

# Relatório Analítico dos Investimentos em novembro de 2016



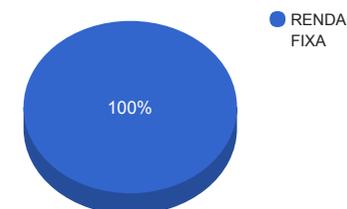
Carteira consolidada de investimentos - base (novembro / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	4.276.641,44	13,36%	1.346	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.035.296,70	3,23%	205	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.590.047,84	20,58%	729	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.809.247,42	8,77%	736	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	4.443.888,59	13,88%	617	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.280.028,38	7,12%	628	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.892.518,60	9,03%	1.175	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRDESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.070.529,09	9,59%	86	0,34%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	2.417.237,08	7,55%	402	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.449.667,22	4,53%	1.333	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	754.449,27	2,36%	755	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
		<b>TOTAL -</b>	<b>32.019.551,63</b>				

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

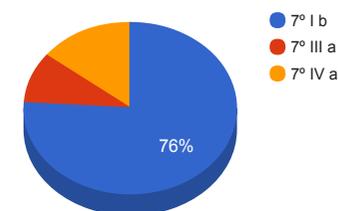
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	90,00%	24.327.668,97	75,98%	4.489.927,50
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	40,00%	3.070.529,09	9,59%	9.737.291,56
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	4.621.353,57	14,43%	4.984.511,92
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.600.977,58
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.600.977,58
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.600.977,58
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>175,00</b>	<b>32.019.551,63</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%	3,00%	0,00	0,00%	960.586,55
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.600.977,58
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	2,00%	0,00	0,00%	640.391,03
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>10,00</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)

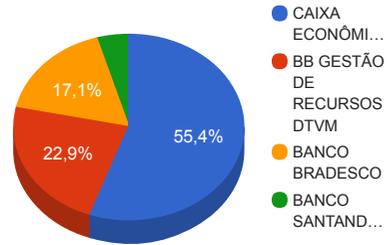
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M 1	1,05%	13,36%	3,22%	6,67%	14,70%	29,27%	-	-	-
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1,03%	13,24%	3,19%	6,57%	14,55%	28,84%	0,20%	0,121%	0,35%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,03%	13,24%	3,17%	6,58%	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%
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%	-	-	-
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,06%	12,77%	3,25%	6,93%	14,09%	29,09%	0,20%	0,020%	0,02%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,05%	12,75%	3,24%	6,86%	14,05%	29,00%	0,20%	0,029%	0,04%
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%
IMA-B 5	0,40%	13,89%	2,28%	5,63%	16,31%	31,55%	-	-	-
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%
IMA-B	-1,22%	21,28%	0,97%	6,44%	23,13%	29,54%	-	-	-
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 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,26%	21,02%	0,91%	6,35%	22,81%	28,78%	0,20%	4,787%	7,06%
IMA Geral	-0,00%	18,76%	2,45%	7,13%	19,96%	29,09%	-	-	-

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

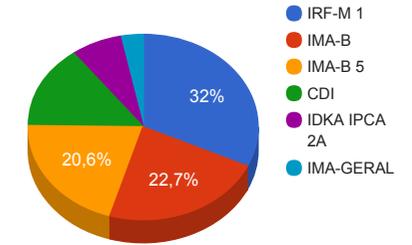
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,04%	18,67%	2,63%	7,23%	19,91%	28,34%	0,20%	2,441%	3,53%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	17.745.711,05	55,42%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	7.336.407,19	22,91%
BANCO BRADESCO	5.487.766,17	17,14%
BANCO SANTANDER	1.449.667,22	4,53%



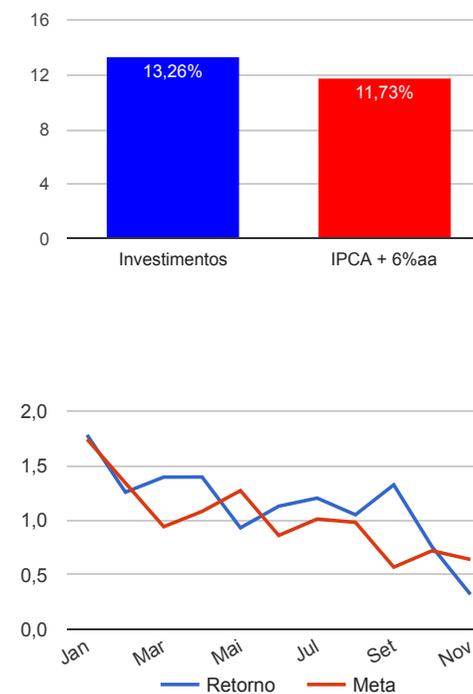
Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	10.239.689,13	31,98%
IMA-B	7.253.136,01	22,65%
IMA-B 5	6.590.047,84	20,58%
CDI	4.621.353,57	14,43%
IDKA IPCA 2A	2.280.028,38	7,12%
IMA-GERAL	1.035.296,70	3,23%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	25.552.981,25	854.529,73	325.438,64	26.546.247,99	464.175,65	1,78%	1,74%	102,31%	0,70%
Fevereiro	26.546.247,99	404.290,46	239.479,60	27.046.486,18	335.427,33	1,26%	1,34%	93,42%	0,83%
Março	27.046.486,18	380.512,11	212.378,29	27.593.914,58	379.294,58	1,39%	0,94%	147,92%	1,04%
Abril	27.593.914,58	385.152,67	240.788,77	28.125.050,44	386.771,96	1,39%	1,08%	129,55%	0,67%
Mai	28.125.050,44	431.708,14	243.515,75	28.576.455,94	263.213,11	0,93%	1,27%	73,17%	0,56%
Junho	28.576.455,94	795.050,04	237.153,44	29.462.895,49	328.542,95	1,13%	0,86%	130,86%	0,48%
Julho	29.462.895,49	542.186,05	241.509,67	30.121.251,31	357.679,44	1,20%	1,01%	119,07%	0,35%
Agosto	30.121.251,31	10.512.176,82	10.278.772,99	30.673.122,15	318.467,01	1,05%	0,98%	107,54%	0,69%
Setembro	30.673.122,15	454.189,61	248.981,71	31.286.874,13	408.544,08	1,32%	0,57%	233,29%	0,78%
Outubro	31.286.874,13	385.054,11	250.609,76	31.658.727,93	237.409,45	0,76%	0,72%	104,26%	0,83%
Novembro	31.658.727,93	503.614,75	245.209,60	32.019.551,63	102.418,55	0,32%	0,64%	49,80%	1,63%
Acumulado no ano					3.581.944,11	13,26%	11,73%	113,04%	

**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(%)
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.390.408,71	0,00	0,00	2.417.237,08	26.828,37	1,12%	0,04%	1,12%
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.434.494,83	0,00	0,00	1.449.667,22	15.172,39	1,06%	0,02%	1,06%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	746.613,61	0,00	0,00	754.449,27	7.835,66	1,05%	0,03%	1,05%
BRDESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	3.039.277,33	0,00	0,00	3.070.529,09	31.251,76	1,03%	0,12%	1,03%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.797.751,01	65.793,87	0,00	2.892.518,60	28.973,72	1,01%	0,12%	1,02%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.040.120,06	437.820,88	245.209,60	4.276.641,44	43.910,10	0,98%	0,12%	1,03%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.267.088,20	0,00	0,00	2.280.028,38	12.940,18	0,57%	1,27%	0,57%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.565.256,23	0,00	0,00	6.590.047,84	24.791,61	0,38%	1,65%	0,38%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.034.889,63	0,00	0,00	1.035.296,70	407,07	0,04%	2,44%	0,04%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.842.372,83	0,00	0,00	2.809.247,42	-33.125,41	-1,17%	4,74%	-1,17%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.500.455,49	0,00	0,00	4.443.888,59	-56.566,90	-1,26%	4,79%	-1,26%
Total Renda Fixa					102.418,55	0,32%	1,63%	