

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 / 4.392 / 4.604
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	18/08/2018	996.213,63	1,21%	75	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.181.583,37	2,65%	179	0,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	42.290.396,10	51,42%	612	0,77%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	868.999,45	1,06%	1.171	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.316.164,96	5,25%	207	0,35%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	10.703.746,07	13,02%	639	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	4.158.748,75	5,06%	248	0,36%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	656.044,30	0,80%	587	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	12.002.033,92	14,59%	760	0,25%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA PETROBRAS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.057.608,88	2,50%	32.927	0,50%	Artigo 8º, Inciso III
BB PETROBRAS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.005.896,79	2,44%	59.757	0,37%	Artigo 8º, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			82.237.436,22				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			36.184,79	Artigo 6º			
Total			82.273.621,01				

Enquadramentos na Resolução 3.922 / 4.392 / 4.604 e Política de Investimentos - base (setembro / 2016)

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	100,00%	61.357.103,58	74,61%	20.880.332,64
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	30,00%	4.158.748,75	5,06%	20.512.482,12
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	12.658.078,22	15,39%	12.013.152,65
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	15,00%	0,00	0,00%	12.335.615,43
Total Renda Fixa	100,00%	175,00	78.173.930,55	95,06%	

Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	4.063.505,67	4,94%	8.272.109,76
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	4.111.871,81
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	4.111.871,81
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	4.111.871,81
Total Renda Variável	30,00%	30,00	4.063.505,67	4,94%	

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
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,04%	9,76%	3,29%	6,59%	13,23%	26,53%	1,00%	0,016%	0,08%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

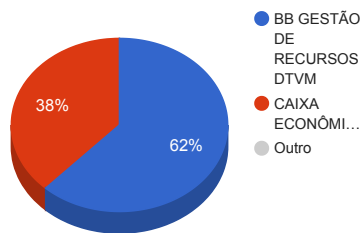
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDKA IPCA 2 Anos	1,50%	12,64%	3,74%	7,11%	18,43%	33,53%	-	-	-
PETROBRAS PN - PETR4	5,60%	102,54%	44,06%	62,51%	87,43%	-24,99%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,33%	12,42%	3,70%	7,14%	18,28%	32,52%	0,20%	0,545%	2,55%
BB PETROBRAS FI AÇÕES	3,40%	83,14%	34,14%	46,15%	79,75%	-17,73%	2,00%	23,519%	63,65%
CAIXA PETROBRAS FI AÇÕES	2,58%	76,62%	30,99%	41,31%	78,35%	-12,84%	1,50%	23,825%	64,25%

Retorno dos investimentos no Exterior e Benchmark's - base (setembro / 2016)

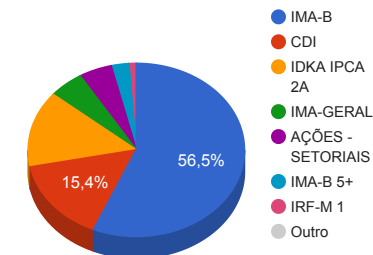
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5	1,41%	12,92%	3,76%	7,19%	18,83%	33,03%	-	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	1,40%	12,79%	3,67%	7,11%	18,62%	31,79%	0,20%	0,834%	2,81%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	50.976.299,02	61,99%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	31.261.137,20	38,01%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	36.184,79	0,04%



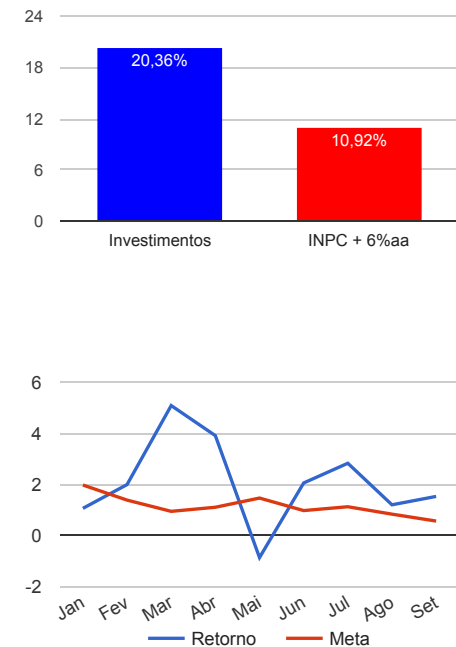
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	46.449.144,85	56,48%
CDI	12.658.078,22	15,39%
IDKA IPCA 2A	11.699.959,70	14,23%
IMA-GERAL	4.316.164,96	5,25%
AÇÕES - SETORIAIS	4.063.505,67	4,94%
IMA-B 5+	2.181.583,37	2,65%
IRF-M 1	868.999,45	1,06%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	36.184,79	0,04%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	65.355.531,09	851.277,97	600.000,00	66.306.944,47	700.135,41	1,07%	1,98%	53,88%	2,60%
Fevereiro	66.306.944,47	1.048.853,29	702.298,40	67.984.512,89	1.331.013,53	2,00%	1,39%	143,20%	3,48%
Março	67.984.512,89	1.098.675,26	660.969,18	71.903.816,26	3.481.597,29	5,09%	0,95%	534,36%	6,19%
Abril	71.903.816,26	1.030.653,29	700.000,00	75.059.712,44	2.825.242,89	3,91%	1,11%	353,48%	4,12%
Mai	75.059.712,44	1.156.706,20	719.871,93	74.848.448,60	-648.098,11	-0,86%	1,47%	-58,34%	3,29%
Junho	74.848.448,60	1.167.411,19	834.895,19	76.729.649,24	1.548.684,64	2,06%	0,98%	209,69%	2,74%
Julho	76.729.649,24	2.250.226,57	1.891.691,36	79.270.622,54	2.182.438,09	2,83%	1,13%	250,57%	2,29%
Agosto	79.270.622,54	1.670.010,02	744.169,18	81.163.569,93	967.106,55	1,21%	0,84%	142,73%	2,30%
Setembro	81.163.569,93	643.224,81	814.215,38	82.237.436,22	1.244.856,86	1,53%	0,57%	270,44%	2,70%
Acumulado no ano					13.632.977,15	20,36%	10,92%	186,42%	

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(%)
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.145.871,06	0,00	0,00	2.181.583,37	35.712,31	1,66%	3,13%	1,66%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.091.522,91	0,00	0,00	4.158.748,75	67.225,84	1,64%	2,27%	1,64%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.249.017,91	0,00	0,00	4.316.164,96	67.147,05	1,58%	1,25%	1,58%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	41.639.246,55	0,00	0,00	42.290.396,10	651.149,55	1,56%	2,30%	1,56%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	983.040,55	0,00	0,00	996.213,63	13.173,08	1,34%	0,46%	1,34%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.522.795,56	40.882,00	0,00	10.703.746,07	140.068,51	1,33%	0,55%	1,33%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	827.978,93	31.158,61	0,00	868.999,45	9.861,91	1,15%	0,08%	1,16%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	12.081.306,60	485.479,00	700.000,00	12.002.033,92	135.248,32	1,08%	0,02%	1,10%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	677.000,66	85.705,20	114.215,38	656.044,30	7.553,82	0,99%	0,02%	1,04%
Total Renda Fixa					1.127.140,39	1,46%	1,61%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB PETROBRAS FI AÇÕES	1.939.960,47	0,00	0,00	2.005.896,79	65.936,32	3,40%	23,52%	3,40%
CAIXA PETROBRAS FI AÇÕES	2.005.828,73	0,00	0,00	2.057.608,88	51.780,15	2,58%	23,83%	2,58%
Total Renda Variável					117.716,47	2,98%	23,67%	

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 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	40.264.201,71	0,00	0,00	42.290.396,10	2.026.194,39	5,03%	5,03%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	10.505.574,99	3.198.459,00	2.100.000,00	12.002.033,92	397.999,93	3,28%	3,46%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.282.651,21	40.882,00	0,00	10.703.746,07	380.212,86	3,69%	3,70%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.954.278,28	0,00	0,00	4.158.748,75	204.470,47	5,17%	5,17%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.137.992,70	0,00	0,00	4.316.164,96	178.172,26	4,31%	4,31%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.059.492,52	0,00	0,00	2.181.583,37	122.090,85	5,93%	5,93%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	810.134,51	31.158,61	0,00	868.999,45	27.706,33	3,38%	3,39%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	1.000.000,00	31.158,61	996.213,63	27.372,24	2,78%	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	538.305,97	292.961,79	196.756,06	656.044,30	21.532,60	3,01%	3,29%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1.110.806,99	0,00	1.122.161,25	0,00	11.354,26	1,02%	3,54%
Total Renda Fixa					3.397.106,19	4,56%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB PETROBRAS FI AÇÕES	1.495.380,18	0,00	0,00	2.005.896,79	510.516,61	34,14%	34,14%
CAIXA PETROBRAS FI AÇÕES	1.570.830,18	0,00	0,00	2.057.608,88	486.778,70	30,99%	30,99%
Total Renda Variável					997.295,31	32,53%	