

Relatório Analítico dos Investimentos em julho de 2016



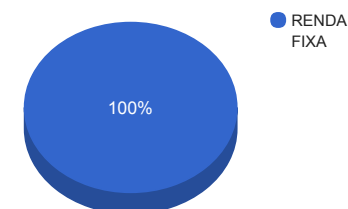
Carteira consolidada de investimentos - base (julho / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2030	2.688.446,00	14,00%	18	5,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.018.506,77	10,51%	744	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.509.261,91	28,70%	1.325	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.197.806,27	6,24%	1.170	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.427.132,82	7,43%	707	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.834.885,95	9,56%	294	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.405.433,60	7,32%	33	1,96%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	981.755,05	5,11%	3.413	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	1.907.545,67	9,94%	143	0,19%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	226.416,85	1,18%	811	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
		TOTAL -	19.197.190,89				

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

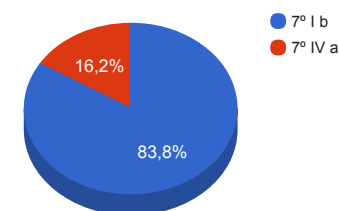
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	90,00%	16.081.473,32	83,77%	1.195.998,48
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	20,00%	0,00	0,00%	3.839.438,18
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	3.115.717,57	16,23%	2.643.439,70
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	959.859,54
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	959.859,54
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	959.859,54
Total Renda Fixa	100,00%	155,00	19.197.190,89	100,00%	

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	5,00%	0,00	0,00%	959.859,54
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	10,00%	0,00	0,00%	1.919.719,09
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	959.859,54
Total Renda Variável	30,00%	20,00	0,00	0,00%	

Distribuição por Artigo / Resolução

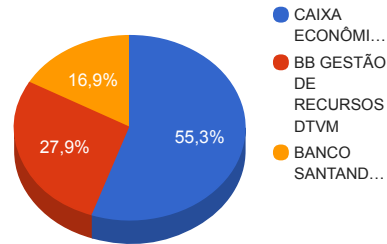


Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (julho / 2016)

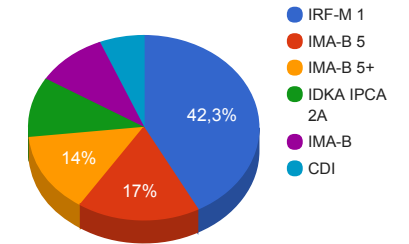
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	2,51%	19,06%	4,38%	16,82%	20,53%	34,07%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,52%	20,63%	5,22%	17,81%	16,27%	21,08%	0,20%	2,508%	13,64%
IMA-B 5	1,21%	10,15%	2,97%	6,97%	16,28%	31,52%	-	-	-
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%
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%
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%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,11%	7,94%	3,42%	6,83%	14,12%	28,12%	0,25%	0,014%	0,08%
IRF-M 1	1,04%	8,53%	3,22%	6,78%	14,68%	27,91%	-	-	-
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1,06%	8,33%	3,19%	6,63%	14,27%	26,91%	0,40%	0,165%	0,50%
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%
IPCA + 6,00% ao ano	1,01%	8,54%	3,17%	6,68%	15,21%	33,82%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,90%	8,92%	3,30%	7,27%	15,62%	34,22%	0,20%	0,025%	0,34%
IDKA IPCA 2 Anos	0,91%	9,56%	2,49%	5,59%	15,90%	31,44%	-	-	-
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%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	10.606.595,78	55,25%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	5.350.275,56	27,87%
BANCO SANTANDER	3.240.319,55	16,88%



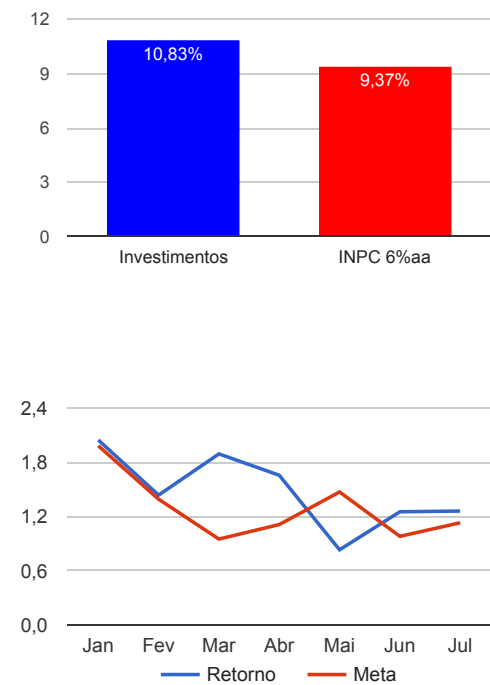
Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	8.112.501,78	42,26%
IMA-B 5	3.262.018,77	16,99%
IMA-B 5+	2.688.446,00	14,00%
IDKA IPCA 2A	2.018.506,77	10,51%
IMA-B	1.907.545,67	9,94%
CDI	1.208.171,90	6,29%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	17.336.482,72	0,00	0,00	17.690.837,97	354.355,25	2,04%	1,98%	103,20%	1,07%
Fevereiro	17.690.837,97	125.890,52	125.890,52	17.944.753,54	253.915,57	1,44%	1,39%	102,93%	1,33%
Março	17.944.753,54	0,00	0,00	18.284.026,30	339.272,76	1,89%	0,95%	198,55%	1,86%
Abril	18.284.026,30	0,00	0,00	18.586.586,58	302.560,28	1,65%	1,11%	149,55%	1,15%
Mai	18.586.586,58	0,00	47.000,00	18.694.112,92	154.526,34	0,83%	1,47%	56,50%	1,27%
Junho	18.694.112,92	40.000,00	10.000,00	18.958.446,66	234.333,74	1,25%	0,98%	127,39%	0,75%
Julho	18.958.446,66	0,00	0,00	19.197.190,89	238.744,23	1,26%	1,13%	111,46%	0,60%
Acumulado no ano					1.877.708,17	10,83%	9,37%	115,63%	

Acumulado no Ano



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 BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.622.370,00	0,00	0,00	2.688.446,00	66.076,00	2,52%	2,51%	2,52%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.410.337,50	0,00	0,00	1.427.132,82	16.795,32	1,19%	0,67%	1,19%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	1.813.597,65	0,00	0,00	1.834.885,95	21.288,30	1,17%	0,67%	1,17%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	223.886,19	0,00	0,00	226.416,85	2.530,66	1,13%	0,01%	1,13%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	970.934,09	0,00	0,00	981.755,05	10.820,96	1,11%	0,01%	1,11%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1.390.726,49	0,00	0,00	1.405.433,60	14.707,11	1,06%	0,16%	1,06%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.997.408,42	0,00	0,00	2.018.506,77	21.098,35	1,06%	0,75%	1,06%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.453.014,25	0,00	0,00	5.509.261,91	56.247,66	1,03%	0,11%	1,03%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.185.619,15	0,00	0,00	1.197.806,27	12.187,12	1,03%	0,11%	1,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.890.552,92	0,00	0,00	1.907.545,67	16.992,75	0,90%	0,02%	0,90%
Total Renda Fixa					238.744,23	1,26%	0,60%	