

# Relatório Analítico dos Investimentos em outubro de 2016



Carteira consolidada de investimentos - base (outubro / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	28.510.140,67	12,32%	208	2,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	14.658.387,65	6,33%	247	0,99%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
DAYCOVAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+3	Não há	7.273.959,29	3,14%	47	14,93%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2020	1.434.749,74	0,62%	122	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	2.925.289,97	1,26%	21	0,91%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	29.257.273,05	12,64%	754	0,46%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	4.592.273,83	1,98%	620	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.017.062,09	0,87%	1.170	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	33.154.016,07	14,32%	1.330	0,33%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.999.712,53	3,02%	738	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	7.800.878,87	3,37%	38	15,42%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
SICREDI INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	10.181.341,13	4,40%	63	6,92%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRABESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	11.284.050,17	4,88%	70	3,39%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	10.163.296,80	4,39%	38	6,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	24.186.545,01	10,45%	792	0,46%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	5.453.901,86	2,36%	143	0,54%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2030	17.545.584,00	7,58%	34	9,15%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SUL INVEST FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 6	Não se aplica	Não se aplica	1.020.624,93	0,44%	20	1,68%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	1.096.761,63	0,47%	98	1,02%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
BB INDEXADO IBRX FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.854.559,96	0,80%	5.142	1,52%	Artigo 8º, Inciso I
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	D+15	Não há	1.040.737,08	0,45%	28	7,12%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	3.241.640,14	1,40%	15	10,97%	Artigo 8º, Inciso II

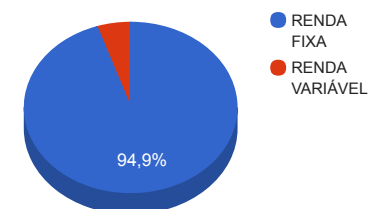
Carteira consolidada de investimentos - base (outubro / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	2.364.474,69	1,02%	485	1,58%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	2.344.179,34	1,01%	235	9,69%	Artigo 8º, Inciso III
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	D+4	Não há	1.065.042,25	0,46%	8.841	0,58%	Artigo 8º, Inciso III
		<b>TOTAL -</b>	<b>231.466.482,75</b>				

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

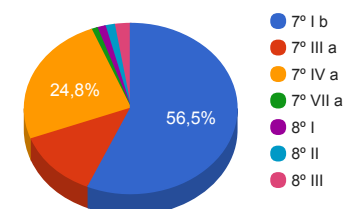
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	70,00%	130.822.864,89	56,52%	31.203.673,04
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	18,00%	29.266.270,17	12,64%	12.397.696,73
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	57.349.327,67	24,78%	12.090.617,16
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	3,00%	2.117.386,56	0,91%	4.826.607,92
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	4,00%	0,00	0,00%	9.258.659,31
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>125,00</b>	<b>219.555.849,29</b>	<b>94,85%</b>	

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	5,00%	2.895.297,04	1,25%	8.678.027,10
Artigo 8º, Inciso II	20,00%	0,00%	3.241.640,14	1,40%	-3.241.640,14
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	5,00%	5.773.696,28	2,49%	5.799.627,86
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>10,00</b>	<b>11.910.633,46</b>	<b>5,15%</b>	

Distribuição por Artigo / Resolução



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
IRF-M	1,22%	20,75%	4,21%	8,12%	22,56%	30,78%	-	-	-
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	1,25%	19,95%	4,18%	8,00%	21,70%	29,88%	0,20%	1,156%	3,17%
CDI	1,05%	11,58%	3,41%	6,94%	14,06%	28,63%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,07%	11,43%	3,48%	6,97%	13,94%	28,77%	0,20%	0,013%	0,17%
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%
IMA Geral	0,90%	18,76%	3,50%	7,58%	21,23%	31,01%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,99%	18,63%	3,64%	7,60%	21,07%	30,17%	0,20%	1,147%	3,38%
IPCA + 7,50% ao ano	0,84%	12,32%	2,65%	6,29%	15,93%	36,92%	-	-	-
SUL INVEST FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 6	0,74%	-2,62%	-10,90%	-7,79%	0,60%	0,81%	0,18%	0,159%	-
IMA-B 5+	0,73%	28,98%	3,30%	8,70%	32,20%	35,92%	-	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,72%	28,80%	3,29%	8,71%	31,90%	35,35%	0,20%	3,106%	9,83%
IPCA + 6,00% ao ano	0,72%	11,02%	2,28%	5,53%	14,32%	33,15%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,62%	5,29%	-0,38%	2,88%	8,45%	19,19%	0,20%	0,162%	4,07%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,61%	11,76%	2,60%	5,99%	15,12%	34,14%	0,20%	0,159%	0,37%
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,61%	5,31%	-0,36%	2,88%	8,45%	19,18%	0,20%	0,162%	4,00%

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (outubro / 2016)

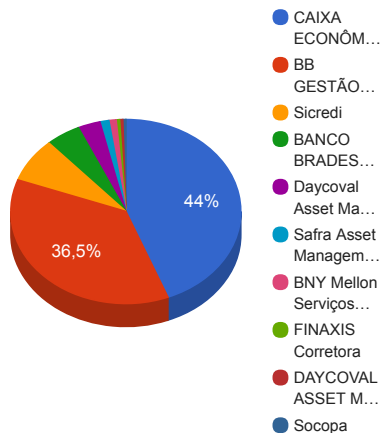
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,43%	13,78%	2,91%	5,94%	16,93%	31,33%	0,15%	0,816%	2,89%
101,50% do IPCA + 5,75% ao ano	0,72%	10,96%	2,26%	5,49%	14,26%	33,01%	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-1,25%	-12,38%	-8,49%	-9,74%	-11,59%	-17,00%	0,25%	1,760%	4,01%
IMA-B	0,64%	22,78%	3,13%	7,65%	25,94%	33,95%	-	-	-
SICREDI INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	0,75%	21,82%	3,27%	7,62%	24,92%	32,79%	0,20%	2,259%	6,67%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,65%	22,51%	3,09%	7,53%	25,56%	31,59%	0,20%	2,279%	6,81%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	0,63%	20,72%	3,01%	7,30%	23,86%	34,31%	0,45%	2,314%	6,23%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,62%	22,56%	3,11%	7,57%	25,65%	33,14%	0,20%	2,279%	6,78%
IMA-B 5	0,46%	13,44%	2,99%	6,05%	16,48%	32,40%	-	-	-
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	0,50%	13,35%	2,99%	5,89%	16,38%	31,08%	0,20%	0,798%	2,63%
DAYCOVAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,38%	12,48%	2,87%	5,66%	15,34%	-	0,50%	0,777%	2,56%
IDKA IPCA 2 Anos	0,41%	13,11%	3,23%	5,80%	15,48%	32,92%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,42%	12,87%	3,08%	5,81%	15,63%	31,54%	0,20%	0,673%	2,49%

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

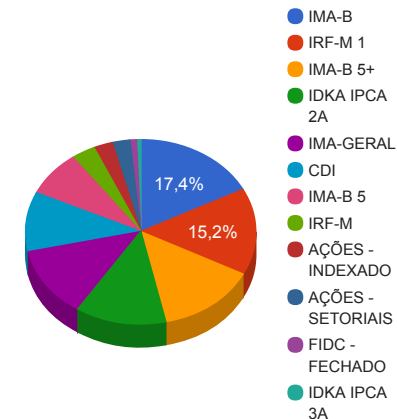
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	11,23%	49,77%	13,29%	20,43%	41,55%	18,85%	-	-	-
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	12,11%	40,03%	12,91%	18,02%	32,70%	-1,58%	2,80%	5,550%	22,24%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	10,92%	48,64%	12,90%	20,12%	41,33%	18,90%	0,50%	5,420%	30,66%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	5,77%	46,96%	3,24%	22,17%	38,14%	0,87%	2,00%	5,388%	22,14%
IBX	10,75%	47,66%	12,67%	20,98%	39,71%	19,02%	-	-	-
BB INDEXADO IBRX FIC AÇÕES	10,50%	44,87%	12,21%	20,15%	36,89%	14,16%	1,50%	5,645%	24,71%
BBSEGURIDADE ON NM - BBSE3	7,56%	40,47%	9,61%	10,12%	28,48%	9,29%	-	-	-
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	7,43%	38,31%	9,30%	9,37%	26,23%	5,69%	1,5%	9,116%	41,75%
SMLL	7,01%	44,67%	7,29%	28,53%	34,32%	3,56%	-	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	9,53%	28,47%	5,86%	20,69%	24,45%	15,71%	2,00%	4,126%	17,44%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	101.958.569,55	44,05%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	84.519.795,44	36,51%
Sicredi	17.982.220,00	7,77%
BANCO BRADESCO	11.284.050,17	4,88%
Daycoval Asset Management	7.273.959,29	3,14%
Safra Asset Management	2.925.289,97	1,26%
BNY Mellon Serviços Financeiros	2.364.474,69	1,02%
FINAXIS Corretora	1.096.761,63	0,47%
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT ADMINISTRAÇÃO DE RECURSOS	1.040.737,08	0,45%
Socopa	1.020.624,93	0,44%



Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	40.315.816,12	17,42%
IRF-M 1	35.171.078,16	15,19%
IMA-B 5+	32.203.971,65	13,91%
IDKA IPCA 2A	29.257.273,05	12,64%
IMA-GERAL	28.510.140,67	12,32%
CDI	24.186.545,01	10,45%
IMA-B 5	18.558.009,46	8,02%
IRF-M	7.800.878,87	3,37%
AÇÕES - INDEXADO	6.136.937,18	2,65%
AÇÕES - SETORIAIS	5.773.696,28	2,49%
FIDC - FECHADO	2.117.386,56	0,91%
IDKA IPCA 3A	1.434.749,74	0,62%

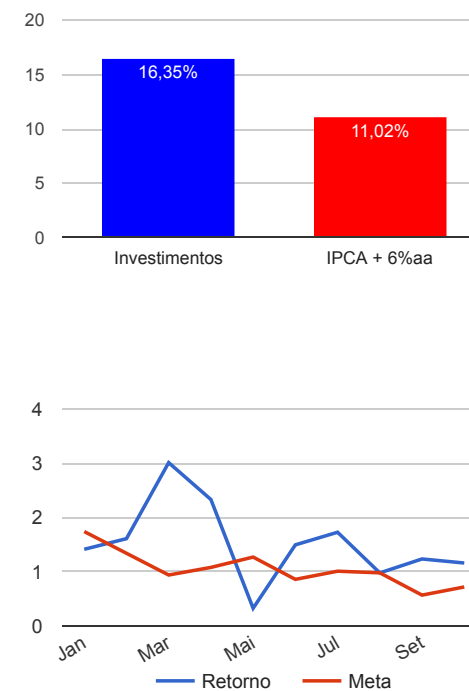




Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	185.108.965,39	6.957.443,56	5.100.594,69	189.608.288,02	2.642.473,76	1,41%	1,74%	81,25%	1,48%
Fevereiro	189.608.288,02	4.245.836,11	2.362.897,71	194.572.326,68	3.081.100,26	1,61%	1,34%	119,69%	2,33%
Março	194.572.326,68	3.352.000,00	1.395.129,18	202.442.046,61	5.912.849,11	3,01%	0,94%	319,33%	3,15%
Abril	202.442.046,61	3.246.705,33	1.451.295,33	208.995.012,47	4.757.555,86	2,33%	1,08%	216,42%	2,09%
Mai	208.995.012,47	9.123.050,72	7.395.409,74	211.413.837,88	691.184,43	0,33%	1,27%	25,82%	2,23%
Junho	211.413.837,88	10.626.971,23	8.905.122,57	216.321.844,89	3.186.158,35	1,49%	0,86%	173,47%	1,40%
Julho	216.321.844,89	12.203.584,49	8.632.494,66	223.690.655,65	3.797.720,93	1,73%	1,01%	171,12%	0,97%
Agosto	223.690.655,65	13.883.074,35	13.423.759,04	226.344.108,12	2.194.137,16	0,98%	0,98%	100,34%	1,70%
Setembro	226.344.108,12	2.429.766,28	2.593.500,50	228.976.706,05	2.796.332,15	1,24%	0,57%	217,83%	1,36%
Outubro	228.976.706,05	1.461.956,00	1.630.244,00	231.466.482,75	2.658.064,70	1,16%	0,72%	160,18%	1,12%
Acumulado no ano					31.717.576,71	16,35%	11,02%	148,44%	

**Acumulado no Ano**



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(%)
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	7.704.267,05	0,00	0,00	7.800.878,87	96.611,82	1,25%	1,16%	1,25%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	23.931.135,69	0,00	0,00	24.186.545,01	255.409,32	1,07%	0,01%	1,07%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	28.230.731,78	0,00	0,00	28.510.140,67	279.408,89	0,99%	1,15%	0,99%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.998.222,18	0,00	0,00	2.017.062,09	18.839,91	0,94%	0,18%	0,94%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	33.009.154,68	1.461.956,00	1.619.000,00	33.154.016,07	301.905,39	0,88%	0,17%	0,94%
SICREDI INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	10.105.859,47	0,00	0,00	10.181.341,13	75.481,66	0,75%	2,26%	0,75%
SUL INVEST FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 6	1.013.112,78	0,00	0,00	1.020.624,93	7.512,15	0,74%	0,16%	0,74%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.552.927,76	0,00	0,00	14.658.387,65	105.459,89	0,72%	3,11%	0,72%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.954.699,91	0,00	0,00	6.999.712,53	45.012,62	0,65%	2,28%	0,65%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	2.906.836,32	0,00	0,00	2.925.289,97	18.453,65	0,63%	2,31%	0,63%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.563.828,04	0,00	0,00	4.592.273,83	28.445,79	0,62%	2,28%	0,62%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	17.438.316,00	0,00	0,00	17.545.584,00	107.268,00	0,62%	0,16%	0,62%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.420.855,74	0,00	0,00	5.453.901,86	33.046,12	0,61%	0,16%	0,61%
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.102.012,20	0,00	0,00	10.163.296,80	61.284,60	0,61%	0,16%	0,61%
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	11.227.921,74	0,00	0,00	11.284.050,17	56.128,43	0,50%	0,80%	0,50%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.428.651,00	0,00	0,00	1.434.749,74	6.098,74	0,43%	0,82%	0,43%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	29.135.833,72	0,00	0,00	29.257.273,05	121.439,33	0,42%	0,67%	0,42%
DAYCOVAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	7.246.212,34	0,00	0,00	7.273.959,29	27.746,95	0,38%	0,78%	0,38%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.110.597,67	0,00	11.244,00	1.096.761,63	-2.592,04	-0,23%	1,76%	-1,25%
Total Renda Fixa					1.642.961,22	0,75%	0,88%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	928.311,73	0,00	0,00	1.040.737,08	112.425,35	12,11%	5,55%	12,11%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	2.922.487,14	0,00	0,00	3.241.640,14	319.153,00	10,92%	5,42%	10,92%
BB INDEXADO IBRX FIC AÇÕES	1.678.348,92	0,00	0,00	1.854.559,96	176.211,04	10,50%	5,64%	10,50%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	2.158.785,94	0,00	0,00	2.364.474,69	205.688,75	9,53%	4,13%	9,53%
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	991.341,33	0,00	0,00	1.065.042,25	73.700,92	7,43%	9,12%	7,43%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	2.216.254,92	0,00	0,00	2.344.179,34	127.924,42	5,77%	5,39%	5,77%
Total Renda Variável					1.015.103,48	9,32%	5,53%	