

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



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
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	22.543.020,16	30,22%	1.331	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2016	3.261.354,00	4,37%	85	0,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2016 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2016	5.622.920,00	7,54%	119	0,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	31.763.704,29	42,58%	1.175	0,41%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	3.443.801,85	4,62%	824	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	1.246.381,51	1,67%	116	0,26%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	5.373.546,74	7,20%	573	0,54%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	843.616,20	1,13%	100	0,43%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
Total para cálculo dos limites da Resolução			74.098.344,75				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			497.462,60	Artigo 6º			
Total			74.595.807,35				

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%	70,00%	63.190.998,45	85,28%	-11.322.157,13
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	20,00%	0,00	0,00%	14.819.668,95
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	0,00%	10.063.730,10	13,58%	-10.063.730,10
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.704.917,24
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00%	843.616,20	1,14%	-843.616,20
Total Renda Fixa	100,00%	95,00	74.098.344,75	100,00%	

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.704.917,24
Total	30,00%	5,00	0,00	0,00%	

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	1,93%	16,15%	5,83%	16,15%	16,73%	32,26%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2016 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,34%	4,16%	3,54%	4,16%	9,84%	-	0,20%	0,145%	4,20%
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,34%	4,16%	3,53%	4,16%	-	-	0,20%	0,145%	-
CDI	1,16%	6,72%	3,36%	6,72%	14,09%	27,57%	-	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,17%	6,27%	3,20%	6,27%	13,15%	25,58%	1,00%	0,106%	0,08%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,07%	6,49%	3,22%	6,49%	13,92%	27,68%	0,20%	0,271%	0,17%
IRF-M 1	1,08%	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%
IPCA	0,35%	4,42%	1,75%	4,42%	8,84%	18,53%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,12%	7,77%	3,29%	7,77%	15,72%	33,49%	0,20%	0,092%	0,31%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,10%	10,96%	3,27%	10,96%	17,28%	-	0,20%	0,734%	3,58%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	41.827.434,39	56,45%
Caixa Econômica Federal	32.270.910,36	43,55%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	497.462,60	0,67%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	54.306.724,45	73,29%
CDI	8.817.348,59	11,90%
IMA-B 5	1.246.381,51	1,68%
CRÉDITO PRIVADO	843.616,20	1,14%
DISP. FINANCEIRA	497.462,60	0,67%

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%
Acumulado no ano					4.501.685,03	7,12%	7,45%	95,52%	

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 2016 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.548.475,00	0,00	0,00	5.622.920,00	74.445,00	1,34%	0,15%	1,34%
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.218.193,00	0,00	0,00	3.261.354,00	43.161,00	1,34%	0,15%	1,34%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.095.721,74	217.398,63	0,00	5.373.546,74	60.426,37	1,14%	0,11%	1,17%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.232.546,14	0,00	0,00	1.246.381,51	13.835,37	1,12%	0,09%	1,12%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	834.449,00	0,00	0,00	843.616,20	9.167,20	1,10%	0,73%	1,10%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	22.307.454,59	0,00	0,00	22.543.020,16	235.565,57	1,06%	0,12%	1,06%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	3.070.293,74	395.907,62	56.215,94	3.443.801,85	33.816,43	0,98%	0,27%	1,07%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	30.740.926,42	2.037.800,46	1.326.730,56	31.763.704,29	311.707,97	0,95%	0,12%	1,03%
Total Renda Fixa					782.124,91	1,07%	0,13%	

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 IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	29.480.276,29	5.373.187,34	4.022.300,84	31.763.704,29	932.541,50	2,96%	3,22%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	21.833.685,82	0,00	0,00	22.543.020,16	709.334,34	3,25%	3,25%
CAIXA BRASIL 2016 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.430.865,00	0,00	0,00	5.622.920,00	192.055,00	3,54%	3,54%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.017.305,60	1.204.372,82	0,00	5.373.546,74	151.868,32	3,02%	3,20%
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.150.009,00	0,00	0,00	3.261.354,00	111.345,00	3,53%	3,53%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	2.492.176,37	947.651,43	86.368,98	3.443.801,85	90.343,03	2,95%	3,22%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.206.695,41	0,00	0,00	1.246.381,51	39.686,10	3,29%	3,29%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	816.911,90	0,00	0,00	843.616,20	26.704,30	3,27%	3,27%
Total Renda Fixa					2.253.877,59	3,19%	

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 IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	26.213.337,80	9.644.339,24	6.094.644,56	31.763.704,29	2.000.671,81	6,87%	7,34%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	20.757.156,48	243.726,00	0,00	22.543.020,16	1.542.137,68	7,38%	7,38%
CAIXA BRASIL 2016 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.398.420,00	0,00	153.688,24	5.622.920,00	378.188,24	7,13%	4,16%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.163.266,86	3.084.552,42	111.195,46	5.373.546,74	236.922,92	5,63%	6,27%
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.131.172,00	0,00	89.081,03	3.261.354,00	219.263,03	7,13%	4,16%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1.735.269,33	2.549.576,58	974.166,07	3.443.801,85	133.122,01	5,18%	6,49%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.191.050,40	0,00	35.284,74	1.246.381,51	90.615,85	7,74%	7,77%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	760.303,60	0,00	0,00	843.616,20	83.312,60	10,96%	10,96%
				Total Renda Fixa	4.684.234,14	7,11%	