

Carteira consolidada de investimentos - base (novembro / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			3.645,17	0,00%			Artigo 20
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	7.058.042,52	3,72%	246	0,67%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BTG PACTUAL TESOURO IPCA LONGO FI RENDA FIXA	D+2	Não há	9.055.456,70	4,77%	196	11,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.499.312,95	0,79%	115	0,38%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	12.101.532,76	6,37%	167	1,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	6.003.150,89	3,16%	55	1,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.733.911,80	2,49%	628	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	15.608.012,00	8,22%	107	1,91%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	10.539.461,04	5,55%	223	0,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2024	4.707.748,00	2,48%	17	2,83%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	5.836.018,12	3,07%	6	13,63%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	9.304.956,80	4,90%	94	2,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2030	9.165.687,30	4,83%	26	4,52%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2020	5.762.230,99	3,03%	122	0,72%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	5.490.891,50	2,89%	70	0,71%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	4.056.182,74	2,14%	1.159	6,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	5.077.778,92	2,67%	46	3,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	7.655.604,44	4,03%	4	8,10%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.101.068,22	1,63%	66	0,26%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	449.718,49	0,24%	796	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.064.409,24	1,09%	589	0,17%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2018	3.815.796,00	2,01%	163	0,30%	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 / 4.392 / 4.604
BTG PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA	D+0 ou D+1	Não há	1.817.257,80	0,96%	12	1,27%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	522.996,89	0,28%	755	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	16/05/2023	12.106.539,43	6,37%	52	4,66%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CARTÃO DE COMPRAS SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	D+45 a D+75	Não há	4.155.003,25	2,19%	180	1,25%	Artigo 7º, Inciso VI
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	21.407,28	0,01%	46	0,09%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
MAXIMUM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 7	Não se aplica	Não se aplica	115.697,40	0,06%	35	2,67%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	2.023.609,52	1,07%	98	1,90%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	4.061,62	0,00%	42	0,14%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
VOTORANTIM PREMIUM BANKS FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+30	Não há	1.309.696,58	0,69%	46	0,15%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BB RPPS IPCA II FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	Término do Fundo	Não há	554.242,98	0,29%	25	0,60%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+30 a D+2880	Não há	3.447.977,84	1,82%	50	1,06%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	2.738.822,25	1,44%	16	9,75%	Artigo 8º, Inciso I
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	3.622.279,31	1,91%	156	1,62%	Artigo 8º, Inciso III
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	1.509.306,32	0,79%	488	1,09%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	3.669.157,60	1,93%	139	2,34%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET VALUATION FI AÇÕES	D+4	Não há	962.300,91	0,51%	8	3,90%	Artigo 8º, Inciso III
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	372.231,59	0,20%	27	0,95%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	23/08/2017	373.335,11	0,20%	116	0,11%	Artigo 8º, Inciso III
BB PIPE FIC AÇÕES	D+4	03/06/2018	381.677,05	0,20%	48	0,43%	Artigo 8º, Inciso III
AZ LEGAN BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	1.059.695,51	0,56%	88	1,67%	Artigo 8º, Inciso III
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	D+33	Não há	674.686,77	0,36%	116	0,72%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	D+43	5 anos	199.182,30	0,10%	60	0,16%	Artigo 8º, Inciso III

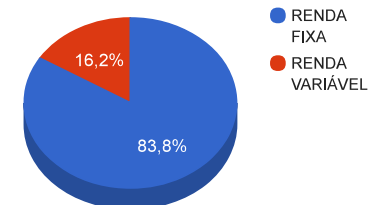
Carteira consolidada de investimentos - base (novembro / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou D+33	Não há	1.723.426,75	0,91%	318	1,02%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO FUTURO FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	726.029,36	0,38%	2.418	0,53%	Artigo 8º, Inciso IV
VOTORANTIM ATUARIAL FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+361	Não há	4.576.395,92	2,41%	17	2,91%	Artigo 8º, Inciso IV
BTG PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO I FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+31	Não há	2.839.211,56	1,49%	306	1,03%	Artigo 8º, Inciso IV
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	591.961,03	0,31%			Artigo 8º, Inciso V
BB VOTORANTIM INFRAESTRUTURA ENERGIA SUST II FIP - ESUD11	Não se aplica	Não se aplica	684.968,14	0,36%	135	0,40%	Artigo 8º, Inciso V
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	281.980,92	0,15%	40	0,13%	Artigo 8º, Inciso V
BRASIL ÓLEO & GÁS MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	321.854,62	0,17%			Artigo 8º, Inciso V
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRCR11	S/Info	Não se aplica	302.170,14	0,16%		0,02%	Artigo 8º, Inciso VI
OURO PRETO DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - ORPD11	Não se aplica	Não se aplica	1.969.524,38	1,04%			Artigo 8º, Inciso VI
KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII - KNRE11	Não se aplica	Não se aplica	1.203.189,42	0,63%			Artigo 8º, Inciso VI
TOTAL -			189.952.494,14				

Enquadramentos na Resolução 3.922 / 4.392 / 4.604 e Política de Investimentos - base (novembro / 2016)

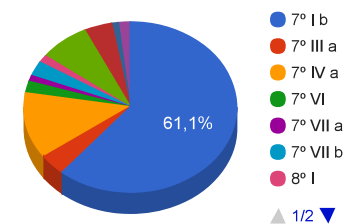
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	100,00%	116.000.375,03	61,07%	73.952.119,11
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	80,00%	7.655.604,44	4,03%	144.306.390,87
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	23.877.786,07	12,57%	33.107.962,17
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	4.155.003,25	2,19%	5.342.621,46
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	2.164.775,82	1,14%	7.332.848,89
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	5.311.917,40	2,80%	4.185.707,31
Total Renda Fixa	100,00%	225,00	159.165.462,01	83,79%	

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	3,00%	2.738.822,25	1,44%	2.959.752,57
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	14,00%	14.547.279,22	7,66%	12.046.069,96
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	8.141.636,84	4,29%	1.355.987,87
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	4,00%	1.880.764,71	0,99%	5.717.335,06
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	4,00%	3.474.883,94	1,83%	4.123.215,83
Total Renda Variável	30,00%	30,00	30.783.386,96	16,21%	

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
130% do CDI	1,35%	16,86%	4,21%	9,01%	18,63%	39,07%	-	-	-
MAXIMUM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 7	-0,52%	-93,67%	36,31%	-6,17%	-93,58%	-94,35%	0,45%	0,977%	103,58%
CDI + 3,50% ao ano	1,31%	16,31%	4,09%	8,73%	18,02%	38,00%	-	-	-
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-5,65%	-72,96%	-71,25%	-71,45%	-70,12%	-63,83%	0,39%	0,576%	70,23%
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-5,97%	-31,76%	-19,20%	-20,73%	-32,38%	-66,13%	0,20%	5,320%	11,02%
115% do CDI	1,19%	14,78%	3,72%	7,93%	16,31%	33,88%	-	-	-
CARTÃO DE COMPRAS SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	1,19%	14,78%	3,72%	7,93%	16,32%	33,86%	0,20%	0,000%	0,00%
CDI	1,04%	12,73%	3,23%	6,86%	14,04%	28,88%	-	-	-
VOTORANTIM PREMIUM BANKS FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,08%	13,10%	3,33%	7,06%	14,42%	29,92%	0,15%	0,035%	0,04%
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%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,05%	12,60%	3,27%	6,87%	13,93%	29,05%	0,20%	0,017%	0,17%
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 RPPS IPCA II FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,78%	12,59%	2,15%	6,07%	14,58%	31,65%	0,20%	0,266%	1,45%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,75%	6,15%	2,16%	2,41%	7,90%	19,09%	0,20%	0,053%	3,94%
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%
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%

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
BTG PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA	-2,07%	6,09%	-0,68%	2,42%	7,83%	18,82%	0,15%	4,684%	3,98%
101,50% do IPCA + 5,75% ao ano	0,62%	11,42%	1,86%	4,70%	13,04%	31,94%	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-1,05%	-13,30%	-5,23%	-9,87%	-12,34%	-16,60%	0,25%	1,529%	3,93%
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%
IPCA	0,18%	5,97%	0,52%	1,84%	6,99%	18,20%	-	-	-
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%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,23%	18,96%	2,59%	7,38%	20,12%	-	0,40%	3,218%	4,18%
IMA Geral ex-C	0,06%	18,78%	2,65%	7,32%	19,99%	29,12%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,24%	-	2,24%	-	-	-	0,30%	2,601%	-
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%
IMA-B 5+	-2,04%	26,35%	0,31%	7,26%	27,77%	29,61%	-	-	-
BTG PACTUAL TESOURO IPCA LONGO FI RENDA FIXA	-2,12%	26,08%	0,16%	7,19%	27,44%	28,58%	0,20%	6,453%	10,17%
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%
IMA-B	-1,22%	21,28%	0,97%	6,44%	23,13%	29,54%	-	-	-