

Relatório Analítico dos Investimentos em julho de 2016



Carteira consolidada de investimentos - base (julho / 2016)

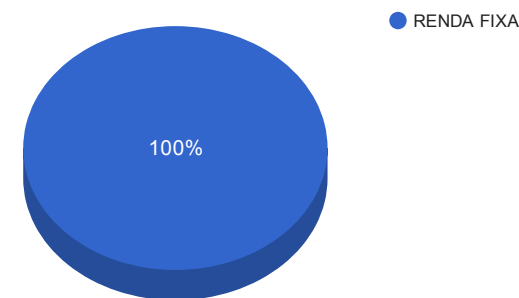
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.022.013,91	5,03%	124	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.537.461,56	27,25%	1.325	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.546.999,63	12,53%	570	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.257.461,79	6,19%	652	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.263.431,54	11,14%	744	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.836.494,85	9,04%	1.170	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	1.182.282,34	5,82%	301	0,06%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.122.129,08	5,52%	748	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.552.414,67	17,48%	811	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
		TOTAL -	20.320.689,37				

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

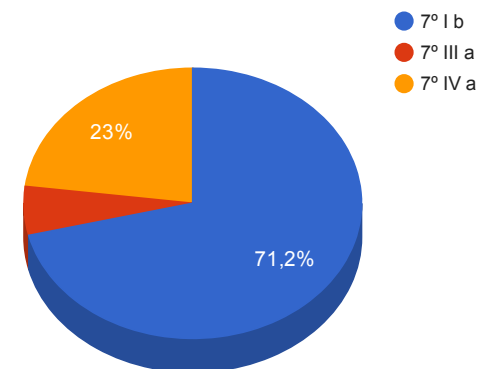
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	100,00%	14.463.863,28	71,18%	5.856.826,09
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	30,00%	1.182.282,34	5,82%	4.913.924,47
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	4.674.543,75	23,00%	1.421.663,06
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	80,00%	10,00%	0,00	0,00%	2.032.068,94
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	30,00%	10,00%	0,00	0,00%	2.032.068,94
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	10,00%	0,00	0,00%	2.032.068,94
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.016.034,47
Total Renda Fixa	100,00%	195,00	20.320.689,37	100,00%	

Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	10,00%	0,00	0,00%	2.032.068,94
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	0,00	0,00%	3.048.103,41
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.016.034,47
Total Renda Variável	30,00%	30,00	0,00	0,00%	

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



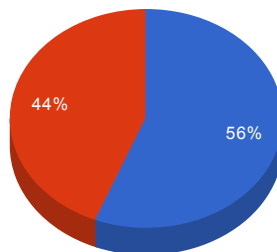
Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (julho / 2016)

	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 IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,50%	18,87%	4,33%	16,73%	20,16%	33,25%	0,20%	1,912%	9,57%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,48%	18,83%	4,31%	16,75%	19,10%	31,74%	0,20%	1,888%	9,57%
IRF-M	1,32%	15,87%	3,75%	12,73%	16,58%	27,99%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,34%	15,79%	3,73%	12,83%	16,14%	27,15%	0,20%	1,042%	4,25%
IMA-B 5	1,21%	10,15%	2,97%	6,97%	16,28%	31,52%	-	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,18%	10,02%	2,90%	6,87%	15,88%	30,56%	0,20%	0,685%	3,42%
CDI	1,11%	7,90%	3,41%	6,78%	14,01%	27,78%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,13%	7,69%	3,37%	6,57%	13,85%	27,91%	0,20%	0,011%	0,17%
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%
IDKA IPCA 2 Anos	0,91%	9,56%	2,49%	5,59%	15,90%	31,44%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,06%	9,50%	2,65%	6,30%	15,78%	30,31%	0,20%	0,748%	3,15%

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

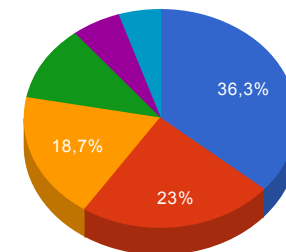
Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	11.381.623,03	56,01%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	8.939.066,34	43,99%

- BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM
- CAIXA ECONÔMICA FEDERAL



Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	7.373.956,41	36,29%
CDI	4.674.543,75	23,00%
IMA-B	3.804.461,42	18,72%
IDKA IPCA 2A	2.263.431,54	11,14%
IMA-B 5	1.182.282,34	5,82%
IRF-M	1.022.013,91	5,03%

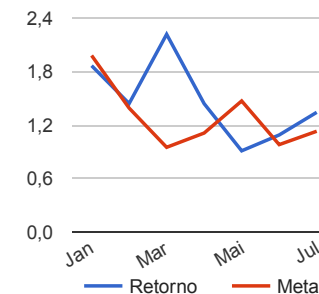
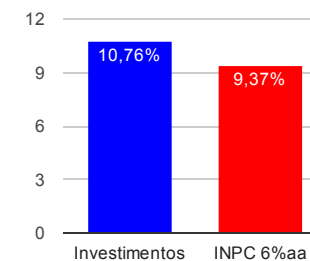
- IRF-M 1
- CDI
- IMA-B
- IDKA IPCA 2A
- IMA-B 5
- IRF-M



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	17.381.863,81	198.245,05	346.571,88	17.557.828,89	324.291,91	1,87%	1,98%	94,20%	1,02%
Fevereiro	17.557.828,89	589.552,56	98.394,09	18.309.058,72	260.071,36	1,44%	1,39%	103,33%	1,13%
Março	18.309.058,72	5.777.636,67	5.510.993,56	18.987.665,34	411.963,51	2,22%	0,95%	232,90%	1,06%
Abril	18.987.665,34	0,00	107.756,99	19.153.208,95	273.300,60	1,44%	1,11%	130,08%	0,69%
Mai	19.153.208,95	426.682,90	1.320.784,77	18.433.502,34	174.395,26	0,91%	1,47%	61,88%	0,64%
Junho	18.433.502,34	2.749.557,64	1.652.310,26	19.743.304,30	212.554,58	1,09%	0,98%	110,78%	0,78%
Julho	19.743.304,30	424.637,17	116.398,84	20.320.689,37	269.146,74	1,34%	1,13%	118,80%	0,57%
Acumulado no ano					1.925.723,96	10,76%	9,37%	114,89%	

Acumulado no Ano



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(%)
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.484.812,13	0,00	0,00	2.546.999,63	62.187,50	2,50%	1,91%	2,50%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.227.013,39	0,00	0,00	1.257.461,79	30.448,40	2,48%	1,89%	2,48%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.008.520,41	0,00	0,00	1.022.013,91	13.493,50	1,34%	1,04%	1,34%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.168.546,89	0,00	0,00	1.182.282,34	13.735,45	1,18%	0,69%	1,18%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.109.821,98	0,00	0,00	1.122.129,08	12.307,10	1,11%	0,01%	1,11%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.285.268,85	229.394,26	0,00	3.552.414,67	37.751,56	1,07%	0,01%	1,13%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.480.925,98	0,00	0,00	5.537.461,56	56.535,58	1,03%	0,11%	1,03%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.045.093,76	195.242,91	0,00	2.263.431,54	23.094,87	1,03%	0,75%	1,06%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.933.300,91	0,00	116.398,84	1.836.494,85	19.592,78	1,01%	0,11%	1,03%
Total Renda Fixa					269.146,74	1,34%	0,57%	