

Relatório Analítico dos Investimentos em agosto de 2016



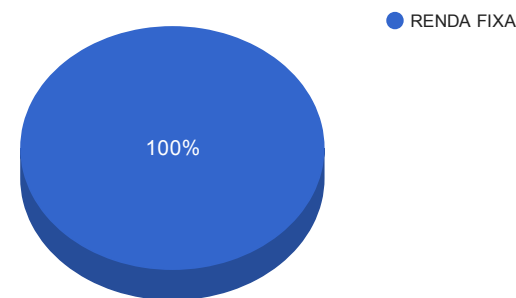
Carteira consolidada de investimentos - base (agosto / 2016)

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 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.259.221,17	10,94%	716	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.032.115,72	5,00%	157	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	3.563.948,04	17,25%	601	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.340.838,85	6,49%	1.176	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	4.599.071,07	22,27%	1.336	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.537.351,13	12,28%	753	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	1.195.438,68	5,79%	326	0,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.135.673,98	5,50%	763	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.992.154,72	14,49%	808	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TOTAL -			20.655.813,36				

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

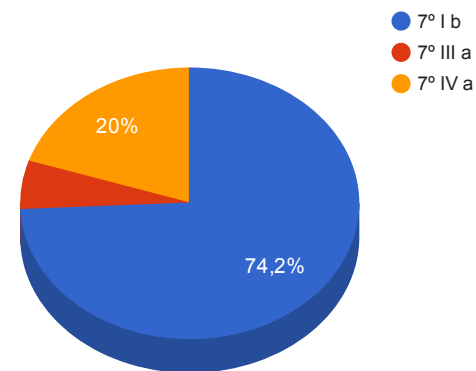
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	100,00%	15.332.545,98	74,23%	5.323.267,38
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	30,00%	1.195.438,68	5,79%	5.001.305,33
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	4.127.828,70	19,98%	2.068.915,31
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	80,00%	10,00%	0,00	0,00%	2.065.581,34
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	30,00%	10,00%	0,00	0,00%	2.065.581,34
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	10,00%	0,00	0,00%	2.065.581,34
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.032.790,67
Total Renda Fixa	100,00%	195,00	20.655.813,36	100,00%	

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	10,00%	0,00	0,00%	2.065.581,34
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	0,00	0,00%	3.098.372,00
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.032.790,67
Total Renda Variável	30,00%	30,00	0,00	0,00%	

Distribuição por Artigo / Resolução



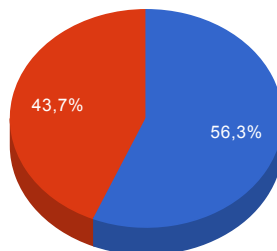
Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (agosto / 2016)

	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 BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,21%	9,21%	3,51%	7,02%	14,14%	28,35%	0,20%	0,008%	0,06%
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%
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%
IRF-M	0,98%	17,01%	4,49%	12,10%	18,72%	27,21%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,99%	16,93%	4,39%	12,14%	18,34%	26,49%	0,20%	0,968%	4,07%
IMA-B	0,89%	20,11%	5,41%	15,26%	25,51%	29,04%	-	-	-
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%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,83%	19,82%	5,32%	15,12%	24,30%	26,87%	0,20%	1,871%	9,20%

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

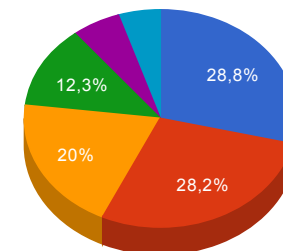
Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	11.629.731,42	56,30%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	9.026.081,94	43,70%

● BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM
● CAIXA ECONÔMICA FEDERAL



Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	5.939.909,92	28,76%
IMA-B	5.823.169,21	28,19%
CDI	4.127.828,70	19,98%
IDKA IPCA 2A	2.537.351,13	12,28%
IMA-B 5	1.195.438,68	5,79%
IRF-M	1.032.115,72	5,00%

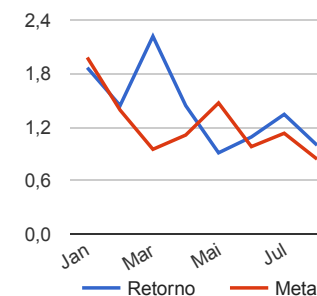
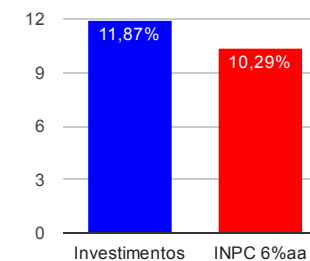
● IRF-M 1
● IMA-B
● CDI
● IDKA IPCA 2A
● IMA-B 5
● IRF-M



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	17.381.863,81	198.245,05	346.571,88	17.557.828,89	324.291,91	1,87%	1,98%	94,20%	1,02%
Fevereiro	17.557.828,89	589.552,56	98.394,09	18.309.058,72	260.071,36	1,44%	1,39%	103,33%	1,13%
Março	18.309.058,72	5.777.636,67	5.510.993,56	18.987.665,34	411.963,51	2,22%	0,95%	232,90%	1,06%
Abril	18.987.665,34	0,00	107.756,99	19.153.208,95	273.300,60	1,44%	1,11%	130,08%	0,69%
Mai	19.153.208,95	426.682,90	1.320.784,77	18.433.502,34	174.395,26	0,91%	1,47%	61,88%	0,64%
Junho	18.433.502,34	2.749.557,64	1.652.310,26	19.743.304,30	212.554,58	1,09%	0,98%	110,78%	0,78%
Julho	19.743.304,30	424.637,17	116.398,84	20.320.689,37	269.146,74	1,34%	1,13%	118,80%	0,57%
Agosto	20.320.689,37	2.845.202,28	2.713.815,24	20.655.813,36	203.736,95	1,00%	0,84%	117,91%	0,74%
Acumulado no ano					2.129.460,91	11,87%	10,29%	115,30%	

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 FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.122.129,08	0,00	0,00	1.135.673,98	13.544,90	1,21%	0,01%	1,21%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.263.431,54	245.202,28	0,00	2.537.351,13	28.717,31	1,14%	0,75%	1,28%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.552.414,67	0,00	600.000,00	2.992.154,72	39.740,05	1,12%	0,02%	1,25%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.182.282,34	0,00	0,00	1.195.438,68	13.156,34	1,11%	0,82%	1,11%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.537.461,56	0,00	1.000.000,00	4.599.071,07	61.609,51	1,11%	0,05%	1,17%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.022.013,91	0,00	0,00	1.032.115,72	10.101,81	0,99%	0,97%	0,99%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.836.494,85	600.000,00	1.113.815,24	1.340.838,85	18.159,24	0,75%	0,05%	1,16%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.546.999,63	1.000.000,00	0,00	3.563.948,04	16.948,41	0,48%	1,90%	0,89%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.257.461,79	1.000.000,00	0,00	2.259.221,17	1.759,38	0,08%	1,87%	0,83%
Total Renda Fixa					203.736,95	1,00%	0,74%	