

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 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	550.679,07	0,71%	200	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	395.892,51	0,51%	596	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.800.800,20	8,82%	728	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.357,03	0,01%	179	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	562.598,98	0,73%	193	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.740.479,64	8,74%	163	0,58%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	2.027.854,84	2,63%	167	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	9.858.334,95	12,78%	639	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	12.154.224,05	15,76%	1.331	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.362.013,09	8,25%	733	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	5.699.979,87	7,39%	1.171	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	11.777.875,28	15,27%	612	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	13.372.829,48	17,34%	754	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	149.275,10	0,19%	207	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	665.645,66	0,86%	587	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	959,68	0,00%	179	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
		Total	77.123.799,43				

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

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	100,00%	76.457.194,09	99,14%	666.605,34
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	50,00%	0,00	0,00%	38.561.899,72
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	30,00%	0,00	0,00%	23.137.139,83
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	10,00%	0,00	0,00%	7.712.379,94
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.856.189,97
Total Renda Fixa	100,00%	195,00	76.457.194,09	99,14%	

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	10,00%	0,00	0,00%	7.712.379,94
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	0,00	0,00%	11.568.569,91
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.856.189,97
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.856.189,97
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.856.189,97
Total	30,00%	40,00	0,00	0,00%	

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	1,960%	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%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,94%	19,20%	4,32%	10,55%	22,01%	29,81%	0,20%	1,406%	3,48%
IMA-B 5+	1,666%	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%
IMA-B	1,571%	22,00%	5,04%	11,16%	28,36%	35,87%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,58%	21,72%	4,97%	11,04%	27,66%	33,42%	0,20%	2,300%	7,11%
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 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,34%	6,28%	0,70%	4,21%	12,34%	-	0,20%	0,462%	5,24%
IMA Geral	1,531%	17,70%	4,28%	9,71%	22,07%	31,71%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,58%	17,46%	4,31%	9,67%	21,60%	30,66%	0,20%	1,247%	3,56%
IDKA IPCA 2 Anos	1,505%	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%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,33%	10,79%	3,19%	6,83%	16,20%	-	0,20%	0,456%	1,06%
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	1,409%	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%

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	1,191%	11,14%	3,46%	6,82%	15,14%	28,83%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,17%	11,05%	3,42%	6,78%	14,99%	28,37%	0,20%	0,075%	0,40%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,16%	10,97%	3,39%	6,72%	14,91%	28,05%	0,10%	0,076%	0,39%
CDI	1,107%	10,42%	3,47%	6,94%	14,13%	28,50%	-	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1,04%	9,76%	3,29%	6,59%	13,23%	26,53%	1,00%	0,016%	0,08%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	1,04%	9,73%	3,25%	6,49%	13,18%	26,36%	0,80%	0,000%	0,00%
IPCA	0,080%	5,51%	1,04%	2,81%	8,48%	18,77%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,40%	12,66%	3,59%	7,28%	18,44%	-	0,20%	0,970%	2,50%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	42.621.122,81	55,26%
BB Gestão de Recursos DTVM	34.502.676,62	44,74%

Sub-segmento	Valor	%
IDKA IPCA 2A	23.793.763,41	30,85%
IMA-B	18.578.675,48	24,09%
IRF-M 1	17.854.203,92	23,15%
IRF-M	7.136.372,15	9,25%
IMA-B 5	6.912.692,16	8,96%
IPCA	2.027.854,84	2,63%
CDI	666.605,34	0,86%
IMA-GERAL	149.275,10	0,19%
IMA-B 5+	4.357,03	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%
Acumulado no ano					9.431.339,14	14,36%	10,22%	140,53%	

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	388.292,21	0,00	0,00	395.892,51	7.600,30	1,96%	1,40%	1,96%	
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.612.278,60	0,00	0,00	6.740.479,64	128.201,04	1,94%	1,41%	1,94%	
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.285,71	0,00	0,00	4.357,03	71,32	1,66%	3,13%	1,66%	
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.591.049,21	1.000.000,00	0,00	11.777.875,28	186.826,07	1,61%	2,30%	1,56%	
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.694.798,39	0,00	0,00	6.800.800,20	106.001,81	1,58%	2,30%	1,58%	
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	146.952,82	0,00	0,00	149.275,10	2.322,28	1,58%	1,25%	1,58%	
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.274.262,56	0,00	0,00	6.362.013,09	87.750,53	1,40%	0,78%	1,40%	
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.999.904,89	0,00	0,00	2.027.854,84	27.949,95	1,40%	0,97%	1,40%	
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.194.910,91	0,00	0,00	13.372.829,48	177.918,57	1,35%	0,56%	1,35%	
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	555.193,26	0,00	0,00	562.598,98	7.405,72	1,33%	0,46%	1,33%	
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.728.834,78	0,00	0,00	9.858.334,95	129.500,17	1,33%	0,55%	1,33%	
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.013.516,99	0,00	0,00	12.154.224,05	140.707,06	1,17%	0,08%	1,17%	
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.634.697,44	0,00	0,00	5.699.979,87	65.282,43	1,16%	0,08%	1,16%	
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	546.000,00	0,00	550.679,07	4.679,07	0,86%	0,46%	1,34%	
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.323.238,99	882.541,81	1.556.004,95	665.645,66	15.869,81	0,72%	0,02%	1,04%	
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	357.573,86	191.855,34	550.441,66	959,68	1.972,14	0,36%	0,00%	1,04%	
Total Renda Fixa						1.090.058,27	1,43%	0,97%	

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 IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.521.260,84	2.427.034,84	0,00	13.372.829,48	424.533,80	3,48%	3,73%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.364.067,21	3.998.839,49	0,00	11.777.875,28	414.968,58	4,59%	5,03%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	11.752.773,44	0,00	0,00	12.154.224,05	401.450,61	3,42%	3,42%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.418.411,38	1.114.224,00	0,00	9.858.334,95	325.699,57	3,55%	3,70%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.461.114,60	0,00	0,00	6.740.479,64	279.365,04	4,32%	4,32%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.422.793,58	1.100.000,00	0,00	6.800.800,20	278.006,62	4,69%	4,97%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.134.912,18	0,00	0,00	6.362.013,09	227.100,91	3,70%	3,70%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.513.259,74	0,00	0,00	5.699.979,87	186.720,13	3,39%	3,39%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.938.595,44	0,00	2.027.816,73	2.027.854,84	117.076,13	3,69%	3,59%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.879.318,40	0,00	3.398.057,60	562.598,98	81.338,18	3,27%	3,19%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.019.710,93	8.068.068,52	8.474.674,25	665.645,66	52.540,46	1,86%	3,29%
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.174.236,00	0,00	2.214.224,00	0,00	39.988,00	1,84%	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	379.515,72	0,00	0,00	395.892,51	16.376,79	4,32%	4,32%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	5.563,24	2.765.420,36	2.778.427,32	959,68	8.403,40	1,36%	3,25%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	143.112,99	0,00	0,00	149.275,10	6.162,11	4,31%	4,31%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	546.000,00	0,00	550.679,07	4.679,07	0,86%	0,70%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.113,19	0,00	0,00	4.357,03	243,84	5,93%	5,93%
				Total Renda Fixa	2.864.653,24	3,88%	