114,60	8,83%	112	1,94%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	3.879.318,40	5,30%	193	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2016	2.174.236,00	2,97%	85	0,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.422.793,58	7,41%	644	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.113,19	0,01%	136	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	379.515,72	0,52%	534	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	143.112,99	0,20%	200	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	5.513.259,74	7,54%	1.175	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.134.912,18	8,39%	701	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	7.364.067,21	10,07%	560	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	10.521.260,84	14,39%	738	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	11.752.773,44	16,07%	1.331	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	5.563,24	0,01%	151	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.019.710,93	1,39%	573	0,10%	Artigo 7º, Inciso IV
<b>Total</b>			<b>73.132.758,88</b>				

Enquadramentos na Resolução 3.922 / 4.392 / 4.604 e Política de Investimentos - base (junho / 2016)

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	100,00%	72.107.484,71	98,60%	1.025.274,17
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	50,00%	0,00	0,00%	36.566.379,44
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	30,00%	0,00	0,00%	21.939.827,66
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	10,00%	0,00	0,00%	7.313.275,89
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.656.637,94
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>195,00</b>	<b>72.107.484,71</b>	<b>98,60%</b>	

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	10,00%	0,00	0,00%	7.313.275,89
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	0,00	0,00%	10.969.913,83
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.656.637,94
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.656.637,94
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.656.637,94
<b>Total</b>	<b>30,00%</b>	<b>40,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (junho / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5+	2,571%	20,82%	7,29%	20,82%	17,14%	33,97%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,58%	20,49%	7,13%	20,49%	16,21%	32,22%	0,20%	3,176%	13,77%
IRF-M	2,134%	14,36%	5,94%	14,36%	16,48%	27,75%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,06%	14,28%	5,94%	14,28%	16,18%	27,12%	0,20%	1,357%	4,46%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,01%	14,26%	5,97%	14,26%	15,99%	26,88%	0,20%	1,350%	4,34%
IMA-B	1,929%	16,15%	5,83%	16,15%	16,73%	32,26%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,92%	15,96%	5,78%	15,96%	15,21%	30,03%	0,20%	2,302%	9,79%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,90%	15,96%	5,76%	15,96%	16,24%	31,43%	0,20%	2,296%	9,75%
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,34%	4,16%	3,53%	4,16%	-	-	0,20%	0,145%	-
IMA Geral	1,815%	12,87%	5,20%	12,87%	15,87%	29,08%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,76%	12,62%	5,15%	12,62%	15,21%	28,02%	0,20%	1,222%	4,85%
CDI	1,161%	6,72%	3,36%	6,72%	14,09%	27,57%	-	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1,17%	6,27%	3,20%	6,27%	13,15%	25,58%	1,00%	0,106%	0,08%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	1,09%	6,28%	3,14%	6,28%	13,13%	25,47%	0,80%	0,000%	0,01%
IRF-M 1	1,082%	7,42%	3,25%	7,42%	14,96%	27,79%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,06%	7,38%	3,25%	7,38%	14,82%	27,31%	0,20%	0,120%	0,49%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,03%	7,34%	3,22%	7,34%	14,66%	27,00%	0,10%	0,117%	0,51%

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (junho / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5	0,938%	8,84%	3,31%	8,84%	16,94%	31,07%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,92%	8,66%	3,26%	8,66%	16,43%	30,14%	0,20%	1,106%	3,51%
IDKA IPCA 2 Anos	0,933%	8,58%	3,25%	8,58%	17,00%	31,47%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,27%	7,36%	3,53%	7,36%	16,27%	-	0,20%	0,257%	1,40%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,88%	8,41%	3,32%	8,41%	16,74%	30,55%	0,20%	1,115%	3,11%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,82%	8,36%	3,26%	8,36%	16,56%	30,05%	0,20%	1,178%	3,23%
IPCA	0,350%	4,42%	1,75%	4,42%	8,84%	18,53%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,03%	8,76%	3,57%	8,76%	16,01%	-	0,20%	0,945%	3,48%

Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (junho / 2016)

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	40.517.030,60	55,40%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	32.615.728,28	44,60%

Sub-segmento	Valor	%
IDKA IPCA 2A	22.818.990,62	31,20%
IRF-M 1	17.266.033,18	23,61%
IMA-B	12.786.860,79	17,48%
IRF-M	6.840.630,32	9,35%
IMA-B 5	6.134.912,18	8,39%
IPCA	3.938.595,44	5,39%
CDI	1.025.274,17	1,40%
IMA-GERAL	143.112,99	0,20%
IMA-B 5+	4.113,19	0,01%

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

**Acumulado no Ano**

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	63.527.792,73	1.020.271,84	460.000,00	65.442.807,02	1.354.742,45	2,11%	1,74%	121,53%	1,23%
Fevereiro	65.442.807,02	1.228.953,35	751.371,74	66.889.690,07	969.301,44	1,47%	1,34%	109,38%	1,44%
Março	66.889.690,07	1.119.524,85	624.503,27	68.788.527,21	1.403.815,56	2,08%	0,94%	221,11%	2,32%
Abril	68.788.527,21	1.090.117,83	656.354,89	70.672.763,88	1.450.473,73	2,10%	1,08%	194,68%	1,47%
Mai	70.672.763,88	6.708.796,89	6.109.370,86	71.779.551,10	507.361,19	0,71%	1,27%	56,03%	1,28%
Junho	71.779.551,10	3.711.581,62	3.239.365,37	73.132.758,88	880.991,53	1,22%	0,86%	141,49%	1,02%
Acumulado no ano					6.566.685,90	10,09%	7,45%	135,31%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de junho / 2016

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.009,85	0,00	0,00	4.113,19	103,34	2,58%	3,18%	2,58%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	371.855,36	0,00	0,00	379.515,72	7.660,36	2,06%	1,36%	2,06%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.333.915,07	0,00	0,00	6.461.114,60	127.199,53	2,01%	1,35%	2,01%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.320.569,08	0,00	0,00	5.422.793,58	102.224,50	1,92%	2,30%	1,92%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.226.464,02	0,00	0,00	7.364.067,21	137.603,19	1,90%	2,30%	1,90%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	140.639,05	0,00	0,00	143.112,99	2.473,94	1,76%	1,22%	1,76%
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.145.462,00	0,00	0,00	2.174.236,00	28.774,00	1,34%	0,15%	1,34%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.830.769,82	0,00	0,00	3.879.318,40	48.548,58	1,27%	0,26%	1,27%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	11.629.961,64	0,00	0,00	11.752.773,44	122.811,80	1,06%	0,12%	1,06%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.456.824,72	0,00	0,00	5.513.259,74	56.435,02	1,03%	0,12%	1,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.898.608,99	0,00	0,00	3.938.595,44	39.986,45	1,03%	0,94%	1,03%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	712.417,73	988.695,72	697.472,05	1.019.710,93	16.069,53	0,94%	0,11%	1,17%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.435.637,34	0,00	0,00	10.521.260,84	85.623,50	0,82%	1,18%	0,82%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.546.969,94	538.900,00	0,00	6.134.912,18	49.042,24	0,81%	1,11%	0,92%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	358.551,69	185.727,90	542.683,32	5.563,24	3.966,97	0,73%	0,00%	1,09%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.372.642,80	1.998.258,00	0,00	8.418.411,38	47.510,58	0,57%	1,11%	0,88%
CAIXA BRASIL IPCA XII FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.994.252,00	0,00	1.999.210,00	0,00	4.958,00	0,25%	-	-
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>880.991,53</b>	<b>1,22%</b>	<b>1,02%</b>	



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre / 2016

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.963.281,72	0,00	0,00	7.364.067,21	400.785,49	5,76%	5,76%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	11.382.962,93	0,00	0,00	11.752.773,44	369.810,51	3,25%	3,25%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.097.113,81	0,00	0,00	6.461.114,60	364.000,79	5,97%	5,97%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.188.663,28	0,00	0,00	10.521.260,84	332.597,56	3,26%	3,26%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.126.337,60	0,00	0,00	5.422.793,58	296.455,98	5,78%	5,78%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.425.262,35	0,00	5.500.000,00	143.112,99	217.850,64	5,80%	5,15%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.221.740,46	1.998.258,00	0,00	8.418.411,38	198.412,92	3,01%	3,32%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.341.135,33	0,00	0,00	5.513.259,74	172.124,41	3,22%	3,22%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.802.952,93	0,00	0,00	3.938.595,44	135.642,51	3,57%	3,57%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.747.140,87	0,00	0,00	3.879.318,40	132.177,53	3,53%	3,53%
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.100.006,00	0,00	0,00	2.174.236,00	74.230,00	3,53%	3,53%
CAIXA BRASIL IPCA XII FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.951.379,00	0,00	1.999.210,00	0,00	47.831,00	2,45%	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	6.103.900,00	0,00	6.134.912,18	31.012,18	0,48%	3,26%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	18.070,36	2.863.856,22	1.893.197,80	1.019.710,93	30.982,15	2,32%	3,20%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	358.230,72	0,00	0,00	379.515,72	21.285,00	5,94%	5,94%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	100,39	544.482,12	547.683,32	5.563,24	8.664,05	2,51%	3,14%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	64.149,46	0,00	65.000,00	4.113,19	4.963,73	10,35%	7,13%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>2.838.826,45</b>	<b>4,08%</b>	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre / 2016

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.350.319,19	0,00	0,00	7.364.067,21	1.013.748,02	15,96%	15,96%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.950.740,36	0,00	5.867,58	11.752.773,44	807.900,66	7,38%	7,38%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.654.941,64	0,00	100,00	6.461.114,60	806.272,96	14,26%	14,26%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.697.993,08	2.068.114,44	0,00	10.521.260,84	755.153,32	8,22%	8,36%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.676.598,24	0,00	0,00	5.422.793,58	746.195,34	15,96%	15,96%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.909.443,49	165.430,99	5.500.000,00	143.112,99	568.238,51	13,23%	12,62%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.553.413,26	2.384.166,62	0,00	8.418.411,38	480.831,50	8,02%	8,41%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.934.499,65	584.069,71	1.404.964,48	5.513.259,74	399.654,86	7,23%	7,34%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.728.251,53	0,00	110.456,96	3.938.595,44	320.800,87	8,74%	8,76%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.718.659,11	0,00	107.904,22	3.879.318,40	268.563,51	7,35%	7,36%
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.087.448,00	0,00	59.387,36	2.174.236,00	146.175,36	7,13%	4,16%
CAIXA BRASIL IPCA XII FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.876.359,00	0,00	1.999.210,00	0,00	122.851,00	6,55%	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	332.088,79	0,00	0,00	379.515,72	47.426,93	14,28%	14,28%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,00	3.028.982,50	2.040.392,21	1.019.710,93	31.120,64	2,41%	6,27%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	6.103.900,00	0,00	6.134.912,18	31.012,18	0,48%	8,66%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	57.037,39	0,00	65.000,00	4.113,19	12.075,80	24,11%	20,49%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,00	544.582,12	547.683,32	5.563,24	8.664,44	2,91%	6,28%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>6.566.685,90</b>	<b>10,09%</b>	