

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 IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	32.516.871,63	39,88%	1.331	0,32%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	36.824.182,00	45,16%	1.171	0,46%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	6.086.471,16	7,47%	587	0,56%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	1.245.327,03	1,53%	116	0,26%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	3.988.077,37	4,89%	801	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	869.923,60	1,07%	100	0,43%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
Total para cálculo dos limites da Resolução			81.530.852,79				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			2.142,58	Artigo 6º			
Total			81.532.995,37				

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%	70,00%	69.341.053,63	85,05%	-12.269.456,68
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	20,00%	0,00	0,00%	16.306.170,56
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	0,00%	11.319.875,56	13,88%	-11.319.875,56
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	4.076.542,64
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00%	869.923,60	1,07%	-869.923,60
Total Renda Fixa	100,00%	95,00	81.530.852,79	100,00%	

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	4.076.542,64
Total	30,00%	5,00	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	1,19%	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	1,11%	10,42%	3,47%	6,94%	14,13%	28,50%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,11%	10,26%	3,54%	6,88%	14,00%	28,66%	0,20%	0,027%	0,17%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,04%	9,76%	3,29%	6,59%	13,23%	26,53%	1,00%	0,016%	0,08%
IPCA	0,08%	5,51%	1,04%	2,81%	8,48%	18,77%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,95%	14,42%	3,12%	6,49%	20,78%	-	0,20%	0,595%	3,16%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,81%	10,78%	2,79%	6,18%	15,41%	34,14%	0,20%	0,065%	0,32%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	48.144.057,56	59,05%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	33.386.795,23	40,95%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	2.142,58	0,00%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	69.341.053,63	85,05%
CDI	10.074.548,53	12,36%
IMA-B 5	1.245.327,03	1,53%
CRÉDITO PRIVADO	869.923,60	1,07%
DISP. FINANCEIRA	2.142,58	0,00%

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	58.708.476,58	3.081.427,72	1.097.949,17	61.646.872,08	954.916,95	1,57%	1,74%	90,46%	0,36%
Fevereiro	61.646.872,08	59.676,04	1.795.860,61	60.561.416,85	650.729,34	1,06%	1,34%	78,52%	0,82%
Março	60.561.416,85	4.332.009,80	0,00	65.626.375,48	732.948,83	1,13%	0,94%	119,88%	0,19%
Abril	65.626.375,48	2.231.176,28	1.203.775,17	67.328.651,88	674.875,29	1,01%	1,08%	94,07%	0,18%
Mai	67.328.651,88	2.120.208,24	1.193.264,40	68.992.810,97	737.215,25	1,08%	1,27%	85,01%	0,10%
Junho	68.992.810,97	2.598.697,24	1.228.190,56	71.114.317,02	750.999,37	1,07%	0,86%	123,85%	0,13%
Julho	71.114.317,02	3.078.695,92	1.746.887,72	73.173.739,45	727.614,23	1,00%	1,01%	99,51%	0,10%
Agosto	73.173.739,45	11.930.006,13	10.453.857,97	75.508.035,75	858.148,14	1,15%	0,98%	117,83%	0,06%
Setembro	75.508.035,75	3.029.735,34	1.478.749,59	77.911.740,08	852.718,58	1,11%	0,57%	195,11%	0,07%
Acumulado no ano					6.940.165,98	10,65%	10,22%	104,23%	

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(%)
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	32.140.430,19	0,00	0,00	32.516.871,63	376.441,44	1,17%	0,08%	1,17%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	35.374.489,30	2.650.599,04	1.596.164,62	36.824.182,00	395.258,28	1,04%	0,08%	1,16%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	3.565.826,21	420.424,27	38.578,80	3.988.077,37	40.405,69	1,01%	0,03%	1,11%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.790.149,56	235.566,16	0,00	6.086.471,16	60.755,44	1,01%	0,02%	1,04%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	861.774,20	0,00	0,00	869.923,60	8.149,40	0,95%	0,59%	0,95%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.235.377,14	0,00	0,00	1.245.327,03	9.949,89	0,81%	0,07%	0,81%
Total Renda Fixa					890.960,14	1,10%	0,07%	

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 IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	31.763.704,29	8.048.844,98	4.083.488,47	36.824.182,00	1.095.121,20	3,06%	3,39%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	22.543.020,16	9.047.751,00	0,00	32.516.871,63	926.100,47	3,23%	3,42%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.373.546,74	616.370,09	86.277,62	6.086.471,16	182.831,95	3,17%	3,29%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	3.443.801,85	1.253.002,11	829.360,46	3.988.077,37	120.633,87	3,02%	3,54%
CAIXA BRASIL 2016 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.622.920,00	0,00	5.726.415,00	0,00	103.495,00	1,84%	-
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.261.354,00	0,00	3.321.336,00	0,00	59.982,00	1,84%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.246.381,51	0,00	35.417,95	1.245.327,03	34.363,47	2,78%	2,79%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	843.616,20	0,00	0,00	869.923,60	26.307,40	3,12%	3,12%
				Total Renda Fixa	2.548.835,36	3,29%	