

# Relatório Analítico dos Investimentos em agosto de 2016



Carteira consolidada de investimentos - base (agosto / 2016)

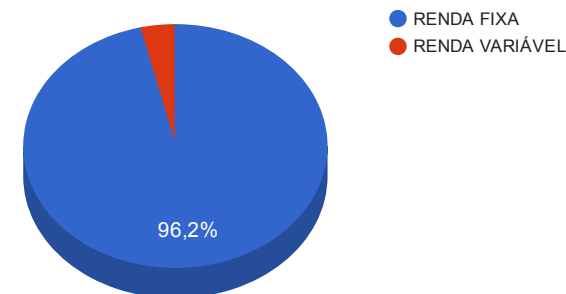
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	9.998.831,09	10,05%	601	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.697.605,83	7,74%	731	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	8.585.773,53	8,63%	753	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	1.605.957,47	1,61%	193	0,48%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.655.145,87	6,69%	631	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	4.297.586,80	4,32%	1.336	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	4.508.669,52	4,53%	298	0,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.031.156,42	3,05%	1.176	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	17.327.780,74	17,42%	88	1,79%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	3.914.961,37	3,94%	241	0,35%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	3.380.399,37	3,40%	326	0,15%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.322.453,23	5,35%	340	0,23%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.788.421,44	3,81%	808	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.429,79	0,00%	583	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.949.367,67	1,96%	384	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	8.651.033,24	8,70%	116	1,81%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2030	4.985.339,17	5,01%	34	2,64%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IPCA VI FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+0	08/11/2016	3.745.347,16	3,77%	17	3,83%	Artigo 8º, Inciso IV
<b>TOTAL -</b>			<b>99.447.259,71</b>				

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

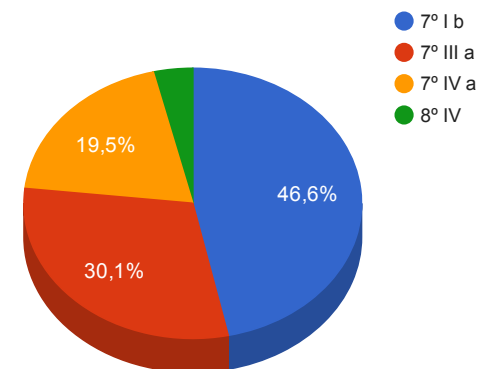
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	50,00%	46.380.726,53	46,64%	3.342.903,33
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	40,00%	29.945.594,71	30,11%	9.833.309,17
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	19.375.591,31	19,48%	10.458.586,60
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	4.972.362,99
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	4.972.362,99
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	4.972.362,99
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>135,00</b>	<b>95.701.912,55</b>	<b>96,23%</b>	

Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	10,00%	0,00	0,00%	9.944.725,97
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	3.745.347,16	3,77%	1.227.015,83
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	3,00%	0,00	0,00%	2.983.417,79
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	3,00%	0,00	0,00%	2.983.417,79
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>21,00</b>	<b>3.745.347,16</b>	<b>3,77%</b>	

**Distribuição por Segmento**



**Distribuição por Artigo / Resolução**



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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDKA IPCA 2 Anos	1,29%	10,97%	3,16%	5,69%	17,70%	31,48%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,28%	10,91%	3,19%	6,25%	17,70%	30,36%	0,20%	0,755%	3,06%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,22%	10,94%	3,23%	6,39%	17,78%	30,85%	0,20%	0,732%	2,94%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,69%	9,33%	3,13%	6,31%	16,22%	-	0,20%	0,552%	1,24%

Selic	1,22%	9,22%	3,53%	7,01%	14,15%	28,31%	-	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,22%	9,24%	3,57%	7,04%	14,18%	28,51%	0,20%	0,007%	0,02%

CDI	1,21%	9,21%	3,52%	7,00%	14,13%	28,23%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,25%	9,04%	3,49%	6,87%	14,01%	28,38%	0,20%	0,021%	0,17%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,16%	8,63%	3,42%	6,60%	13,22%	26,27%	1,00%	0,016%	0,08%

IRF-M 1	1,19%	9,83%	3,35%	6,89%	14,87%	28,36%	-	-	-
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1,18%	9,75%	3,28%	6,84%	14,59%	27,89%	0,20%	0,055%	0,75%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,17%	9,76%	3,30%	6,83%	14,74%	27,89%	0,20%	0,051%	0,45%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,16%	9,70%	3,26%	6,78%	14,60%	27,58%	0,10%	0,051%	0,47%

IMA-B 5	1,09%	11,35%	3,27%	6,50%	18,11%	31,19%	-	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,11%	11,25%	3,23%	6,45%	17,79%	30,28%	0,20%	0,823%	3,32%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1,10%	11,21%	3,22%	6,40%	17,90%	30,75%	0,10%	0,786%	3,32%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,07%	11,13%	3,21%	6,38%	17,61%	30,24%	0,20%	0,801%	3,29%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA + 6,00% ao ano	0,98%	9,60%	2,87%	6,29%	15,51%	34,14%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,09%	9,89%	3,12%	6,58%	15,49%	34,24%	0,20%	0,123%	0,32%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,78%	3,81%	0,19%	3,59%	9,17%	19,87%	0,20%	4,487%	4,06%
IMA-B	0,89%	20,11%	5,41%	15,26%	25,51%	29,04%	-	-	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,98%	19,70%	5,37%	14,95%	24,89%	28,27%	0,30%	1,894%	9,19%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	0,97%	19,34%	5,35%	14,94%	24,37%	28,43%	0,20%	1,795%	8,44%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,89%	19,92%	5,38%	15,20%	25,07%	28,34%	0,20%	1,899%	9,26%

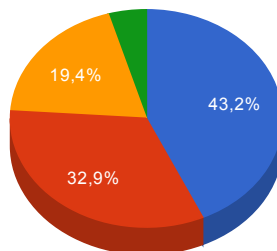
Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (agosto / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA + 6,00% ao ano	0,98%	9,60%	2,87%	6,29%	15,51%	34,14%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA VI FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1,08%	10,38%	3,23%	6,92%	15,33%	33,91%	0,20%	0,042%	0,35%

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

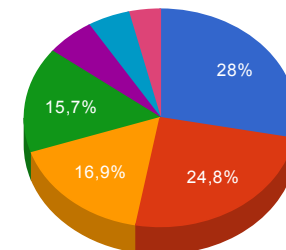
Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	42.957.963,72	43,20%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	32.703.478,06	32,89%
BANCO BRADESCO	19.277.148,41	19,38%
BANCO SANTANDER	4.508.669,52	4,53%

- BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM
- CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
- BANCO BRADESCO
- BANCO SANTANDER



Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	27.887.278,93	28,04%
IRF-M 1	24.656.523,96	24,79%
IDKA IPCA 2A	16.846.876,87	16,94%
IMA-B 5	15.586.674,72	15,67%
CDI	5.739.218,90	5,77%
IMA-B 5+	4.985.339,17	5,01%
MULTIMERCADO	3.745.347,16	3,77%

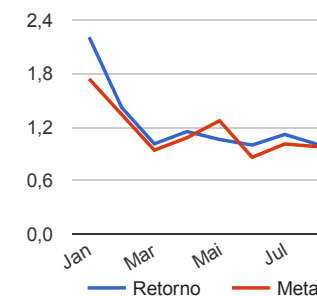
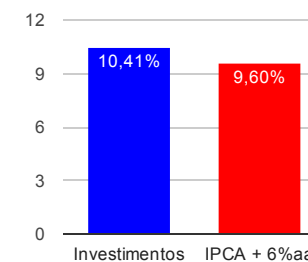
- IMA-B
- IRF-M 1
- IDKA IPCA 2A
- IMA-B 5
- CDI
- IMA-B 5+
- MULTIMERCADO



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	85.161.209,79	35.511,76	592.117,36	86.484.870,74	1.880.266,55	2,21%	1,74%	126,93%	1,02%
Fevereiro	86.484.870,74	3.639.002,55	3.229.408,41	88.126.166,16	1.231.701,28	1,42%	1,34%	105,45%	1,15%
Março	88.126.166,16	25.268.944,51	24.472.426,08	89.822.194,38	899.509,79	1,01%	0,94%	107,36%	0,64%
Abril	89.822.194,38	3.782.263,41	3.162.842,39	91.480.951,13	1.039.335,73	1,15%	1,08%	106,77%	0,44%
Mai	91.480.951,13	1.274.893,56	621.498,16	93.111.075,95	976.729,42	1,06%	1,27%	83,44%	0,52%
Junho	93.111.075,95	13.863.022,19	13.399.547,46	94.508.064,35	933.513,67	1,00%	0,86%	115,76%	0,56%
Julho	94.508.064,35	5.187.015,41	3.093.889,43	97.679.999,84	1.078.809,51	1,12%	1,01%	110,65%	0,41%
Agosto	97.679.999,84	11.573.710,79	10.796.429,41	99.447.259,71	989.978,49	1,01%	0,98%	103,07%	0,86%
Acumulado no ano					9.029.844,44	10,41%	9,60%	108,42%	

Acumulado no Ano





Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de agosto / 2016

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.477.063,88	0,00	0,00	8.585.773,53	108.709,65	1,28%	0,75%	1,28%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.741.502,39	0,00	0,00	3.788.421,44	46.919,05	1,25%	0,02%	1,25%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.925.909,87	0,00	0,00	1.949.367,67	23.457,80	1,22%	0,01%	1,22%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.575.192,84	0,00	0,00	6.655.145,87	79.953,03	1,22%	0,73%	1,22%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.247.678,56	0,00	0,00	4.297.586,80	49.908,24	1,17%	0,05%	1,17%
BRDESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	17.676.788,10	17.649,44	573.817,15	17.327.780,74	207.160,35	1,17%	0,05%	1,18%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.996.315,76	0,00	0,00	3.031.156,42	34.840,66	1,16%	0,05%	1,16%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.413,44	0,00	0,00	1.429,79	16,35	1,16%	0,02%	1,16%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.343.196,42	0,00	0,00	3.380.399,37	37.202,95	1,11%	0,82%	1,11%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	4.459.794,95	0,00	0,00	4.508.669,52	48.874,57	1,10%	0,79%	1,10%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.075.785,03	0,00	145.334,58	4.985.339,17	54.888,72	1,08%	4,49%	-1,78%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.804.072,72	0,00	248.022,96	8.651.033,24	94.983,48	1,08%	0,12%	1,09%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.616.276,00	0,00	0,00	7.697.605,83	81.329,83	1,07%	0,80%	1,07%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	5.128.769,70	145.364,08	0,00	5.322.453,23	48.319,45	0,92%	1,79%	0,97%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.348.397,28	0,00	9.829.254,72	1.605.957,47	86.814,91	0,76%	0,55%	0,69%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.556.379,32	1.333.419,59	0,00	3.914.961,37	25.162,46	0,65%	1,89%	0,98%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	10.077.277,68	0,00	9.998.831,09	-78.446,59	-0,78%	1,90%	0,89%
Total Renda Fixa					950.094,91	1,00%	0,89%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de agosto / 2016

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IPCA VI FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	3.705.463,58	0,00	0,00	3.745.347,16	39.883,58	1,08%	0,04%	1,08%
				Total Renda Variável	39.883,58	1,08%	0,04%	