

Relatório Analítico dos Investimentos em outubro de 2016



Carteira consolidada de investimentos - base (outubro / 2016)

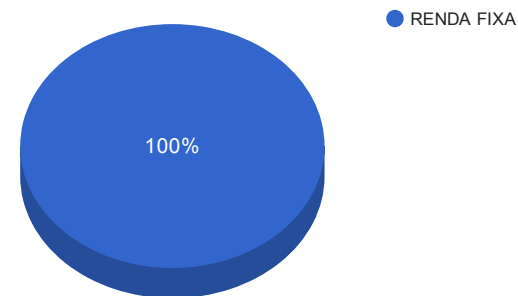
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	5.388.439,26	5,83%	754	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2020	2.855.259,88	3,09%	122	0,36%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	3.690.819,15	4,00%	247	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	10.391.304,68	11,25%	1.170	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	239.585,42	0,26%	641	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	9.484.347,62	10,27%	101	2,47%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.017.831,94	4,35%	738	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.230.787,97	6,75%	208	0,49%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	7.675.435,39	8,31%	97	1,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	6.325.851,07	6,85%	1.330	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	2.489.773,34	2,70%	46	0,73%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.524.835,68	9,23%	344	0,35%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.449.912,53	2,65%	250	0,21%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.910.521,05	3,15%	454	0,15%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	18.147.367,51	19,65%	792	0,35%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.534.569,01	1,66%	586	0,14%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
		TOTAL -	92.356.641,50				

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

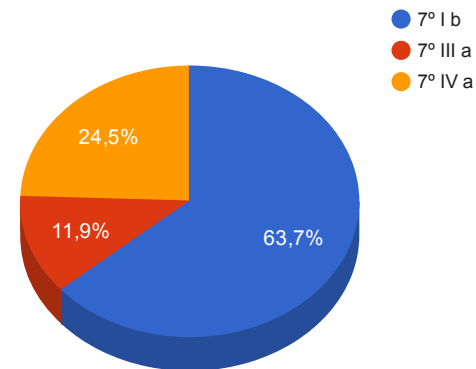
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	85,00%	58.789.435,72	63,65%	19.713.709,56
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	30,00%	10.974.748,21	11,88%	16.732.244,24
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	22.592.457,57	24,46%	5.114.534,88
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	4.617.832,08
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	4.617.832,08
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	4.617.832,08
Total Renda Fixa	100,00%	160,00	92.356.641,50	100,00%	

Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	4.617.832,08
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	4.617.832,08
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	4.617.832,08
Total Renda Variável	30,00%	15,00	0,00	0,00%	

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	1,05%	11,58%	3,41%	6,94%	14,06%	28,63%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,07%	11,43%	3,48%	6,97%	13,94%	28,77%	0,20%	0,013%	0,17%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,04%	11,65%	3,37%	6,84%	14,05%	28,15%	0,20%	0,016%	0,12%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,99%	10,85%	3,22%	6,66%	13,17%	26,64%	1,00%	0,010%	0,08%
IMA Geral ex-C	0,98%	18,71%	3,66%	7,67%	21,13%	30,90%	-	-	-
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,98%	18,62%	3,64%	7,59%	20,94%	30,30%	0,20%	1,176%	3,38%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,91%	-	-	-	-	-	0,30%	1,286%	-
IRF-M 1	0,94%	12,18%	3,36%	6,69%	14,72%	28,94%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,94%	12,10%	3,33%	6,60%	14,59%	28,51%	0,20%	0,171%	0,35%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,94%	12,02%	3,30%	6,54%	14,50%	28,20%	0,10%	0,177%	0,35%
IMA Geral	0,90%	18,76%	3,50%	7,58%	21,23%	31,01%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,99%	18,63%	3,64%	7,60%	21,07%	30,17%	0,20%	1,147%	3,38%
IMA-B 5+	0,73%	28,98%	3,30%	8,70%	32,20%	35,92%	-	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,72%	28,80%	3,29%	8,71%	31,90%	35,35%	0,20%	3,106%	9,83%
IPCA + 6,00% ao ano	0,72%	11,02%	2,28%	5,53%	14,32%	33,15%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,43%	13,78%	2,91%	5,94%	16,93%	31,33%	0,15%	0,816%	2,89%
IMA-B	0,64%	22,78%	3,13%	7,65%	25,94%	33,95%	-	-	-

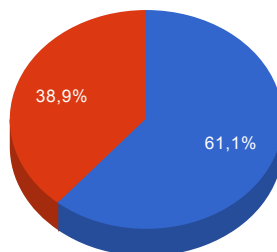
Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (outubro / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	0,84%	22,16%	3,35%	7,86%	25,16%	33,00%	0,20%	2,261%	6,22%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,65%	22,51%	3,09%	7,53%	25,56%	31,59%	0,20%	2,279%	6,81%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,65%	22,45%	3,31%	7,64%	25,55%	33,17%	0,30%	2,283%	6,71%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,45%	9,57%	0,07%	2,71%	12,98%	-	0,20%	1,026%	6,42%
IDKA IPCA 2 Anos	0,41%	13,11%	3,23%	5,80%	15,48%	32,92%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,43%	12,90%	3,00%	5,89%	15,70%	31,80%	0,20%	0,673%	2,42%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,42%	12,87%	3,08%	5,81%	15,63%	31,54%	0,20%	0,673%	2,49%

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

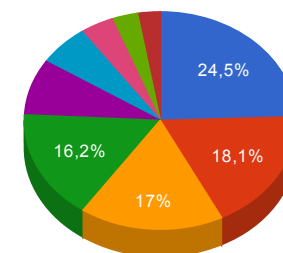
Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	56.431.792,98	61,10%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	35.924.848,52	38,90%

- BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM
- CAIXA ECONÔMICA FEDERAL



Sub-segmento	Valor	%
CDI	22.592.457,57	24,46%
IRF-M 1	16.717.155,75	18,10%
IMA-GERAL	15.715.135,59	17,02%
IMA-B	14.992.580,15	16,23%
IMA-B 5	7.675.435,39	8,31%
IDKA IPCA 2A	5.628.024,68	6,09%
IMA-B 5+	3.690.819,15	4,00%
IDKA IPCA 3A	2.855.259,88	3,09%
IMA-GERAL EX-C	2.489.773,34	2,70%

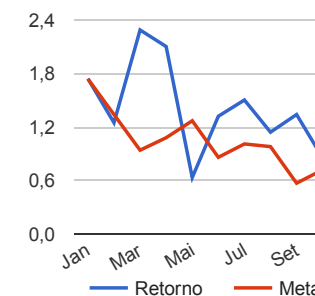
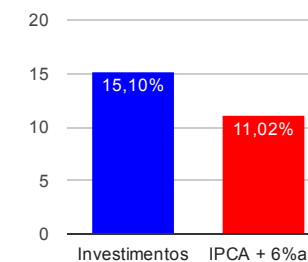
- CDI
- IRF-M 1
- IMA-GERAL
- IMA-B
- IMA-B 5
- IDKA IPCA 2A
- IMA-B 5+
- IDKA IPCA 3A
- IMA-GERAL EX-C



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	75.972.334,18	1.395.750,08	918.412,98	77.782.013,01	1.332.341,73	1,74%	1,74%	100,19%	1,01%
Fevereiro	77.782.013,01	1.820.519,76	1.133.534,42	79.448.523,97	979.525,62	1,25%	1,34%	92,86%	1,48%
Março	79.448.523,97	6.413.240,25	5.913.897,40	81.777.556,22	1.829.689,40	2,29%	0,94%	242,90%	2,47%
Abril	81.777.556,22	1.037.527,12	896.892,47	83.640.739,93	1.722.549,06	2,10%	1,08%	195,36%	1,53%
Mai	83.640.739,93	1.958.100,73	1.176.511,44	84.956.758,79	534.429,57	0,63%	1,27%	49,82%	1,39%
Junho	84.956.758,79	6.582.441,40	6.400.353,35	86.263.174,08	1.124.327,24	1,32%	0,86%	153,24%	1,03%
Julho	86.263.174,08	1.442.709,29	1.006.191,14	88.002.775,11	1.303.082,88	1,50%	1,01%	148,92%	0,76%
Agosto	88.002.775,11	2.800.270,91	4.201.734,14	87.606.398,53	1.005.086,65	1,14%	0,98%	117,07%	1,07%
Setembro	87.606.398,53	3.420.118,80	1.087.443,04	91.144.394,13	1.205.319,84	1,34%	0,57%	236,30%	0,89%
Outubro	91.144.394,13	3.883.897,85	3.452.268,86	92.356.641,50	780.618,38	0,85%	0,72%	117,62%	0,91%
Acumulado no ano					11.816.970,37	15,10%	11,02%	137,05%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	17.955.731,75	0,00	0,00	18.147.367,51	191.635,76	1,07%	0,01%	1,07%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.880.521,35	0,00	0,00	2.910.521,05	29.999,70	1,04%	0,02%	1,04%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.169.724,18	0,00	0,00	6.230.787,97	61.063,79	0,99%	1,15%	0,99%
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	9.392.485,16	0,00	0,00	9.484.347,62	91.862,46	0,98%	1,18%	0,98%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.266.741,04	0,00	0,00	6.325.851,07	59.110,03	0,94%	0,17%	0,94%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.294.247,04	0,00	0,00	10.391.304,68	97.057,64	0,94%	0,18%	0,94%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	8.453.566,77	0,00	0,00	8.524.835,68	71.268,91	0,84%	2,26%	0,84%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.551.878,54	1.394.124,51	3.452.268,86	1.534.569,01	40.834,82	0,83%	0,01%	0,99%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.664.265,52	0,00	0,00	3.690.819,15	26.553,63	0,72%	3,11%	0,72%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.991.994,72	0,00	0,00	4.017.831,94	25.837,22	0,65%	2,28%	0,65%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.434.178,71	0,00	0,00	2.449.912,53	15.733,82	0,65%	2,28%	0,65%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.641.300,08	0,00	0,00	7.675.435,39	34.135,31	0,45%	1,03%	0,45%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	238.563,08	0,00	0,00	239.585,42	1.022,34	0,43%	0,67%	0,43%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.843.122,94	0,00	0,00	2.855.259,88	12.136,94	0,43%	0,82%	0,43%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.366.073,25	0,00	0,00	5.388.439,26	22.366,01	0,42%	0,67%	0,42%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	2.489.773,34	0,00	2.489.773,34	0,00	0,00%	1,29%	0,91%
Total Renda Fixa					780.618,38	0,85%	0,91%	