

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)

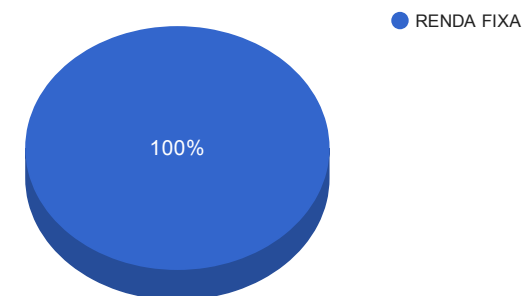
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	4.295.560,21	18,24%	596	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	1.012.459,95	4,30%	237	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	5.302.944,52	22,52%	612	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	3.834.890,32	16,28%	754	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	554.372,50	2,35%	97	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	559.769,13	2,38%	733	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	44788	316.309,93	1,34%	32	0,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.605.580,18	11,06%	100	0,70%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	618.388,97	2,63%	179	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	173.236,90	0,74%	167	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	599.497,05	2,55%	639	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.042.188,58	4,43%	86	0,09%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	19.005,86	0,08%	55	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	211.442,71	0,90%	70	0,36%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	1.381.817,34	5,87%	327	0,06%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	289.220,09	1,23%	587	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	732.783,21	3,11%	801	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TOTAL -			23.549.467,45				

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

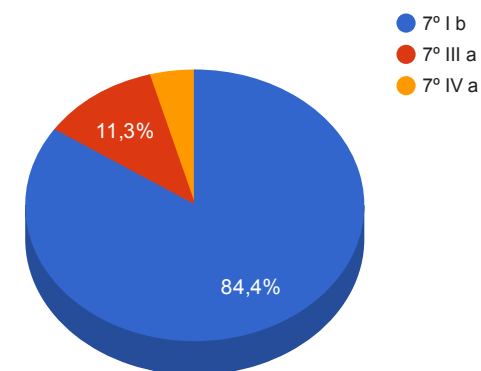
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	95,00%	19.873.009,66	84,39%	2.498.984,42
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	30,00%	2.654.454,49	11,27%	4.410.385,75
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	15,00%	1.022.003,30	4,34%	2.510.416,82
Total Renda Fixa	100,00%	140,00	23.549.467,45	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%	1.177.473,37
Total Renda Variável	30,00%	5,00	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
IRF-M	1,96%	19,30%	4,31%	10,51%	22,20%	30,67%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,96%	19,21%	4,32%	10,51%	22,07%	30,02%	0,20%	1,397%	3,48%
IMA-B 5+	1,67%	28,05%	5,98%	13,71%	34,70%	38,62%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,66%	27,64%	5,93%	13,48%	33,84%	36,94%	0,20%	3,135%	10,13%
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%	-	-	-
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	1,67%	21,70%	5,15%	11,39%	27,86%	35,65%	0,20%	2,399%	7,14%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	1,61%	21,79%	4,98%	10,96%	27,97%	34,93%	0,50%	2,377%	7,10%
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%
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%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,40%	12,66%	3,59%	7,28%	18,44%	-	0,20%	0,970%	2,50%
IDKA IPCA 5 Anos	1,56%	18,29%	4,74%	9,16%	24,91%	34,57%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,40%	-	4,72%	9,10%	-	-	0,20%	1,868%	-
IMA Geral	1,53%	17,70%	4,28%	9,71%	22,07%	31,71%	-	-	-
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	1,70%	18,02%	4,57%	10,22%	22,43%	31,46%	0,25%	1,464%	3,74%

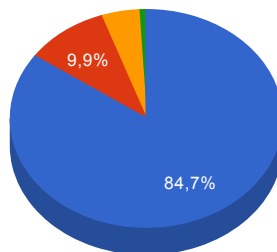
Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (setembro / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
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%
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%
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)

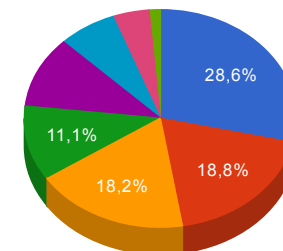
Administrador	Valor	%
BB Gestão de Recursos DTVM	19.944.802,65	84,69%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	2.332.027,65	9,90%
BANCO BRADESCO	1.061.194,44	4,51%
ITAÚ UNIBANCO	211.442,71	0,90%

- BB Gestão de Recursos DTVM
- CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
- BANCO BRADESCO
- ITAÚ UNIBANCO



Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	6.729.812,71	28,58%
IDKA IPCA 2A	4.434.387,37	18,83%
IRF-M	4.295.560,21	18,24%
IMA-GERAL	2.624.586,04	11,14%
IMA-B 5	2.495.958,97	10,60%
IMA-B 5+	1.630.848,92	6,93%
CDI	1.022.003,30	4,34%
IDKA IPCA 5A	316.309,93	1,34%

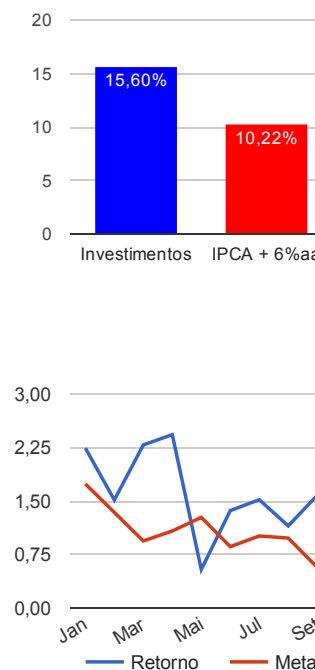
- IMA-B
- IDKA IPCA 2A
- IRF-M
- IMA-GERAL
- IMA-B 5
- IMA-B 5+
- CDI
- IDKA IPCA 5A



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	20.193.059,54	2.673,58	296.872,35	20.351.813,58	452.952,81	2,24%	1,74%	128,96%	1,35%
Fevereiro	20.351.813,58	2.458.014,82	2.293.085,12	20.827.559,30	310.816,02	1,51%	1,34%	112,70%	1,54%
Março	20.827.559,30	855.184,81	843.683,93	21.315.529,43	476.469,25	2,29%	0,94%	242,67%	2,56%
Abril	21.315.529,43	687.000,52	619.399,24	21.902.883,30	519.752,59	2,43%	1,08%	225,82%	1,75%
Mai	21.902.883,30	348.605,94	314.170,51	22.055.664,88	118.346,15	0,54%	1,27%	42,46%	1,62%
Junho	22.055.664,88	1.782.307,94	1.719.487,01	22.420.514,90	302.029,09	1,37%	0,86%	158,45%	1,33%
Julho	22.420.514,90	415.753,04	319.239,83	22.858.769,59	341.741,48	1,52%	1,01%	150,37%	0,99%
Agosto	22.858.769,59	4.567.298,47	4.565.937,02	23.123.260,23	263.129,19	1,15%	0,98%	117,98%	1,35%
Setembro	23.123.260,23	380.806,56	320.839,18	23.549.467,45	366.239,84	1,58%	0,57%	278,55%	1,49%
Acumulado no ano					3.151.476,42	15,60%	10,22%	152,67%	

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 IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.213.094,45	0,00	0,00	4.295.560,21	82.465,76	1,96%	1,40%	1,96%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	18.687,30	0,00	0,00	19.005,86	318,56	1,70%	1,46%	1,70%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	1.025.092,72	0,00	0,00	1.042.188,58	17.095,86	1,67%	2,40%	1,67%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	608.266,00	0,00	0,00	618.388,97	10.122,97	1,66%	3,13%	1,66%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	996.079,71	0,00	0,00	1.012.459,95	16.380,24	1,64%	3,13%	1,64%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	208.094,08	0,00	0,00	211.442,71	3.348,63	1,61%	2,38%	1,61%
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	2.564.989,82	0,00	0,00	2.605.580,18	40.590,36	1,58%	1,24%	1,58%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.221.343,77	0,00	0,00	5.302.944,52	81.600,75	1,56%	2,30%	1,56%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	546.378,00	0,00	0,00	554.372,50	7.994,50	1,46%	1,26%	1,46%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	552.048,30	0,00	0,00	559.769,13	7.720,83	1,40%	0,78%	1,40%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	311.948,31	0,00	0,00	316.309,93	4.361,62	1,40%	1,87%	1,40%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	170.849,18	0,00	0,00	173.236,90	2.387,72	1,40%	0,97%	1,40%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.362.837,74	0,00	0,00	1.381.817,34	18.979,60	1,39%	0,77%	1,39%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.783.869,09	0,00	0,00	3.834.890,32	51.021,23	1,35%	0,56%	1,35%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	591.621,99	0,00	0,00	599.497,05	7.875,06	1,33%	0,55%	1,33%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	724.705,44	0,00	0,00	732.783,21	8.077,77	1,11%	0,03%	1,11%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	223.354,33	380.806,56	320.839,18	289.220,09	5.898,38	0,98%	0,02%	1,04%
Total Renda Fixa					366.239,84	1,58%	1,49%	

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	2.543.126,41	2.533.510,85	0,00	5.302.944,52	226.307,26	5,75%	5,03%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.117.866,73	0,00	0,00	4.295.560,21	177.693,48	4,32%	4,32%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.696.909,32	0,00	0,00	3.834.890,32	137.981,00	3,73%	3,73%
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	2.498.042,87	0,00	0,00	2.605.580,18	107.537,31	4,30%	4,30%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.332.180,19	0,00	0,00	1.381.817,34	49.637,15	3,73%	3,73%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	782.883,76	182.140,29	0,00	1.012.459,95	47.435,90	5,56%	5,97%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.568.099,70	0,00	2.613.002,45	0,00	44.902,75	1,75%	3,39%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.126.565,38	0,00	600.000,00	559.769,13	33.203,75	3,69%	3,70%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	396.202,09	620.000,00	0,00	1.042.188,58	25.986,49	4,09%	5,15%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	707.730,33	0,00	0,00	732.783,21	25.052,88	3,54%	3,54%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	578.120,38	0,00	0,00	599.497,05	21.376,67	3,70%	3,70%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	620.369,17	0,00	620.000,00	19.005,86	18.636,69	4,71%	4,57%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	310.645,87	0,00	8.906,64	316.309,93	14.570,70	4,73%	4,72%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	58.161,69	1.409.446,26	1.190.873,29	289.220,09	12.485,43	2,14%	3,29%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	199.446,11	1.971,78	0,00	211.442,71	10.024,82	4,98%	4,98%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	336.468,90	0,00	173.233,65	173.236,90	10.001,65	3,69%	3,59%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	547.696,00	0,00	0,00	554.372,50	6.676,50	1,22%	1,22%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	616.788,89	0,00	618.388,97	1.600,08	0,26%	5,93%
Total Renda Fixa					971.110,51	4,31%	