

Relatório Analítico dos Investimentos em agosto 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 (agosto / 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	32.140.430,19	40,69%	1.336	0,32%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	35.374.489,30	44,79%	1.176	0,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	3.565.826,21	4,51%	808	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	1.235.377,14	1,56%	116	0,26%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	5.790.149,56	7,33%	583	0,43%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	861.774,20	1,09%	100	0,43%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
Total para cálculo dos limites da Resolução			78.968.046,60				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			15.711,11	Artigo 6º			
Total			78.983.757,71				

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

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	70,00%	67.514.919,49	85,50%	-12.237.286,87
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	20,00%	0,00	0,00%	15.793.609,32
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	0,00%	10.591.352,91	13,41%	-10.591.352,91
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.948.402,33
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00%	861.774,20	1,09%	-861.774,20
Total Renda Fixa	100,00%	95,00	78.968.046,60	100,00%	

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.948.402,33
Total	30,00%	5,00	0,00	0,00%	

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	1,21%	9,21%	3,52%	7,00%	14,13%	28,23%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,25%	9,04%	3,49%	6,87%	14,01%	28,38%	0,20%	0,021%	0,17%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,16%	8,63%	3,42%	6,60%	13,22%	26,27%	1,00%	0,016%	0,08%
IRF-M 1	1,19%	9,83%	3,35%	6,89%	14,87%	28,36%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,17%	9,76%	3,30%	6,83%	14,74%	27,89%	0,20%	0,051%	0,45%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,16%	9,70%	3,26%	6,78%	14,60%	27,58%	0,10%	0,051%	0,47%
IPCA	0,44%	5,42%	1,32%	3,17%	8,97%	19,36%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,78%	13,35%	3,27%	8,03%	18,95%	-	0,20%	0,705%	3,35%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,09%	9,89%	3,12%	6,58%	15,49%	34,24%	0,20%	0,123%	0,32%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	45.965.842,21	58,21%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	33.002.204,39	41,79%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	15.711,11	0,02%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	67.514.919,49	85,50%
CDI	9.355.975,77	11,85%
IMA-B 5	1.235.377,14	1,56%
CRÉDITO PRIVADO	861.774,20	1,09%
DISP. FINANCEIRA	15.711,11	0,02%

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%
Agosto	73.173.739,45	11.930.006,13	10.453.857,97	75.508.035,75	858.148,14	1,15%	0,98%	117,83%	0,06%
Acumulado no ano					6.087.447,40	9,44%	9,60%	98,36%	

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	846.714,40	0,00	0,00	861.774,20	15.059,80	1,78%	0,71%	1,78%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.691.548,77	119.604,70	86.277,62	5.790.149,56	65.273,71	1,12%	0,02%	1,16%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.257.231,34	0,00	35.417,95	1.235.377,14	13.563,75	1,08%	0,12%	1,09%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	33.064.879,68	2.648.245,94	722.518,48	35.374.489,30	383.882,16	1,07%	0,05%	1,16%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	22.775.550,70	9.047.751,00	0,00	32.140.430,19	317.128,49	1,00%	0,05%	1,17%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	3.846.776,02	396.094,72	718.614,96	3.565.826,21	41.570,43	0,98%	0,02%	1,25%
CAIXA BRASIL 2016 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.687.880,00	0,00	5.726.415,00	0,00	38.535,00	0,68%	-	-
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.299.016,00	0,00	3.321.336,00	0,00	22.320,00	0,68%	-	-
Total Renda Fixa					897.333,34	1,15%	0,06%	