

Relatório Analítico dos Investimentos em julho de 2016



Carteira consolidada de investimentos - base (julho / 2016)

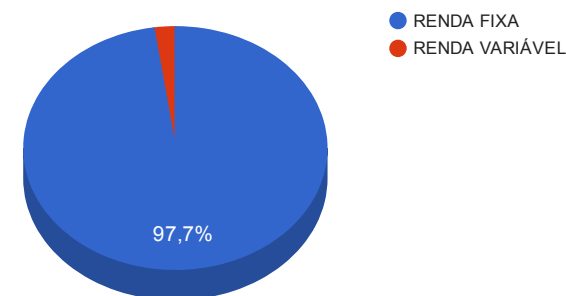
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	64.797.065,32	25,36%	604	1,68%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	9.638.375,80	3,77%	199	0,92%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	20.019.365,07	7,83%	157	1,62%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	49.911.289,84	19,53%	1.325	0,53%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	689.012,81	0,27%	1.170	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.635.447,27	3,38%	707	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	11.355.617,24	4,44%	167	0,54%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	33.753.503,12	13,21%	193	1,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	16.264.413,60	6,37%	748	0,37%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	12.572.313,30	4,92%	116	2,59%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VIII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	01/01/2017	13.097.412,75	5,13%	49	2,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB RPPS I FI RENDA FIXA IPCA CRÉDITO PRIVADO	Término do fundo	Não há	1.885.636,68	0,74%	29	2,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+30 a D+2880	Não há	7.073.893,89	2,77%	51	2,25%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BB CONSUMO FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.815.745,99	0,71%	2.329	2,32%	Artigo 8º, Inciso III
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	827.530,13	0,32%	84	0,75%	Artigo 8º, Inciso III
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	Não se aplica	Não se aplica	3.183.821,37	1,25%			Artigo 8º, Inciso VI
		TOTAL -	255.520.444,18				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (julho / 2016)

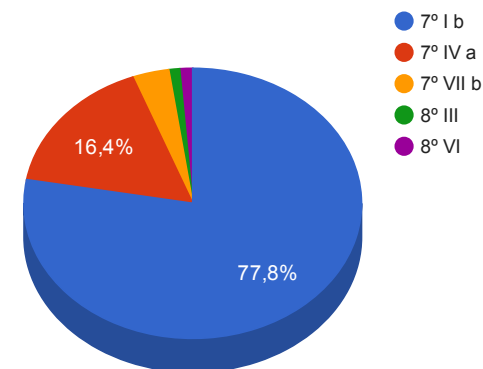
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	100,00%	198.799.676,47	77,80%	56.720.767,71
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	41.934.139,65	16,41%	34.721.993,60
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	8.959.530,57	3,51%	3.816.491,64
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	30,00%	0,00	0,00%	76.656.133,25
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	12.776.022,21
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	12.776.022,21
Total Renda Fixa	100,00%	175,00	249.693.346,69	97,72%	

Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	5,00%	2.643.276,12	1,03%	10.132.746,09
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	3.183.821,37	1,25%	9.592.200,84
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	5,00%	0,00	0,00%	12.776.022,21
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	12.776.022,21
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	12.776.022,21
Total Renda Variável	30,00%	25,00	5.827.097,49	2,28%	

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



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%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,29%	10,16%	3,31%	7,60%	15,78%	-	0,20%	0,530%	3,27%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,99%	6,59%	2,53%	3,26%	8,63%	-	0,20%	0,775%	5,78%
IMA Geral	1,66%	14,74%	3,94%	12,48%	17,19%	29,87%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,64%	14,47%	3,83%	12,26%	16,49%	28,73%	0,20%	0,931%	4,72%
IRF-M	1,32%	15,87%	3,75%	12,73%	16,58%	27,99%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VIII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,04%	9,36%	3,10%	6,93%	12,87%	22,89%	0,20%	0,092%	2,28%
IMA-B 5	1,21%	10,15%	2,97%	6,97%	16,28%	31,52%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,19%	9,96%	2,91%	6,84%	15,77%	30,58%	0,20%	0,670%	3,40%
CDI	1,11%	7,90%	3,41%	6,78%	14,01%	27,78%	-	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,11%	7,91%	3,41%	6,79%	14,05%	27,92%	0,20%	0,009%	0,06%
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 + 6,00% ao ano	1,01%	8,54%	3,17%	6,68%	15,21%	33,82%	-	-	-
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%
IDKA IPCA 2 Anos	0,91%	9,56%	2,49%	5,59%	15,90%	31,44%	-	-	-

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
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,13%	8,58%	3,79%	6,65%	15,79%	-	0,20%	0,118%	1,27%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,11%	9,61%	2,80%	6,55%	16,02%	30,88%	0,20%	0,697%	3,03%
IPCA	0,52%	4,96%	1,66%	3,64%	8,74%	19,13%	-	-	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1,59%	13,38%	2,97%	10,35%	17,02%	31,56%	0,20%	1,186%	6,65%
BB RPPS I FI RENDA FIXA IPCA CRÉDITO PRIVADO	1,03%	8,65%	3,92%	6,81%	16,02%	32,06%	0,20%	0,243%	0,92%

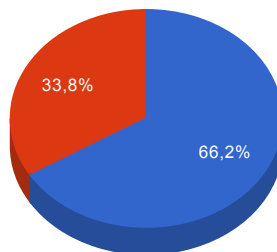
Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (julho / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IGC	10,73%	27,74%	8,59%	35,20%	10,75%	7,73%	-	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	10,65%	27,39%	8,26%	34,84%	10,65%	7,23%	1,00%	5,570%	23,44%
ICON	10,08%	21,73%	13,03%	27,78%	7,43%	18,87%	-	-	-
BB CONSUMO FIC AÇÕES	9,77%	20,69%	12,31%	26,72%	5,78%	15,69%	1,00%	6,011%	20,94%
IFIX	5,92%	23,14%	11,65%	31,24%	18,03%	23,14%	-	-	-
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	-	-	-	-	-	-	0,30%	-	-

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

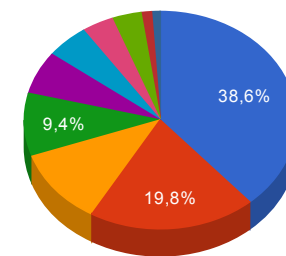
Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	169.265.956,90	66,24%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	86.254.487,28	33,76%

- CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
- BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM



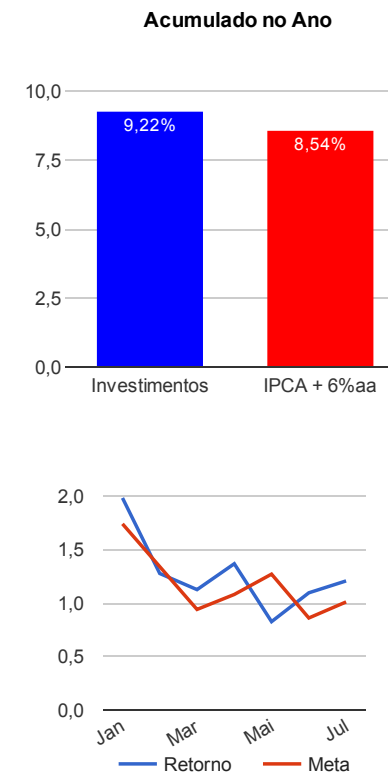
Sub-segmento	Valor	%
IDKA IPCA 2A	98.550.568,44	38,57%
IRF-M 1	50.600.302,65	19,80%
IMA-B 5	28.654.812,34	11,21%
IMA-B	23.927.930,54	9,36%
CDI	16.264.413,60	6,37%
IRF-M	13.097.412,75	5,13%
IMA-GERAL	9.638.375,80	3,77%
CRÉDITO PRIVADO	8.959.530,57	3,51%
FUNDO IMOBILIÁRIO	3.183.821,37	1,25%
AÇÕES - SETORIAIS	2.643.276,12	1,03%

- IDKA IPCA 2A
- IRF-M 1
- IMA-B 5
- IMA-B
- CDI
- IRF-M
- IMA-GERAL
- CRÉDITO PRIVADO
- FUNDO IMOBILIÁRIO
- AÇÕES - SETORIAIS



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	222.268.582,18	3.111.515,01	1.401.422,52	228.418.541,38	4.439.866,71	1,98%	1,74%	113,96%	1,00%
Fevereiro	228.418.541,38	5.467.304,09	2.845.550,27	233.988.550,54	2.948.255,34	1,28%	1,34%	94,93%	0,86%
Março	233.988.550,54	2.396.477,84	1.480.622,63	237.547.464,51	2.643.058,76	1,13%	0,94%	119,42%	1,08%
Abril	237.547.464,51	42.986.621,86	41.530.622,63	242.270.910,87	3.267.447,13	1,37%	1,08%	127,01%	0,78%
Mai	242.270.910,87	109.647.050,75	107.454.053,59	246.482.891,23	2.018.983,20	0,83%	1,27%	65,00%	0,76%
Junho	246.482.891,23	2.800.885,53	1.628.378,25	250.368.415,38	2.713.016,87	1,10%	0,86%	127,12%	0,64%
Julho	250.368.415,38	27.051.418,00	24.945.799,02	255.520.444,18	3.046.409,82	1,21%	1,01%	119,55%	0,46%
Acumulado no ano					21.077.037,83	9,22%	8,54%	107,98%	



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 IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.482.570,26	0,00	0,00	9.638.375,80	155.805,54	1,64%	0,93%	1,64%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	6.963.358,82	0,00	0,00	7.073.893,89	110.535,07	1,59%	1,19%	1,59%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.211.066,41	0,00	0,00	11.355.617,24	144.550,83	1,29%	0,53%	1,29%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.533.820,28	0,00	0,00	8.635.447,27	101.626,99	1,19%	0,67%	1,19%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	33.375.639,94	0,00	0,00	33.753.503,12	377.863,18	1,13%	0,12%	1,13%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	35.892.328,46	0,00	20.015.510,16	16.264.413,60	387.595,30	1,08%	0,01%	1,11%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	60.928.651,92	3.187.293,48	0,00	64.797.065,32	681.119,92	1,06%	0,70%	1,11%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VIII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12.963.199,31	0,00	0,00	13.097.412,75	134.213,44	1,04%	0,09%	1,04%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	49.401.712,74	0,00	0,00	49.911.289,84	509.577,10	1,03%	0,11%	1,03%
BB RPPS I FI RENDA FIXA IPCA CRÉDITO PRIVADO	1.866.456,16	0,00	0,00	1.885.636,68	19.180,52	1,03%	0,24%	1,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12.463.814,98	0,00	0,00	12.572.313,30	108.498,32	0,87%	0,02%	0,87%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.721.827,63	3.864.124,52	4.930.288,86	689.012,81	33.349,52	0,60%	0,11%	1,03%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	20.000.000,00	0,00	20.019.365,07	19.365,07	0,10%	0,78%	0,99%
Total Renda Fixa					2.783.280,80	1,13%	0,41%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	747.850,65	0,00	0,00	827.530,13	79.679,48	10,65%	5,57%	10,65%
BB CONSUMO FIC AÇÕES	1.654.123,23	0,00	0,00	1.815.745,99	161.622,76	9,77%	6,01%	9,77%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	3.161.994,59	0,00	0,00	3.183.821,37	21.826,78	0,69%	-	-
Total Renda Variável					263.129,02	3,43%	5,87%	