

Relatório Analítico dos Investimentos em novembro de 2016



Carteira consolidada de investimentos - base (novembro / 2016)

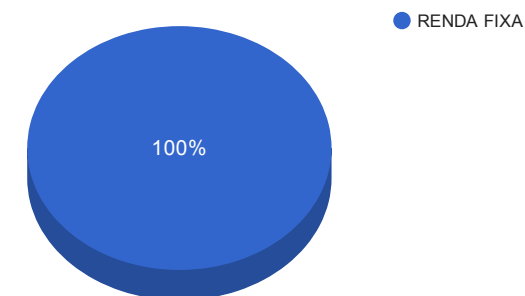
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	5.913.345,78	5,71%	368	0,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.855.820,97	4,69%	729	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	14.588.482,35	14,09%	617	0,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	8.784.578,65	8,49%	738	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	1.645.152,72	1,59%	193	0,48%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	4.432.884,99	4,28%	1.346	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.227.968,92	6,02%	628	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.684.169,27	5,49%	86	0,62%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	13.161.613,92	12,71%	89	1,06%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	3.455.858,58	3,34%	321	0,17%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	3.956.616,58	3,82%	250	0,35%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	12.124.068,16	11,71%	337	0,52%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	844.581,42	0,82%	402	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2030	5.094.836,88	4,92%	34	2,64%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	8.836.703,24	8,54%	116	1,81%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.912.133,60	3,78%	796	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.473,26	0,00%	589	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TOTAL -			103.520.289,29				

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

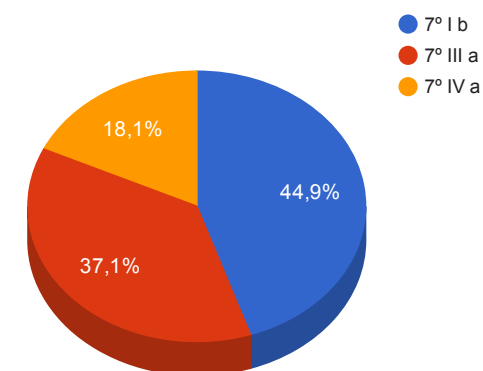
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	50,00%	46.448.234,38	44,87%	5.311.910,27
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	40,00%	38.382.326,51	37,08%	3.025.789,21
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	18.689.728,40	18,05%	12.366.358,39
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	5.176.014,46
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	5.176.014,46
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	5.176.014,46
Total Renda Fixa	100,00%	135,00	103.520.289,29	100,00%	

Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	5.176.014,46
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	10,00%	0,00	0,00%	10.352.028,93
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	3,00%	0,00	0,00%	3.105.608,68
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	3,00%	0,00	0,00%	3.105.608,68
Total Renda Variável	30,00%	21,00	0,00	0,00%	

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M 1	1,05%	13,36%	3,22%	6,67%	14,70%	29,27%	-	-	-
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1,03%	13,24%	3,19%	6,57%	14,55%	28,84%	0,20%	0,121%	0,35%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,03%	13,24%	3,17%	6,58%	14,56%	28,82%	0,20%	0,124%	0,35%
Selic	1,04%	12,75%	3,23%	6,87%	14,06%	28,94%	-	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,12%	12,99%	3,43%	7,13%	14,31%	29,33%	0,20%	0,042%	0,05%
CDI	1,04%	12,73%	3,23%	6,86%	14,04%	28,88%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,05%	12,60%	3,27%	6,87%	13,93%	29,05%	0,20%	0,017%	0,17%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,98%	11,93%	3,04%	6,56%	13,15%	26,92%	1,00%	0,008%	0,08%
IPCA + 6,00% ao ano	0,64%	11,73%	1,95%	4,88%	13,38%	32,71%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,76%	6,09%	2,20%	2,39%	7,85%	19,04%	0,20%	0,053%	4,06%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,73%	12,25%	2,15%	5,33%	14,09%	33,23%	0,20%	0,054%	0,36%
IDKA IPCA 2 Anos	0,57%	13,75%	2,50%	5,74%	15,91%	32,27%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,68%	12,00%	2,44%	5,64%	13,94%	-	0,20%	0,992%	1,14%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,57%	13,55%	2,35%	5,66%	15,78%	31,23%	0,20%	1,272%	2,38%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,54%	13,48%	2,32%	5,58%	15,72%	30,90%	0,20%	1,297%	2,46%
IMA-B 5	0,40%	13,89%	2,28%	5,63%	16,31%	31,55%	-	-	-
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	0,39%	13,69%	2,23%	5,53%	16,08%	31,05%	0,10%	1,642%	2,53%

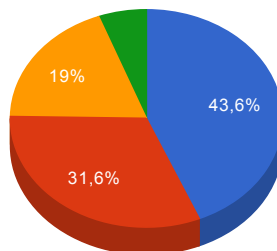
Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (novembro / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,38%	13,73%	2,23%	5,54%	16,09%	30,66%	0,20%	1,633%	2,54%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,38%	13,63%	2,25%	5,53%	15,95%	30,58%	0,20%	1,646%	2,53%
IMA-B	-1,22%	21,28%	0,97%	6,44%	23,13%	29,54%	-	-	-
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	-1,15%	20,75%	1,18%	6,59%	22,21%	28,86%	0,20%	4,608%	6,56%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,21%	20,97%	1,06%	6,49%	22,78%	28,89%	0,30%	4,759%	6,98%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,26%	21,02%	0,91%	6,35%	22,81%	28,78%	0,20%	4,787%	7,06%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	-1,27%	21,01%	1,09%	6,58%	22,74%	28,95%	0,20%	4,895%	7,19%

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

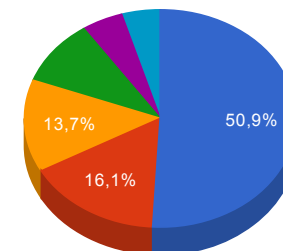
Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	45.180.998,98	43,64%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	32.735.579,92	31,62%
BANCO BRADESCO	19.690.364,61	19,02%
BANCO SANTANDER	5.913.345,78	5,71%

- BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM
- CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
- BANCO BRADESCO
- BANCO SANTANDER



Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	52.667.484,25	50,88%
IDKA IPCA 2A	16.657.700,29	16,09%
IMA-B 5	14.225.025,33	13,74%
IRF-M 1	10.117.054,26	9,77%
IMA-B 5+	5.094.836,88	4,92%
CDI	4.758.188,28	4,60%

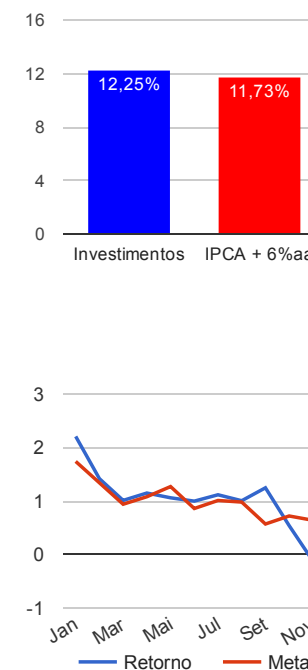
- IMA-B
- IDKA IPCA 2A
- IMA-B 5
- IRF-M 1
- IMA-B 5+
- CDI



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	85.161.209,79	35.511,76	592.117,36	86.484.870,74	1.880.266,55	2,21%	1,74%	126,93%	1,02%
Fevereiro	86.484.870,74	3.639.002,55	3.229.408,41	88.126.166,16	1.231.701,28	1,42%	1,34%	105,45%	1,15%
Março	88.126.166,16	25.268.944,51	24.472.426,08	89.822.194,38	899.509,79	1,01%	0,94%	107,36%	0,64%
Abril	89.822.194,38	3.782.263,41	3.162.842,39	91.480.951,13	1.039.335,73	1,15%	1,08%	106,77%	0,44%
Mai	91.480.951,13	1.274.893,56	621.498,16	93.111.075,95	976.729,42	1,06%	1,27%	83,44%	0,52%
Junho	93.111.075,95	13.863.022,19	13.399.547,46	94.508.064,35	933.513,67	1,00%	0,86%	115,76%	0,56%
Julho	94.508.064,35	5.187.015,41	3.093.889,43	97.679.999,84	1.078.809,51	1,12%	1,01%	110,65%	0,41%
Agosto	97.679.999,84	11.573.710,79	10.796.429,41	99.447.259,71	989.978,49	1,01%	0,98%	103,07%	0,86%
Setembro	99.447.259,71	10.040,56	529.201,64	100.168.230,39	1.240.131,76	1,25%	0,57%	219,88%	0,68%
Outubro	100.168.230,39	23.977.302,55	23.183.091,56	101.507.679,23	545.237,85	0,54%	0,72%	74,52%	1,13%
Novembro	101.507.679,23	6.745.873,98	4.608.142,13	103.520.289,29	-125.121,79	-0,12%	0,64%	-18,74%	2,47%
Acumulado no ano					10.690.092,26	12,25%	11,73%	104,41%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.871.531,53	0,00	0,00	3.912.133,60	40.602,07	1,05%	0,02%	1,05%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	5.626.315,94	0,00	0,00	5.684.169,27	57.853,33	1,03%	0,12%	1,03%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.387.899,76	0,00	0,00	4.432.884,99	44.985,23	1,03%	0,12%	1,03%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.458,97	0,00	0,00	1.473,26	14,29	0,98%	0,01%	0,98%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.482.114,01	144.841,75	797.180,69	844.581,42	14.806,35	0,91%	0,04%	1,12%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.056.511,27	0,00	0,00	5.094.836,88	38.325,61	0,76%	0,05%	0,76%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.772.316,03	0,00	0,00	8.836.703,24	64.387,21	0,73%	0,05%	0,73%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.634.024,20	0,00	0,00	1.645.152,72	11.128,52	0,68%	0,99%	0,68%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.192.622,40	0,00	0,00	6.227.968,92	35.346,52	0,57%	1,27%	0,57%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.737.811,44	0,00	0,00	8.784.578,65	46.767,21	0,54%	1,30%	0,54%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.442.656,90	0,00	0,00	3.455.858,58	13.201,68	0,38%	1,63%	0,38%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.837.553,45	0,00	0,00	4.855.820,97	18.267,52	0,38%	1,65%	0,38%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	4.591.343,57	1.304.101,69	0,00	5.913.345,78	17.900,52	0,30%	1,64%	0,39%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	8.449.102,60	3.810.961,44	0,00	12.124.068,16	-135.995,88	-1,11%	4,61%	-1,15%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.005.007,17	0,00	0,00	3.956.616,58	-48.390,59	-1,21%	4,76%	-1,21%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.287.400,52	1.485.969,10	0,00	14.588.482,35	-184.887,27	-1,25%	4,79%	-1,26%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	13.330.420,93	0,00	0,00	13.161.613,92	-168.807,01	-1,27%	4,90%	-1,27%
Total Renda Fixa					-134.494,69	-0,13%	2,47%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IPCA VI FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	3.801.588,54	0,00	3.810.961,44	0,00	9.372,90	0,25%	-	-
				Total Renda Variável	9.372,90	0,25%	0,00%	