



# Relatório Analítico dos Investimentos em novembro de 2016

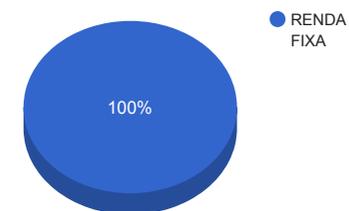
Carteira consolidada de investimentos - base (novembro / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.451.050,67	9,15%	193	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	6.270.989,66	39,53%	1.346	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	6.260.022,10	39,46%	72	0,31%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	1.063.684,49	6,71%	321	0,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	817.958,56	5,16%	128	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
<b>TOTAL -</b>			<b>15.863.705,48</b>				

Enquadramentos na Resolução 3.922 / 4.392 / 4.604 e Política de Investimentos - base (novembro / 2016)

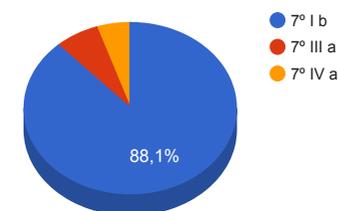
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	100,00%	13.982.062,43	88,14%	1.881.643,05
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	50,00%	1.063.684,49	6,71%	6.868.168,25
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	80,00%	10,00%	0,00	0,00%	1.586.370,55
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	817.958,56	5,16%	3.941.153,08
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	30,00%	10,00%	0,00	0,00%	1.586.370,55
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	793.185,27
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	793.185,27
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	793.185,27
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>215,00</b>	<b>15.863.705,48</b>	<b>100,00%</b>	

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	10,00%	0,00	0,00%	1.586.370,55
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	0,00	0,00%	2.379.555,82
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	793.185,27
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	793.185,27
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	793.185,27
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>40,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	

Distribuição por Artigo / Resolução

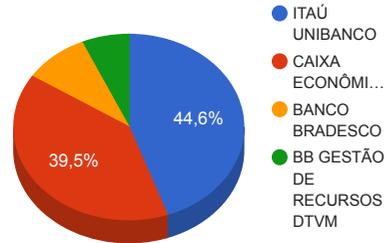


Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (novembro / 2016)

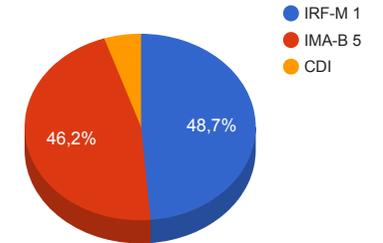
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M 1	1,05%	13,36%	3,22%	6,67%	14,70%	29,27%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,03%	13,24%	3,17%	6,58%	14,56%	28,82%	0,20%	0,124%	0,35%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,02%	13,20%	3,17%	6,55%	14,50%	28,73%	0,20%	0,124%	0,36%
CDI	1,04%	12,73%	3,23%	6,86%	14,04%	28,88%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	1,04%	12,80%	3,23%	6,92%	14,12%	29,13%	0,18%	0,007%	0,02%
IMA-B 5	0,40%	13,89%	2,28%	5,63%	16,31%	31,55%	-	-	-
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%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	0,37%	13,48%	2,18%	5,42%	15,84%	30,44%	0,40%	1,636%	2,53%

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

Administrador	Valor	%
ITAÚ UNIBANCO	7.077.980,66	44,62%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	6.270.989,66	39,53%
BANCO BRADESCO	1.451.050,67	9,15%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	1.063.684,49	6,71%



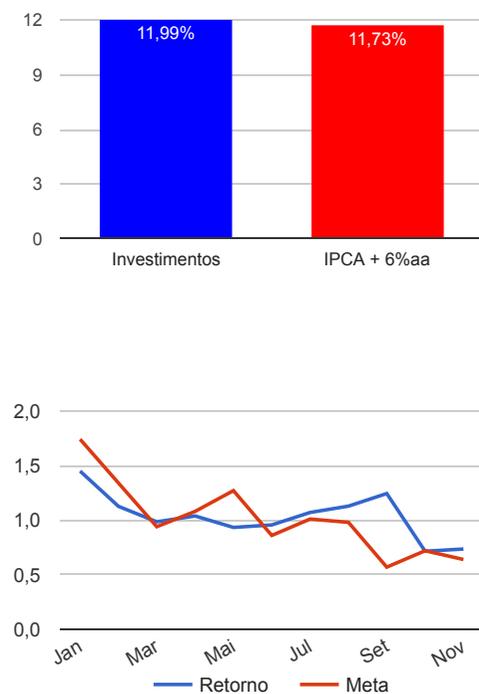
Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	7.722.040,33	48,68%
IMA-B 5	7.323.706,59	46,17%
CDI	817.958,56	5,16%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	19.237.530,89	5.181.529,56	11.007.634,31	13.690.099,82	278.673,68	1,45%	1,74%	83,28%	0,77%
Fevereiro	13.690.099,82	8.174.365,36	4.056.713,42	18.008.328,95	200.577,19	1,13%	1,34%	83,79%	0,48%
Março	18.008.328,95	6.834.484,65	6.640.468,81	18.381.610,68	179.265,89	0,98%	0,94%	104,53%	0,59%
Abril	18.381.610,68	4.327.821,34	5.729.948,94	17.170.285,09	190.802,01	1,04%	1,08%	96,44%	0,55%
Mai	17.170.285,09	3.173.708,12	1.607.552,96	18.911.331,67	174.891,42	0,93%	1,27%	73,47%	0,38%
Junho	18.911.331,67	4.236.600,16	3.332.820,22	20.004.552,52	189.440,91	0,96%	0,86%	110,94%	0,43%
Julho	20.004.552,52	3.170.545,63	4.525.311,07	18.863.868,17	214.081,09	1,07%	1,01%	106,03%	0,31%
Agosto	18.863.868,17	918.639,50	4.077.797,79	15.917.494,09	212.784,21	1,13%	0,98%	115,62%	0,37%
Setembro	15.917.494,09	1.691.767,73	2.526.417,52	15.280.758,20	197.913,90	1,24%	0,57%	219,23%	0,39%
Outubro	15.280.758,20	411.958,60	328.474,77	15.474.192,70	109.950,67	0,72%	0,72%	98,74%	0,43%
Novembro	15.474.192,70	833.072,33	559.423,30	15.863.705,48	115.863,75	0,74%	0,64%	114,18%	0,82%
Acumulado no ano					2.064.244,72	11,99%	11,73%	102,15%	

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 BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.207.351,20	0,00	0,00	6.270.989,66	63.638,46	1,03%	0,12%	1,03%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.436.366,71	0,00	0,00	1.451.050,67	14.683,96	1,02%	0,12%	1,02%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	662.652,52	705.000,06	559.423,30	817.958,56	9.729,28	0,71%	0,01%	1,04%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.059.621,12	0,00	0,00	1.063.684,49	4.063,37	0,38%	1,63%	0,38%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	6.108.201,15	128.072,27	0,00	6.260.022,10	23.748,68	0,38%	1,64%	0,37%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>115.863,75</b>	<b>0,74%</b>	<b>0,82%</b>	