

# 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)

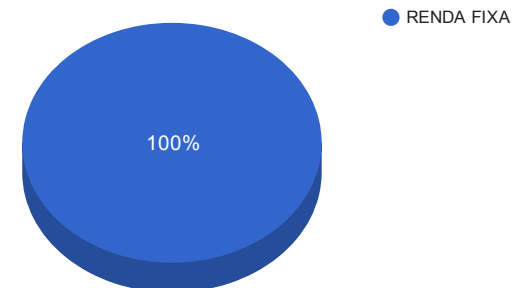
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.227.647,37	20,65%	754	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	827.710,56	13,92%	1.171	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.725.201,41	29,02%	89	0,19%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	1.579.132,95	26,56%	327	0,07%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	148.621,30	2,50%	587	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	437.289,07	7,35%	801	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
		<b>TOTAL -</b>	<b>5.945.602,66</b>				

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

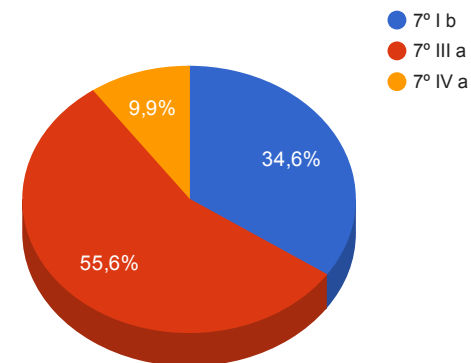
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	90,00%	2.055.357,93	34,57%	3.295.684,46
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	40,00%	3.304.334,36	55,58%	-926.093,30
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	585.910,37	9,85%	1.197.770,43
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	80,00%	10,00%	0,00	0,00%	594.560,27
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	30,00%	10,00%	0,00	0,00%	594.560,27
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	10,00%	0,00	0,00%	594.560,27
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	297.280,13
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>195,00</b>	<b>5.945.602,66</b>	<b>100,00%</b>	

Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	5,00%	0,00	0,00%	297.280,13
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	10,00%	0,00	0,00%	594.560,27
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	297.280,13
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>20,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução

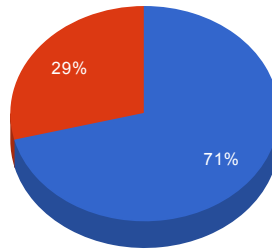


## Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (setembro / 2016)

	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%	-	-	-
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%
IMA-B 5	1,41%	12,92%	3,76%	7,19%	18,83%	33,03%	-	-	-
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%	-	-	-
BRADESCO 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%
CDI	1,11%	10,42%	3,47%	6,94%	14,13%	28,50%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,11%	10,26%	3,54%	6,88%	14,00%	28,66%	0,20%	0,027%	0,17%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,04%	9,76%	3,29%	6,59%	13,23%	26,53%	1,00%	0,016%	0,08%

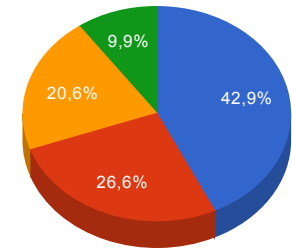
Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	4.220.401,25	70,98%
BANCO BRADESCO	1.725.201,41	29,02%

- BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM
- BANCO BRADESCO

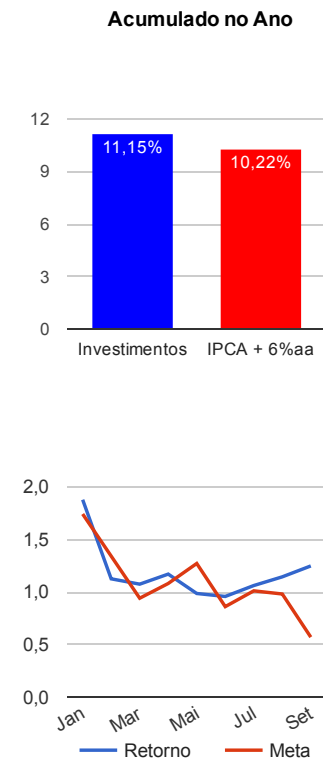


Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	2.552.911,97	42,94%
IMA-B 5	1.579.132,95	26,56%
IDKA IPCA 2A	1.227.647,37	20,65%
CDI	585.910,37	9,85%

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



Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	4.425.924,26	0,00	45.513,08	4.463.437,93	83.026,75	1,88%	1,74%	107,85%	0,64%
Fevereiro	4.463.437,93	363.068,39	49.656,31	4.830.555,72	53.705,71	1,12%	1,34%	83,64%	0,44%
Março	4.830.555,72	148.686,72	61.679,25	4.970.354,87	52.791,68	1,07%	0,94%	113,94%	0,51%
Abril	4.970.354,87	232.471,84	30.036,57	5.233.261,86	60.471,72	1,17%	1,08%	108,61%	0,39%
Mai	5.233.261,86	120.757,04	41.928,48	5.364.411,92	52.321,50	0,98%	1,27%	77,52%	0,34%
Junho	5.364.411,92	579.378,56	403.801,94	5.592.987,75	52.999,21	0,96%	0,86%	111,01%	0,39%
Julho	5.592.987,75	242.362,98	82.297,67	5.814.059,10	61.006,04	1,06%	1,01%	105,07%	0,25%
Agosto	5.814.059,10	4.565.661,68	4.599.501,04	5.846.679,61	66.459,87	1,14%	0,98%	117,17%	0,40%
Setembro	5.846.679,61	1.192.952,25	1.167.241,74	5.945.602,66	73.212,54	1,25%	0,57%	219,83%	0,35%
Acumulado no ano					555.995,02	11,15%	10,22%	109,10%	



Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.557.443,09	0,00	0,00	1.579.132,95	21.689,86	1,39%	0,77%	1,39%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.211.314,15	0,00	0,00	1.227.647,37	16.333,22	1,35%	0,56%	1,35%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	432.468,72	0,00	0,00	437.289,07	4.820,35	1,11%	0,03%	1,11%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.066.913,87	0,00	250.000,00	827.710,56	10.796,69	1,01%	0,08%	1,16%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1.208.738,53	500.000,00	0,00	1.725.201,41	16.462,88	0,96%	0,07%	1,17%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	369.801,25	692.952,25	917.241,74	148.621,30	3.109,54	0,29%	0,02%	1,04%
Total Renda Fixa					73.212,54	1,25%	0,35%	

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.515.441,00	0,00	2.750.000,00	827.710,56	62.269,56	2,49%	3,39%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	732.831,10	800.000,00	0,00	1.579.132,95	46.301,85	3,65%	3,73%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	689.512,15	500.000,00	0,00	1.227.647,37	38.135,22	3,66%	3,73%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,00	1.700.000,00	0,00	1.725.201,41	25.201,41	1,70%	3,40%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	422.338,81	0,00	0,00	437.289,07	14.950,26	3,54%	3,54%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	232.864,69	3.000.976,91	3.099.040,45	148.621,30	13.820,15	1,45%	3,29%
Total Renda Fixa					200.678,45	3,49%	