

Relatório Analítico dos Investimentos em setembro e 3º Trimestre de 2016



Carteira consolidada de investimentos - base (setembro / 2016)

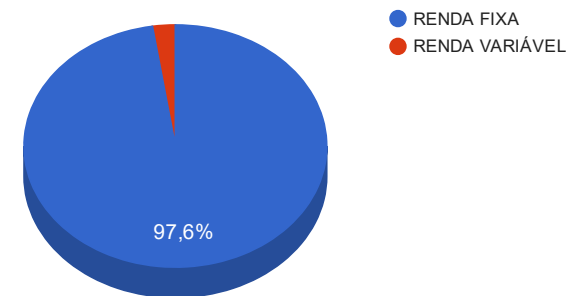
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.439.905,21	18,59%	1.331	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.537.055,54	29,93%	733	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.765.155,63	9,54%	639	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	2.679.341,30	14,48%	327	0,12%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.432,06	0,01%	587	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	3.670.881,71	19,84%	760	0,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRANCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	958.088,39	5,18%	385	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SCHRODER IBRX-100 FI AÇÕES	D+4	Não há	278.519,38	1,51%	6	6,91%	Artigo 8º, Inciso I
WESTERN ASSET DIVIDEND YIELD FI AÇÕES	D+4	Não há	170.571,95	0,92%	3	0,46%	Artigo 8º, Inciso III
		TOTAL -	18.501.951,17				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (setembro / 2016)

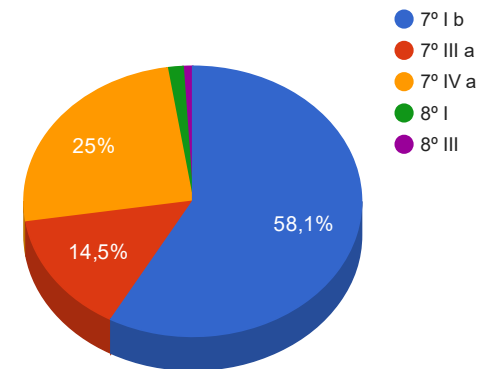
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	75,00%	10.742.116,38	58,06%	3.134.347,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	25,00%	2.679.341,30	14,48%	1.946.146,49
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	4.631.402,16	25,03%	919.183,19
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	925.097,56
Total Renda Fixa	100,00%	135,00	18.052.859,84	97,57%	

Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	3,00%	278.519,38	1,51%	276.539,16
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	3,00%	170.571,95	0,92%	384.486,59
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	925.097,56
Total Renda Variável	30,00%	11,00	449.091,33	2,43%	

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



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
IDKA IPCA 2 Anos	1,50%	12,64%	3,74%	7,11%	18,43%	33,53%	-	-	-
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	1,41%	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%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,39%	12,80%	3,73%	7,13%	18,55%	32,13%	0,20%	0,771%	2,71%
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%
Selic	1,11%	10,44%	3,47%	6,95%	14,15%	28,56%	-	-	-
BRABESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,10%	10,44%	3,49%	6,99%	14,15%	28,71%	0,20%	0,005%	0,02%
CDI	1,11%	10,42%	3,47%	6,94%	14,13%	28,50%	-	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,10%	10,42%	3,46%	6,94%	14,12%	28,60%	0,20%	0,017%	0,06%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,04%	9,76%	3,29%	6,59%	13,23%	26,53%	1,00%	0,016%	0,08%

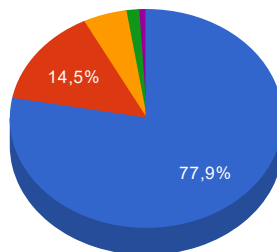
Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (setembro / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IBX	0,60%	33,33%	13,24%	17,03%	27,85%	8,48%	-	-	-
SCHRODER IBRX-100 FI AÇÕES	0,24%	19,93%	10,56%	9,65%	16,69%	2,78%	1,50%	11,092%	23,84%
IDIV	-0,27%	44,15%	14,52%	22,19%	36,47%	-14,52%	-	-	-
WESTERN ASSET DIVIDEND YIELD FI AÇÕES	-0,03%	26,61%	9,80%	12,43%	28,43%	7,25%	2,00%	8,993%	20,48%

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

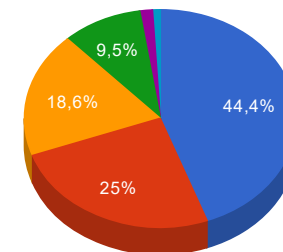
Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	14.412.998,09	77,90%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	2.681.773,36	14,49%
BANCO BRADESCO	958.088,39	5,18%
BNY Mellon Serviços Financeiros	278.519,38	1,51%
WESTERN ASSET	170.571,95	0,92%

- CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
- BB GESTÃO DE RECURSO...
- BANCO BRADESCO
- BNY Mellon Serviços Financeiros
- WESTERN ASSET



Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5	8.216.396,84	44,41%
CDI	4.631.402,16	25,03%
IRF-M 1	3.439.905,21	18,59%
IDKA IPCA 2A	1.765.155,63	9,54%
AÇÕES - INDEXADO	278.519,38	1,51%
AÇÕES - SETORIAIS	170.571,95	0,92%

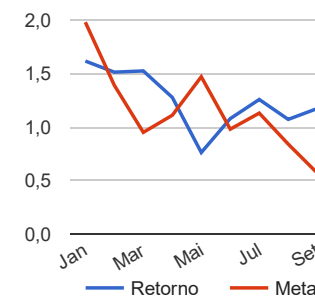
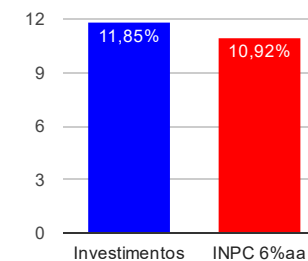
- IMA-B 5
- CDI
- IRF-M 1
- IDKA IPCA 2A
- AÇÕES - INDEXADO
- AÇÕES - SETORIAIS



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	17.509.380,50	725.616,75	132.732,06	18.394.888,45	292.623,26	1,62%	1,98%	81,62%	1,30%
Fevereiro	18.394.888,45	3.633.813,60	2.176.922,53	20.152.126,44	300.346,92	1,51%	1,39%	108,50%	1,29%
Março	20.152.126,44	8.782.593,97	8.272.494,51	20.977.177,57	314.951,67	1,52%	0,95%	160,07%	1,12%
Abril	20.977.177,57	1.000.000,00	1.702.000,00	20.543.047,81	267.870,24	1,28%	1,11%	115,41%	0,86%
Mai	20.543.047,81	190.000,00	541.860,00	20.347.700,32	156.512,51	0,76%	1,47%	51,77%	0,71%
Junho	20.347.700,32	190.000,00	0,00	20.759.236,16	221.535,84	1,08%	0,98%	109,80%	0,76%
Julho	20.759.236,16	1.140.000,00	1.955.000,00	20.205.250,01	261.013,85	1,26%	1,13%	111,28%	0,48%
Agosto	20.205.250,01	746.529,45	1.696.529,45	19.471.709,47	216.459,46	1,07%	0,84%	126,80%	0,58%
Setembro	19.471.709,47	201.916,70	1.400.000,00	18.501.951,17	228.325,00	1,17%	0,57%	206,76%	0,66%
Acumulado no ano					2.259.638,75	11,85%	10,92%	108,53%	

Acumulado no Ano



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 IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.460.683,58	0,00	0,00	5.537.055,54	76.371,96	1,40%	0,78%	1,40%	
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2.642.539,88	0,00	0,00	2.679.341,30	36.801,42	1,39%	0,77%	1,39%	
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.741.968,35	0,00	0,00	1.765.155,63	23.187,28	1,33%	0,55%	1,33%	
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	3.630.794,73	0,00	0,00	3.670.881,71	40.086,98	1,10%	0,02%	1,10%	
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	947.684,73	0,00	0,00	958.088,39	10.403,66	1,10%	0,01%	1,10%	
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.406,99	0,00	0,00	2.432,06	25,07	1,04%	0,02%	1,04%	
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.597.166,18	201.916,70	1.400.000,00	3.439.905,21	40.822,33	0,85%	0,08%	1,17%	
Total Renda Fixa						227.698,70	1,20%	0,42%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de setembro / 2016

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
SCHRODER IBRX-100 FI AÇÕES	277.847,18	0,00	0,00	278.519,38	672,20	0,24%	11,09%	0,24%
WESTERN ASSET DIVIDEND YIELD FI AÇÕES	170.617,85	0,00	0,00	170.571,95	-45,90	-0,03%	8,99%	-0,03%
Total Renda Variável					626,30	0,14%	10,29%	

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 (%)
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.339.402,66	0,00	0,00	5.537.055,54	197.652,88	3,70%	3,70%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.497.388,46	201.916,70	1.400.000,00	3.439.905,21	140.600,05	3,09%	3,42%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	3.626.718,56	1.886.529,45	1.955.000,00	3.670.881,71	112.633,70	2,93%	3,46%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2.583.094,95	0,00	0,00	2.679.341,30	96.246,35	3,73%	3,73%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.702.214,29	0,00	0,00	1.765.155,63	62.941,34	3,70%	3,70%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.307.139,16	0,00	1.400.000,00	958.088,39	50.949,23	2,87%	3,49%
CAIXA BRASIL IPCA XIII FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	293.668,35	0,00	296.529,45	0,00	2.861,10	0,97%	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.354,66	0,00	0,00	2.432,06	77,40	3,29%	3,29%
				Total Renda Fixa	663.962,05	3,41%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre / 2016

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
SCHRODER IBRX-100 FI AÇÕES	251.914,14	0,00	0,00	278.519,38	26.605,24	10,56%	10,56%
WESTERN ASSET DIVIDEND YIELD FI AÇÕES	155.340,93	0,00	0,00	170.571,95	15.231,02	9,80%	9,80%
Total Renda Variável					41.836,26	10,27%	