

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 3.922/2010 - 4.392/2014
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	6.088.374,68	1,81%	620	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	21.392.411,69	6,35%	128	3,54%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.416.153,46	0,42%	364	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	16.771.869,06	4,98%	14	12,71%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	35.261.144,30	10,46%	1.170	0,44%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRABESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	D+1	16/05/2019	11.578.733,33	3,44%	11	15,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	58.420.907,99	17,33%	733	0,97%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	41.071.350,27	12,19%	754	0,64%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRABESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	66.115.962,77	19,62%	88	5,31%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.811.082,00	1,13%	792	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BGT PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA	D+0 ou D+1	Não há	12.370.517,00	3,67%	12	8,43%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	13.322.372,91	3,95%	95	3,67%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	2.106.901,24	0,63%	66	0,18%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+30 a D+2880	Não há	6.422.989,72	1,91%	50	2,01%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	7.444.828,31	2,21%	21.191	1,37%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	23/08/2017	1.209.782,00	0,36%	116	0,33%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	9.051.698,21	2,69%	3.045	3,13%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA BRASIL IPCA VIII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+0	06/12/2016	1.871.404,00	0,56%	21	2,00%	Artigo 8º, Inciso IV
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	5.503.736,84	1,63%	249	4,23%	Artigo 8º, Inciso IV
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	D+5	Não há	4.470.427,64	1,33%	30	2,28%	Artigo 8º, Inciso IV
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	819.094,93	0,24%	19	1,02%	Artigo 8º, Inciso V
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	Não se aplica	Não se aplica	3.871.416,08	1,15%	98	0,72%	Artigo 8º, Inciso V

Carteira consolidada de investimentos - base (outubro / 2016)

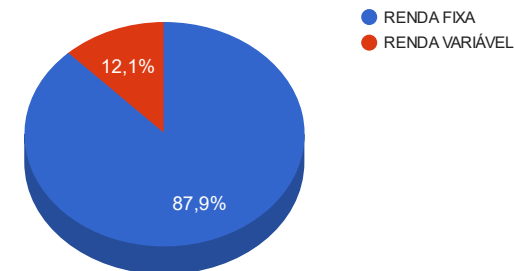
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPPF11	Não se aplica	Não se aplica	1.310.325,63	0,39%		0,75%	Artigo 8º, Inciso VI
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	Não se aplica	Não se aplica	5.313.005,88	1,58%			Artigo 8º, Inciso VI
		TOTAL -	337.016.489,94				

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

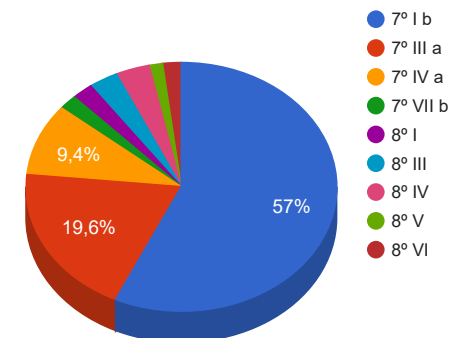
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	80,00%	192.000.944,78	56,97%	77.612.247,17
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	50,00%	66.115.962,77	19,62%	102.392.282,20
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	31.610.873,15	9,38%	69.494.073,83
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	16.850.824,50
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	16.850.824,50
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	6.422.989,72	1,91%	10.427.834,78
Total Renda Fixa	100,00%	175,00	296.150.770,42	87,87%	

Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	5,00%	7.444.828,31	2,21%	9.405.996,19
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	10,00%	10.261.480,21	3,04%	23.440.168,78
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	11.845.568,48	3,51%	5.005.256,02
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	4.690.511,01	1,39%	12.160.313,49
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	6.623.331,51	1,97%	10.227.492,99
Total Renda Variável	30,00%	30,00	40.865.719,52	12,13%	

Distribuição por Segmento



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
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%	-	-	-
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 + 6,00% ao ano	0,72%	11,02%	2,28%	5,53%	14,32%	33,15%	-	-	-
BTG PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA	0,60%	8,33%	2,52%	2,89%	8,37%	18,84%	0,15%	0,171%	4,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,57%	18,97%	3,17%	6,28%	23,68%	31,56%	0,15%	1,520%	6,26%
IMA-B	0,64%	22,78%	3,13%	7,65%	25,94%	33,95%	-	-	-
BRABESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	0,70%	22,56%	3,33%	7,78%	25,60%	33,75%	0,20%	2,350%	6,87%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP	0,63%	22,71%	3,15%	7,61%	25,81%	33,23%	0,20%	2,278%	6,78%
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%
BRABESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	0,39%	11,95%	3,28%	3,06%	11,56%	-	0,20%	0,735%	5,40%
IMA-B 5	0,46%	13,44%	2,99%	6,05%	16,48%	32,40%	-	-	-
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	0,59%	16,67%	3,40%	6,21%	19,32%	32,75%	0,40%	1,303%	3,64%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,46%	13,20%	2,95%	5,95%	16,15%	31,42%	0,20%	0,735%	2,53%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	0,44%	13,25%	2,95%	5,94%	16,24%	31,87%	0,10%	0,738%	2,51%
IDKA IPCA 2 Anos	0,41%	13,11%	3,23%	5,80%	15,48%	32,92%	-	-	-

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 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%
IPCA	0,26%	5,78%	0,78%	2,45%	7,87%	18,59%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,00%	19,23%	3,76%	7,75%	21,38%	-	0,40%	1,503%	3,74%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,54%	17,67%	3,79%	6,87%	21,76%	33,06%	0,20%	1,153%	4,66%

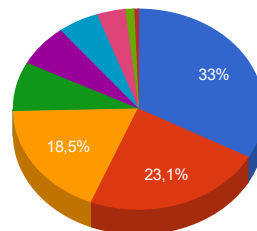
Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (outubro / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA	0,26%	5,78%	0,78%	2,45%	7,87%	18,59%	-	-	-
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	-	-	-	-	-	-	1,00%	0,028%	9,16%
S&P 500	-1,94%	4,02%	-2,18%	2,95%	2,25%	5,36%	-	-	-
CDI + 3,50% ao ano	1,53%	11,75%	4,46%	8,90%	18,13%	37,38%	-	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	-0,80%	13,89%	1,10%	9,92%	15,81%	33,97%	1,00%	3,012%	14,02%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-0,21%	-5,95%	-0,68%	-2,72%	-2,06%	-6,05%	0,39%	0,186%	11,08%
CDI	1,21%	9,21%	3,52%	7,00%	14,13%	28,23%	-	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,21%	9,21%	3,51%	7,02%	14,14%	28,35%	0,20%	0,008%	0,06%
SANTANDER MASTER FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,14%	8,64%	3,34%	6,59%	13,25%	26,43%	1,00%	0,003%	0,02%
INCENTIVO I FIDC MULTISSETORIAL	-93,24%	-93,21%	-93,09%	-93,16%	-93,30%	-95,99%	0,18%	-	-
Não Possui	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,50%	0,019%	41,55%

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

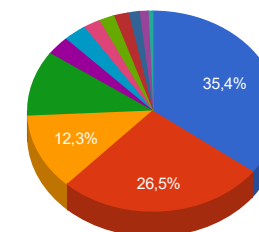
Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	111.290.319,76	33,02%
BANCO BRADESCO	77.694.696,10	23,05%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	62.321.188,92	18,49%
Western Asset	26.746.033,54	7,94%
BANCO SANTANDER	22.808.565,15	6,77%
GERAÇÃO FUTURO	17.806.852,15	5,28%
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS	12.370.517,00	3,67%
PÁTRIA INVESTIMENTOS	3.871.416,08	1,15%
Itaú Unibanco	2.106.901,24	0,63%

- BB GESTÃO DE RECURSO...
- BANCO BRADESCO
- CAIXA ECONÔMIC...
- Western Asset
- BANCO SANTANDER
- GERAÇÃO FUTURO
- BTG PACTUAL...
- PÁTRIA INVESTIM...
- Itaú Unibanco



Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	118.497.855,38	35,16%
IMA-B 5	88.979.447,51	26,40%
IDKA IPCA 2A	41.071.350,27	12,19%
IRF-M 1	35.261.144,30	10,46%
AÇÕES - SETORIAIS	10.261.480,21	3,04%
MULTIMERCADO	9.974.164,48	2,96%
AÇÕES - INDEXADO	7.444.828,31	2,21%
FUNDO IMOBILIÁRIO	6.623.331,51	1,97%
CRÉDITO PRIVADO	6.422.989,72	1,91%
FIP	4.690.511,01	1,39%
CDI	3.811.082,00	1,13%
GESTÃO DURATION	2.106.901,24	0,63%

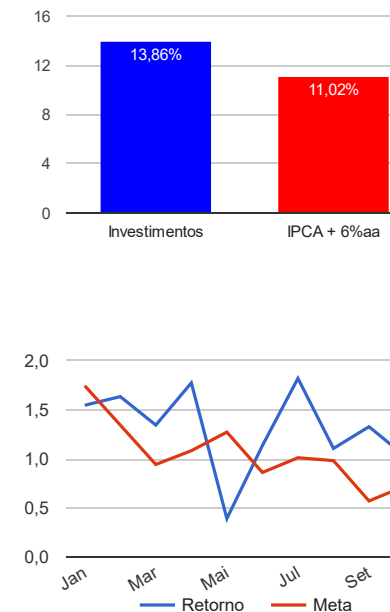
- IMA-B
- IMA-B 5
- IDKA IPCA 2A
- IRF-M 1
- AÇÕES - SETORIAIS
- MULTIMER...
- AÇÕES - INDEXADO
- FUNDO IMOBILIÁRIO
- CRÉDITO PRIVADO
- FIP
- CDI
- GESTÃO DURATION



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	308.051.335,34	6.737.337,95	5.182.608,69	314.380.496,84	4.774.432,24	1,54%	1,74%	88,66%	2,27%
Fevereiro	314.380.496,84	18.082.507,36	19.015.521,99	318.569.760,65	5.122.278,44	1,63%	1,34%	121,21%	2,16%
Março	318.569.760,65	74.303.565,24	75.371.269,37	321.768.125,22	4.266.068,70	1,34%	0,94%	142,13%	2,36%
Abril	321.768.125,22	7.534.703,96	8.379.525,53	326.622.539,80	5.699.236,15	1,77%	1,08%	164,56%	1,75%
Mai	326.622.539,80	5.461.192,96	6.763.556,47	326.600.595,78	1.280.419,49	0,39%	1,27%	30,85%	1,67%
Junho	326.600.595,78	12.976.057,50	17.141.219,13	326.134.537,68	3.699.103,53	1,13%	0,86%	131,43%	1,65%
Julho	326.134.537,68	27.311.591,63	28.839.384,43	330.529.053,26	5.922.308,38	1,82%	1,01%	179,92%	1,14%
Agosto	330.529.053,26	45.166.951,12	46.749.718,52	332.589.494,36	3.643.208,50	1,10%	0,98%	112,98%	1,20%
Setembro	332.589.494,36	21.627.089,97	23.408.740,09	335.213.274,83	4.405.430,59	1,32%	0,57%	233,55%	1,56%
Outubro	335.213.274,83	43.531.414,39	45.171.845,74	337.016.489,94	3.443.646,46	1,03%	0,72%	141,75%	1,45%
Acumulado no ano					42.256.132,48	13,86%	11,02%	125,84%	

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(%)
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.086.067,30	0,00	0,00	2.106.901,24	20.833,94	1,00%	1,50%	1,00%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	36.545.369,67	6.975.000,00	8.595.000,00	35.261.144,30	335.774,63	0,77%	0,18%	0,94%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIX...	21.259.073,27	0,00	0,00	21.392.411,69	133.338,42	0,63%	2,28%	0,63%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.050.661,63	0,00	0,00	6.088.374,68	37.713,05	0,62%	2,28%	0,62%
BTG PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA	12.296.902,00	0,00	0,00	12.370.517,00	73.615,00	0,60%	0,17%	0,60%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.246.799,07	0,00	0,00	13.322.372,91	75.573,84	0,57%	1,52%	0,57%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	6.388.527,82	0,00	0,00	6.422.989,72	34.461,90	0,54%	1,15%	0,54%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	14.685.062,51	2.000.000,00	0,00	16.771.869,06	86.806,55	0,52%	1,30%	0,59%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	58.155.764,40	0,00	0,00	58.420.907,99	265.143,59	0,46%	0,74%	0,46%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	1.409.963,40	0,00	0,00	1.416.153,46	6.190,06	0,44%	0,74%	0,44%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	40.900.873,78	0,00	0,00	41.071.350,27	170.476,49	0,42%	0,67%	0,42%
BRADESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	11.534.291,23	0,00	0,00	11.578.733,33	44.442,10	0,39%	0,74%	0,39%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	35.604.960,06	30.276.320,78	0,00	66.115.962,77	234.681,93	0,36%	2,35%	0,70%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	30.261.825,35	0,00	30.276.320,78	0,00	14.495,43	0,05%	0,18%	0,96%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	4.231.082,00	420.216,78	3.811.082,00	216,78	0,01%	0,01%	1,07%
Total Renda Fixa					1.533.763,71	0,52%	1,21%	

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(%)
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	6.620.531,40	0,00	0,00	7.444.828,31	824.296,91	12,45%	5,99%	12,45%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	8.194.503,27	0,00	0,00	9.051.698,21	857.194,94	10,46%	5,55%	10,46%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.135.522,00	0,00	0,00	1.209.782,00	74.260,00	6,54%	3,49%	6,54%
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	1.286.671,92	0,00	10.042,18	1.310.325,63	33.695,89	2,62%	-	10,80%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	4.364.783,14	0,00	0,00	4.470.427,64	105.644,50	2,42%	0,74%	2,42%
CAIXA BRASIL IPCA III FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	3.788.182,00	0,00	3.812.766,00	0,00	24.584,00	0,65%	0,12%	0,65%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	5.337.597,27	0,00	57.500,00	5.313.005,88	32.908,61	0,62%	-	-
CAIXA BRASIL IPCA VIII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.862.626,00	0,00	0,00	1.871.404,00	8.778,00	0,47%	0,18%	0,47%
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	3.822.834,96	49.011,61	0,00	3.871.416,08	-430,49	-0,01%	0,03%	0,03%
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA FIP	820.164,36	0,00	0,00	819.094,93	-1.069,43	-0,13%	0,02%	-0,13%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	7.553.717,02	0,00	2.000.000,00	5.503.736,84	-49.980,18	-0,66%	3,01%	-0,80%
Total Renda Variável					1.909.882,75	4,26%	3,49%	

