

Relatório Analítico dos Investimentos em novembro de 2016



Carteira consolidada de investimentos - base (novembro / 2016)

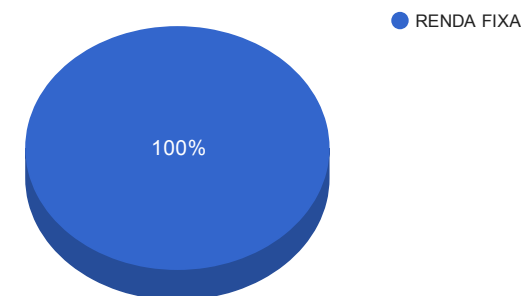
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	9.484.505,24	10,20%	101	2,44%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	2.483.776,26	2,67%	55	0,48%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	240.952,93	0,26%	628	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2020	2.866.818,27	3,08%	122	0,36%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	10.497.186,31	11,29%	1.175	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	6.390.704,40	6,87%	1.346	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	3.612.220,04	3,88%	246	0,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	5.417.279,69	5,82%	738	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.971.007,56	4,27%	736	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.233.238,83	6,70%	205	0,51%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	7.683.429,93	8,26%	107	0,94%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.420.311,41	2,60%	250	0,22%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.426.695,30	9,06%	337	0,36%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.940.251,17	3,16%	453	0,15%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.007.116,67	2,16%	589	0,16%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	18.337.685,13	19,72%	796	0,35%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
		TOTAL -	93.013.179,14				

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

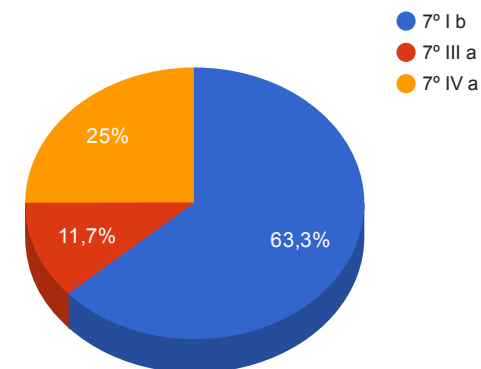
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	85,00%	58.881.119,46	63,30%	20.180.082,81
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	30,00%	10.847.006,71	11,66%	17.056.947,03
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	23.285.052,97	25,03%	4.618.900,77
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	4.650.658,96
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	4.650.658,96
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	4.650.658,96
Total Renda Fixa	100,00%	160,00	93.013.179,14	100,00%	

Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	4.650.658,96
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	4.650.658,96
Artigos - Renda Variável Artigo 8º, Inciso VI	Limite Resolução 5,00%	Limite Política 5,00%	Total Artigo 0,00	% Carteira 0,00%	GAP Política 4.650.658,96
Total Renda Variável	30,00%	15,00	0,00	0,00%	

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%
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%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,98%	11,93%	3,04%	6,56%	13,15%	26,92%	1,00%	0,008%	0,08%
IPCA + 6,00% ao ano	0,64%	11,73%	1,95%	4,88%	13,38%	32,71%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,40%	14,24%	2,25%	5,57%	16,75%	30,28%	0,15%	1,665%	2,86%
IDKA IPCA 2 Anos	0,57%	13,75%	2,50%	5,74%	15,91%	32,27%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,57%	13,55%	2,35%	5,66%	15,78%	31,23%	0,20%	1,272%	2,38%
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 Geral ex-C	0,06%	18,78%	2,65%	7,32%	19,99%	29,12%	-	-	-
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00%	18,62%	2,58%	7,19%	19,75%	28,54%	0,20%	2,504%	3,55%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,24%	-	2,24%	-	-	-	0,30%	2,601%	-
IMA-B 5+	-2,04%	26,35%	0,31%	7,26%	27,77%	29,61%	-	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-2,13%	26,06%	0,20%	7,13%	27,37%	28,99%	0,20%	6,196%	10,10%

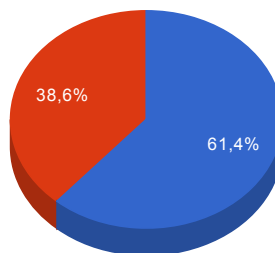
Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (novembro / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	-1,22%	21,28%	0,97%	6,44%	23,13%	29,54%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,10%	9,68%	2,02%	2,47%	12,62%	-	0,20%	2,411%	6,37%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	-1,15%	20,75%	1,18%	6,59%	22,21%	28,86%	0,20%	4,608%	6,56%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,17%	21,08%	1,05%	6,42%	22,85%	27,38%	0,20%	4,745%	7,05%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,21%	20,97%	1,06%	6,49%	22,78%	28,89%	0,30%	4,759%	6,98%
IMA Geral	-0,00%	18,76%	2,45%	7,13%	19,96%	29,09%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,04%	18,67%	2,63%	7,23%	19,91%	28,34%	0,20%	2,441%	3,53%

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

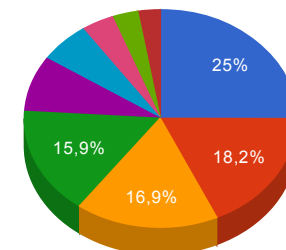
Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	57.126.899,02	61,42%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	35.886.280,12	38,58%

- BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM
- CAIXA ECONÔMICA FEDERAL



Sub-segmento	Valor	%
CDI	23.285.052,97	25,03%
IRF-M 1	16.887.890,71	18,16%
IMA-GERAL	15.717.744,07	16,90%
IMA-B	14.818.014,27	15,93%
IMA-B 5	7.683.429,93	8,26%
IDKA IPCA 2A	5.658.232,62	6,08%
IMA-B 5+	3.612.220,04	3,88%
IDKA IPCA 3A	2.866.818,27	3,08%
IMA-GERAL EX-C	2.483.776,26	2,67%

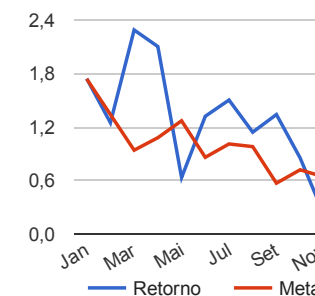
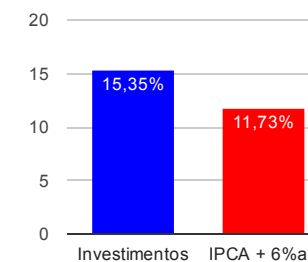
- CDI
- IRF-M 1
- IMA-GERAL
- IMA-B
- IMA-B 5
- IDKA IPCA 2A
- IMA-B 5+
- IDKA IPCA 3A
- IMA-GERAL EX-C



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	75.972.334,18	1.395.750,08	918.412,98	77.782.013,01	1.332.341,73	1,74%	1,74%	100,19%	1,01%
Fevereiro	77.782.013,01	1.820.519,76	1.133.534,42	79.448.523,97	979.525,62	1,25%	1,34%	92,86%	1,48%
Março	79.448.523,97	6.413.240,25	5.913.897,40	81.777.556,22	1.829.689,40	2,29%	0,94%	242,90%	2,47%
Abril	81.777.556,22	1.037.527,12	896.892,47	83.640.739,93	1.722.549,06	2,10%	1,08%	195,36%	1,53%
Mai	83.640.739,93	1.958.100,73	1.176.511,44	84.956.758,79	534.429,57	0,63%	1,27%	49,82%	1,39%
Junho	84.956.758,79	6.582.441,40	6.400.353,35	86.263.174,08	1.124.327,24	1,32%	0,86%	153,24%	1,03%
Julho	86.263.174,08	1.442.709,29	1.006.191,14	88.002.775,11	1.303.082,88	1,50%	1,01%	148,92%	0,76%
Agosto	88.002.775,11	2.800.270,91	4.201.734,14	87.606.398,53	1.005.086,65	1,14%	0,98%	117,07%	1,07%
Setembro	87.606.398,53	3.420.118,80	1.087.443,04	91.144.394,13	1.205.319,84	1,34%	0,57%	236,30%	0,89%
Outubro	91.144.394,13	3.883.897,85	3.452.268,86	92.356.641,50	780.618,38	0,85%	0,72%	117,62%	0,91%
Novembro	92.356.641,50	1.514.555,48	1.062.019,78	93.013.179,14	204.001,94	0,22%	0,64%	34,11%	1,83%
Mês Acumulado no ano	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
					12.020.972,31	15,35%	11,73%	130,85%	

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(%)	
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	18.147.367,51	0,00	0,00	18.337.685,13	190.317,62	1,05%	0,02%	1,05%	
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.325.851,07	0,00	0,00	6.390.704,40	64.853,33	1,03%	0,12%	1,03%	
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.910.521,05	0,00	0,00	2.940.251,17	29.730,12	1,02%	0,00%	1,02%	
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.391.304,68	0,00	0,00	10.497.186,31	105.881,63	1,02%	0,12%	1,02%	
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.534.569,01	1.514.555,48	1.062.019,78	2.007.116,67	20.011,96	0,66%	0,01%	0,98%	
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	239.585,42	0,00	0,00	240.952,93	1.367,51	0,57%	1,27%	0,57%	
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.388.439,26	0,00	0,00	5.417.279,69	28.840,43	0,54%	1,30%	0,54%	
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.855.259,88	0,00	0,00	2.866.818,27	11.558,39	0,40%	1,66%	0,40%	
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.675.435,39	0,00	0,00	7.683.429,93	7.994,54	0,10%	2,41%	0,10%	
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.230.787,97	0,00	0,00	6.233.238,83	2.450,86	0,04%	2,44%	0,04%	
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.484.347,62	0,00	0,00	9.484.505,24	157,62	0,00%	2,50%	0,00%	
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.489.773,34	0,00	0,00	2.483.776,26	-5.997,08	-0,24%	2,60%	-0,24%	
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	8.524.835,68	0,00	0,00	8.426.695,30	-98.140,38	-1,15%	4,61%	-1,15%	
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.017.831,94	0,00	0,00	3.971.007,56	-46.824,38	-1,17%	4,74%	-1,17%	
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.449.912,53	0,00	0,00	2.420.311,41	-29.601,12	-1,21%	4,76%	-1,21%	
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.690.819,15	0,00	0,00	3.612.220,04	-78.599,11	-2,13%	6,20%	-2,13%	
Total Renda Fixa						204.001,94	0,22%	1,83%	