

Relatório Analítico dos Investimentos em outubro de 2016



Carteira consolidada de investimentos - base (outubro / 2016)

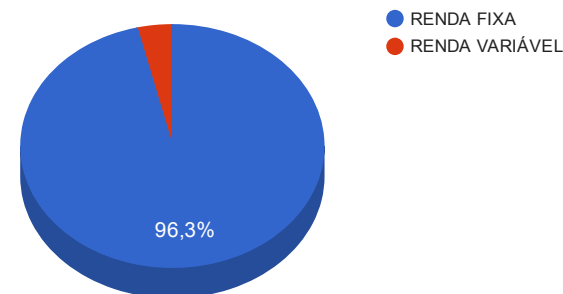
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.837.553,45	4,77%	733	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	13.287.400,52	13,09%	620	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	4.387.899,76	4,32%	1.330	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	1.634.024,20	1,61%	193	0,48%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	4.591.343,57	4,52%	364	0,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	8.737.811,44	8,61%	754	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.192.622,40	6,10%	641	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	3.442.656,90	3,39%	331	0,15%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	13.330.420,93	13,13%	88	1,07%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.449.102,60	8,32%	344	0,35%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.626.315,94	5,54%	87	0,67%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	4.005.007,17	3,95%	250	0,34%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	8.772.316,03	8,64%	116	1,81%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2030	5.056.511,27	4,98%	34	2,64%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.482.114,01	1,46%	399	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.871.531,53	3,81%	792	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.458,97	0,00%	586	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IPCA VI FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+0	08/11/2016	3.801.588,54	3,75%	17	3,83%	Artigo 8º, Inciso IV
TOTAL -			101.507.679,23				

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

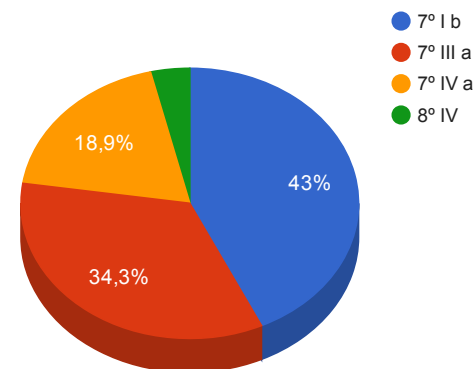
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	50,00%	43.668.655,34	43,02%	7.085.184,28
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	40,00%	34.853.503,54	34,34%	5.749.568,15
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	19.183.931,81	18,90%	11.268.371,96
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	5.075.383,96
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	5.075.383,96
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	5.075.383,96
Total Renda Fixa	100,00%	135,00	97.706.090,69	96,25%	

Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	10,00%	0,00	0,00%	10.150.767,92
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	3.801.588,54	3,75%	1.273.795,42
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	3,00%	0,00	0,00%	3.045.230,38
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	3,00%	0,00	0,00%	3.045.230,38
Total Renda Variável	30,00%	21,00	3.801.588,54	3,75%	

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
Selic	1,05%	11,59%	3,41%	6,95%	14,08%	28,69%	-	-	-
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,17%	11,74%	3,53%	7,13%	14,23%	28,98%	0,20%	0,040%	0,04%
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%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,99%	10,85%	3,22%	6,66%	13,17%	26,64%	1,00%	0,010%	0,08%
IRF-M 1	0,94%	12,18%	3,36%	6,69%	14,72%	28,94%	-	-	-
BRDESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,96%	12,09%	3,34%	6,61%	14,54%	28,54%	0,20%	0,182%	0,38%
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%
IPCA + 6,00% ao ano	0,72%	11,02%	2,28%	5,53%	14,32%	33,15%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,62%	5,29%	-0,38%	2,88%	8,45%	19,19%	0,20%	0,162%	4,07%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,59%	11,43%	2,51%	5,84%	14,74%	33,42%	0,20%	0,160%	0,36%
IMA-B	0,64%	22,78%	3,13%	7,65%	25,94%	33,95%	-	-	-
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%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	0,70%	22,56%	3,33%	7,78%	25,60%	33,75%	0,20%	2,350%	6,87%
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%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,62%	22,56%	3,11%	7,57%	25,65%	33,14%	0,20%	2,279%	6,78%
IMA-B 5	0,46%	13,44%	2,99%	6,05%	16,48%	32,40%	-	-	-

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 BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,46%	13,20%	2,95%	5,95%	16,15%	31,42%	0,20%	0,735%	2,53%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,44%	13,30%	2,98%	5,96%	16,25%	31,51%	0,20%	0,738%	2,52%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	0,44%	13,25%	2,95%	5,94%	16,24%	31,87%	0,10%	0,738%	2,51%
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%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,41%	11,24%	2,45%	6,34%	14,15%	-	0,20%	0,695%	1,05%

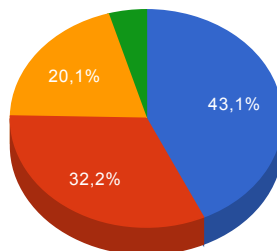
Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (outubro / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA + 6,00% ao ano	0,72%	11,02%	2,28%	5,53%	14,32%	33,15%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA VI FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	0,56%	12,04%	2,59%	5,95%	15,26%	33,39%	0,20%	0,047%	0,31%

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

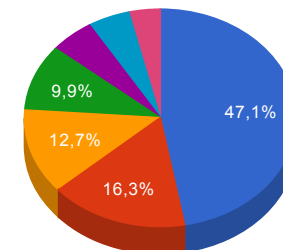
Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	43.752.206,76	43,10%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	32.725.278,02	32,24%
BANCO BRADESCO	20.438.850,88	20,14%
BANCO SANTANDER	4.591.343,57	4,52%

- BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM
- CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
- BANCO BRADESCO
- BANCO SANTANDER



Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	47.844.247,25	47,13%
IDKA IPCA 2A	16.564.458,04	16,32%
IMA-B 5	12.871.553,92	12,68%
IRF-M 1	10.014.215,70	9,87%
CDI	5.355.104,51	5,28%
IMA-B 5+	5.056.511,27	4,98%
MULTIMERCADO	3.801.588,54	3,75%

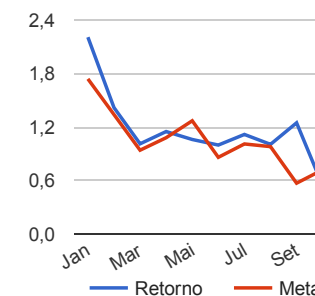
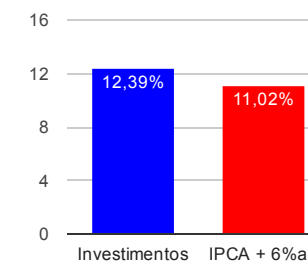
- IMA-B
- IDKA IPCA 2A
- IMA-B 5
- IRF-M 1
- CDI
- IMA-B 5+
- MULTIMERCADO



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	85.161.209,79	35.511,76	592.117,36	86.484.870,74	1.880.266,55	2,21%	1,74%	126,93%	1,02%
Fevereiro	86.484.870,74	3.639.002,55	3.229.408,41	88.126.166,16	1.231.701,28	1,42%	1,34%	105,45%	1,15%
Março	88.126.166,16	25.268.944,51	24.472.426,08	89.822.194,38	899.509,79	1,01%	0,94%	107,36%	0,64%
Abril	89.822.194,38	3.782.263,41	3.162.842,39	91.480.951,13	1.039.335,73	1,15%	1,08%	106,77%	0,44%
Mai	91.480.951,13	1.274.893,56	621.498,16	93.111.075,95	976.729,42	1,06%	1,27%	83,44%	0,52%
Junho	93.111.075,95	13.863.022,19	13.399.547,46	94.508.064,35	933.513,67	1,00%	0,86%	115,76%	0,56%
Julho	94.508.064,35	5.187.015,41	3.093.889,43	97.679.999,84	1.078.809,51	1,12%	1,01%	110,65%	0,41%
Agosto	97.679.999,84	11.573.710,79	10.796.429,41	99.447.259,71	989.978,49	1,01%	0,98%	103,07%	0,86%
Setembro	99.447.259,71	10.040,56	529.201,64	100.168.230,39	1.240.131,76	1,25%	0,57%	219,88%	0,68%
Outubro	100.168.230,39	23.977.302,55	23.183.091,56	101.507.679,23	545.237,85	0,54%	0,72%	74,52%	1,13%
Acumulado no ano					10.815.214,05	12,39%	11,02%	112,42%	

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(%)
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.451.130,83	13.884,37	0,00	1.482.114,01	17.098,81	1,17%	0,04%	1,17%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.830.648,25	0,00	0,00	3.871.531,53	40.883,28	1,07%	0,01%	1,07%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.444,68	0,00	0,00	1.458,97	14,29	0,99%	0,01%	0,99%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.979.286,22	0,00	0,00	4.005.007,17	25.720,95	0,65%	2,28%	0,65%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.025.597,40	0,00	0,00	5.056.511,27	30.913,87	0,62%	0,16%	0,62%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.720.709,85	0,00	0,00	8.772.316,03	51.606,18	0,59%	0,16%	0,59%
BRDESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	17.530.276,12	0,00	12.000.000,00	5.626.315,94	96.039,82	0,55%	0,18%	0,96%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	5.402.673,00	3.148.884,39	148.884,39	8.449.102,60	46.429,60	0,54%	2,26%	0,84%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.347.921,85	4.378.714,97	4.378.714,97	4.387.899,76	39.977,91	0,46%	0,17%	0,94%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.427.476,62	0,00	0,00	3.442.656,90	15.180,28	0,44%	0,74%	0,44%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	4.571.274,62	0,00	0,00	4.591.343,57	20.068,95	0,44%	0,74%	0,44%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.155.191,61	3.076.431,11	0,00	13.287.400,52	55.777,80	0,42%	2,28%	0,62%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.701.543,06	0,00	0,00	8.737.811,44	36.268,38	0,42%	0,67%	0,42%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.743.732,26	0,00	579.061,09	6.192.622,40	27.951,23	0,41%	0,67%	0,43%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.805.262,92	0,00	3.000.000,00	4.837.553,45	32.290,53	0,41%	0,74%	0,46%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.627.379,35	0,00	0,00	1.634.024,20	6.644,85	0,41%	0,70%	0,41%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.066.274,77	0,00	3.076.431,11	0,00	10.156,34	0,33%	0,18%	0,94%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	0,00	13.359.387,71	0,00	13.330.420,93	-28.966,78	-0,22%	2,35%	0,70%
Total Renda Fixa					524.056,29	0,54%	1,17%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IPCA VI FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	3.780.406,98	0,00	0,00	3.801.588,54	21.181,56	0,56%	0,05%	0,56%
				Total Renda Variável	21.181,56	0,56%	0,05%	