

Relatório Analítico dos Investimentos em outubro de 2016



Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

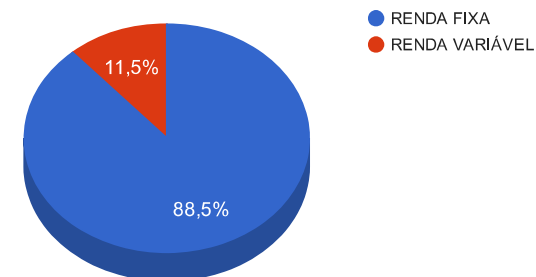
Carteira consolidada de investimentos - base (outubro / 2016)

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	2.013.161,34	4,48%	1.170	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	12.009.078,46	26,73%	754	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	9.519.032,76	21,19%	1.330	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
TOWER BRIDGE II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	284.168,45	0,63%	34	0,24%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	1.025.765,93	2,28%	39	0,20%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	D+1	Não há	489.221,79	1,09%	13	0,15%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.844.606,83	15,23%	454	0,35%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.963.126,76	6,60%	792	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.197.057,10	2,66%	9	0,27%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	121.291,64	0,27%	586	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
LEME IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	1.398.612,23	3,11%	71	0,82%	Artigo 7º, Inciso VI
GGR PRIME I FIDC	D+1601	29 dias	1.896.223,39	4,22%			Artigo 7º, Inciso VI
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+91 ou D+1441	Não há	1.362.839,99	3,03%	14	0,78%	Artigo 8º, Inciso IV
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+1	Não há	481.492,13	1,07%	13	1,16%	Artigo 8º, Inciso IV
W7 MULTIELABORAÇÃO FIP	Não se aplica	Não se aplica	1.999.730,86	4,45%	20	2,36%	Artigo 8º, Inciso V
ÁTICO RENDA FII - ATCR11	Não se aplica	Não se aplica	1.310.506,21	2,92%		9,53%	Artigo 8º, Inciso VI
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	11.039,40	0,02%	14.798	0,00%	Desenquadrado - RF
TOTAL -			44.926.955,27				

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

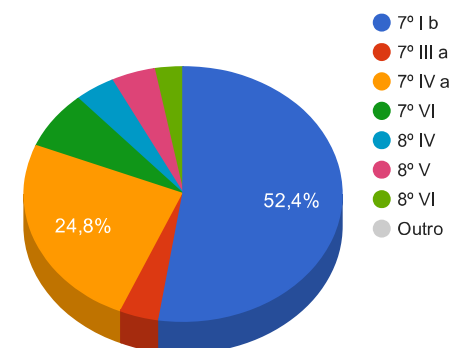
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	100,00%	23.541.272,56	52,40%	21.385.682,71
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	30,00%	1.799.156,17	4,00%	11.678.930,41
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	11.126.082,33	24,76%	2.352.004,25
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	15,00%	3.294.835,62	7,33%	3.444.207,67
Desenquadrado - RF	0,00%	0,00%	11.039,40	0,02%	-11.039,40
Total Renda Fixa	100,00%	175,00	39.772.386,08	88,53%	

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	1.844.332,12	4,11%	402.015,64
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	1.999.730,86	4,45%	246.616,90
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	1.310.506,21	2,92%	935.841,55
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	0,00	0,00%	6.739.043,29
Total Renda Variável	30,00%	30,00	5.154.569,19	11,47%	

Distribuição por Artigo / Resolução



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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	1,05%	11,58%	3,41%	6,94%	14,06%	28,63%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,07%	11,43%	3,48%	6,97%	13,94%	28,77%	0,20%	0,013%	0,17%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,04%	11,65%	3,37%	6,84%	14,05%	28,15%	0,20%	0,016%	0,12%
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,03%	11,36%	3,34%	6,82%	13,81%	28,11%	0,10%	0,005%	0,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,99%	10,85%	3,22%	6,66%	13,17%	26,64%	1,00%	0,010%	0,08%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,65%	7,05%	2,10%	4,26%	8,53%	16,46%	5,00%	0,003%	0,00%

IRF-M 1	0,94%	12,18%	3,36%	6,69%	14,72%	28,94%	-	-	-
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	1,00%	11,84%	3,41%	6,82%	14,42%	29,06%	0,50%	0,224%	0,39%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,94%	12,10%	3,33%	6,60%	14,59%	28,51%	0,20%	0,171%	0,35%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,94%	12,02%	3,30%	6,54%	14,50%	28,20%	0,10%	0,177%	0,35%

IPCA + 7,00% ao ano	0,80%	11,89%	2,53%	6,04%	15,39%	35,66%	-	-	-
GGR PRIME I FIDC	0,76%	12,05%	2,75%	6,44%	15,25%	32,16%	0,15%	-	-
LEME IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-26,29%	-62,60%	-29,12%	-29,32%	-62,63%	-56,12%	1,50%	17,872%	-

IMA-B 5	0,46%	13,44%	2,99%	6,05%	16,48%	32,40%	-	-	-
TOWER BRIDGE II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2,04%	-	4,22%	1,19%	-	-	0,70%	5,967%	-
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,53%	7,17%	3,02%	6,83%	-0,34%	9,80%	0,70%	0,905%	12,72%

IDKA IPCA 2 Anos	0,41%	13,11%	3,23%	5,80%	15,48%	32,92%	-	-	-
------------------	-------	--------	-------	-------	--------	--------	---	---	---

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,42%	12,87%	3,08%	5,81%	15,63%	31,54%	0,20%	0,673%	2,49%

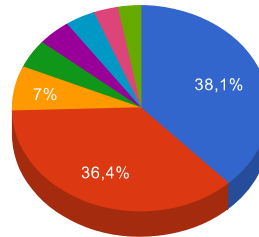
Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (outubro / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	3,80%	33,78%	8,65%	21,30%	31,82%	34,45%	-	-	-
ÁTICO RENDA FII - ATCR11	0,00%	-	0,00%	0,00%	0,00%	-	1,20%	-	-
CDI	1,05%	11,58%	3,41%	6,94%	14,06%	28,63%	-	-	-
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	0,67%	11,71%	2,66%	5,99%	5,44%	-5,13%	0,00%	0,578%	7,36%
IPCA	0,26%	5,78%	0,78%	2,45%	7,87%	18,59%	-	-	-
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	3,02%	9,62%	3,31%	5,89%	13,03%	27,98%	1,50%	5,811%	5,91%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,50%	0,000%	28,24%

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

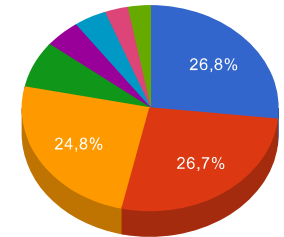
Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	17.106.658,20	38,08%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	16.374.678,99	36,45%
GRADUAL INVESTIMENTOS	3.154.838,33	7,02%
Planner Corretora	1.999.730,86	4,45%
CM Capital Markets DTVM	1.896.223,39	4,22%
Safra Asset Management	1.686.278,89	3,75%
Gradual Asset Management	1.398.612,23	3,11%
Bridge Trust	1.309.934,38	2,92%

- BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM
- CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
- GRADUAL INVESTIMENTOS
- Planner Corretora
- CM Capital Markets DTVM
- Safra Asset Management
- Gradual Asset Management
- Bridge Trust



Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	12.021.415,89	26,76%
IDKA IPCA 2A	12.009.078,46	26,73%
CDI	11.137.121,73	24,79%
FIDC - ABERTO	3.294.835,62	7,33%
FIP	1.999.730,86	4,45%
MULTIMERCADO	1.844.332,12	4,11%
FUNDO IMOBILIÁRIO	1.310.506,21	2,92%
IMA-B 5	1.309.934,38	2,92%

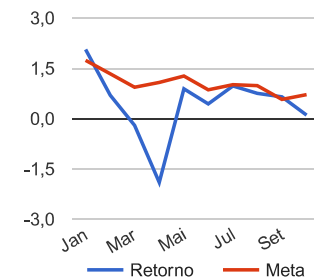
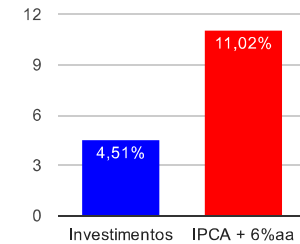
- IRF-M 1
- IDKA IPCA 2A
- CDI
- FIDC - ABERTO
- FIP
- MULTIMERCADO
- FUNDO IMOBILIÁRIO
- IMA-B 5



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%
Acumulado no ano					1.909.378,71	4,51%	11,02%	40,91%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
TOWER BRIDGE II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	278.498,39	0,00	0,00	284.168,45	5.670,06	2,04%	5,97%	2,04%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.836.485,21	95.706,37	0,00	2.963.126,76	30.935,18	1,06%	0,01%	1,07%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.774.057,21	0,00	0,00	6.844.606,83	70.549,62	1,04%	0,02%	1,04%
SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.184.838,43	0,00	0,00	1.197.057,10	12.218,67	1,03%	0,00%	1,03%
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	484.375,10	0,00	0,00	489.221,79	4.846,69	1,00%	0,22%	1,00%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.994.357,86	0,00	0,00	2.013.161,34	18.803,48	0,94%	0,18%	0,94%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.280.953,58	150.000,00	0,00	9.519.032,76	88.079,18	0,93%	0,17%	0,94%
GGR PRIME I FIDC	1.881.961,15	0,00	0,00	1.896.223,39	14.262,24	0,76%	-	-
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.020.326,93	0,00	0,00	1.025.765,93	5.439,00	0,53%	0,90%	0,53%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.959.231,90	0,00	0,00	12.009.078,46	49.846,56	0,42%	0,67%	0,42%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	297.364,46	82.084,10	259.698,59	121.291,64	1.541,67	0,41%	0,01%	0,99%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	26.991,53	259.999,50	276.310,60	11.039,40	358,97	0,13%	0,00%	0,65%
LEME IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1.696.262,41	0,00	0,00	1.398.612,23	-297.650,18	-17,55%	17,87%	-9,72%
Total Renda Fixa					4.901,14	0,01%	1,00%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.318.626,03	0,00	0,00	1.362.839,99	44.213,96	3,35%	5,81%	3,02%
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	478.301,51	0,00	0,00	481.492,13	3.190,62	0,67%	0,58%	0,67%
ÁTICO RENDA FII - ATCR11	1.311.645,43	0,00	0,00	1.310.506,21	-1.139,22	-0,09%	-	0,00%
W7 MULTIELSTRATÉGIA FIP	2.002.957,46	0,00	0,00	1.999.730,86	-3.226,60	-0,16%	0,00%	-0,16%
Total Renda Variável					43.038,76	0,84%	2,13%	