

Relatório Analítico dos Investimentos em novembro de 2016



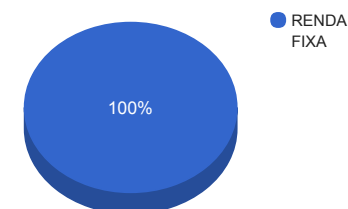
Carteira consolidada de investimentos - base (novembro / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.249.937,77	6,31%	1.175	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.400.007,83	7,06%	32	1,53%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.091.730,31	10,55%	738	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2030	2.650.962,00	13,37%	18	5,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.474.761,12	7,44%	729	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.896.373,58	9,57%	368	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.750.829,43	29,01%	1.346	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	1.916.100,94	9,67%	143	0,19%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.100.615,51	5,55%	4.057	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	293.130,64	1,48%	796	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
		TOTAL -	19.824.449,13				

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

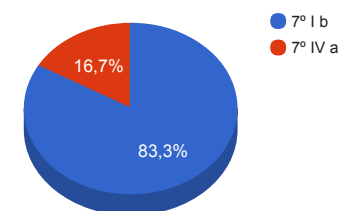
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	90,00%	16.514.602,04	83,30%	1.327.402,18
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	20,00%	0,00	0,00%	3.964.889,83
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	3.309.847,09	16,70%	2.637.487,65
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	991.222,46
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	991.222,46
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	991.222,46
Total Renda Fixa	100,00%	155,00	19.824.449,13	100,00%	

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	5,00%	0,00	0,00%	991.222,46
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	10,00%	0,00	0,00%	1.982.444,91
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	991.222,46
Total Renda Variável	30,00%	20,00	0,00	0,00%	

Distribuição por Artigo / Resolução

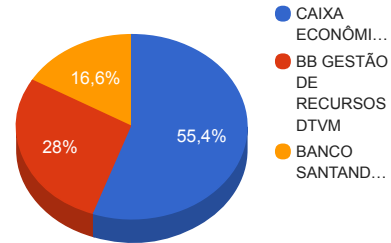


Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (novembro / 2016)

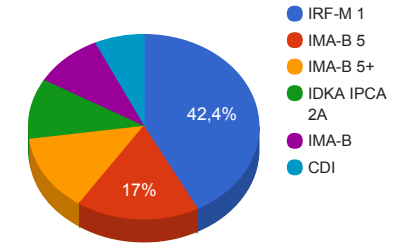
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M 1	1,05%	13,36%	3,22%	6,67%	14,70%	29,27%	-	-	-
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1,04%	13,01%	3,11%	6,58%	14,30%	28,33%	0,40%	0,134%	0,38%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,03%	13,24%	3,17%	6,58%	14,56%	28,82%	0,20%	0,124%	0,35%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,02%	13,16%	3,15%	6,52%	14,47%	28,52%	0,10%	0,124%	0,35%
CDI	1,04%	12,73%	3,23%	6,86%	14,04%	28,88%	-	-	-
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,06%	12,80%	3,26%	6,90%	14,11%	29,19%	0,25%	0,038%	0,05%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,05%	12,60%	3,27%	6,87%	13,93%	29,05%	0,20%	0,017%	0,17%
IPCA + 6,00% ao ano	0,64%	11,73%	1,95%	4,88%	13,38%	32,71%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,76%	12,60%	2,23%	5,50%	14,49%	33,94%	0,20%	0,069%	0,37%
IDKA IPCA 2 Anos	0,57%	13,75%	2,50%	5,74%	15,91%	32,27%	-	-	-
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%
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 BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,70%	18,95%	-0,21%	3,85%	20,29%	15,45%	0,20%	5,782%	10,18%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	10.977.168,06	55,37%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	5.550.899,66	28,00%
BANCO SANTANDER	3.296.381,41	16,63%



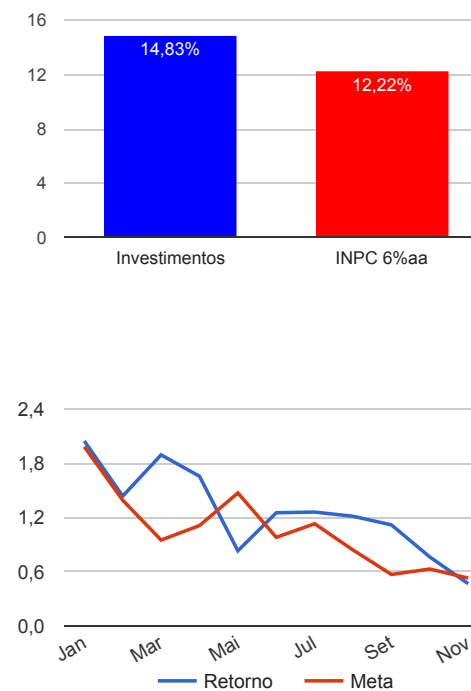
Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	8.400.775,03	42,38%
IMA-B 5	3.371.134,70	17,00%
IMA-B 5+	2.650.962,00	13,37%
IDKA IPCA 2A	2.091.730,31	10,55%
IMA-B	1.916.100,94	9,67%
CDI	1.393.746,15	7,03%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	17.336.482,72	0,00	0,00	17.690.837,97	354.355,25	2,04%	1,98%	103,20%	1,07%
Fevereiro	17.690.837,97	125.890,52	125.890,52	17.944.753,54	253.915,57	1,44%	1,39%	102,93%	1,33%
Março	17.944.753,54	0,00	0,00	18.284.026,30	339.272,76	1,89%	0,95%	198,55%	1,86%
Abril	18.284.026,30	0,00	0,00	18.586.586,58	302.560,28	1,65%	1,11%	149,55%	1,15%
Mai	18.586.586,58	0,00	47.000,00	18.694.112,92	154.526,34	0,83%	1,47%	56,50%	1,27%
Junho	18.694.112,92	40.000,00	10.000,00	18.958.446,66	234.333,74	1,25%	0,98%	127,39%	0,75%
Julho	18.958.446,66	0,00	0,00	19.197.190,89	238.744,23	1,26%	1,13%	111,46%	0,60%
Agosto	19.197.190,89	126.446,50	126.446,50	19.429.987,47	232.796,58	1,21%	0,84%	143,53%	0,91%
Setembro	19.429.987,47	0,00	0,00	19.647.130,62	217.143,15	1,12%	0,57%	197,05%	0,61%
Outubro	19.647.130,62	0,00	65.000,00	19.732.054,19	149.923,57	0,76%	0,63%	120,30%	0,70%
Novembro	19.732.054,19	0,00	0,00	19.824.449,13	92.394,94	0,47%	0,53%	87,71%	1,25%
Acumulado no ano					2.569.966,41	14,83%	12,22%	121,39%	

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(%)
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.089.097,79	0,00	0,00	1.100.615,51	11.517,72	1,06%	0,04%	1,06%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	290.088,39	0,00	0,00	293.130,64	3.042,25	1,05%	0,02%	1,05%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1.385.641,70	0,00	0,00	1.400.007,83	14.366,13	1,04%	0,13%	1,04%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.692.469,60	0,00	0,00	5.750.829,43	58.359,83	1,03%	0,12%	1,03%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.237.330,07	0,00	0,00	1.249.937,77	12.607,70	1,02%	0,12%	1,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.901.722,35	0,00	0,00	1.916.100,94	14.378,59	0,76%	0,07%	0,76%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.080.594,38	0,00	0,00	2.091.730,31	11.135,93	0,54%	1,30%	0,54%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	1.889.008,80	0,00	0,00	1.896.373,58	7.364,78	0,39%	1,64%	0,39%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.469.213,11	0,00	0,00	1.474.761,12	5.548,01	0,38%	1,65%	0,38%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.696.888,00	0,00	0,00	2.650.962,00	-45.926,00	-1,70%	5,78%	-1,70%
Total Renda Fixa					92.394,94	0,47%	1,25%	