

# Relatório Analítico dos Investimentos em outubro 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 (outubro / 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-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	150.752,53	0,19%	208	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	13.428.567,97	17,19%	754	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	11.851.285,36	15,17%	620	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.391.018,76	8,18%	733	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	12.268.866,82	15,71%	1.330	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	5.753.721,21	7,37%	1.170	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	9.900.581,72	12,67%	641	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	552.882,63	0,71%	201	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.827.824,82	8,74%	179	0,48%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	564.896,17	0,72%	193	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.387,53	0,01%	197	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.844.816,73	8,76%	738	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	400.757,09	0,51%	601	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	2.036.970,68	2,61%	167	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	963.330,09	1,23%	586	0,08%	Artigo 7º, Inciso IV
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	178.688,47	0,23%	180	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV
		<b>Total</b>	<b>78.119.348,58</b>				

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

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	100,00%	76.977.330,02	98,54%	1.142.018,56
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	50,00%	0,00	0,00%	39.059.674,29
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	30,00%	0,00	0,00%	23.435.804,57
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	10,00%	0,00	0,00%	7.811.934,86
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.905.967,43
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>195,00</b>	<b>76.977.330,02</b>	<b>98,54%</b>	

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	10,00%	0,00	0,00%	7.811.934,86
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	0,00	0,00%	11.717.902,29
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.905.967,43
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.905.967,43
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.905.967,43
<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 (outubro / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M	1,217%	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%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,23%	20,68%	4,23%	8,08%	22,44%	30,20%	0,20%	1,178%	3,30%
CDI	1,047%	11,58%	3,41%	6,94%	14,06%	28,63%	-	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,99%	10,85%	3,22%	6,66%	13,17%	26,64%	1,00%	0,010%	0,08%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,98%	10,80%	3,19%	6,49%	13,11%	26,50%	0,80%	0,003%	0,00%
IRF-M 1	0,943%	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 Geral	0,903%	18,76%	3,50%	7,58%	21,23%	31,01%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,99%	18,63%	3,64%	7,60%	21,07%	30,17%	0,20%	1,147%	3,38%
IMA-B 5+	0,729%	28,98%	3,30%	8,70%	32,20%	35,92%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,70%	28,53%	3,22%	8,54%	31,37%	34,60%	0,20%	3,091%	9,77%
IMA-B	0,642%	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%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,40%	6,71%	0,12%	2,64%	9,34%	-	0,20%	0,705%	5,08%

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
IMA-B 5	0,459%	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%
IDKA IPCA 2 Anos	0,411%	13,11%	3,23%	5,80%	15,48%	32,92%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,43%	12,90%	3,00%	5,89%	15,70%	31,80%	0,20%	0,673%	2,42%
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%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,41%	11,24%	2,45%	6,34%	14,15%	-	0,20%	0,695%	1,05%
IPCA	0,260%	5,78%	0,78%	2,45%	7,87%	18,59%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,45%	13,17%	2,73%	6,13%	16,35%	-	0,20%	0,910%	2,35%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	43.119.820,01	55,20%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	34.999.528,57	44,80%

Sub-segmento	Valor	%
IDKA IPCA 2A	23.894.045,86	30,59%
IMA-B	18.696.102,09	23,93%
IRF-M 1	18.022.588,03	23,07%
IRF-M	7.228.581,91	9,25%
IMA-B 5	6.943.901,39	8,89%
IPCA	2.036.970,68	2,61%
CDI	1.142.018,56	1,46%
IMA-GERAL	150.752,53	0,19%
IMA-B 5+	4.387,53	0,01%

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%
Acumulado no ano					9.965.853,30	15,15%	11,02%	137,49%	

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	6.740.479,64	0,00	0,00	6.827.824,82	87.345,18	1,30%	1,16%	1,30%	
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	395.892,51	0,00	0,00	400.757,09	4.864,58	1,23%	1,18%	1,23%	
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	149.275,10	0,00	0,00	150.752,53	1.477,43	0,99%	1,15%	0,99%	
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.154.224,05	0,00	0,00	12.268.866,82	114.642,77	0,94%	0,17%	0,94%	
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.699.979,87	0,00	0,00	5.753.721,21	53.741,34	0,94%	0,18%	0,94%	
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	959,68	180.998,31	4.755,69	178.688,47	1.486,17	0,82%	0,00%	0,98%	
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.357,03	0,00	0,00	4.387,53	30,50	0,70%	3,09%	0,70%	
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	665.645,66	1.321.093,78	1.036.301,41	963.330,09	12.892,06	0,65%	0,01%	0,99%	
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.800.800,20	0,00	0,00	6.844.816,73	44.016,53	0,65%	2,28%	0,65%	
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.777.875,28	0,00	0,00	11.851.285,36	73.410,08	0,62%	2,28%	0,62%	
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.362.013,09	0,00	0,00	6.391.018,76	29.005,67	0,46%	0,74%	0,46%	
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.027.854,84	0,00	0,00	2.036.970,68	9.115,84	0,45%	0,91%	0,45%	
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.858.334,95	0,00	0,00	9.900.581,72	42.246,77	0,43%	0,67%	0,43%	
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.372.829,48	0,00	0,00	13.428.567,97	55.738,49	0,42%	0,67%	0,42%	
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	562.598,98	0,00	0,00	564.896,17	2.297,19	0,41%	0,70%	0,41%	
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	550.679,07	0,00	0,00	552.882,63	2.203,56	0,40%	0,70%	0,40%	
Total Renda Fixa						534.514,16	0,69%	0,99%	