

Relatório Analítico dos Investimentos em novembro de 2016



Carteira consolidada de investimentos - base (novembro / 2016)

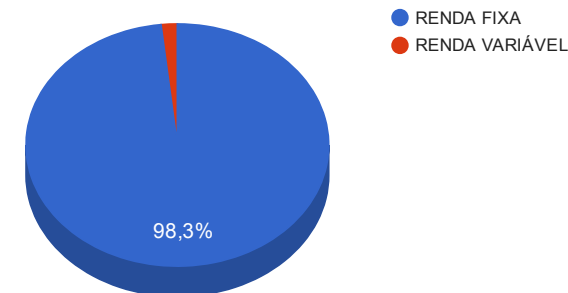
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
TÍTULOS PÚBLICOS			4.150.027,77	10,85%			Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.108.980,83	2,90%	32	1,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	128.527,77	0,34%	193	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.278.815,46	11,19%	729	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	4.103.361,97	10,73%	1.175	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	854.483,23	2,23%	617	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.038.073,15	21,02%	736	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	148.513,94	0,39%	205	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	4.095.001,66	10,71%	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	3.713.690,74	9,71%	628	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	101.930,78	0,27%	53	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRDESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	136.343,40	0,36%	86	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	D+3	Não há	2.469.583,16	6,46%	367	1,30%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	2.766.577,75	7,24%	402	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.480.851,66	3,87%	755	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER PETROBRÁS PLUS FIC AÇÕES	D+4	Não há	661.203,67	1,73%	1.905	1,50%	Artigo 8º, Inciso III
		TOTAL -	38.235.966,94				

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

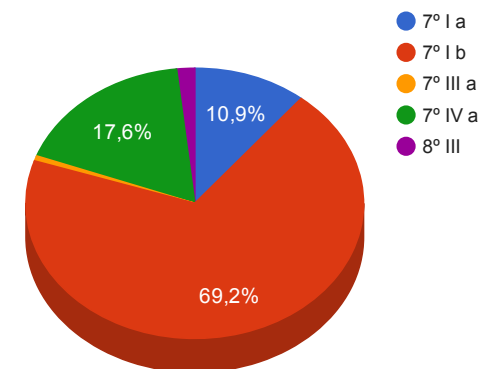
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	15,00%	4.150.027,77	10,85%	1.585.367,27
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	85,00%	26.469.448,75	69,23%	6.031.123,15
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	40,00%	238.274,18	0,62%	15.056.112,60
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	6.717.012,57	17,57%	4.753.777,51
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.911.798,35
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.911.798,35
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.911.798,35
Total Renda Fixa	100,00%	185,00	37.574.763,27	98,27%	

Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	5,00%	661.203,67	1,73%	1.250.594,68
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.911.798,35
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.911.798,35
Total Renda Variável	30,00%	15,00	661.203,67	1,73%	

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



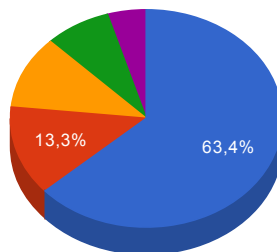
Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (novembro / 2016)

Dados atualizados dos Benchmark's dos Fundos, referente à base (novembro / 2016) ainda não disponíveis.

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

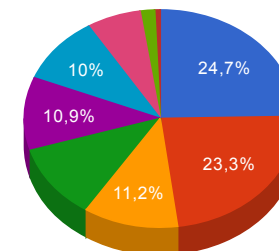
Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	24.224.529,77	63,36%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	5.086.372,97	13,30%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	4.150.027,77	10,85%
BANCO BRADESCO	3.004.851,93	7,86%
BANCO SANTANDER	1.770.184,50	4,63%

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



Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	9.443.687,86	24,70%
IMA-B	8.892.556,38	23,26%
IMA-B 5	4.278.815,46	11,19%
CDI	4.247.429,41	11,11%
TÍTULOS PÚBLICOS	4.150.027,77	10,85%
IDKA IPCA 2A	3.842.218,51	10,05%
GESTÃO LIVRE	2.469.583,16	6,46%
AÇÕES - SETORIAIS	661.203,67	1,73%
IMA-GERAL	250.444,72	0,65%

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



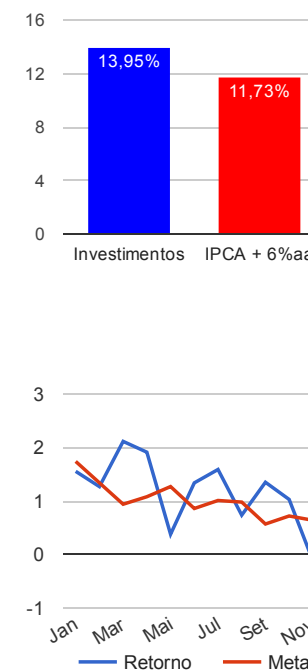
Carteira de Títulos Públicos - base (novembro / 2016)

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	2.989,238844	743.672,41	1.494.619,42	750.947,01
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	02/12/2004	270	1.494,58526	2.989,238844	403.538,02	807.094,49	403.556,47
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	02/03/2009	630	1.104,73659	2.933,831526	695.984,05	1.848.313,86	1.152.329,81

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%
Outubro	38.301.432,38	237.603,45	430.000,00	38.503.414,08	394.378,25	1,03%	0,72%	142,08%	1,18%
Novembro	38.503.414,08	1.575.105,95	1.797.562,00	38.235.966,94	-44.991,09	-0,12%	0,64%	-18,13%	2,37%
Acumulado no ano					4.612.569,27	13,95%	11,73%	118,91%	

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(%)
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.735.872,12	0,00	0,00	2.766.577,75	30.705,63	1,12%	0,04%	1,12%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.465.471,63	0,00	0,00	1.480.851,66	15.380,03	1,05%	0,03%	1,05%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1.095.433,86	2.172,24	0,00	1.108.980,83	11.374,73	1,04%	0,13%	1,04%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	134.955,70	0,00	0,00	136.343,40	1.387,70	1,03%	0,12%	1,03%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.061.972,72	0,00	0,00	4.103.361,97	41.389,25	1,02%	0,12%	1,02%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.947.076,35	1.572.933,71	460.000,00	4.095.001,66	34.991,60	0,77%	0,12%	1,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	127.658,35	0,00	0,00	128.527,77	869,42	0,68%	0,99%	0,68%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.692.613,88	0,00	0,00	3.713.690,74	21.076,86	0,57%	1,27%	0,57%
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	2.456.989,79	0,00	0,00	2.469.583,16	12.593,37	0,51%	1,38%	0,51%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.262.718,63	0,00	0,00	4.278.815,46	16.096,83	0,38%	1,65%	0,38%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	148.455,55	0,00	0,00	148.513,94	58,39	0,04%	2,44%	0,04%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	102.041,17	0,00	0,00	101.930,78	-110,39	-0,11%	2,67%	-0,11%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.132.854,59	0,00	0,00	8.038.073,15	-94.781,44	-1,17%	4,74%	-1,17%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	865.360,07	0,00	0,00	854.483,23	-10.876,84	-1,26%	4,79%	-1,26%
TÍTULOS PÚBLICOS	4.272.627,63	0,00	0,00	4.150.027,77	-122.599,86	-2,87%	-	-
Total Renda Fixa					-42.444,72	-0,11%	1,78%	

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 VII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	375.445,00	0,00	378.336,00	0,00	2.891,00	0,77%	-	-
CAIXA BRASIL IPCA V FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	956.868,00	0,00	959.226,00	0,00	2.358,00	0,25%	-	-
SANTANDER PETROBRÁS PLUS FIC AÇÕES	668.999,04	0,00	0,00	661.203,67	-7.795,37	-1,17%	31,97%	-1,17%
Total Renda Variável					-2.546,37	-0,13%	31,97%	