

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 IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.285,71	0,01%	176	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	9.728.834,78	12,88%	631	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.612.278,60	8,76%	157	0,63%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	1.999.904,89	2,65%	167	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	555.193,26	0,74%	193	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	12.013.516,99	15,91%	1.336	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.694.798,39	8,86%	716	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.274.262,56	8,31%	731	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	388.292,21	0,51%	598	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	146.952,82	0,19%	207	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	13.194.910,91	17,47%	753	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	5.634.697,44	7,46%	1.176	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	10.591.049,21	14,02%	601	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	357.573,86	0,47%	179	0,13%	Artigo 7º, Inciso IV
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.323.238,99	1,75%	583	0,10%	Artigo 7º, Inciso IV
Total			75.519.790,62				

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%	100,00%	73.838.977,77	97,77%	1.680.812,85
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	50,00%	0,00	0,00%	37.759.895,31
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	30,00%	0,00	0,00%	22.655.937,19
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	10,00%	0,00	0,00%	7.551.979,06
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.775.989,53
Total Renda Fixa	100,00%	195,00	73.838.977,77	97,77%	

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	10,00%	0,00	0,00%	7.551.979,06
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	0,00	0,00%	11.327.968,59
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.775.989,53
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.775.989,53
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.775.989,53
Total	30,00%	40,00	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
IDKA IPCA 2 Anos	1,287%	10,97%	3,16%	5,69%	17,70%	31,48%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,28%	10,91%	3,19%	6,25%	17,70%	30,36%	0,20%	0,755%	3,06%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,22%	10,94%	3,23%	6,39%	17,78%	30,85%	0,20%	0,732%	2,94%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,69%	9,33%	3,13%	6,31%	16,22%	-	0,20%	0,552%	1,24%
CDI	1,214%	9,21%	3,52%	7,00%	14,13%	28,23%	-	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1,16%	8,63%	3,42%	6,60%	13,22%	26,27%	1,00%	0,016%	0,08%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	1,14%	8,60%	3,30%	6,54%	13,18%	26,11%	0,80%	0,001%	0,00%
IRF-M 1	1,192%	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%
IMA-B 5	1,094%	11,35%	3,27%	6,50%	18,11%	31,19%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,07%	11,13%	3,21%	6,38%	17,61%	30,24%	0,20%	0,801%	3,29%
IMA Geral	1,029%	15,92%	4,57%	11,75%	19,78%	27,84%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,02%	15,64%	4,49%	11,57%	19,16%	26,88%	0,20%	0,925%	4,52%
IRF-M	0,976%	17,01%	4,49%	12,10%	18,72%	27,21%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,99%	16,93%	4,39%	12,14%	18,34%	26,49%	0,20%	0,968%	4,07%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,98%	16,92%	4,42%	12,05%	18,50%	26,64%	0,20%	0,968%	4,21%

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
IMA-B	0,887%	20,11%	5,41%	15,26%	25,51%	29,04%	-	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,89%	19,92%	5,38%	15,20%	25,07%	28,34%	0,20%	1,899%	9,26%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,83%	19,82%	5,32%	15,12%	24,30%	26,87%	0,20%	1,871%	9,20%
IMA-B 5+	0,875%	25,95%	6,93%	21,12%	30,33%	28,94%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,82%	25,55%	6,88%	20,93%	29,43%	27,40%	0,20%	2,523%	13,15%
IPCA	0,440%	5,42%	1,32%	3,17%	8,97%	19,36%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,86%	11,11%	3,21%	6,88%	17,72%	-	0,20%	0,869%	3,09%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	41.832.503,71	55,39%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	33.687.286,91	44,61%

Sub-segmento	Valor	%
IDKA IPCA 2A	23.478.938,95	31,09%
IRF-M 1	17.648.214,43	23,37%
IMA-B	17.285.847,60	22,89%
IRF-M	7.000.570,81	9,27%
IMA-B 5	6.274.262,56	8,31%
IPCA	1.999.904,89	2,65%
CDI	1.680.812,85	2,23%
IMA-GERAL	146.952,82	0,19%
IMA-B 5+	4.285,71	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%
Julho	73.132.758,88	925.117,73	775.922,70	74.286.076,10	1.004.122,19	1,37%	1,01%	135,76%	0,74%
Agosto	74.286.076,10	16.474.072,33	16.010.830,59	75.519.790,62	770.472,78	1,03%	0,98%	105,65%	0,86%
Acumulado no ano					8.341.280,87	12,74%	9,60%	132,79%	

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 IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	11.874.002,92	0,00	0,00	12.013.516,99	139.514,07	1,17%	0,05%	1,17%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.569.931,22	0,00	0,00	5.634.697,44	64.766,22	1,16%	0,05%	1,16%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.511.519,25	1.114.224,00	0,00	9.728.834,78	103.091,53	1,07%	0,73%	1,22%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.207.971,21	0,00	0,00	6.274.262,56	66.291,35	1,07%	0,80%	1,07%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.632.395,44	2.427.034,84	0,00	13.194.910,91	135.480,63	1,04%	0,75%	1,28%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	145.464,45	0,00	0,00	146.952,82	1.488,37	1,02%	0,93%	1,02%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.547.561,09	0,00	0,00	6.612.278,60	64.717,51	0,99%	0,97%	0,99%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	384.509,88	0,00	0,00	388.292,21	3.782,33	0,98%	0,97%	0,98%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.989.378,05	0,00	2.027.816,73	1.999.904,89	38.343,57	0,96%	0,87%	0,86%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.250,65	0,00	0,00	4.285,71	35,06	0,82%	2,52%	0,82%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.923.238,20	0,00	3.398.057,60	555.193,26	30.012,66	0,76%	0,55%	0,69%
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.199.344,00	0,00	2.214.224,00	0,00	14.880,00	0,68%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.557.360,48	1.100.000,00	0,00	6.694.798,39	37.437,91	0,56%	1,87%	0,83%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.548.368,04	2.998.839,49	0,00	10.591.049,21	43.841,68	0,42%	1,90%	0,89%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.004.255,51	6.449.227,62	6.152.166,60	1.323.238,99	21.922,46	0,29%	0,02%	1,16%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	186.525,71	2.384.746,38	2.218.565,66	357.573,86	4.867,43	0,19%	0,00%	1,14%
Total Renda Fixa					770.472,78	1,03%	0,86%	