

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 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	383.563,65	1,25%	639	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	992.924,60	3,24%	1.171	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.306.427,45	17,32%	733	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	4.958.910,00	16,19%	754	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	7.151.397,96	23,34%	1.331	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	D+0	Não há	3.369.869,50	11,00%	341	0,14%	Artigo 7º, Inciso III
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	5.222,40	0,02%	587	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	1.059.657,20	3,46%	801	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	4.184.641,66	13,66%	760	0,09%	Artigo 7º, Inciso IV
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	Não se aplica	Não se aplica	24.142,29	0,08%	98	0,02%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	18/04/2018	372.824,40	1,22%	100	0,18%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	D+4	Não há	485.210,42	1,58%	86	0,62%	Artigo 8º, Inciso I
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	D+4	Não há	570.158,28	1,86%	84	0,51%	Artigo 8º, Inciso III
BB CONSUMO FIC AÇÕES	D+4	Não há	173.628,85	0,57%	2.302	0,22%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	65.477,34	0,21%	224	0,29%	Artigo 8º, Inciso III
BB PIPE FIC AÇÕES	D+4	03/06/2018	420.971,96	1,37%	48	0,45%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	69.084,98	0,23%	346	0,57%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	57.877,48	0,19%	1.164	0,17%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA BRASIL IPCA VII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+0	22/11/2016	933.226,50	3,05%	20	0,93%	Artigo 8º, Inciso IV
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se aplica	Não se aplica	49.450,00	0,16%		0,03%	Artigo 8º, Inciso VI
Total			30.634.666,92				

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%	80,00%	18.793.223,66	61,35%	5.714.509,88
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '	80,00%	50,00%	0,00	0,00%	15.317.333,46
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b ' '	80,00%	10,00%	0,00	0,00%	3.063.466,69
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' '	30,00%	30,00%	0,00	0,00%	9.190.400,08
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b ' '	30,00%	10,00%	0,00	0,00%	3.063.466,69
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.531.733,35
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a ' '	5,00%	5,00%	24.142,29	0,08%	1.507.591,06
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b ' '	5,00%	5,00%	372.824,40	1,22%	1.158.908,95
Total Renda Fixa	100,00%	195,00	19.190.190,35	62,64%	

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	10,00%	485.210,42	1,58%	2.578.256,27
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	1.357.198,89	4,43%	3.238.001,15
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	933.226,50	3,05%	598.506,85
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.531.733,35
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	49.450,00	0,16%	1.482.283,35
Total	30,00%	40,00	2.825.085,81	9,22%	

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
IMA-B	1,571%	22,00%	5,04%	11,16%	28,36%	35,87%	-	-	-
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1,51%	21,14%	4,94%	10,88%	27,24%	34,68%	0,20%	2,172%	6,44%
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%
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%
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 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%
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 SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1,04%	9,76%	3,29%	6,59%	13,23%	26,53%	1,00%	0,016%	0,08%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	-3,02%	-11,28%	-7,68%	-9,80%	-10,95%	-17,12%	0,25%	4,297%	4,82%
IPCA + 6,00% ao ano	0,567%	10,22%	2,57%	5,90%	14,98%	33,45%	-	-	-
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%

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
IFIX	2,77%	28,89%	10,87%	22,29%	29,71%	27,80%	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	-0,46%	23,63%	6,34%	20,61%	25,19%	3,02%	1,20%	-	24,81%
IBX-50	0,86%	32,99%	12,94%	15,61%	26,41%	6,94%	-	-	-
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	0,66%	19,60%	10,98%	11,26%	13,40%	-3,63%	0,70%	11,411%	24,65%
Ibovespa	0,80%	34,64%	13,28%	16,61%	29,53%	7,86%	-	-	-
BB CONSUMO FIC AÇÕES	2,14%	23,60%	12,42%	15,84%	15,38%	16,62%	1,00%	7,373%	20,20%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	-0,09%	27,29%	10,57%	14,16%	22,78%	9,26%	1,00%	9,612%	22,62%
BB PIPE FIC AÇÕES	-0,47%	26,30%	3,57%	12,41%	21,87%	21,90%	1,20%	7,449%	15,26%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	-1,22%	38,94%	11,37%	22,71%	37,39%	-4,93%	2,00%	11,650%	22,72%
IPCA + 6,00% ao ano	0,57%	10,22%	2,57%	5,90%	14,98%	33,45%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA VII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	0,81%	11,05%	2,80%	6,15%	15,73%	33,98%	0,20%	0,070%	0,41%
SMLL	0,09%	35,19%	14,90%	26,78%	32,37%	-4,76%	-	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	0,22%	22,08%	12,65%	18,74%	23,35%	-4,06%	1,50%	8,965%	19,20%
IDIV	-0,27%	44,15%	14,52%	22,19%	36,47%	-14,52%	-	-	-
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	-1,18%	18,09%	5,68%	7,69%	12,78%	-26,93%	1,50%	10,085%	24,15%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	22.429.051,34	73,21%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	8.181.473,29	26,71%
FINAXIS CORRETORA	24.142,29	0,08%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	8.144.322,56	26,59%
IDKA IPCA 2A	5.342.473,65	17,44%
IMA-B 5	5.306.427,45	17,32%
CDI	5.249.521,26	17,14%
IMA-B	3.369.869,50	11,00%
AÇÕES - INDEXADO	570.158,28	1,86%
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	485.210,42	1,58%
AÇÕES - LIVRES	420.971,96	1,37%
CRÉDITO PRIVADO	372.824,40	1,22%
AÇÕES - SETORIAIS	239.106,19	0,78%
AÇÕES - SMALL / MID CAPS	69.084,98	0,23%
AÇÕES - DIVIDENDOS	57.877,48	0,19%
FUNDO IMOBILIÁRIO	49.450,00	0,16%
FIDC	24.142,29	0,08%

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	29.427.425,26	540.876,47	592.000,00	29.812.425,58	436.123,85	1,48%	1,98%	74,83%	1,45%
Fevereiro	29.812.425,58	5.922.476,97	6.544.063,24	29.633.078,26	442.238,95	1,48%	1,39%	106,38%	1,39%
Março	29.633.078,26	1.045.504,73	603.000,00	30.634.903,39	559.320,40	1,86%	0,95%	195,30%	1,97%
Abril	30.634.903,39	570.212,36	1.194.183,37	30.522.452,52	511.520,14	1,67%	1,11%	150,90%	1,50%
Mai	30.522.452,52	875.548,21	1.162.709,34	30.385.279,27	149.987,88	0,49%	1,47%	33,39%	1,25%
Junho	30.385.279,27	468.302,61	628.125,47	30.636.418,33	410.961,92	1,35%	0,98%	137,67%	1,24%
Julho	30.636.418,33	599.621,22	1.000.491,81	30.759.776,75	524.229,01	1,71%	1,13%	151,44%	0,82%
Agosto	30.759.776,75	1.298.431,28	1.544.405,76	30.826.205,08	312.402,81	1,02%	0,84%	120,21%	0,88%
Setembro	30.826.205,08	25.664,59	580.872,82	30.634.666,92	363.670,07	1,18%	0,57%	208,01%	1,08%
Acumulado no ano					3.710.455,03	12,93%	10,92%	118,38%	

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 NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	3.319.833,12	0,00	0,00	3.369.869,50	50.036,38	1,51%	2,17%	1,51%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.233.236,49	0,00	0,00	5.306.427,45	73.190,96	1,40%	0,78%	1,40%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.892.934,27	0,00	0,00	4.958.910,00	65.975,73	1,35%	0,56%	1,35%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	378.525,12	0,00	0,00	383.563,65	5.038,53	1,33%	0,55%	1,33%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.061.435,92	7.199,39	0,00	7.151.397,96	82.762,65	1,17%	0,08%	1,17%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	981.552,53	0,00	0,00	992.924,60	11.372,07	1,16%	0,08%	1,16%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.138.944,28	0,00	0,00	4.184.641,66	45.697,38	1,10%	0,02%	1,10%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1.603.197,83	0,00	560.000,00	1.059.657,20	16.459,37	1,03%	0,03%	1,11%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	369.331,80	0,00	0,00	372.824,40	3.492,60	0,95%	0,59%	0,95%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	7.543,10	18.465,20	20.872,82	5.222,40	86,92	0,33%	0,02%	1,04%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	24.894,07	0,00	0,00	24.142,29	-751,78	-3,02%	4,30%	-3,02%
Total Renda Fixa					353.360,81	1,26%	0,56%	

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(%)
BB CONSUMO FIC AÇÕES	169.995,18	0,00	0,00	173.628,85	3.633,67	2,14%	7,37%	2,14%
CAIXA BRASIL IPCA VII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	925.689,00	0,00	0,00	933.226,50	7.537,50	0,81%	0,07%	0,81%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	482.031,53	0,00	0,00	485.210,42	3.178,89	0,66%	11,41%	0,66%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	68.935,41	0,00	0,00	69.084,98	149,57	0,22%	8,97%	0,22%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	570.643,48	0,00	0,00	570.158,28	-485,20	-0,09%	9,61%	-0,09%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	49.680,50	0,00	0,00	49.450,00	-230,50	-0,46%	-	-0,46%
BB PIPE FIC AÇÕES	422.947,06	0,00	0,00	420.971,96	-1.975,10	-0,47%	7,45%	-0,47%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	58.565,83	0,00	0,00	57.877,48	-688,35	-1,18%	10,08%	-1,18%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	66.288,56	0,00	0,00	65.477,34	-811,22	-1,22%	11,65%	-1,22%
Total Renda Variável					10.309,26	0,37%	6,29%	

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 IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.248.653,09	798.278,59	123.015,08	7.151.397,96	227.481,36	3,39%	3,42%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.117.007,14	0,00	0,00	5.306.427,45	189.420,31	3,70%	3,70%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.780.486,27	0,00	0,00	4.958.910,00	178.423,73	3,73%	3,73%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	3.211.376,36	0,00	0,00	3.369.869,50	158.493,14	4,94%	4,94%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.044.727,13	0,00	0,00	4.184.641,66	139.914,53	3,46%	3,46%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1.565.645,41	0,00	560.000,00	1.059.657,20	54.011,79	3,45%	3,54%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.436.261,03	0,00	480.000,00	992.924,60	36.663,57	3,31%	3,39%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	358.022,04	12.077,53	0,00	383.563,65	13.464,08	3,67%	3,70%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	361.549,80	0,00	0,00	372.824,40	11.274,60	3,12%	3,12%
CAIXA BRASIL IPCA XIV FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	783.443,60	0,00	791.079,20	0,00	7.635,60	0,97%	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	60.057,81	1.113.360,97	1.170.602,21	5.222,40	2.405,83	0,66%	3,29%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	26.150,55	0,00	1.073,90	24.142,29	-934,36	-3,70%	-7,68%
Total Renda Fixa					1.018.254,18	3,68%	

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 (%)
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	515.676,77	0,00	0,00	570.158,28	54.481,51	10,57%	10,57%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	437.210,42	0,00	0,00	485.210,42	48.000,00	10,98%	10,98%
CAIXA BRASIL IPCA VII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	907.838,50	0,00	0,00	933.226,50	25.388,00	2,80%	2,80%
BB CONSUMO FIC AÇÕES	154.446,42	0,00	0,00	173.628,85	19.182,43	12,42%	12,42%
BB PIPE FIC AÇÕES	406.478,52	0,00	0,00	420.971,96	14.493,44	3,57%	3,57%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	61.328,19	0,00	0,00	69.084,98	7.756,79	12,65%	12,65%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	58.790,91	0,00	0,00	65.477,34	6.686,43	11,37%	11,37%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	54.765,87	0,00	0,00	57.877,48	3.111,61	5,68%	5,68%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	46.502,50	0,00	0,00	49.450,00	2.947,50	6,34%	6,34%
Total Renda Variável					182.047,71	6,89%	