

# Relatório Analítico dos Investimentos em agosto de 2016



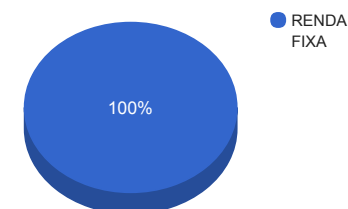
Carteira consolidada de investimentos - base (agosto / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.442.372,36	7,42%	731	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.211.734,16	6,24%	1.176	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.573.993,19	28,69%	1.336	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.044.392,04	10,52%	753	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2030	2.656.450,00	13,67%	18	5,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.421.927,14	7,32%	33	2,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.854.994,34	9,55%	298	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.065.917,02	5,49%	3.549	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	283.861,06	1,46%	808	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	1.874.346,16	9,65%	143	0,19%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
		<b>TOTAL -</b>	<b>19.429.987,47</b>				

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

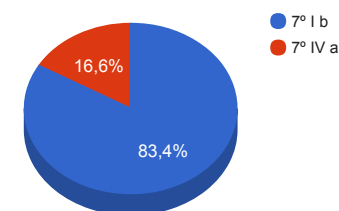
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	90,00%	16.205.863,23	83,41%	1.281.125,49
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	20,00%	0,00	0,00%	3.885.997,49
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	3.224.124,24	16,59%	2.604.872,00
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	971.499,37
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	971.499,37
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	971.499,37
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>155,00</b>	<b>19.429.987,47</b>	<b>100,00%</b>	

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%	971.499,37
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	10,00%	0,00	0,00%	1.942.998,75
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	971.499,37
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>20,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	

Distribuição por Artigo / Resolução

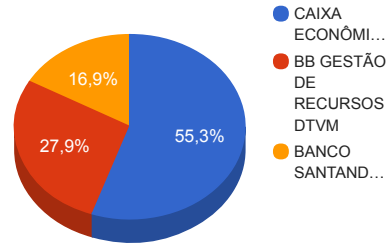


Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (agosto / 2016)

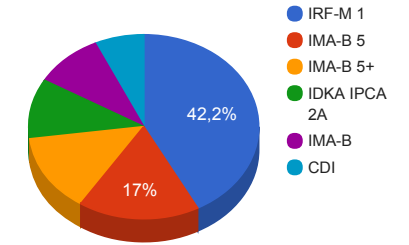
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDKA IPCA 2 Anos	1,29%	10,97%	3,16%	5,69%	17,70%	31,48%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,28%	10,91%	3,19%	6,25%	17,70%	30,36%	0,20%	0,755%	3,06%
CDI	1,21%	9,21%	3,52%	7,00%	14,13%	28,23%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,25%	9,04%	3,49%	6,87%	14,01%	28,38%	0,20%	0,021%	0,17%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,21%	9,25%	3,53%	7,05%	14,20%	28,55%	0,25%	0,017%	0,07%
IRF-M 1	1,19%	9,83%	3,35%	6,89%	14,87%	28,36%	-	-	-
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%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1,17%	9,61%	3,37%	6,75%	14,47%	27,38%	0,40%	0,119%	0,49%
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%	-	-	-
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS 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%
IPCA + 6,00% ao ano	0,98%	9,60%	2,87%	6,29%	15,51%	34,14%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,13%	10,15%	3,20%	6,73%	15,90%	34,89%	0,20%	0,130%	0,34%
IMA-B	0,89%	20,11%	5,41%	15,26%	25,51%	29,04%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,19%	19,19%	4,07%	17,02%	23,46%	15,44%	0,20%	4,805%	13,35%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	10.738.732,57	55,27%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	5.414.333,42	27,87%
BANCO SANTANDER	3.276.921,48	16,87%



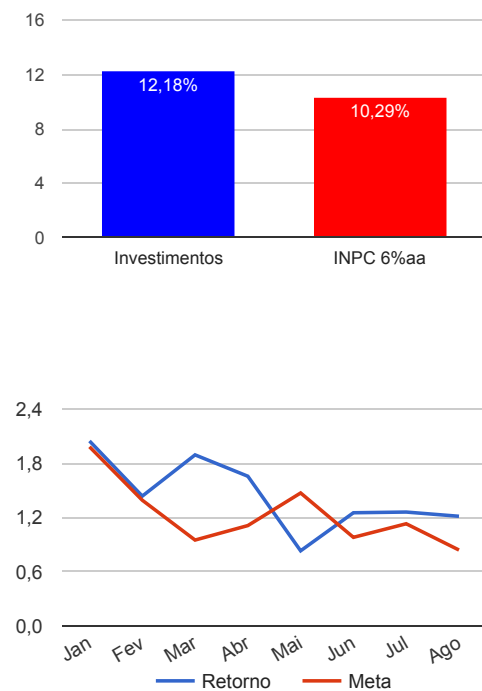
Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	8.207.654,49	42,24%
IMA-B 5	3.297.366,70	16,97%
IMA-B 5+	2.656.450,00	13,67%
IDKA IPCA 2A	2.044.392,04	10,52%
IMA-B	1.874.346,16	9,65%
CDI	1.349.778,08	6,95%



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%
Agosto	19.197.190,89	126.446,50	126.446,50	19.429.987,47	232.796,58	1,21%	0,84%	143,53%	0,91%
Acumulado no ano					2.110.504,75	12,18%	10,29%	118,30%	

**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(%)
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.688.446,00	0,00	72.044,02	2.656.450,00	40.048,02	1,49%	4,80%	-1,19%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.018.506,77	0,00	0,00	2.044.392,04	25.885,27	1,28%	0,75%	1,28%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.509.261,91	0,00	0,00	5.573.993,19	64.731,28	1,17%	0,05%	1,17%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1.405.433,60	0,00	0,00	1.421.927,14	16.493,54	1,17%	0,12%	1,17%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.197.806,27	0,00	0,00	1.211.734,16	13.927,89	1,16%	0,05%	1,16%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	981.755,05	72.044,02	0,00	1.065.917,02	12.117,95	1,15%	0,02%	1,21%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.907.545,67	0,00	54.402,48	1.874.346,16	21.202,97	1,11%	0,13%	1,13%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	1.834.885,95	0,00	0,00	1.854.994,34	20.108,39	1,10%	0,79%	1,10%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	226.416,85	54.402,48	0,00	283.861,06	3.041,73	1,08%	0,02%	1,25%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.427.132,82	0,00	0,00	1.442.372,36	15.239,54	1,07%	0,80%	1,07%
Total Renda Fixa					232.796,58	1,21%	0,91%	