

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
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			20.978,99	0,04%			Artigo 20
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	571,98	0,00%	144	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	9.616.495,00	19,46%	1.325	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	12.087.957,09	24,46%	604	0,31%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.185.082,21	6,44%	707	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1901	Não há	5.062.266,24	10,24%	9	12,14%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	9.209.292,46	18,63%	335	0,39%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
GBX PRIME I FIDC	D+1201	29 dias	7.583.896,15	15,34%	33	2,87%	Artigo 7º, Inciso VI
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIAÇÕES	D+4	Não há	74.723,54	0,15%	277	0,64%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CONSUMO FIAÇÕES	D+4	Não há	91.172,81	0,18%	1.058	0,72%	Artigo 8º, Inciso III
W7 FIP	Não se aplica	Não se aplica	2.495.693,48	5,05%	20	2,93%	Artigo 8º, Inciso V
TOTAL -			49.428.129,95				

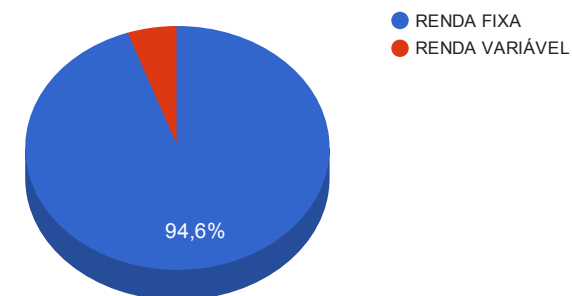
Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (julho / 2016)

Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	100,00%	24.890.106,28	50,36%	24.538.023,67
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	40,00%	14.271.558,70	28,87%	5.499.693,28
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	15,00%	7.583.896,15	15,34%	-169.676,66
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	0,00	0,00%	14.828.438,99
Total Renda Fixa	100,00%	185,00	46.745.561,13	94,57%	

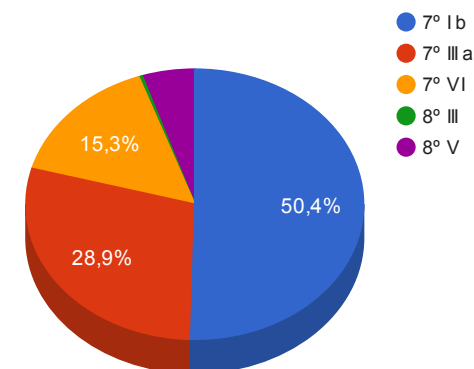
Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	10,00%	165.896,35	0,34%	4.776.916,65
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	2.495.693,48	5,05%	-24.286,98
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	2.471.406,50
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	2.471.406,50
Total Renda Variável	30,00%	25,00	2.661.589,83	5,38%	

⚠️ Atenção!! - Valores em desacordo com Artigo 7º, Inciso VII, § 5º

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 5+	3,34%	24,86%	5,22%	23,37%	23,27%	36,66%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,34%	24,52%	5,16%	23,20%	22,42%	34,84%	0,20%	2,839%	13,58%
IMA-B	2,51%	19,06%	4,38%	16,82%	20,53%	34,07%	-	-	-
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	2,39%	18,20%	4,36%	16,28%	19,54%	32,81%	0,20%	1,829%	8,74%
IMA-B 5	1,21%	10,15%	2,97%	6,97%	16,28%	31,52%	-	-	-
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1,29%	9,60%	3,02%	6,93%	13,01%	-	1,00%	0,737%	4,07%
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%
IPCA + 7,00% ao ano	1,09%	9,13%	3,42%	7,18%	16,29%	36,36%	-	-	-
GBX PRIME I FIDC	1,07%	9,05%	3,59%	7,56%	15,73%	-	0,15%	0,097%	0,75%
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%
IDKA IPCA 2 Anos	0,91%	9,56%	2,49%	5,59%	15,90%	31,44%	-	-	-
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%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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
SMLL	14,60%	34,83%	19,79%	47,41%	16,72%	-7,40%	-	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIAÇÕES	13,33%	22,82%	15,96%	29,85%	14,60%	-4,99%	1,50%	6,516%	19,74%

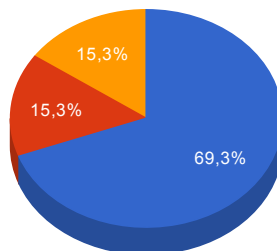
ICON	10,08%	21,73%	13,03%	27,78%	7,43%	18,87%	-	-	-
CAIXA CONSUMO FIAÇÕES	9,18%	18,06%	11,22%	24,51%	0,80%	6,97%	1,60%	6,513%	20,68%

Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
W7 FIP	-	-	-	-	-	-	1,50%	0,030%	28,30%

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

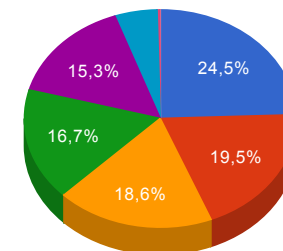
Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	34.265.295,09	69,32%
CM Capital Markets DTVM	7.583.896,15	15,34%
Santander Securities Services	7.557.959,72	15,29%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	20.978,99	0,04%

- CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
- CM Capital Markets DTVM
- Santander Securities Services
- Outro



Sub-segmento	Valor	%
IDKA IPCA 2A	12.087.957,09	24,46%
IRF-M 1	9.616.495,00	19,46%
IMA-B	9.209.292,46	18,63%
IMA-B 5	8.247.348,45	16,69%
FIDC - ABERTO	7.583.896,15	15,34%
FIP	2.495.693,48	5,05%
AÇÕES - SETORIAIS	165.896,35	0,34%
CVS	20.978,99	0,04%
IMA-B 5+	571,98	0,00%

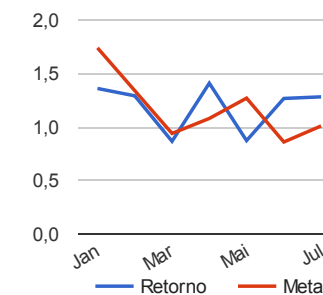
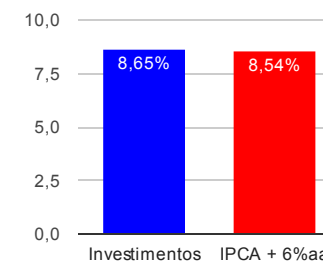
- IDKA IPCA 2A
- IRF-M 1
- IMA-B
- IMA-B 5
- FIDC - ABERTO
- FIP
- AÇÕES - SETORIAIS
- Outro



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	44.370.457,26	21.950.562,56	21.915.209,37	45.009.933,37	604.122,92	1,36%	1,74%	78,21%	1,17%
Fevereiro	45.009.933,37	893.834,14	671.000,00	45.817.039,38	584.271,87	1,29%	1,34%	96,09%	0,95%
Março	45.817.039,38	364.000,00	64.700,00	46.516.045,09	399.705,71	0,87%	0,94%	91,99%	1,23%
Abril	46.516.045,09	236.000,00	724.092,57	46.683.737,09	655.784,57	1,41%	1,08%	130,98%	0,86%
Mai	46.683.737,09	1.470.000,00	646.740,00	47.921.779,89	414.782,80	0,87%	1,27%	68,72%	0,78%
Junho	47.921.779,89	44.448.992,03	45.835.260,54	47.142.706,18	607.194,80	1,27%	0,86%	147,03%	1,07%
Julho	47.142.706,18	2.435.020,52	796.000,00	49.407.150,96	625.424,26	1,28%	1,01%	127,03%	0,69%
Acumulado no ano					3.891.286,93	8,65%	8,54%	101,36%	

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(%)
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	553,48	0,00	0,00	571,98	18,50	3,34%	2,84%	3,34%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	8.130.043,34	885.020,52	0,00	9.209.292,46	194.228,60	2,15%	1,83%	2,39%
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	4.997.594,84	0,00	0,00	5.062.266,24	64.671,40	1,29%	0,74%	1,29%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.147.598,31	0,00	0,00	3.185.082,21	37.483,90	1,19%	0,67%	1,19%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.955.726,39	0,00	0,00	12.087.957,09	132.230,70	1,11%	0,70%	1,11%
GBX PRIME I FIDC	7.503.475,98	0,00	0,00	7.583.896,15	80.420,17	1,07%	0,10%	1,07%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.758.617,74	1.550.000,00	796.000,00	9.616.495,00	103.877,26	1,01%	0,11%	1,03%
Total Renda Fixa					612.930,53	1,33%	0,70%	

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(%)
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIAÇÕES	65.934,99	0,00	0,00	74.723,54	8.788,55	13,33%	6,52%	13,33%
CAIXA CONSUMO FIAÇÕES	83.509,11	0,00	0,00	91.172,81	7.663,70	9,18%	6,51%	9,18%
W7 FIP	2.499.652,00	0,00	0,00	2.495.693,48	-3.958,52	-0,16%	0,03%	-0,16%
Total Renda Variável					12.493,73	0,47%	0,43%	

