

Relatório Analítico dos Investimentos em julho 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 (julho / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2016	3.299.016,00	4,31%	85	0,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2016 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2016	5.687.880,00	7,43%	119	0,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	22.775.550,70	29,77%	1.325	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	33.064.879,68	43,21%	1.170	0,44%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	1.257.231,34	1,64%	116	0,26%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	3.846.776,02	5,03%	811	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	5.691.548,77	7,44%	576	0,56%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	846.714,40	1,11%	100	0,43%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
Total para cálculo dos limites da Resolução			76.469.596,91				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			47.593,17	Artigo 6º			
Total			76.517.190,08				

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

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	70,00%	64.827.326,38	84,78%	-11.298.608,54
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	20,00%	0,00	0,00%	15.293.919,38
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	0,00%	10.795.556,13	14,12%	-10.795.556,13
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.823.479,85
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00%	846.714,40	1,11%	-846.714,40
Total Renda Fixa	100,00%	95,00	76.469.596,91	100,00%	

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.823.479,85
Total	30,00%	5,00	0,00	0,00%	

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	2,51%	19,06%	4,38%	16,82%	20,53%	34,07%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2016 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,16%	5,36%	4,00%	3,73%	9,55%	-	0,20%	0,086%	4,20%
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,15%	5,36%	4,00%	3,73%	9,47%	-	0,20%	0,086%	4,25%
CDI	1,11%	7,90%	3,41%	6,78%	14,01%	27,78%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,13%	7,69%	3,37%	6,57%	13,85%	27,91%	0,20%	0,011%	0,17%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,05%	7,39%	3,33%	6,34%	13,09%	25,82%	1,00%	0,011%	0,08%
IRF-M 1	1,04%	8,53%	3,22%	6,78%	14,68%	27,91%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,03%	8,49%	3,17%	6,75%	14,55%	27,44%	0,20%	0,110%	0,47%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,03%	8,44%	3,13%	6,71%	14,41%	27,14%	0,10%	0,111%	0,49%
IPCA	0,52%	4,96%	1,66%	3,64%	8,74%	19,13%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,87%	8,70%	3,25%	7,13%	15,28%	33,53%	0,20%	0,024%	0,32%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,37%	11,37%	2,98%	7,25%	16,57%	-	0,20%	0,831%	3,46%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	43.860.435,81	57,36%
Caixa Econômica Federal	32.609.161,10	42,64%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	47.593,17	0,06%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	55.840.430,38	73,02%
CDI	9.538.324,79	12,47%
IMA-B 5	1.257.231,34	1,64%
CRÉDITO PRIVADO	846.714,40	1,11%
DISP. FINANCEIRA	47.593,17	0,06%

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	58.708.476,58	3.081.427,72	1.097.949,17	61.646.872,08	954.916,95	1,57%	1,74%	90,46%	0,36%
Fevereiro	61.646.872,08	59.676,04	1.795.860,61	60.561.416,85	650.729,34	1,06%	1,34%	78,52%	0,82%
Março	60.561.416,85	4.332.009,80	0,00	65.626.375,48	732.948,83	1,13%	0,94%	119,88%	0,19%
Abril	65.626.375,48	2.231.176,28	1.203.775,17	67.328.651,88	674.875,29	1,01%	1,08%	94,07%	0,18%
Mai	67.328.651,88	2.120.208,24	1.193.264,40	68.992.810,97	737.215,25	1,08%	1,27%	85,01%	0,10%
Junho	68.992.810,97	2.598.697,24	1.228.190,56	71.114.317,02	750.999,37	1,07%	0,86%	123,85%	0,13%
Julho	71.114.317,02	3.078.695,92	1.746.887,72	73.173.739,45	727.614,23	1,00%	1,01%	99,51%	0,10%
Acumulado no ano					5.229.299,26	8,20%	8,54%	95,99%	

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL 2016 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.622.920,00	0,00	0,00	5.687.880,00	64.960,00	1,16%	0,09%	1,16%
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.261.354,00	0,00	0,00	3.299.016,00	37.662,00	1,15%	0,09%	1,15%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	22.543.020,16	0,00	0,00	22.775.550,70	232.530,54	1,03%	0,11%	1,03%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.373.546,74	261.199,23	0,00	5.691.548,77	56.802,80	1,01%	0,01%	1,05%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	3.443.801,85	436.483,12	72.166,70	3.846.776,02	38.657,75	1,00%	0,01%	1,13%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	31.763.704,29	2.750.000,00	1.764.805,37	33.064.879,68	315.980,76	0,92%	0,11%	1,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.246.381,51	0,00	0,00	1.257.231,34	10.849,83	0,87%	0,02%	0,87%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	843.616,20	0,00	0,00	846.714,40	3.098,20	0,37%	0,83%	0,37%
Total Renda Fixa					760.541,88	1,00%	0,10%	