

Relatório Analítico dos Investimentos em setembro e 3º Trimestre de 2016



Carteira consolidada de investimentos - base (setembro / 2016)

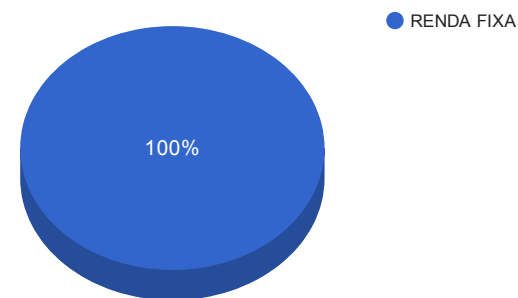
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2020	2.843.122,94	3,12%	122	0,36%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	6.266.741,04	6,88%	1.331	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.169.724,18	6,77%	207	0,50%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	238.563,08	0,26%	639	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.991.994,72	4,38%	728	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	5.366.073,25	5,89%	754	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	10.294.247,04	11,29%	1.171	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	3.664.265,52	4,02%	237	0,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	9.392.485,16	10,31%	100	2,51%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	7.641.300,08	8,38%	97	1,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.434.178,71	2,67%	248	0,21%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.453.566,77	9,27%	341	0,36%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.880.521,35	3,16%	463	0,13%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.551.878,54	3,90%	587	0,33%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	17.955.731,75	19,70%	801	0,34%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TOTAL -			91.144.394,13				

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

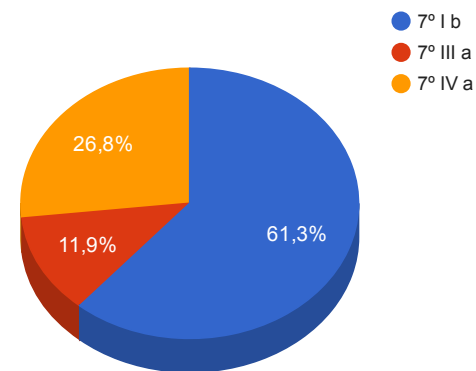
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	85,00%	55.868.517,01	61,30%	21.604.218,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	30,00%	10.887.745,48	11,95%	16.455.572,76
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	24.388.131,64	26,76%	2.955.186,60
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	4.557.219,71
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	4.557.219,71
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	4.557.219,71
Total Renda Fixa	100,00%	160,00	91.144.394,13	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%	4.557.219,71
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	4.557.219,71
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	4.557.219,71
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 (setembro / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5+	1,67%	28,05%	5,98%	13,71%	34,70%	38,62%	-	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,64%	27,87%	5,97%	13,71%	34,39%	38,07%	0,20%	3,129%	10,20%
IMA Geral ex-C	1,59%	17,56%	4,35%	9,71%	21,74%	31,48%	-	-	-
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,58%	17,47%	4,30%	9,66%	21,49%	30,80%	0,20%	1,243%	3,53%
IMA-B	1,57%	22,00%	5,04%	11,16%	28,36%	35,87%	-	-	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,64%	21,66%	5,17%	11,11%	27,79%	35,14%	0,30%	2,270%	6,99%
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%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	1,51%	21,14%	4,94%	10,88%	27,24%	34,68%	0,20%	2,172%	6,44%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,46%	9,08%	1,22%	4,60%	14,98%	-	0,20%	1,260%	6,70%
IMA Geral	1,53%	17,70%	4,28%	9,71%	22,07%	31,71%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,58%	17,46%	4,31%	9,67%	21,60%	30,66%	0,20%	1,247%	3,56%
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%
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%

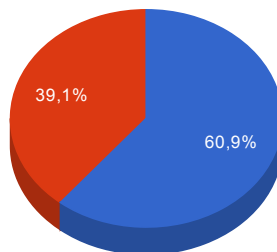
Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (setembro / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
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 BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,10%	10,50%	3,43%	6,90%	14,12%	27,99%	0,20%	0,016%	0,14%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,04%	9,76%	3,29%	6,59%	13,23%	26,53%	1,00%	0,016%	0,08%
IPCA + 6,00% ao ano	0,57%	10,22%	2,57%	5,90%	14,98%	33,45%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,40%	13,30%	3,76%	7,34%	19,39%	32,25%	0,15%	0,808%	3,12%

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

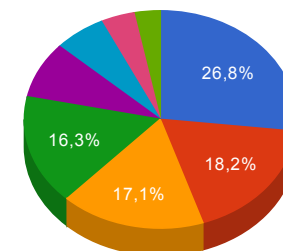
Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	55.501.982,91	60,89%
Caixa Econômica Federal	35.642.411,22	39,11%

- BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM
- Caixa Econômica Federal



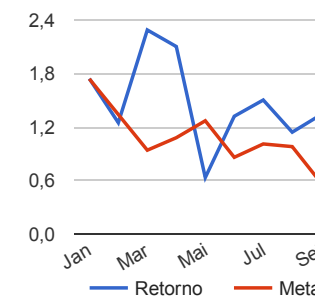
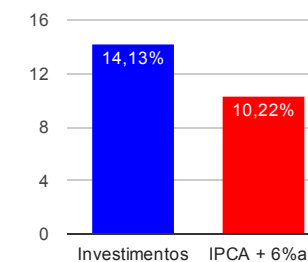
Sub-segmento	Valor	%
CDI	24.388.131,64	26,76%
IRF-M 1	16.560.988,08	18,17%
IMA-GERAL	15.562.209,34	17,07%
IMA-B	14.879.740,20	16,33%
IMA-B 5	7.641.300,08	8,38%
IDKA IPCA 2A	5.604.636,33	6,15%
IMA-B 5+	3.664.265,52	4,02%
IDKA IPCA 3A	2.843.122,94	3,12%

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



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%
Acumulado no ano					11.036.351,99	14,13%	10,22%	138,25%	

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 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.604.982,66	0,00	0,00	3.664.265,52	59.282,86	1,64%	3,13%	1,64%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.394.830,40	0,00	0,00	2.434.178,71	39.348,31	1,64%	2,27%	1,64%
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	9.246.166,75	0,00	0,00	9.392.485,16	146.318,41	1,58%	1,24%	1,58%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.073.741,10	0,00	0,00	6.169.724,18	95.983,08	1,58%	1,25%	1,58%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	8.328.046,81	0,00	0,00	8.453.566,77	125.519,96	1,51%	2,17%	1,51%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.531.106,35	0,00	0,00	7.641.300,08	110.193,73	1,46%	1,26%	1,46%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.992.535,79	1.942.270,00	0,00	3.991.994,72	57.188,93	1,45%	2,30%	1,58%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.803.781,59	0,00	0,00	2.843.122,94	39.341,35	1,40%	0,81%	1,40%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.294.680,42	0,00	0,00	5.366.073,25	71.392,83	1,35%	0,56%	1,35%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	235.429,29	0,00	0,00	238.563,08	3.133,79	1,33%	0,55%	1,33%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.194.192,21	0,00	0,00	6.266.741,04	72.548,83	1,17%	0,08%	1,17%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.176.346,01	0,00	0,00	10.294.247,04	117.901,03	1,16%	0,08%	1,16%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	17.757.798,33	0,00	0,00	17.955.731,75	197.933,42	1,11%	0,03%	1,11%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.849.229,56	0,00	0,00	2.880.521,35	31.291,79	1,10%	0,02%	1,10%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.123.531,26	1.477.848,80	1.087.443,04	3.551.878,54	37.941,52	0,82%	0,02%	1,04%
Total Renda Fixa					1.205.319,84	1,34%	0,89%	

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 PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	17.341.849,49	0,00	0,00	17.955.731,75	613.882,26	3,54%	3,54%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	8.055.975,01	0,00	0,00	8.453.566,77	397.591,76	4,94%	4,94%
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	9.004.839,22	0,00	0,00	9.392.485,16	387.645,94	4,30%	4,30%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.957.027,74	0,00	0,00	10.294.247,04	337.219,30	3,39%	3,39%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.549.273,25	0,00	231.412,93	7.641.300,08	323.439,76	4,33%	1,22%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.689.966,71	231.412,93	0,00	6.169.724,18	248.344,54	4,26%	4,31%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.059.752,35	0,00	0,00	6.266.741,04	206.988,69	3,42%	3,42%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.457.867,09	0,00	0,00	3.664.265,52	206.398,43	5,97%	5,97%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.172.999,61	0,00	0,00	5.366.073,25	193.073,64	3,73%	3,73%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.767.109,71	0,00	1.052.725,34	2.843.122,94	128.738,57	3,81%	3,76%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.928.262,45	1.942.270,00	0,00	3.991.994,72	121.462,27	4,84%	4,97%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.314.499,04	0,00	0,00	2.434.178,71	119.679,67	5,17%	5,17%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.785.072,24	0,00	0,00	2.880.521,35	95.449,11	3,43%	3,43%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.044.397,69	5.489.416,07	3.068.960,05	3.551.878,54	87.024,83	2,32%	3,29%
CAIXA BRASIL IPCA XV FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.904.226,00	0,00	1.942.270,00	0,00	38.044,00	2,00%	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	230.056,48	0,00	0,00	238.563,08	8.506,60	3,70%	3,70%
				Total Renda Fixa	3.513.489,37	4,04%	