

Relatório Analítico dos Investimentos em setembro e 3º Trimestre 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 (setembro / 2016)

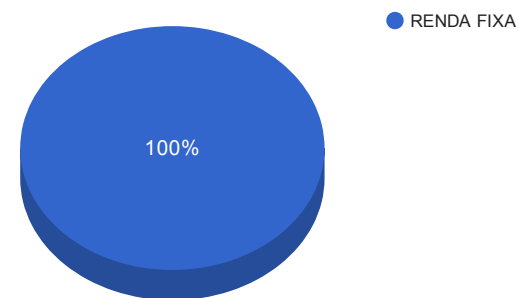
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	642.161,59	7,37%	754	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	505.090,42	5,79%	728	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.526.179,34	17,51%	639	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.128.903,84	12,95%	612	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	918.077,45	10,53%	1.331	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	161.437,90	1,85%	1.171	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	206.460,13	2,37%	733	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	1.586.405,21	18,20%	327	0,07%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.456.323,16	16,70%	801	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	558.988,18	6,41%	3.732	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	28.093,77	0,32%	587	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
		TOTAL -	8.718.120,99				

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

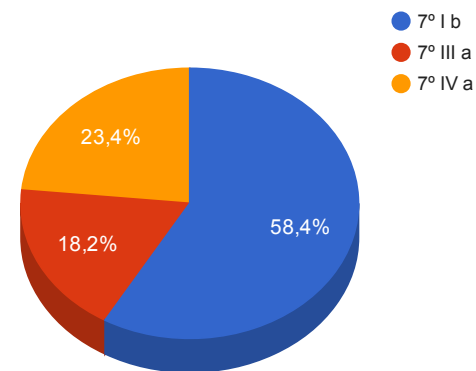
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	100,00%	5.088.310,67	58,36%	3.629.810,32
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	20,00%	1.586.405,21	18,20%	157.218,99
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	2.043.405,11	23,44%	572.031,19
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	10,00%	0,00	0,00%	871.812,10
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	2,50%	0,00	0,00%	217.953,02
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	2,50%	0,00	0,00%	217.953,02
Total Renda Fixa	100,00%	165,00	8.718.120,99	100,00%	

Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	10,00%	0,00	0,00%	871.812,10
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	435.906,05
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	3,00%	0,00	0,00%	261.543,63
Total Renda Variável	30,00%	18,00	0,00	0,00%	

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



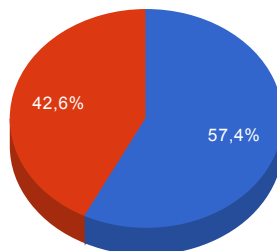
Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (setembro / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	1,57%	22,00%	5,04%	11,16%	28,36%	35,87%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,58%	21,72%	4,97%	11,04%	27,66%	33,42%	0,20%	2,300%	7,11%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,56%	21,80%	5,03%	11,08%	27,99%	35,08%	0,20%	2,302%	7,06%
IDKA IPCA 2 Anos	1,50%	12,64%	3,74%	7,11%	18,43%	33,53%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,35%	12,40%	3,73%	7,12%	18,25%	32,16%	0,20%	0,558%	2,63%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,33%	12,42%	3,70%	7,14%	18,28%	32,52%	0,20%	0,545%	2,55%
IMA-B 5	1,41%	12,92%	3,76%	7,19%	18,83%	33,03%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,40%	12,68%	3,70%	7,08%	18,43%	32,08%	0,20%	0,778%	2,72%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,39%	12,80%	3,73%	7,13%	18,55%	32,13%	0,20%	0,771%	2,71%
IRF-M 1	1,19%	11,14%	3,46%	6,82%	15,14%	28,83%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,17%	11,05%	3,42%	6,78%	14,99%	28,37%	0,20%	0,075%	0,40%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,16%	10,97%	3,39%	6,72%	14,91%	28,05%	0,10%	0,076%	0,39%
CDI	1,11%	10,42%	3,47%	6,94%	14,13%	28,50%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,11%	10,26%	3,54%	6,88%	14,00%	28,66%	0,20%	0,027%	0,17%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,11%	10,45%	3,47%	6,97%	14,17%	28,80%	0,25%	0,023%	0,07%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,04%	9,76%	3,29%	6,59%	13,23%	26,53%	1,00%	0,016%	0,08%

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

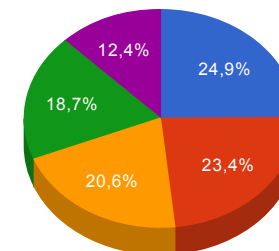
Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	5.003.325,47	57,39%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	3.714.795,52	42,61%

- BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM
- CAIXA ECONÔMICA FEDERAL



Sub-segmento	Valor	%
IDKA IPCA 2A	2.168.340,93	24,87%
CDI	2.043.405,11	23,44%
IMA-B 5	1.792.865,34	20,56%
IMA-B	1.633.994,26	18,74%
IRF-M 1	1.079.515,35	12,38%

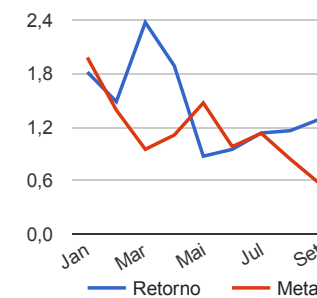
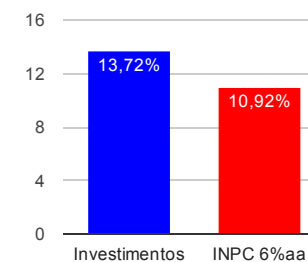
- IDKA IPCA 2A
- CDI
- IMA-B 5
- IMA-B
- IRF-M 1



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	7.789.402,72	99.562,40	99.267,60	7.931.193,13	141.495,61	1,82%	1,98%	91,72%	1,11%
Fevereiro	7.931.193,13	521.109,89	542.246,66	8.027.784,74	117.728,38	1,48%	1,39%	106,45%	1,32%
Março	8.027.784,74	125.142,10	202.263,65	8.141.228,76	190.565,57	2,37%	0,95%	249,29%	2,70%
Abril	8.141.228,76	1.002.667,24	989.827,89	8.307.920,33	153.852,22	1,89%	1,11%	170,52%	1,24%
Mai	8.307.920,33	3.508.753,49	3.486.065,43	8.403.287,83	72.679,44	0,87%	1,47%	59,29%	0,55%
Junho	8.403.287,83	757.150,16	719.304,53	8.521.294,88	80.161,42	0,95%	0,98%	96,67%	0,62%
Julho	8.521.294,88	1.231.503,47	1.263.557,68	8.585.766,73	96.526,06	1,13%	1,13%	100,26%	0,45%
Agosto	8.585.766,73	822.438,01	812.455,69	8.695.362,36	99.613,31	1,16%	0,84%	137,16%	0,61%
Setembro	8.695.362,36	741.061,04	830.110,35	8.718.120,99	111.807,94	1,29%	0,57%	226,72%	0,74%
Acumulado no ano					1.064.429,95	13,72%	10,92%	125,67%	

Acumulado no Ano



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de setembro / 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	1.111.521,99	0,00	0,00	1.128.903,84	17.381,85	1,56%	2,30%	1,56%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	203.612,45	0,00	0,00	206.460,13	2.847,68	1,40%	0,78%	1,40%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.564.615,54	0,00	0,00	1.586.405,21	21.789,67	1,39%	0,77%	1,39%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	633.617,96	0,00	0,00	642.161,59	8.543,63	1,35%	0,56%	1,35%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.506.131,29	0,00	0,00	1.526.179,34	20.048,05	1,33%	0,55%	1,33%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	159.588,93	0,00	0,00	161.437,90	1.848,97	1,16%	0,08%	1,16%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.440.269,50	0,00	0,00	1.456.323,16	16.053,66	1,11%	0,03%	1,11%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	552.872,90	0,00	0,00	558.988,18	6.115,28	1,11%	0,02%	1,11%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	500.000,00	0,00	505.090,42	5.090,42	1,02%	2,30%	1,58%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.406.777,30	0,00	500.000,00	918.077,45	11.300,15	0,80%	0,08%	1,17%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	116.354,50	241.061,04	330.110,35	28.093,77	788,58	0,22%	0,02%	1,04%
Total Renda Fixa					111.807,94	1,29%	0,74%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre / 2016

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.525.798,30	200.000,00	200.000,00	1.586.405,21	60.606,91	3,67%	3,73%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.272.688,80	200.000,00	0,00	1.526.179,34	53.490,54	3,63%	3,70%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.382.092,10	24.702,31	0,00	1.456.323,16	49.528,75	3,53%	3,54%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.775.461,80	0,00	900.000,00	918.077,45	42.615,65	2,85%	3,42%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	397.164,68	700.508,60	0,00	1.128.903,84	31.230,56	4,47%	5,03%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	420.017,15	200.000,00	0,00	642.161,59	22.144,44	3,57%	3,73%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	540.258,23	0,00	0,00	558.988,18	18.729,95	3,47%	3,47%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.045.685,46	0,00	900.191,85	161.437,90	15.944,29	2,93%	3,39%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	200.000,00	0,00	206.460,13	6.460,13	3,23%	3,70%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	500.000,00	0,00	505.090,42	5.090,42	1,02%	4,97%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	162.128,36	769.791,61	905.931,87	28.093,77	2.105,67	0,56%	3,29%
				Total Renda Fixa	307.947,31	3,62%	