

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)

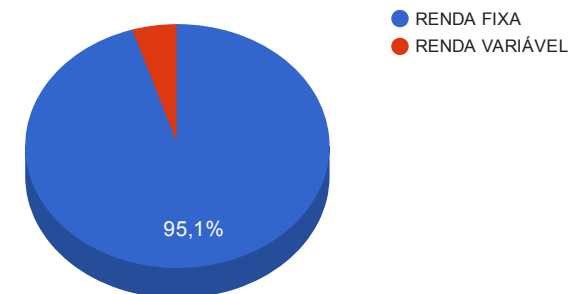
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
TÍTULOS PÚBLICOS			4.247.358,29	11,09%			Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	4.024.032,78	10,51%	1.171	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.676.857,13	9,60%	639	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.243.372,26	11,08%	733	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.085.478,75	2,83%	33	1,52%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	127.139,22	0,33%	193	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.112.761,27	8,13%	1.331	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	147.000,63	0,38%	207	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.080.555,13	21,10%	728	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	859.999,80	2,25%	612	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	101.003,46	0,26%	55	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	133.677,74	0,35%	89	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	D+3	Não há	2.438.208,69	6,37%	382	1,25%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.450.259,18	3,79%	760	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	2.704.138,19	7,06%	385	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER PETROBRÁS PLUS FIC AÇÕES	D+4	Não há	544.727,76	1,42%	1.927	1,49%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA BRASIL IPCA VII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+0	22/11/2016	373.290,60	0,97%	20	0,37%	Artigo 8º, Inciso IV
CAIXA BRASIL IPCA V FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+0	08/11/2016	951.571,50	2,48%	23	0,98%	Artigo 8º, Inciso IV
		TOTAL -	38.301.432,38				

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

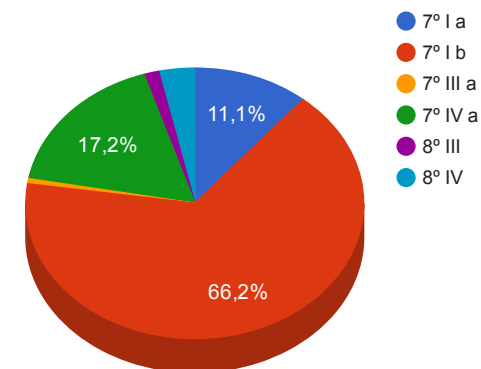
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	15,00%	4.247.358,29	11,09%	1.497.856,57
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	85,00%	25.357.196,97	66,20%	7.199.020,55
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	40,00%	234.681,20	0,61%	15.085.891,75
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	6.592.606,06	17,21%	4.897.823,65
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.915.071,62
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.915.071,62
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.915.071,62
Total Renda Fixa	100,00%	185,00	36.431.842,52	95,12%	

Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.915.071,62
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	5,00%	544.727,76	1,42%	1.370.343,86
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	1.324.862,10	3,46%	590.209,52
Total Renda Variável	30,00%	15,00	1.869.589,86	4,88%	

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
IMA-B	1,57%	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%
IMA Geral	1,53%	17,70%	4,28%	9,71%	22,07%	31,71%	-	-	-
BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	1,70%	18,02%	4,57%	10,22%	22,43%	31,46%	0,25%	1,464%	3,74%
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	1,50%	12,64%	3,74%	7,11%	18,43%	33,53%	-	-	-
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	1,41%	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%
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%
BRASESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1,17%	11,03%	3,40%	6,73%	15,20%	28,38%	0,20%	0,075%	0,52%
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%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1,12%	10,84%	3,39%	6,70%	14,73%	27,83%	0,40%	0,078%	0,42%
Selic	1,11%	10,44%	3,47%	6,95%	14,15%	28,56%	-	-	-

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
BRDESCO 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%
IPCA + 6,00% ao ano	0,57%	10,22%	2,57%	5,90%	14,98%	33,45%	-	-	-
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	1,35%	13,34%	3,96%	7,45%	18,80%	30,35%	0,30%	0,680%	2,59%

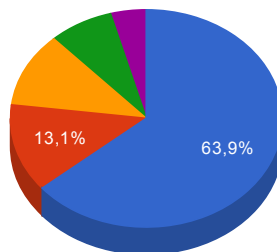
Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (setembro / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
PETROBRAS ON - PETR3	2,71%	76,66%	31,54%	42,43%	77,28%	-12,23%	-	-	-
SANTANDER PETROBRÁS PLUS FIC AÇÕES	2,45%	74,91%	30,49%	40,23%	75,56%	-15,16%	3,00%	23,901%	64,44%
IPCA + 6,00% ao ano	0,57%	10,22%	2,57%	5,90%	14,98%	33,45%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA V FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	0,93%	11,42%	2,86%	6,27%	15,60%	34,17%	0,20%	0,007%	0,33%
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%

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

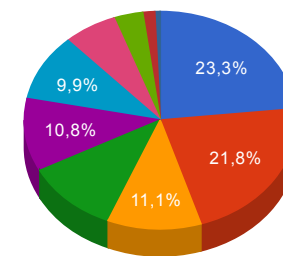
Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	24.473.876,39	63,90%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	5.011.171,80	13,08%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	4.247.358,29	11,09%
BANCO BRADESCO	2.938.819,39	7,67%
BANCO SANTANDER	1.630.206,51	4,26%

- CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
- BB GESTÃO DE RECURSO...
- TESOURO NACIONAL (TÍTULOS P...
- BANCO BRADESCO
- BANCO SANTANDER



Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	8.940.554,93	23,34%
IRF-M 1	8.355.950,54	21,82%
TÍTULOS PÚBLICOS	4.247.358,29	11,09%
IMA-B 5	4.243.372,26	11,08%
CDI	4.154.397,37	10,85%
IDKA IPCA 2A	3.803.996,35	9,93%
GESTÃO LIVRE	2.438.208,69	6,37%
MULTIMERCADO	1.324.862,10	3,46%
AÇÕES - SETORIAIS	544.727,76	1,42%
IMA-GERAL	248.004,09	0,65%

- IMA-B
- IRF-M 1
- TÍTULOS PÚBLICOS
- IMA-B 5
- CDI
- IDKA IPCA 2A
- GESTÃO LIVRE
- MULTIMER...
- AÇÕES - SETORIAIS
- IMA-GERAL



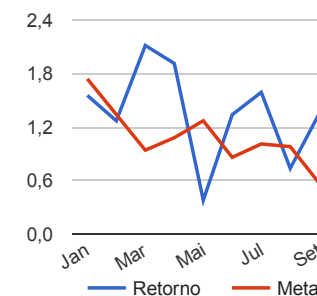
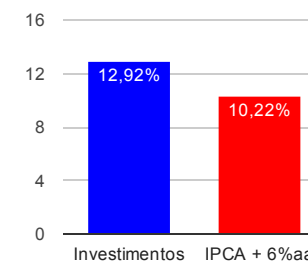
Carteira de Títulos Públicos - base (setembro / 2016)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde.	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	GAP (Atual - Pago)
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	11/08/2004	500	1.487,344824	2.986,232533	743.672,41	1.493.116,27	749.443,85
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	02/12/2004	270	1.494,58526	2.986,232533	403.538,02	806.282,78	402.744,76
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	02/03/2009	630	1.104,73659	3.091,998796	695.984,05	1.947.959,24	1.251.975,19

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	30.803.950,98	4.171.192,91	2.700.000,00	32.776.920,78	501.776,89	1,55%	1,74%	89,38%	1,13%
Fevereiro	32.776.920,78	1.338.931,86	1.207.290,88	33.326.255,10	417.693,34	1,27%	1,34%	94,42%	2,13%
Março	33.326.255,10	734.958,21	690.000,00	34.077.050,51	705.837,20	2,12%	0,94%	224,49%	1,40%
Abril	34.077.050,51	938.403,18	490.000,00	35.185.926,08	660.472,39	1,91%	1,08%	177,73%	1,08%
Mai	35.185.926,08	781.358,91	480.000,00	35.621.696,87	134.411,88	0,38%	1,27%	29,81%	0,77%
Junho	35.621.696,87	669.598,14	500.000,00	36.270.548,44	479.253,43	1,34%	0,86%	155,38%	0,85%
Julho	36.270.548,44	649.837,10	500.000,00	36.999.244,16	578.858,62	1,59%	1,01%	157,48%	0,63%
Agosto	36.999.244,16	8.760.042,77	8.471.533,36	37.562.140,19	274.386,62	0,74%	0,98%	75,43%	1,10%
Setembro	37.562.140,19	688.800,45	460.000,00	38.301.432,38	510.491,74	1,35%	0,57%	238,18%	1,22%
Acumulado no ano					4.263.182,11	12,92%	10,22%	126,45%	

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(%)
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	99.310,54	0,00	0,00	101.003,46	1.692,92	1,70%	1,46%	1,70%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.954.606,20	0,00	0,00	8.080.555,13	125.948,93	1,58%	2,30%	1,58%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	144.713,73	0,00	0,00	147.000,63	2.286,90	1,58%	1,25%	1,58%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	846.758,29	0,00	0,00	859.999,80	13.241,51	1,56%	2,30%	1,56%
TÍTULOS PÚBLICOS	4.182.275,08	0,00	0,00	4.247.358,29	65.083,21	1,56%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.184.843,90	0,00	0,00	4.243.372,26	58.528,36	1,40%	0,78%	1,40%
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	2.405.747,72	0,00	0,00	2.438.208,69	32.460,97	1,35%	0,68%	1,35%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	125.465,64	0,00	0,00	127.139,22	1.673,58	1,33%	0,46%	1,33%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.628.557,53	0,00	0,00	3.676.857,13	48.299,60	1,33%	0,55%	1,33%
BRDESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	132.133,61	0,00	0,00	133.677,74	1.544,13	1,17%	0,07%	1,17%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.977.945,14	0,00	0,00	4.024.032,78	46.087,64	1,16%	0,08%	1,16%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1.073.412,80	0,00	0,00	1.085.478,75	12.065,95	1,12%	0,08%	1,12%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.434.421,97	0,00	0,00	1.450.259,18	15.837,21	1,10%	0,02%	1,10%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.674.774,60	0,00	0,00	2.704.138,19	29.363,59	1,10%	0,01%	1,10%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.852.377,91	688.800,45	460.000,00	3.112.761,27	31.582,91	0,89%	0,08%	1,17%
				Total Renda Fixa	485.697,41	1,35%	0,89%	

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(%)
SANTANDER PETROBRÁS PLUS FIC AÇÕES	531.721,93	0,00	0,00	544.727,76	13.005,83	2,45%	23,90%	2,45%
CAIXA BRASIL IPCA V FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	942.798,00	0,00	0,00	951.571,50	8.773,50	0,93%	0,01%	0,93%
CAIXA BRASIL IPCA VII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	370.275,60	0,00	0,00	373.290,60	3.015,00	0,81%	0,07%	0,81%
Total Renda Variável					24.794,33	1,34%	6,98%	

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 (%)
TÍTULOS PÚBLICOS	4.076.940,85	0,00	0,00	4.247.358,29	170.417,44	4,18%	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.091.899,19	0,00	0,00	4.243.372,26	151.473,07	3,70%	3,70%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.892.213,38	0,00	0,00	4.024.032,78	131.819,40	3,39%	3,39%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.545.748,98	0,00	0,00	3.676.857,13	131.108,15	3,70%	3,70%
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	2.345.273,93	0,00	0,00	2.438.208,69	92.934,76	3,96%	3,96%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	734.205,78	7.253.621,50	0,00	8.080.555,13	92.727,85	3,44%	4,97%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.612.946,30	0,00	0,00	2.704.138,19	91.191,89	3,49%	3,49%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.447.879,15	1.990.658,04	1.410.000,00	3.112.761,27	84.224,08	2,56%	3,42%
CAIXA BRASIL 2016 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.392.812,00	0,00	4.473.604,00	0,00	80.792,00	1,84%	-
CAIXA BRASIL 2016 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.729.845,00	0,00	2.780.017,50	0,00	50.172,50	1,84%	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.401.769,40	0,00	0,00	1.450.259,18	48.489,78	3,46%	3,46%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1.049.859,43	0,00	0,00	1.085.478,75	35.619,32	3,39%	3,39%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	876.669,83	0,00	767.911,86	127.139,22	18.381,25	3,27%	3,19%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	140.932,42	0,00	0,00	147.000,63	6.068,21	4,31%	4,31%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	854.400,78	0,00	859.999,80	5.599,02	0,66%	5,03%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	96.585,17	0,00	0,00	101.003,46	4.418,29	4,57%	4,57%
BRDESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	129.284,64	0,00	0,00	133.677,74	4.393,10	3,40%	3,40%
				Total Renda Fixa	1.199.830,11	3,43%	

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 (%)
SANTANDER PETROBRÁS PLUS FIC AÇÕES	417.437,09	0,00	0,00	544.727,76	127.290,67	30,49%	30,49%
CAIXA BRASIL IPCA V FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	925.110,50	0,00	0,00	951.571,50	26.461,00	2,86%	2,86%
CAIXA BRASIL IPCA VII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	363.135,40	0,00	0,00	373.290,60	10.155,20	2,80%	2,80%
Total Renda Variável					163.906,87	9,61%	