Relatório Analítico dos Investimentos em novembro de 2016

crédito & mercado
Engenharia Financeira

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 (novembro / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	15.377.252,23	4,74%	628	0,39%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	17.560.595,52	5,42%	113	3,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.155.436,01	0,97%	1.175	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	45.093.527,65	13,91%	736	0,96%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	11.173.106,93	3,45%	246	1,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	7.512.603,92	2,32%	1.346	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	30.275.890,31	9,34%	738	0,53%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	23.970.034,24	7,39%	729	0,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	5.561.756,75	1,72%	617	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	20.505.855,55	6,32%	212	2,94%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1901	Não há	3.284.561,89	1,01%	10	6,97%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	D+1471	Não há	2.345.936,83	0,72%	33	2,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	8.569.088,90	2,64%	38	1,57%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.104.393,91	1,57%	453	0,26%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	16/05/2023	10.303.437,83	3,18%	52	3,97%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	19.441.356,79	6,00%	755	0,37%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	12.330.925,13	3,80%	64	17,61%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	11.366.491,01	3,51%	66	0,94%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	4.924.766,72	1,52%	71	3,49%	Artigo 7º, Inciso VI
TRX CORPORATIVO I FIDC SÊNIOR	D+1401	Não Informado	10.590.344,45	3,27%	7	20,78%	Artigo 7º, Inciso VI
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	13.396.702,34	4,13%			Artigo 7º, Inciso VI
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	516.838,02	0,16%	241	3,34%	Artigo 8º, Inciso III

Crédito & Mercado Engenharia Financeira
Rua Tapinas, 22 - 5º Andar - São Paulo - SP - Telefone: (11) 3168-0053

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
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	4.160.490,33	1,28%	342	5,61%	Artigo 8º, Inciso III
CONSTÂNCIA BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	523.508,81	0,16%	88	0,83%	Artigo 8º, Inciso III
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.014.531,55	0,62%	139	2,64%	Artigo 8º, Inciso III
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	D+13	Não há	485.495,33	0,15%	198	1,05%	Artigo 8º, Inciso III
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	3.446.554,72	1,06%	34	19,35%	Artigo 8º, Inciso IV
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+180	Não há	5.890.270,36	1,82%	32	3,92%	Artigo 8º, Inciso IV
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	6.386.230,62	1,97%	8	14,08%	Artigo 8º, Inciso V
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	8.825.118,61	2,72%			Artigo 8º, Inciso V
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	Não se aplica	Não se aplica	8.987.418,61	2,77%			Artigo 8º, Inciso VI
CSHG BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	Não se aplica	Não se aplica	1.180.748,80	0,36%			Artigo 8º, Inciso VI
		Total	**324.261.270,67**				

Crédito & Mercado Engenharia Financeira
Rua Tapinas, 22 - 5º Andar - São Paulo - SP - Telefone: (11) 3168-0053

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

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	100,00%	180.186.059,11	55,57%	144.075.211,56
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	30,00%	14.199.587,62	4,38%	83.078.793,58
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	58.546.604,67	18,06%	38.731.776,53
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	11,00%	28.911.813,51	8,92%	6.756.926,26
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	4,00%	0,00	0,00%	12.970.450,83
Total Renda Fixa	100,00%	175,00	281.844.064,91	86,92%	

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	7.700.864,04	2,37%	40.938.326,56
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	9.336.825,08	2,88%	6.876.238,45
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	15.211.349,23	4,69%	1.001.714,30
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	10.168.167,41	3,14%	6.044.896,12
Total	30,00%	30,00	42.417.205,76	13,08%	

Crédito & Mercado Engenharia Financeira
Rua Tapinas, 22 - 5º Andar - São Paulo - SP - Telefone: (11) 3168-0053

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%	-	-	-
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	1,10%	13,97%	3,44%	7,41%	15,56%	31,44%	0,75%	0,856%	5,66%
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%
IPCA + 7,00% ao ano	0,72%	12,69%	2,18%	5,38%	14,45%	35,21%	-	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1,58%	-62,00%	-29,63%	-29,16%	-62,21%	-55,87%	0,00%	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	0,90%	13,06%	2,53%	6,08%	14,89%	32,26%	1,65%	-	-
IPCA + 6,00% ao ano	0,64%	11,73%	1,95%	4,88%	13,38%	32,71%	-	-	-
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%	-	-	-
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%	-	-	-
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%
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,30%	13,28%	2,28%	5,62%	15,36%	-	0,97%	1,686%	2,58%

Crédito & Mercado Engenharia Financeira
Rua Tapinas, 22 - 5º Andar - São Paulo - SP - Telefone: (11) 3168-0053

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
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,21%	7,39%	1,99%	6,27%	-0,89%	8,78%	0,70%	1,907%	12,74%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	-0,97%	-	2,12%	-0,97%	-	-	0,70%	2,262%	-
IPCA	0,18%	5,97%	0,52%	1,84%	6,99%	18,20%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,23%	18,96%	2,59%	7,38%	20,12%	-	0,40%	3,218%	4,18%
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%
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%	-	-	-
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%
BRADESCO 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%
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%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
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%
TRX CORPORATIVO I FIDC SÊNIOR	0,84%	-	2,54%	23,35%	-	-	1,55%	0,017%	-

Crédito & Mercado Engenharia Financeira
Rua Tapinas, 22 - 5º Andar - São Paulo - SP - Telefone: (11) 3168-0053

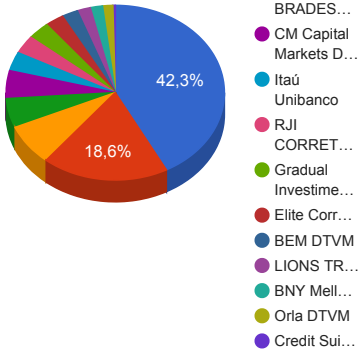
Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (novembro / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	1,04%	12,73%	3,23%	6,86%	14,04%	28,88%	-	-	-
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	1,34%	15,25%	5,17%	8,50%	16,97%	39,28%	1,00%	10,961%	20,27%
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	0,80%	13,21%	2,91%	6,90%	14,59%	31,45%	0,55%	0,537%	1,37%
IBX	-5,00%	40,28%	5,85%	26,86%	34,96%	12,72%	-	-	-
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	-7,48%	19,47%	-1,39%	9,94%	18,71%	6,26%	2,00%	9,945%	15,50%
Ibovespa	-4,65%	42,81%	6,92%	27,72%	37,20%	13,12%	-	-	-
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	-3,62%	36,46%	5,03%	16,70%	30,72%	16,45%	2,00%	9,381%	17,80%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-4,06%	38,54%	4,22%	21,56%	34,79%	20,74%	1,85%	7,688%	13,92%
CONSTÂNCIA BRASIL FI AÇÕES	-4,65%	30,36%	4,94%	20,87%	27,17%	-0,53%	2,00%	11,074%	23,05%
IDIV	-2,21%	61,93%	12,03%	38,53%	55,85%	4,69%	-	-	-
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	-6,63%	23,03%	-5,41%	8,95%	22,00%	16,36%	2,00%	8,010%	14,50%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CSHG BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	-0,08%	43,40%	4,93%	15,20%	-	-	0,60%	-	19,95%
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	-15,04%	-20,19%	-11,13%	-16,64%	-20,03%	-21,07%	0,00%	28,405%	35,17%
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	-	-	-	-	-	-	1,35%	-	0,00%

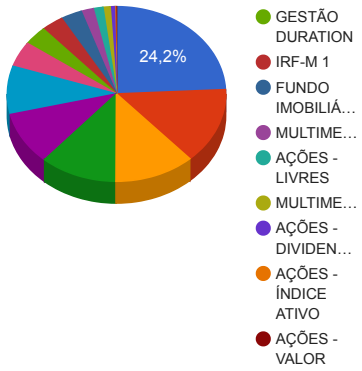
Crédito & Mercado Engenharia Financeira
Rua Tapinas, 22 - 5º Andar - São Paulo - SP - Telefone: (11) 3168-0053

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	137.005.024,29	42,25%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	60.469.627,83	18,65%
PLANNER CORRETORA	24.602.598,46	7,59%
BANCO BRADESCO	17.560.595,52	5,42%
CM Capital Markets DTVM	16.681.264,23	5,14%
Itaú Unibanco	11.366.491,01	3,51%
RJI CORRETORA DE VALORES	10.915.025,73	3,37%
Gradual Investimentos	10.590.344,45	3,27%
Elite Corretora	8.987.418,61	2,77%
BEM DTVM	7.700.864,04	2,37%
LIONS TRUST	6.386.230,62	1,97%
BNY Mellon Serviços Financeiros	5.890.270,36	1,82%
Orla DTVM	4.924.766,72	1,52%
Credit Suisse Hedging-Griffo Corretora	1.180.748,80	0,36%



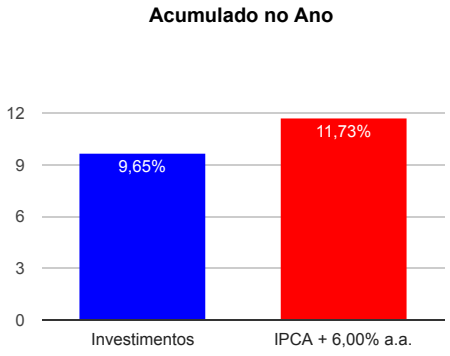
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	78.519.317,75	24,21%
IDKA IPCA 2A	45.653.142,54	14,08%
IMA-B 5	38.169.621,86	11,77%
CDI	36.876.675,83	11,37%
IMA-B 5+	31.678.962,48	9,77%
FIDC	28.911.813,51	8,92%
FIP	15.211.349,23	4,69%
GESTÃO DURATION	11.366.491,01	3,51%
IRF-M 1	10.668.039,93	3,29%
FUNDO IMOBILIÁRIO	10.168.167,41	3,14%
MULTIMERCADO - CRÉDITO PRIVADO	5.890.270,36	1,82%
AÇÕES - LIVRES	4.677.328,35	1,44%
MULTIMERCADO - MODERADO	3.446.554,72	1,06%
AÇÕES - DIVIDENDOS	2.014.531,55	0,62%
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	523.508,81	0,16%
AÇÕES - VALOR	485.495,33	0,15%

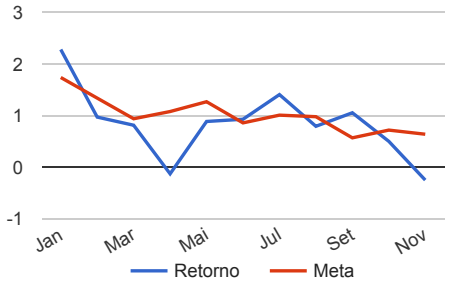


Crédito & Mercado Engenharia Financeira
Rua Tapinas, 22 - 5º Andar - São Paulo - SP - Telefone: (11) 3168-0053

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno ($)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	294.155.551,80	6.101.666,64	6.032.327,66	300.941.364,38	6.716.473,60	2,28%	1,74%	131,24%	3,00%
Fevereiro	300.941.364,38	4.968.148,77	8.590.258,37	300.245.158,57	2.925.903,79	0,97%	1,34%	72,33%	2,44%
Março	300.245.158,57	9.774.815,85	5.387.537,27	307.113.429,13	2.480.991,98	0,81%	0,94%	86,44%	2,17%
Abril	307.113.429,13	7.457.869,56	7.126.805,12	307.052.783,06	-391.710,51	-0,13%	1,08%	-11,84%	1,18%
Maio	307.052.783,06	4.737.090,47	4.517.657,61	309.998.524,44	2.726.308,52	0,89%	1,27%	69,83%	1,34%
Junho	309.998.524,44	38.600.661,48	38.486.350,55	312.997.734,82	2.884.899,45	0,93%	0,86%	107,95%	1,65%
Julho	312.997.734,82	5.338.706,27	4.889.817,99	317.861.011,67	4.414.388,57	1,41%	1,01%	139,54%	0,87%
Agosto	317.861.011,67	82.189.332,69	83.051.438,27	319.522.897,98	2.523.991,89	0,79%	0,98%	81,39%	1,29%
Setembro	319.522.897,98	5.583.582,80	5.284.251,12	323.199.076,52	3.376.846,86	1,06%	0,57%	186,17%	1,52%
Outubro	323.199.076,52	11.571.341,88	11.423.422,37	324.970.865,11	1.623.869,08	0,50%	0,72%	69,30%	1,96%
Novembro	324.970.865,11	3.906.157,00	3.807.339,78	324.261.270,67	-808.411,66	-0,25%	0,64%	-38,59%	3,56%
Acumulado no ano					28.473.551,57	9,65%	11,73%	82,22%	





Crédito & Mercado Engenharia Financeira
Rua Tapinas, 22 - 5º Andar - São Paulo - SP - Telefone: (11) 3168-0053

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(%)
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	4.842.909,51	0,00	0,00	4.924.766,72	81.857,21	1,69%	-	-17,06%
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	12.196.940,70	0,00	0,00	12.330.925,13	133.984,43	1,10%	0,86%	1,10%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.436.365,47	0,00	0,00	7.512.603,92	76.238,45	1,03%	0,12%	1,03%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.052.781,21	0,00	0,00	5.104.393,91	51.612,70	1,02%	0,00%	1,02%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	18.883.157,75	2.610.546,90	2.271.892,01	19.441.356,79	219.544,15	1,02%	0,03%	1,05%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.200.970,87	0,00	78.110,97	3.155.436,01	32.576,11	1,02%	0,12%	1,02%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	13.277.221,27	0,00	0,00	13.396.702,34	119.481,07	0,90%	-	-
TRX CORPORATIVO I FIDC SÊNIOR	10.502.426,48	0,00	0,00	10.590.344,45	87.917,97	0,84%	0,02%	0,84%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	15.289.979,43	0,00	0,00	15.377.252,23	87.272,80	0,57%	1,27%	0,57%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	30.114.707,96	0,00	0,00	30.275.890,31	161.182,35	0,54%	1,30%	0,54%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	23.879.859,51	0,00	0,00	23.970.034,24	90.174,73	0,38%	1,65%	0,38%
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	3.274.808,68	0,00	0,00	3.284.561,89	9.753,21	0,30%	1,69%	0,30%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	8.550.859,92	0,00	0,00	8.569.088,90	18.228,98	0,21%	1,91%	0,21%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.622.663,25	0,00	295.610,10	10.303.437,83	-23.615,32	-0,22%	3,66%	-0,18%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	11.392.475,20	0,00	0,00	11.366.491,01	-25.984,19	-0,23%	3,22%	-0,23%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	2.368.849,03	0,00	0,00	2.345.936,83	-22.912,20	-0,97%	2,26%	-0,97%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	45.625.250,75	0,00	0,00	45.093.527,65	-531.723,10	-1,17%	4,74%	-1,17%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	17.770.525,74	0,00	0,00	17.560.595,52	-209.930,22	-1,18%	4,67%	-1,18%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.632.553,15	0,00	0,00	5.561.756,75	-70.796,40	-1,26%	4,79%	-1,26%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.110.156,38	295.610,10	0,00	11.173.106,93	-232.659,55	-2,04%	6,20%	-2,13%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	20.935.227,17	0,00	0,00	20.505.855,55	-429.371,62	-2,05%	6,42%	-2,05%
			Total Renda Fixa		-377.168,44	-0,13%	2,79%	

Crédito & Mercado Engenharia Financeira
Rua Tapinas, 22 - 5º Andar - São Paulo - SP - Telefone: (11) 3168-0053

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(%)
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	3.401.079,69	0,00	0,00	3.446.554,72	45.475,03	1,34%	10,96%	1,34%
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	5.843.245,54	0,00	0,00	5.890.270,36	47.024,82	0,80%	0,54%	0,80%
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	7.517.032,01	0,00	1.153.460,50	6.386.230,62	22.659,11	0,30%	28,40%	-15,04%
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	7.851.595,32	1.000.000,00	0,00	8.825.118,61	-26.476,71	-0,30%	-	-
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	9.088.494,73	0,00	0,00	8.987.418,61	-101.076,12	-1,11%	-	-
CSHG BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	1.204.487,17	0,00	8.266,20	1.180.748,80	-15.472,17	-1,28%	-	-1,14%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	536.239,01	0,00	0,00	516.838,02	-19.400,99	-3,62%	9,38%	-3,62%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4.336.773,30	0,00	0,00	4.160.490,33	-176.282,97	-4,06%	7,69%	-4,06%
CONSTÂNCIA BRASIL FI AÇÕES	549.014,39	0,00	0,00	523.508,81	-25.505,58	-4,65%	11,07%	-4,65%
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.157.488,44	0,00	0,00	2.014.531,55	-142.956,89	-6,63%	8,01%	-6,63%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	524.726,08	0,00	0,00	485.495,33	-39.230,75	-7,48%	9,94%	-7,48%
			Total Renda Variável		-431.243,22	-1,00%	12,21%	

Crédito & Mercado Engenharia Financeira
Rua Tapinas, 22 - 5º Andar - São Paulo - SP - Telefone: (11) 3168-0053