

# 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 IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	32.823.581,81	40,00%	1.330	0,32%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	35.652.631,31	43,45%	1.170	0,44%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	1.252.696,45	1,53%	116	0,26%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	6.051.967,90	7,37%	586	0,53%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	2.452.355,01	2,99%	792	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	871.435,60	1,06%	100	0,43%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>79.104.668,08</b>				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			2.957.712,23	Artigo 6º			
<b>Total</b>			<b>82.062.380,31</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%	70,00%	68.476.213,12	86,56%	-13.102.945,46
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	20,00%	0,00	0,00%	15.820.933,62
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	0,00%	9.757.019,36	12,33%	-9.757.019,36
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.955.233,40
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00%	871.435,60	1,10%	-871.435,60
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>95,00</b>	<b>79.104.668,08</b>	<b>100,00%</b>	

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.955.233,40
<b>Total</b>	<b>30,00%</b>	<b>5,00</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
CDI	1,05%	11,58%	3,41%	6,94%	14,06%	28,63%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,07%	11,43%	3,48%	6,97%	13,94%	28,77%	0,20%	0,013%	0,17%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,99%	10,85%	3,22%	6,66%	13,17%	26,64%	1,00%	0,010%	0,08%
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%
IPCA	0,26%	5,78%	0,78%	2,45%	7,87%	18,59%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,59%	11,43%	2,51%	5,84%	14,74%	33,42%	0,20%	0,160%	0,36%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,17%	14,62%	2,92%	5,99%	17,34%	-	0,20%	0,804%	2,89%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	45.409.650,67	57,40%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	33.695.017,41	42,60%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	2.957.712,23	3,74%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	68.476.213,12	86,56%
CDI	8.504.322,91	10,75%
DISP. FINANCEIRA	2.957.712,23	3,74%
IMA-B 5	1.252.696,45	1,58%
CRÉDITO PRIVADO	871.435,60	1,10%

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%
Outubro	77.911.740,08	267.366,14	3.198.899,06	75.695.123,55	714.916,39	0,92%	0,72%	126,61%	0,16%
Acumulado no ano					7.655.082,37	11,67%	11,02%	105,89%	

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(%)
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	3.988.077,37	52.306,50	1.628.817,30	2.452.355,01	40.788,44	1,01%	0,01%	1,07%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.086.471,16	41.414,09	136.035,85	6.051.967,90	60.118,50	0,98%	0,01%	0,99%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	32.516.871,63	0,00	0,00	32.823.581,81	306.710,18	0,94%	0,17%	0,94%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	36.824.182,00	174.525,96	1.679.460,73	35.652.631,31	333.384,08	0,90%	0,18%	0,94%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.245.327,03	0,00	0,00	1.252.696,45	7.369,42	0,59%	0,16%	0,59%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	869.923,60	0,00	0,00	871.435,60	1.512,00	0,17%	0,80%	0,17%
Total Renda Fixa					749.882,62	0,92%	0,16%	