

Relatório Analítico dos Investimentos em novembro 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 (novembro / 2016)

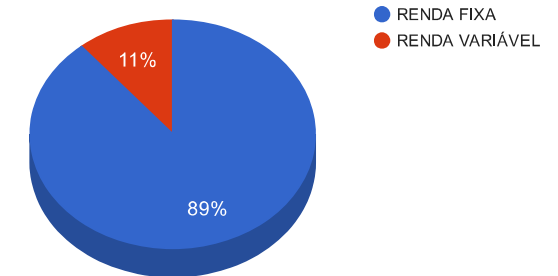
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	9.616.622,93	21,31%	1.346	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.033.674,33	4,51%	1.175	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	12.073.354,41	26,75%	738	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	1.027.952,69	2,28%	38	0,19%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	D+1	Não há	493.870,47	1,09%	12	0,16%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
TOWER BRIDGE II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	281.419,89	0,62%	33	0,25%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	153.812,24	0,34%	589	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.209.262,59	2,68%	9	0,22%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.914.522,49	15,32%	453	0,36%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.994.202,09	6,63%	796	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
GGR PRIME I FIDC	D+1601	29 dias	1.913.287,40	4,24%			Artigo 7º, Inciso VI
LEME IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	1.422.252,25	3,15%	71	1,01%	Artigo 7º, Inciso VI
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+91 ou D+1441	Não há	1.373.235,30	3,04%	14	0,74%	Artigo 8º, Inciso IV
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+1	Não há	308.695,35	0,68%	13	1,16%	Artigo 8º, Inciso IV
W7 MULTIELABRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	1.993.640,51	4,42%			Artigo 8º, Inciso V
ÁTICO RENDA FII - ATCR11	Não se aplica	Não se aplica	1.309.751,76	2,90%		9,52%	Artigo 8º, Inciso VI
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	14.066,72	0,03%	14.627	0,00%	Desenquadrado - RF
TOTAL -			45.133.623,42				

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

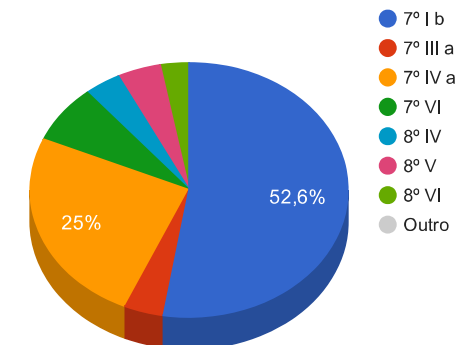
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	100,00%	23.723.651,67	52,56%	21.409.971,75
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	30,00%	1.803.243,05	4,00%	11.736.843,98
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	11.271.799,41	24,97%	2.268.287,62
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	15,00%	3.335.539,65	7,39%	3.434.503,86
Desenquadrado - RF	0,00%	0,00%	14.066,72	0,03%	-14.066,72
Total Renda Fixa	100,00%	175,00	40.148.300,50	88,95%	

Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	1.681.930,65	3,73%	574.750,52
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	1.993.640,51	4,42%	263.040,66
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	1.309.751,76	2,90%	946.929,41
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	0,00	0,00%	6.770.043,51
Total Renda Variável	30,00%	30,00	4.985.322,92	11,05%	

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%	-	-	-
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%
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	0,95%	12,90%	3,16%	6,78%	14,30%	29,15%	0,50%	0,529%	0,48%

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%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,02%	12,79%	3,19%	6,78%	14,06%	28,42%	0,20%	0,002%	0,10%
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,02%	12,50%	3,17%	6,74%	13,79%	28,36%	0,10%	0,001%	0,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,98%	11,93%	3,04%	6,56%	13,15%	26,92%	1,00%	0,008%	0,08%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,64%	7,73%	1,99%	4,21%	8,51%	16,69%	5,00%	0,000%	0,00%

IPCA + 7,00% ao ano	0,72%	12,69%	2,18%	5,38%	14,45%	35,21%	-	-	-
LEME IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1,58%	-62,00%	-29,63%	-29,16%	-62,21%	-55,87%	1,50%	-	-
GGR PRIME I FIDC	0,90%	13,06%	2,53%	6,08%	14,89%	32,26%	0,15%	-	-

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%	-	-	-
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,21%	7,39%	1,99%	6,27%	-0,89%	8,78%	0,70%	1,907%	12,74%

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
TOWER BRIDGE II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,97%	-	2,12%	-0,97%	-	-	0,70%	2,262%	-

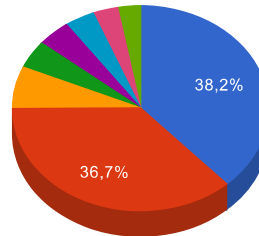
Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (novembro / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	1,04%	12,73%	3,23%	6,86%	14,04%	28,88%	-	-	-
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-35,89%	-28,38%	-34,87%	-32,79%	-27,34%	-46,90%	0,00%	61,292%	36,75%
IPCA	0,18%	5,97%	0,52%	1,84%	6,99%	18,20%	-	-	-
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1,09%	10,81%	5,09%	6,54%	12,71%	26,44%	1,50%	1,729%	5,57%
IFIX	-2,55%	30,38%	3,96%	13,96%	26,52%	34,97%	-	-	-
ÁTICO RENDA FII - ATCR11	0,00%	-	0,00%	0,00%	0,00%	-	1,20%	-	-
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
W7 MULTIELSTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,50%	-	-

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

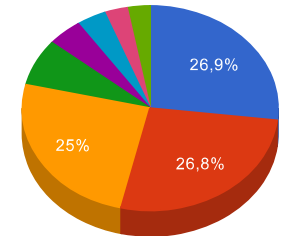
Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	17.255.043,07	38,23%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	16.545.212,14	36,66%
GRADUAL INVESTIMENTOS	2.991.682,41	6,63%
Planner Corretora	1.993.640,51	4,42%
CM Capital Markets DTVM	1.913.287,40	4,24%
Safra Asset Management	1.703.133,06	3,77%
Gradual Asset Management	1.422.252,25	3,15%
BRIDGE TRUST	1.309.372,58	2,90%

- BB GESTÃO DE RECUR...
- CAIXA ECONÔMIC...
- GRADUAL INVESTIME...
- Planner Corretora
- CM Capital Markets DT...
- Safra Asset Management
- Gradual Asset Management
- BRIDGE TR...



Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	12.144.167,73	26,91%
IDKA IPCA 2A	12.073.354,41	26,75%
CDI	11.285.866,13	25,01%
FIDC - ABERTO	3.335.539,65	7,39%
FIP	1.993.640,51	4,42%
MULTIMERCADO	1.681.930,65	3,73%
FUNDO IMOBILIÁRIO	1.309.751,76	2,90%
IMA-B 5	1.309.372,58	2,90%

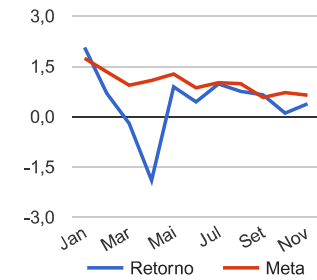
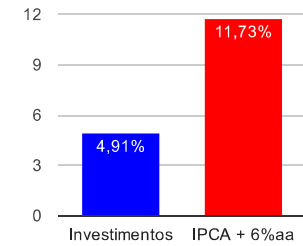
- IRF-M 1
- IDKA IPCA 2A
- CDI
- FIDC - ABERTO
- FIP
- MULTIMER...
- FUNDO IMOBILIÁRIO
- IMA-B 5



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	40.520.412,07	1.219.652,09	111.837,45	42.488.658,81	860.432,10	2,07%	1,74%	118,83%	3,31%
Fevereiro	42.488.658,81	4.637.101,41	4.222.136,82	43.201.114,16	297.490,76	0,69%	1,34%	51,58%	0,83%
Março	43.201.114,16	796.633,59	521.790,05	43.388.598,11	-87.359,59	-0,20%	0,94%	-21,33%	1,09%
Abril	43.388.598,11	250.187,92	11.634,29	42.795.881,92	-831.269,82	-1,91%	1,08%	-177,02%	0,58%
Mai	42.795.881,92	509.750,74	259.294,73	43.428.824,89	382.486,96	0,89%	1,27%	69,93%	0,60%
Junho	43.428.824,89	1.399.227,82	1.365.947,24	43.652.732,17	190.626,70	0,44%	0,86%	50,90%	1,05%
Julho	43.652.732,17	277.946,77	243.597,79	44.113.006,27	425.925,12	0,97%	1,01%	96,60%	0,34%
Agosto	44.113.006,27	182.510,86	9.099,48	44.618.558,34	332.140,69	0,75%	0,98%	76,88%	0,41%
Setembro	44.618.558,34	431.894,33	514.183,97	44.827.234,59	290.965,89	0,65%	0,57%	114,98%	0,24%
Outubro	44.827.234,59	587.789,97	536.009,19	44.926.955,27	47.939,90	0,11%	0,72%	14,74%	1,11%
Novembro	44.926.955,27	305.919,43	272.035,95	45.133.623,42	172.784,67	0,38%	0,64%	59,64%	1,07%
Acumulado no ano					2.082.163,38	4,91%	11,73%	41,84%	
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)

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(%)
LEME IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1.398.612,23	0,00	0,00	1.422.252,25	23.640,02	1,69%	-	-17,06%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.963.126,76	0,00	0,00	2.994.202,09	31.075,33	1,05%	0,02%	1,05%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.519.032,76	0,00	0,00	9.616.622,93	97.590,17	1,03%	0,12%	1,03%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.844.606,83	0,00	0,00	6.914.522,49	69.915,66	1,02%	0,00%	1,02%
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.197.057,10	0,00	0,00	1.209.262,59	12.205,49	1,02%	0,00%	1,02%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.013.161,34	0,00	0,00	2.033.674,33	20.512,99	1,02%	0,12%	1,02%
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	489.221,79	0,00	0,00	493.870,47	4.648,68	0,95%	0,53%	0,95%
GGR PRIME I FIDC	1.896.223,39	0,00	0,00	1.913.287,40	17.064,01	0,90%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12.009.078,46	0,00	0,00	12.073.354,41	64.275,95	0,54%	1,30%	0,54%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	121.291,64	182.904,66	151.944,66	153.812,24	1.560,60	0,51%	0,01%	0,98%
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.025.765,93	0,00	0,00	1.027.952,69	2.186,76	0,21%	1,91%	0,21%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	11.039,40	123.014,77	120.091,29	14.066,72	103,84	0,08%	0,00%	0,64%
TOWER BRIDGE II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	284.168,45	0,00	0,00	281.419,89	-2.748,56	-0,97%	2,26%	-0,97%
Total Renda Fixa					342.030,94	0,86%	0,54%	

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(%)
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.362.839,99	0,00	0,00	1.373.235,30	10.395,31	0,76%	1,73%	0,98%
ÁTICO RENDA FII - ATCR11	1.310.506,21	0,00	0,00	1.309.751,76	-754,45	-0,06%	-	0,00%
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	1.999.730,86	0,00	0,00	1.993.640,51	-6.090,35	-0,30%	-	-
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	481.492,13	0,00	0,00	308.695,35	-172.796,78	-35,89%	61,29%	-35,89%
Total Renda Variável					-169.246,27	-3,28%	12,66%	