

# Relatório Analítico dos Investimentos em outubro de 2016



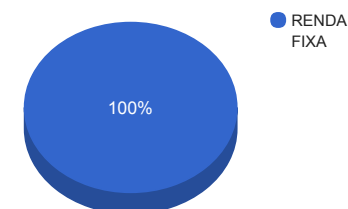
Carteira consolidada de investimentos - base (outubro / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.385.641,70	7,02%	33	1,85%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2030	2.696.888,00	13,67%	18	5,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.469.213,11	7,45%	733	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.889.008,80	9,57%	364	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.692.469,60	28,85%	1.330	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.237.330,07	6,27%	1.170	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.080.594,38	10,54%	754	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.089.097,79	5,52%	3.837	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	1.901.722,35	9,64%	143	0,19%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	290.088,39	1,47%	792	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
		<b>TOTAL -</b>	<b>19.732.054,19</b>				

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

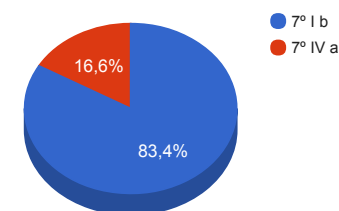
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	90,00%	16.451.145,66	83,37%	1.307.703,11
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	20,00%	0,00	0,00%	3.946.410,84
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	3.280.908,53	16,63%	2.638.707,73
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	986.602,71
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	986.602,71
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	986.602,71
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>155,00</b>	<b>19.732.054,19</b>	<b>100,00%</b>	

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	5,00%	0,00	0,00%	986.602,71
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	10,00%	0,00	0,00%	1.973.205,42
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	986.602,71
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>20,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	

Distribuição por Artigo / Resolução

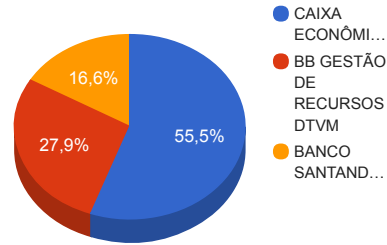


Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (outubro / 2016)

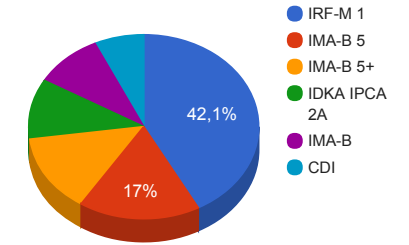
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	1,05%	11,58%	3,41%	6,94%	14,06%	28,63%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,07%	11,43%	3,48%	6,97%	13,94%	28,77%	0,20%	0,013%	0,17%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,06%	11,62%	3,41%	6,95%	14,11%	28,93%	0,25%	0,010%	0,06%
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%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	0,92%	11,85%	3,25%	6,54%	14,30%	27,98%	0,40%	0,170%	0,38%
IPCA + 6,00% ao ano	0,72%	11,02%	2,28%	5,53%	14,32%	33,15%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,61%	11,76%	2,60%	5,99%	15,12%	34,14%	0,20%	0,159%	0,37%
IMA-B	0,64%	22,78%	3,13%	7,65%	25,94%	33,95%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,86%	21,01%	0,31%	5,55%	23,72%	20,37%	0,20%	3,020%	9,99%
IMA-B 5	0,46%	13,44%	2,99%	6,05%	16,48%	32,40%	-	-	-
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%
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%	-	-	-
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	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	10.947.668,50	55,48%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	5.509.735,19	27,92%
BANCO SANTANDER	3.274.650,50	16,60%



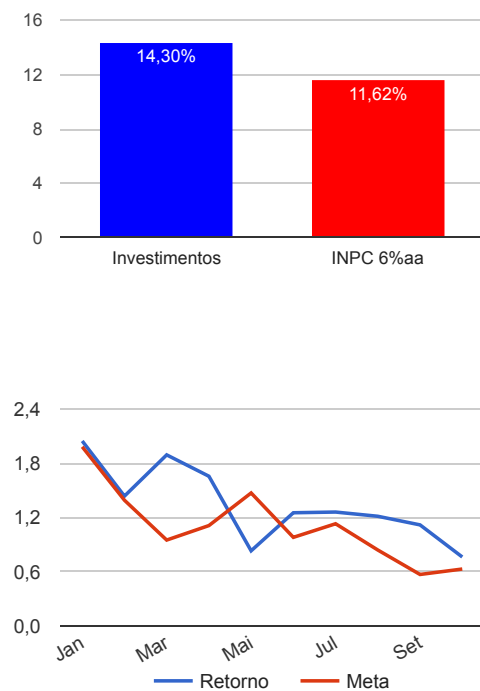
Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	8.315.441,37	42,14%
IMA-B 5	3.358.221,91	17,02%
IMA-B 5+	2.696.888,00	13,67%
IDKA IPCA 2A	2.080.594,38	10,54%
IMA-B	1.901.722,35	9,64%
CDI	1.379.186,18	6,99%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	17.336.482,72	0,00	0,00	17.690.837,97	354.355,25	2,04%	1,98%	103,20%	1,07%
Fevereiro	17.690.837,97	125.890,52	125.890,52	17.944.753,54	253.915,57	1,44%	1,39%	102,93%	1,33%
Março	17.944.753,54	0,00	0,00	18.284.026,30	339.272,76	1,89%	0,95%	198,55%	1,86%
Abril	18.284.026,30	0,00	0,00	18.586.586,58	302.560,28	1,65%	1,11%	149,55%	1,15%
Mai	18.586.586,58	0,00	47.000,00	18.694.112,92	154.526,34	0,83%	1,47%	56,50%	1,27%
Junho	18.694.112,92	40.000,00	10.000,00	18.958.446,66	234.333,74	1,25%	0,98%	127,39%	0,75%
Julho	18.958.446,66	0,00	0,00	19.197.190,89	238.744,23	1,26%	1,13%	111,46%	0,60%
Agosto	19.197.190,89	126.446,50	126.446,50	19.429.987,47	232.796,58	1,21%	0,84%	143,53%	0,91%
Setembro	19.429.987,47	0,00	0,00	19.647.130,62	217.143,15	1,12%	0,57%	197,05%	0,61%
Outubro	19.647.130,62	0,00	65.000,00	19.732.054,19	149.923,57	0,76%	0,63%	120,30%	0,70%
Acumulado no ano					2.477.571,47	14,30%	11,62%	123,01%	

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	287.025,06	0,00	0,00	290.088,39	3.063,33	1,07%	0,01%	1,07%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.077.707,05	0,00	0,00	1.089.097,79	11.390,74	1,06%	0,01%	1,06%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.639.278,01	0,00	0,00	5.692.469,60	53.191,59	0,94%	0,17%	0,94%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.225.773,06	0,00	0,00	1.237.330,07	11.557,01	0,94%	0,18%	0,94%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1.437.910,63	0,00	65.000,00	1.385.641,70	12.731,07	0,89%	0,17%	0,92%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.673.982,00	0,00	0,00	2.696.888,00	22.906,00	0,86%	3,02%	0,86%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.890.199,49	0,00	0,00	1.901.722,35	11.522,86	0,61%	0,16%	0,61%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.462.545,08	0,00	0,00	1.469.213,11	6.668,03	0,46%	0,74%	0,46%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	1.880.751,86	0,00	0,00	1.889.008,80	8.256,94	0,44%	0,74%	0,44%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.071.958,38	0,00	0,00	2.080.594,38	8.636,00	0,42%	0,67%	0,42%
Total Renda Fixa					149.923,57	0,76%	0,70%	