

# Relatório Analítico dos Investimentos em novembro 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 (novembro / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.679.120,81	3,40%	212	0,38%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	10.081.419,42	12,80%	1.346	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.765.046,28	8,59%	736	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	2.043.075,94	2,59%	167	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	12.712.453,35	16,14%	617	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	568.743,40	0,72%	193	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	13.500.441,43	17,14%	738	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	9.957.092,69	12,64%	628	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.415.152,42	8,14%	729	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.846.129,01	8,69%	171	0,51%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	5.812.348,44	7,38%	1.175	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	401.902,44	0,51%	595	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	556.308,94	0,71%	223	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	150.811,83	0,19%	205	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	259.607,13	0,33%	589	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	14.529,85	0,02%	182	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV
<b>Total</b>			<b>78.764.183,38</b>				

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

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	100,00%	78.490.046,40	99,65%	274.136,98
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	50,00%	0,00	0,00%	39.382.091,69
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	30,00%	0,00	0,00%	23.629.255,01
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	10,00%	0,00	0,00%	7.876.418,34
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.938.209,17
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>195,00</b>	<b>78.490.046,40</b>	<b>99,65%</b>	

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	10,00%	0,00	0,00%	7.876.418,34
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	0,00	0,00%	11.814.627,51
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.938.209,17
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.938.209,17
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.938.209,17
<b>Total</b>	<b>30,00%</b>	<b>40,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M 1	1,050%	13,36%	3,22%	6,67%	14,70%	29,27%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,03%	13,24%	3,17%	6,58%	14,56%	28,82%	0,20%	0,124%	0,35%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,02%	13,16%	3,15%	6,52%	14,47%	28,52%	0,10%	0,124%	0,35%
CDI	1,037%	12,73%	3,23%	6,86%	14,04%	28,88%	-	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,98%	11,93%	3,04%	6,56%	13,15%	26,92%	1,00%	0,008%	0,08%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,97%	11,88%	3,02%	6,42%	13,10%	26,75%	0,80%	0,000%	0,00%
IDKA IPCA 2 Anos	0,571%	13,75%	2,50%	5,74%	15,91%	32,27%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,68%	12,00%	2,44%	5,64%	13,94%	-	0,20%	0,992%	1,14%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,57%	13,55%	2,35%	5,66%	15,78%	31,23%	0,20%	1,272%	2,38%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,54%	13,48%	2,32%	5,58%	15,72%	30,90%	0,20%	1,297%	2,46%
IMA-B 5	0,397%	13,89%	2,28%	5,63%	16,31%	31,55%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,38%	13,63%	2,25%	5,53%	15,95%	30,58%	0,20%	1,646%	2,53%
IRF-M	0,322%	21,14%	3,53%	8,19%	21,83%	29,69%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,29%	21,02%	3,51%	8,08%	21,68%	29,10%	0,20%	2,524%	3,52%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,27%	21,07%	3,54%	8,09%	21,70%	28,90%	0,20%	2,552%	3,51%
IPCA	0,180%	5,97%	0,52%	1,84%	6,99%	18,20%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,30%	13,51%	2,16%	5,43%	15,84%	-	0,20%	1,962%	2,48%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5+	-2,045%	26,35%	0,31%	7,26%	27,77%	29,61%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-2,05%	25,89%	0,28%	7,17%	27,10%	28,32%	0,20%	6,424%	10,08%
IMA-B	-1,220%	21,28%	0,97%	6,44%	23,13%	29,54%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,62%	7,37%	2,38%	2,57%	9,61%	-	0,20%	1,072%	5,00%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,17%	21,08%	1,05%	6,42%	22,85%	27,38%	0,20%	4,745%	7,05%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,26%	21,02%	0,91%	6,35%	22,81%	28,78%	0,20%	4,787%	7,06%
IMA Geral	-0,001%	18,76%	2,45%	7,13%	19,96%	29,09%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,04%	18,67%	2,63%	7,23%	19,91%	28,34%	0,20%	2,441%	3,53%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	43.465.611,25	55,18%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	35.298.572,13	44,82%

Sub-segmento	Valor	%
IDKA IPCA 2A	24.026.277,52	30,50%
IMA-B	19.477.499,63	24,73%
IRF-M 1	15.893.767,86	20,18%
IRF-M	7.248.031,45	9,20%
IMA-B 5	6.971.461,36	8,85%
IMA-B 5+	2.679.120,81	3,40%
IPCA	2.043.075,94	2,59%
CDI	274.136,98	0,35%
IMA-GERAL	150.811,83	0,19%

## Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

## Acumulado no Ano

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	63.527.792,73	1.020.271,84	460.000,00	65.442.807,02	1.354.742,45	2,11%	1,74%	121,53%	1,23%
Fevereiro	65.442.807,02	1.228.953,35	751.371,74	66.889.690,07	969.301,44	1,47%	1,34%	109,38%	1,44%
Março	66.889.690,07	1.119.524,85	624.503,27	68.788.527,21	1.403.815,56	2,08%	0,94%	221,11%	2,32%
Abril	68.788.527,21	1.090.117,83	656.354,89	70.672.763,88	1.450.473,73	2,10%	1,08%	194,68%	1,47%
Mai	70.672.763,88	6.708.796,89	6.109.370,86	71.779.551,10	507.361,19	0,71%	1,27%	56,03%	1,28%
Junho	71.779.551,10	3.711.581,62	3.239.365,37	73.132.758,88	880.991,53	1,22%	0,86%	141,49%	1,02%
Julho	73.132.758,88	925.117,73	775.922,70	74.286.076,10	1.004.122,19	1,37%	1,01%	135,76%	0,74%
Agosto	74.286.076,10	16.474.072,33	16.010.830,59	75.519.790,62	770.472,78	1,03%	0,98%	105,65%	0,86%
Setembro	75.519.790,62	2.620.397,15	2.106.446,61	77.123.799,43	1.090.058,27	1,43%	0,57%	252,78%	0,97%
Outubro	77.123.799,43	1.502.092,09	1.041.057,10	78.119.348,58	534.514,16	0,69%	0,72%	95,06%	0,99%
Novembro	78.119.348,58	4.682.351,75	4.220.769,51	78.764.183,38	183.252,56	0,23%	0,64%	36,19%	2,25%
Acumulado no ano					10.149.105,86	15,42%	11,73%	131,40%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de novembro / 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	4.387,53	2.640.000,00	0,00	2.679.120,81	34.733,28	1,31%	6,42%	-2,05%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.753.721,21	0,00	0,00	5.812.348,44	58.627,23	1,02%	0,12%	1,02%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.268.866,82	0,00	2.300.000,00	10.081.419,42	112.552,60	0,92%	0,12%	1,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	564.896,17	0,00	0,00	568.743,40	3.847,23	0,68%	0,99%	0,68%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	552.882,63	0,00	0,00	556.308,94	3.426,31	0,62%	1,07%	0,62%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.900.581,72	0,00	0,00	9.957.092,69	56.510,97	0,57%	1,27%	0,57%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.428.567,97	0,00	0,00	13.500.441,43	71.873,46	0,54%	1,30%	0,54%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	963.330,09	864.483,56	1.577.486,77	259.607,13	9.280,25	0,51%	0,01%	0,98%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.391.018,76	0,00	0,00	6.415.152,42	24.133,66	0,38%	1,65%	0,38%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	178.688,47	177.868,19	343.282,74	14.529,85	1.255,93	0,35%	0,00%	0,97%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.036.970,68	0,00	0,00	2.043.075,94	6.105,26	0,30%	1,96%	0,30%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	400.757,09	0,00	0,00	401.902,44	1.145,35	0,29%	2,52%	0,29%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.827.824,82	0,00	0,00	6.846.129,01	18.304,19	0,27%	2,55%	0,27%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	150.752,53	0,00	0,00	150.811,83	59,30	0,04%	2,44%	0,04%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.851.285,36	1.000.000,00	0,00	12.712.453,35	-138.832,01	-1,08%	4,79%	-1,26%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.844.816,73	0,00	0,00	6.765.046,28	-79.770,45	-1,17%	4,74%	-1,17%
Total Renda Fixa					183.252,56	0,23%	2,25%	