

Relatório Analítico dos Investimentos em julho de 2016



Carteira consolidada de investimentos - base (julho / 2016)

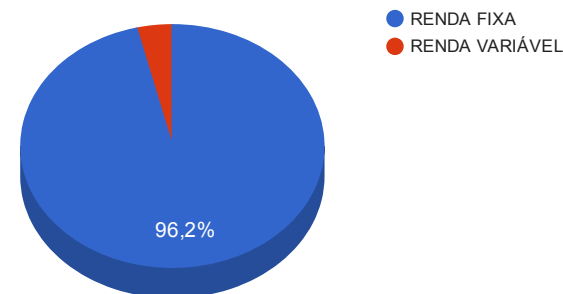
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	4.459.794,95	4,57%	294	0,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.575.192,84	6,73%	604	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.996.315,76	3,07%	1.170	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	11.348.397,28	11,62%	193	0,48%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	4.247.678,56	4,35%	1.325	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.616.276,00	7,80%	707	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	8.477.063,88	8,68%	744	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.556.379,32	2,62%	235	0,26%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	3.343.196,42	3,42%	301	0,18%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	17.676.788,10	18,10%	90	1,65%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.128.769,70	5,25%	335	0,22%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	8.804.072,72	9,01%	116	1,81%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.925.909,87	1,97%	382	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.741.502,39	3,83%	811	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2030	5.075.785,03	5,20%	34	2,64%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.413,44	0,00%	576	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IPCA VI FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+0	08/11/2016	3.705.463,58	3,79%	17	3,83%	Artigo 8º, Inciso IV
TOTAL -			97.679.999,84				

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

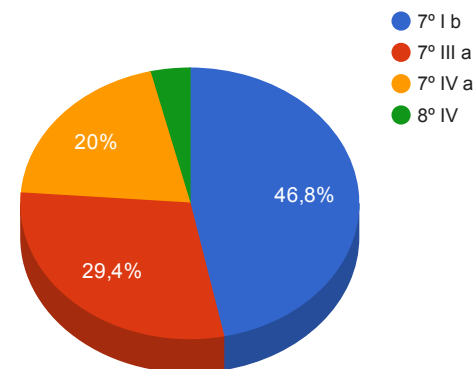
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	50,00%	45.720.719,27	46,81%	3.119.280,65
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	40,00%	28.705.133,54	29,39%	10.366.866,40
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	19.548.683,45	20,01%	9.755.316,50
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	4.883.999,99
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	4.883.999,99
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	4.883.999,99
Total Renda Fixa	100,00%	135,00	93.974.536,26	96,21%	

Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	10,00%	0,00	0,00%	9.767.999,98
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	3.705.463,58	3,79%	1.178.536,41
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	3,00%	0,00	0,00%	2.930.400,00
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	3,00%	0,00	0,00%	2.930.400,00
Total Renda Variável	30,00%	21,00	3.705.463,58	3,79%	

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	2,51%	19,06%	4,38%	16,82%	20,53%	34,07%	-	-	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,46%	18,53%	4,20%	16,35%	19,89%	33,13%	0,30%	1,867%	9,50%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	2,39%	18,20%	4,36%	16,28%	19,54%	32,81%	0,20%	1,829%	8,74%
IMA-B 5	1,21%	10,15%	2,97%	6,97%	16,28%	31,52%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,19%	9,96%	2,91%	6,84%	15,77%	30,58%	0,20%	0,670%	3,40%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,18%	10,02%	2,90%	6,87%	15,88%	30,56%	0,20%	0,685%	3,42%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	1,17%	10,01%	2,90%	6,85%	16,06%	31,04%	0,10%	0,672%	3,43%
Selic	1,11%	7,91%	3,42%	6,78%	14,03%	27,87%	-	-	-
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,13%	7,93%	3,47%	6,80%	14,06%	28,07%	0,20%	0,015%	0,02%
CDI	1,11%	7,90%	3,41%	6,78%	14,01%	27,78%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,13%	7,69%	3,37%	6,57%	13,85%	27,91%	0,20%	0,011%	0,17%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,05%	7,39%	3,33%	6,34%	13,09%	25,82%	1,00%	0,011%	0,08%
IRF-M 1	1,04%	8,53%	3,22%	6,78%	14,68%	27,91%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,03%	8,49%	3,17%	6,75%	14,55%	27,44%	0,20%	0,110%	0,47%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,03%	8,44%	3,13%	6,71%	14,41%	27,14%	0,10%	0,111%	0,49%
BRDESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1,01%	8,47%	3,17%	6,71%	14,48%	27,45%	0,20%	0,110%	0,76%
IPCA + 6,00% ao ano	1,01%	8,54%	3,17%	6,68%	15,21%	33,82%	-	-	-

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,87%	8,70%	3,25%	7,13%	15,28%	33,53%	0,20%	0,024%	0,32%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,87%	5,70%	3,28%	4,13%	8,95%	19,14%	0,20%	0,027%	4,10%
IDKA IPCA 2 Anos	0,91%	9,56%	2,49%	5,59%	15,90%	31,44%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,13%	8,58%	3,79%	6,65%	15,79%	-	0,20%	0,118%	1,27%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,11%	9,61%	2,80%	6,55%	16,02%	30,88%	0,20%	0,697%	3,03%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,06%	9,50%	2,65%	6,30%	15,78%	30,31%	0,20%	0,748%	3,15%

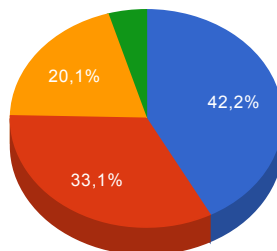
Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (julho / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA + 6,00% ao ano	1,01%	8,54%	3,17%	6,68%	15,21%	33,82%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA VI FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	0,83%	9,20%	3,27%	7,70%	15,38%	33,17%	0,20%	0,004%	0,35%

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

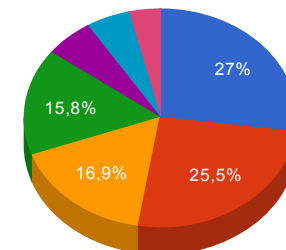
Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	41.268.341,21	42,25%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	32.349.165,71	33,12%
BANCO BRADESCO	19.602.697,97	20,07%
BANCO SANTANDER	4.459.794,95	4,57%

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



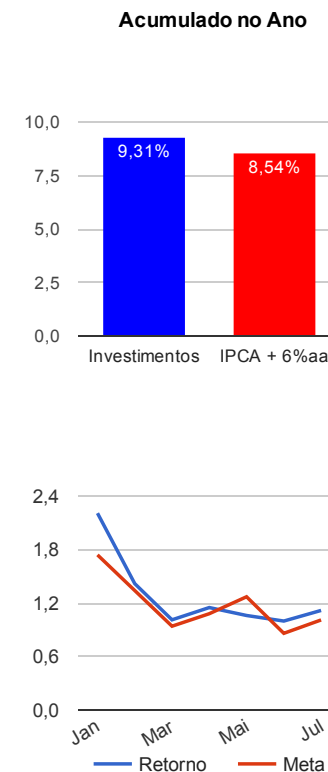
Sub-segmento	Valor	%
IDKA IPCA 2A	26.400.654,00	27,03%
IRF-M 1	24.920.782,42	25,51%
IMA-B	16.489.221,74	16,88%
IMA-B 5	15.419.267,37	15,79%
CDI	5.668.825,70	5,80%
IMA-B 5+	5.075.785,03	5,20%
MULTIMERCADO	3.705.463,58	3,79%

- IDKA IPCA 2A
- IRF-M 1
- IMA-B
- 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%
Acumulado no ano					8.039.865,95	9,31%	8,54%	109,00%	



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	5.009.101,12	0,00	0,00	5.128.769,70	119.668,58	2,39%	1,83%	2,39%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.524.955,01	1.693,80	0,00	7.616.276,00	89.627,19	1,19%	0,67%	1,19%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.304.356,01	0,00	0,00	3.343.196,42	38.840,41	1,18%	0,69%	1,18%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	4.408.052,49	0,00	0,00	4.459.794,95	51.742,46	1,17%	0,67%	1,17%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.221.354,42	0,00	0,00	11.348.397,28	127.042,86	1,13%	0,12%	1,13%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.631.728,40	67.991,84	0,00	3.741.502,39	41.782,15	1,13%	0,01%	1,13%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.411.077,46	53.472,08	565.388,03	1.925.909,87	26.748,36	1,09%	0,01%	1,13%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.388.457,78	0,00	0,00	8.477.063,88	88.606,10	1,06%	0,75%	1,06%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.398,70	0,00	0,00	1.413,44	14,74	1,05%	0,01%	1,05%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.204.311,20	0,00	0,00	4.247.678,56	43.367,36	1,03%	0,11%	1,03%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.965.829,63	0,00	0,00	2.996.315,76	30.486,13	1,03%	0,11%	1,03%
BRDESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	17.499.540,53	0,00	0,00	17.676.788,10	177.247,57	1,01%	0,11%	1,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.728.094,09	0,00	0,00	8.804.072,72	75.978,63	0,87%	0,02%	0,87%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.031.988,37	0,00	0,00	5.075.785,03	43.796,66	0,87%	0,03%	0,87%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	2.535.385,79	0,00	2.556.379,32	20.993,53	0,83%	1,87%	2,46%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.502.931,91	2.528.471,90	2.528.501,40	6.575.192,84	72.290,43	0,80%	0,70%	1,11%
Total Renda Fixa					1.048.233,16	1,13%	0,43%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de julho / 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	3.674.887,23	0,00	0,00	3.705.463,58	30.576,35	0,83%	0,00%	0,83%
				Total Renda Variável	30.576,35	0,83%	0,00%	