

Relatório Analítico dos Investimentos em outubro de 2016



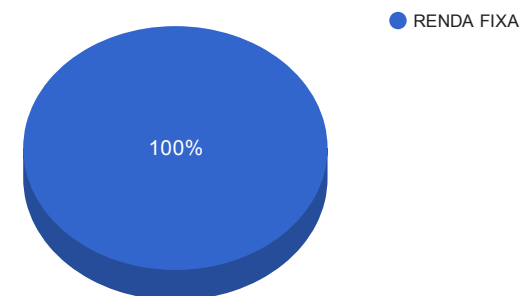
Carteira consolidada de investimentos - base (outubro / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.065.760,50	5,05%	179	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.582.282,84	12,23%	754	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.309.846,25	10,94%	738	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.382.954,37	6,55%	1.170	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	4.696.825,29	22,24%	1.330	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	3.642.241,74	17,25%	620	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	1.217.455,38	5,77%	331	0,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.160.256,90	5,49%	751	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.057.796,37	14,48%	792	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TOTAL -			21.115.419,64				

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

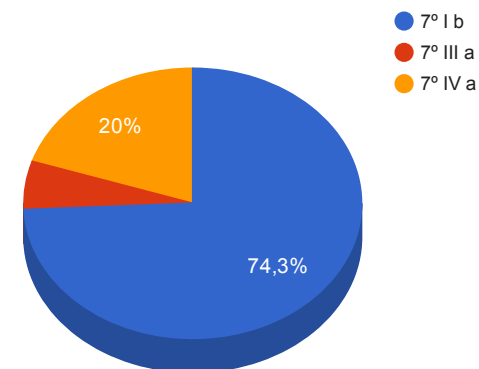
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	100,00%	15.679.910,99	74,26%	5.435.508,65
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	30,00%	1.217.455,38	5,77%	5.117.170,51
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	4.218.053,27	19,98%	2.116.572,62
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	80,00%	10,00%	0,00	0,00%	2.111.541,96
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	30,00%	10,00%	0,00	0,00%	2.111.541,96
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	10,00%	0,00	0,00%	2.111.541,96
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.055.770,98
Total Renda Fixa	100,00%	195,00	21.115.419,64	100,00%	

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	10,00%	0,00	0,00%	2.111.541,96
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	0,00	0,00%	3.167.312,95
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.055.770,98
Total Renda Variável	30,00%	30,00	0,00	0,00%	

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
IRF-M	1,22%	20,75%	4,21%	8,12%	22,56%	30,78%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,30%	20,74%	4,28%	8,17%	22,56%	30,08%	0,20%	1,160%	3,29%

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 BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,05%	11,58%	3,40%	6,92%	14,05%	28,73%	0,20%	0,008%	0,04%

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%

IMA-B	0,64%	22,78%	3,13%	7,65%	25,94%	33,95%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,65%	22,51%	3,09%	7,53%	25,56%	31,59%	0,20%	2,279%	6,81%
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%

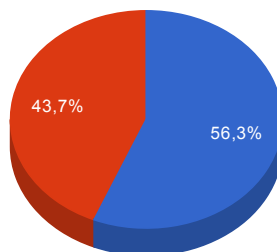
IMA-B 5	0,46%	13,44%	2,99%	6,05%	16,48%	32,40%	-	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,44%	13,30%	2,98%	5,96%	16,25%	31,51%	0,20%	0,738%	2,52%

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)

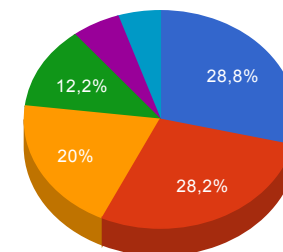
Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	11.882.730,70	56,28%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	9.232.688,94	43,72%

● BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM
● CAIXA ECONÔMICA FEDERAL



Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	6.079.779,66	28,79%
IMA-B	5.952.087,99	28,19%
CDI	4.218.053,27	19,98%
IDKA IPCA 2A	2.582.282,84	12,23%
IMA-B 5	1.217.455,38	5,77%
IRF-M	1.065.760,50	5,05%

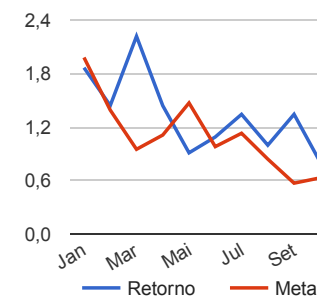
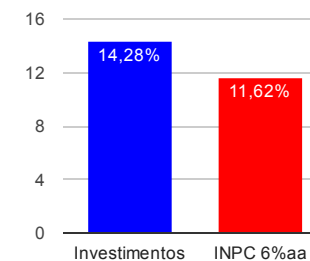
● IRF-M 1
● IMA-B
● CDI
● IDKA IPCA 2A
● IMA-B 5
● IRF-M



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	17.381.863,81	198.245,05	346.571,88	17.557.828,89	324.291,91	1,87%	1,98%	94,20%	1,02%
Fevereiro	17.557.828,89	589.552,56	98.394,09	18.309.058,72	260.071,36	1,44%	1,39%	103,33%	1,13%
Março	18.309.058,72	5.777.636,67	5.510.993,56	18.987.665,34	411.963,51	2,22%	0,95%	232,90%	1,06%
Abril	18.987.665,34	0,00	107.756,99	19.153.208,95	273.300,60	1,44%	1,11%	130,08%	0,69%
Mai	19.153.208,95	426.682,90	1.320.784,77	18.433.502,34	174.395,26	0,91%	1,47%	61,88%	0,64%
Junho	18.433.502,34	2.749.557,64	1.652.310,26	19.743.304,30	212.554,58	1,09%	0,98%	110,78%	0,78%
Julho	19.743.304,30	424.637,17	116.398,84	20.320.689,37	269.146,74	1,34%	1,13%	118,80%	0,57%
Agosto	20.320.689,37	2.845.202,28	2.713.815,24	20.655.813,36	203.736,95	1,00%	0,84%	117,91%	0,74%
Setembro	20.655.813,36	0,00	108.023,20	20.825.193,48	277.403,32	1,34%	0,57%	236,80%	0,86%
Outubro	20.825.193,48	253.834,21	131.874,31	21.115.419,64	168.266,26	0,80%	0,63%	126,64%	0,88%
Acumulado no ano					2.575.130,49	14,28%	11,62%	122,88%	

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(%)
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.052.126,72	0,00	0,00	1.065.760,50	13.633,78	1,30%	1,16%	1,30%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.025.506,12	0,00	0,00	3.057.796,37	32.290,25	1,07%	0,01%	1,07%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.148.212,76	0,00	0,00	1.160.256,90	12.044,14	1,05%	0,01%	1,05%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.652.937,21	0,00	0,00	4.696.825,29	43.888,08	0,94%	0,17%	0,94%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.248.085,99	253.834,21	131.874,31	1.382.954,37	12.908,48	0,86%	0,18%	0,94%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.294.992,46	0,00	0,00	2.309.846,25	14.853,79	0,65%	2,28%	0,65%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.619.680,71	0,00	0,00	3.642.241,74	22.561,03	0,62%	2,28%	0,62%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.212.087,05	0,00	0,00	1.217.455,38	5.368,33	0,44%	0,74%	0,44%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.571.564,46	0,00	0,00	2.582.282,84	10.718,38	0,42%	0,67%	0,42%
Total Renda Fixa					168.266,26	0,80%	0,88%	