

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
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	12.720.024,13	4,46%	628	0,32%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.999.989,58	1,05%	205	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	6.749.386,58	2,37%	368	0,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	502.795,70	0,18%	113	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	16.834.882,20	5,91%	115	4,32%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	3.778.410,48	1,33%	20	1,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	787.829,89	0,28%	729	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	40.387.683,43	14,17%	223	1,32%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	2.463.311,29	0,86%	35	4,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	41.270.351,96	14,48%	1.346	0,36%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	4.060.884,57	1,42%	193	1,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	784.791,62	0,28%	212	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.955.691,71	0,69%	738	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2024	705.037,32	0,25%	17	0,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	28.600.871,58	10,04%	595	0,81%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	814.483,87	0,29%	1.175	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	775.451,31	0,27%	1.159	1,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	13.368.831,40	4,69%	337	0,58%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADERCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	21.486.346,89	7,54%	86	2,35%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	536.913,02	0,19%	39	0,18%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	D+1	Não há	2.545.829,44	0,89%	12	0,81%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	4.973.661,29	1,75%	182	1,83%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "

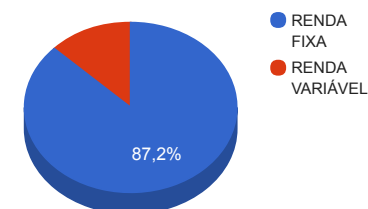
Carteira consolidada de investimentos - base (novembro / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.284.360,35	1,15%	796	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	20.491.166,43	7,19%	402	0,30%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	2.554.801,25	0,90%	143	0,25%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VIII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	01/01/2017	2.744.162,36	0,96%	49	0,41%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.676.277,62	1,29%	453	0,19%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	16/05/2023	3.863.789,18	1,36%	52	1,49%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+30 a D+2880	Não há	1.505.007,92	0,53%	50	0,46%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	1.253.905,00	0,44%	100	0,61%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	2.677.500,38	0,94%	245	11,21%	Artigo 8º, Inciso III
XP INVESTOR FI AÇÕES	D+4	Não há	2.002.080,48	0,70%	4.613	0,77%	Artigo 8º, Inciso III
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	1.339.421,16	0,47%	4.015	1,14%	Artigo 8º, Inciso III
BB CIELO FI AÇÕES	D+4	Não há	1.779.209,68	0,62%	6.184	1,17%	Artigo 8º, Inciso III
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	D+4	Não há	3.853.891,27	1,35%	3.768	5,12%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	1.558.319,92	0,55%	139	0,99%	Artigo 8º, Inciso III
BB PIPE FIC AÇÕES	D+4	03/06/2018	1.011.271,98	0,35%	48	1,13%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	D+12	Não há	1.608.076,51	0,56%	391	2,25%	Artigo 8º, Inciso III
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	D+4	Não há	3.033.951,11	1,06%	8.720	1,92%	Artigo 8º, Inciso III
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	2.514.645,26	0,88%	27	6,44%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.226.912,26	0,78%	3.010	0,86%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	D+5	Não há	2.098.544,50	0,74%	30	0,98%	Artigo 8º, Inciso IV
CAIXA BRASIL IPCA VIII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+0	06/12/2016	1.887.901,00	0,66%	21	2,00%	Artigo 8º, Inciso IV
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	8.915.672,75	3,13%	281	6,63%	Artigo 8º, Inciso IV
TOTAL -			284.984.327,63				

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

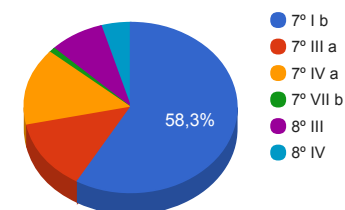
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	10,00%	0,00	0,00%	28.498.432,76
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	75,00%	166.191.877,22	58,32%	47.546.368,50
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	50,00%	37.937.920,75	13,31%	104.554.243,07
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	41.588.218,48	14,59%	43.907.079,81
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	14.249.216,38
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	14.249.216,38
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	2.758.912,92	0,97%	11.490.303,46
Total Renda Fixa	100,00%	180,00	248.476.929,37	87,19%	

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%	14.249.216,38
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	23.605.280,01	8,28%	19.142.369,13
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	12.902.118,25	4,53%	1.347.098,13
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	14.249.216,38
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	14.249.216,38
Total Renda Variável	30,00%	35,00	36.507.398,26	12,81%	

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%	-	-	-
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1,03%	13,24%	3,19%	6,57%	14,55%	28,84%	0,20%	0,121%	0,35%
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%
Selic	1,04%	12,75%	3,23%	6,87%	14,06%	28,94%	-	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,12%	12,99%	3,43%	7,13%	14,31%	29,33%	0,20%	0,042%	0,05%
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 TÍTULOS PÚBLICOS VIII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,02%	14,17%	3,20%	6,54%	15,58%	25,16%	0,20%	0,010%	0,75%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,97%	11,88%	3,02%	6,42%	13,10%	26,75%	0,80%	0,000%	0,00%
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%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,18%	19,91%	1,55%	5,81%	23,18%	29,27%	0,15%	3,657%	6,56%
IDKA IPCA 2 Anos	0,57%	13,75%	2,50%	5,74%	15,91%	32,27%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,68%	12,00%	2,44%	5,64%	13,94%	-	0,20%	0,992%	1,14%

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
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-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%
IRF-M	0,32%	21,14%	3,53%	8,19%	21,83%	29,69%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,29%	21,02%	3,51%	8,08%	21,68%	29,10%	0,20%	2,524%	3,52%
IPCA	0,18%	5,97%	0,52%	1,84%	6,99%	18,20%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,72%	15,45%	1,85%	5,19%	15,97%	-	0,20%	0,948%	2,88%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,31%	18,04%	2,62%	6,71%	21,16%	31,96%	0,20%	2,607%	4,63%
IRF-M 1+	0,03%	26,95%	3,73%	8,99%	27,16%	30,46%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,05%	26,91%	3,74%	8,89%	27,07%	30,27%	0,20%	3,534%	5,53%
IDKA IPCA 20 Anos	-4,98%	42,97%	-2,47%	9,23%	40,27%	28,28%	-	-	-
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-3,57%	31,72%	-0,54%	8,62%	31,23%	28,62%	0,20%	9,132%	14,30%
IMA-B 5+	-2,04%	26,35%	0,31%	7,26%	27,77%	29,61%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-2,05%	25,89%	0,28%	7,17%	27,10%	28,32%	0,20%	6,424%	10,08%

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
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	-2,13%	25,73%	0,22%	7,21%	26,97%	28,30%	0,20%	6,508%	10,19%
IMA-B	-1,22%	21,28%	0,97%	6,44%	23,13%	29,54%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,62%	7,37%	2,38%	2,57%	9,61%	-	0,20%	1,072%	5,00%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,20%	14,35%	1,19%	2,79%	16,99%	-	0,20%	4,108%	8,37%
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%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	-1,18%	21,06%	1,01%	6,36%	22,84%	28,58%	0,20%	4,673%	7,07%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	-1,26%	19,20%	0,91%	6,10%	21,09%	30,93%	0,45%	5,013%	6,69%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	-1,28%	20,56%	1,31%	6,37%	22,22%	29,70%	0,15%	4,921%	7,43%
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%

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

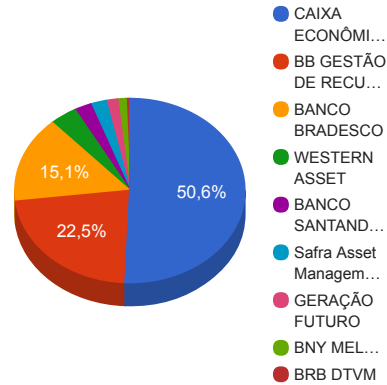
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
S&P 500	3,42%	7,58%	1,28%	4,86%	5,69%	6,35%	-	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	4,50%	19,02%	4,48%	11,75%	19,39%	35,35%	1,00%	4,997%	13,98%
CDI	1,04%	12,73%	3,23%	6,86%	14,04%	28,88%	-	-	-
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	1,05%	15,87%	4,33%	9,02%	17,62%	38,93%	2,00%	0,932%	1,87%
IPCA + 6,00% ao ano	0,64%	11,73%	1,95%	4,88%	13,38%	32,71%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA VIII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	0,88%	12,97%	2,28%	5,58%	14,77%	33,25%	0,15%	0,041%	0,42%
BBSEGURIDADE ON NM - BBSE3	-11,98%	23,64%	-2,95%	6,68%	15,83%	-5,27%	-	-	-
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	-12,05%	21,65%	-3,27%	5,98%	13,85%	-8,32%	1,5%	17,754%	41,40%
CIELO ON NM - CIEL3	-8,27%	7,97%	-10,79%	-5,62%	3,30%	0,90%	-	-	-
BB CIELO FI AÇÕES	-8,33%	6,14%	-10,99%	-6,35%	1,41%	-2,31%	1,50%	13,454%	32,14%
IFNC	-7,76%	49,48%	3,94%	25,05%	42,72%	19,30%	-	-	-
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	-8,11%	47,91%	3,32%	24,15%	41,49%	16,86%	1,00%	16,725%	31,48%
Ibovespa	-4,65%	42,81%	6,92%	27,72%	37,20%	13,12%	-	-	-
GERAÇÃO FI AÇÕES	-6,82%	3,24%	5,47%	22,84%	2,01%	-3,22%	3,00%	15,151%	22,65%
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	-6,89%	27,84%	3,76%	21,87%	23,48%	13,44%	1,00%	15,443%	22,39%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	-7,98%	35,22%	-3,86%	17,45%	30,69%	-6,07%	2,00%	17,456%	23,62%
XP INVESTOR FI AÇÕES	-8,58%	48,76%	1,30%	23,13%	48,75%	32,59%	2,00%	15,380%	21,38%

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

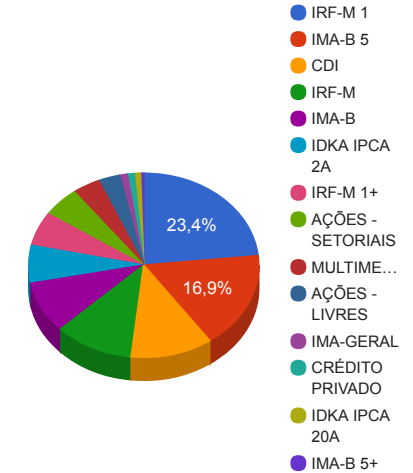
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB PIPE FIC AÇÕES	-8,58%	22,44%	-3,51%	7,54%	20,37%	12,21%	1,20%	10,881%	15,93%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	-10,79%	3,26%	-0,68%	20,56%	2,93%	-3,28%	2,00%	15,006%	22,02%
IDIV	-2,21%	61,93%	12,03%	38,53%	55,85%	4,69%	-	-	-
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	-9,31%	38,24%	-0,65%	11,36%	38,46%	23,95%	3,00%	14,028%	19,80%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	-10,97%	-3,77%	-0,74%	14,25%	-6,76%	-13,02%	3,00%	15,276%	22,88%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	144.328.666,82	50,64%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	64.040.333,38	22,47%
BANCO BRADESCO	43.017.222,04	15,09%
WESTERN ASSET	11.014.217,25	3,86%
BANCO SANTANDER	6.749.386,58	2,37%
Safra Asset Management	6.324.239,92	2,22%
GERAÇÃO FUTURO	4.610.440,08	1,62%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	3.341.501,64	1,17%
BRB DTVM	1.558.319,92	0,55%



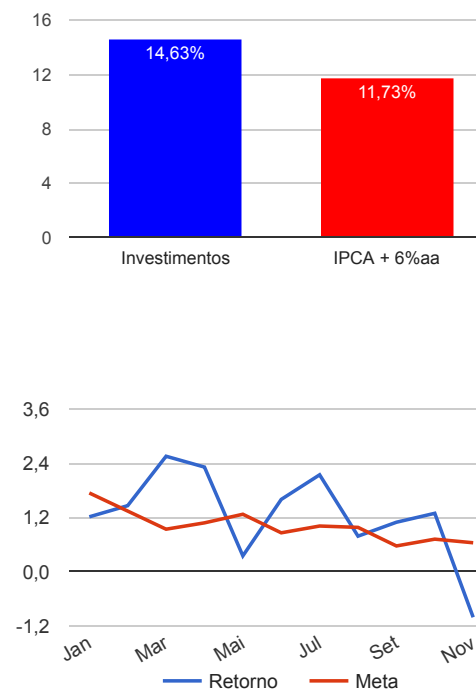
Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	66.117.012,16	23,20%
IMA-B 5	47.924.899,90	16,82%
CDI	32.425.465,69	11,38%
IRF-M	31.345.033,94	11,00%
IMA-B	25.549.116,64	8,97%
IDKA IPCA 2A	18.736.600,41	6,57%
IRF-M 1+	16.834.882,20	5,91%
AÇÕES - SETORIAIS	14.910.885,86	5,23%
MULTIMERCADO	11.014.217,25	3,86%
AÇÕES - LIVRES	8.694.394,15	3,05%
IMA-GERAL	2.999.989,58	1,05%
CRÉDITO PRIVADO	2.758.912,92	0,97%
IDKA IPCA 20A	2.463.311,29	0,86%
IMA-B 5+	1.321.704,64	0,46%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	241.212.832,49	35.867.183,30	35.272.132,63	244.741.399,82	2.933.516,66	1,21%	1,74%	69,75%	2,33%
Fevereiro	244.741.399,82	9.607.549,88	9.179.947,33	248.747.930,53	3.578.928,16	1,46%	1,34%	108,59%	2,84%
Março	248.747.930,53	182.053.778,36	181.728.508,26	255.427.795,69	6.354.595,06	2,55%	0,94%	270,78%	4,25%
Abril	255.427.795,69	32.599.986,76	32.762.345,97	261.171.295,48	5.905.859,00	2,31%	1,08%	214,81%	2,40%
Mai	261.171.295,48	6.516.425,80	6.252.173,84	262.352.914,80	917.367,36	0,35%	1,27%	27,62%	2,12%
Junho	262.352.914,80	20.257.583,29	18.505.041,69	268.325.723,04	4.220.266,64	1,60%	0,86%	185,42%	1,91%
Julho	268.325.723,04	34.720.002,88	35.354.949,28	273.436.298,45	5.745.521,81	2,14%	1,01%	212,15%	1,51%
Agosto	273.436.298,45	116.699.411,99	116.173.159,89	276.116.230,17	2.153.679,62	0,79%	0,98%	80,58%	1,88%
Setembro	276.116.230,17	48.964.439,65	48.638.608,75	279.465.140,67	3.023.079,60	1,09%	0,57%	192,82%	2,15%
Outubro	279.465.140,67	55.467.324,82	54.814.015,01	283.734.404,12	3.615.953,64	1,29%	0,72%	178,12%	1,95%
Novembro	283.734.404,12	154.356.287,16	150.212.913,41	284.984.327,63	-2.893.450,24	-1,01%	0,64%	-155,98%	2,75%
Acumulado no ano					35.555.317,31	14,63%	11,73%	124,73%	

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(%)
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	20.263.739,61	0,00	0,00	20.491.166,43	227.426,82	1,12%	0,04%	1,12%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.139.984,79	110.853,79	0,00	3.284.360,35	33.521,77	1,03%	0,02%	1,05%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	806.268,44	0,00	0,00	814.483,87	8.215,43	1,02%	0,12%	1,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VIII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.716.547,81	0,00	0,00	2.744.162,36	27.614,55	1,02%	0,01%	1,02%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	40.000.000,00	0,00	40.387.683,43	387.683,43	0,97%	1,07%	0,62%
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	2.521.866,16	0,00	0,00	2.545.829,44	23.963,28	0,95%	0,53%	0,95%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.535.629,80	0,00	0,00	2.554.801,25	19.171,45	0,76%	0,07%	0,76%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.244.908,00	0,00	0,00	1.253.905,00	8.997,00	0,72%	0,95%	0,72%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.033.415,00	0,00	0,00	4.060.884,57	27.469,57	0,68%	0,99%	0,68%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	41.000.000,00	0,00	41.270.351,96	270.351,96	0,66%	0,12%	1,03%
BRADERCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1.349.928,19	20.000.000,00	0,00	21.486.346,89	136.418,70	0,64%	0,12%	1,03%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	12.647.832,30	0,00	0,00	12.720.024,13	72.191,83	0,57%	1,27%	0,57%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.945.280,02	0,00	0,00	1.955.691,71	10.411,69	0,54%	1,30%	0,54%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	6.723.174,59	0,00	0,00	6.749.386,58	26.211,99	0,39%	1,64%	0,39%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1.500.362,46	0,00	0,00	1.505.007,92	4.645,46	0,31%	2,61%	0,31%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	28.519.363,77	0,00	0,00	28.600.871,58	81.507,81	0,29%	2,52%	0,29%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.578.475,83	40.000.000,00	40.000.000,00	3.676.277,62	97.801,79	0,22%	0,00%	1,02%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	1.499.380,35	12.565.219,49	9.102.059,62	4.973.661,29	11.121,07	0,08%	0,00%	0,97%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	16.842.596,62	0,00	0,00	16.834.882,20	-7.714,42	-0,05%	3,53%	-0,05%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	706.425,90	0,00	0,00	705.037,32	-1.388,58	-0,20%	4,11%	-0,20%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.983.498,71	0,00	110.853,79	3.863.789,18	-8.855,74	-0,22%	3,66%	-0,18%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	16.865.343,79	0,00	16.000.000,00	787.829,89	-77.513,90	-0,46%	1,65%	0,38%

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 IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	18.126.507,07	0,00	15.000.000,00	2.999.989,58	-126.517,49	-0,70%	2,44%	0,04%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	3.826.523,73	0,00	0,00	3.778.410,48	-48.113,25	-1,26%	5,01%	-1,26%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	785.511,11	0,00	0,00	775.451,31	-10.059,80	-1,28%	4,92%	-1,28%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	53.703.562,18	680.213,88	40.000.000,00	13.368.831,40	-1.014.944,66	-1,87%	4,61%	-1,15%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	548.575,99	0,00	0,00	536.913,02	-11.662,97	-2,13%	6,51%	-2,13%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.121.228,83	0,00	10.000.000,00	784.791,62	-336.437,21	-3,03%	6,42%	-2,05%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	21.219.606,02	0,00	20.000.000,00	502.795,70	-716.810,32	-3,38%	4,67%	-1,18%
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.554.418,39	0,00	0,00	2.463.311,29	-91.107,10	-3,57%	9,13%	-3,57%
Total Renda Fixa					-976.399,84	-0,39%	1,48%	

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(%)
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	8.531.536,94	0,00	0,00	8.915.672,75	384.135,81	4,50%	5,00%	4,50%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	2.076.773,90	0,00	0,00	2.098.544,50	21.770,60	1,05%	0,93%	1,05%
CAIXA BRASIL IPCA VIII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.871.404,00	0,00	0,00	1.887.901,00	16.497,00	0,88%	0,04%	0,88%
GERAÇÃO FI AÇÕES	1.672.399,09	0,00	0,00	1.558.319,92	-114.079,17	-6,82%	15,15%	-6,82%
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	2.700.866,69	0,00	0,00	2.514.645,26	-186.221,43	-6,89%	15,44%	-6,89%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	2.909.847,20	0,00	0,00	2.677.500,38	-232.346,82	-7,98%	17,46%	-7,98%
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	4.194.093,05	0,00	0,00	3.853.891,27	-340.201,78	-8,11%	16,73%	-8,11%
BB CIELO FI AÇÕES	1.940.979,11	0,00	0,00	1.779.209,68	-161.769,43	-8,33%	13,45%	-8,33%
XP INVESTOR FI AÇÕES	2.189.872,80	0,00	0,00	2.002.080,48	-187.792,32	-8,58%	15,38%	-8,58%
BB PIPE FIC AÇÕES	1.106.204,01	0,00	0,00	1.011.271,98	-94.932,03	-8,58%	10,88%	-8,58%
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.476.982,76	0,00	0,00	1.339.421,16	-137.561,60	-9,31%	14,03%	-9,31%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	1.802.659,11	0,00	0,00	1.608.076,51	-194.582,60	-10,79%	15,01%	-10,79%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.501.323,85	0,00	0,00	2.226.912,26	-274.411,59	-10,97%	15,28%	-10,97%
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	3.449.506,15	0,00	0,00	3.033.951,11	-415.555,04	-12,05%	17,75%	-12,05%
Total Renda Variável					-1.917.050,40	-4,99%	11,42%	