

Relatório Analítico dos Investimentos em agosto de 2017



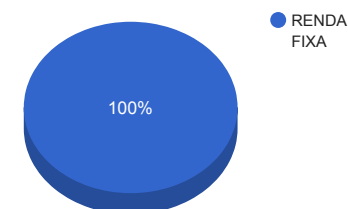
Carteira consolidada de investimentos - base (agosto / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.367.811,29	6,09%	1.211	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.452.628,03	6,47%	28	2,48%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2030	2.886.276,00	12,86%	18	5,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	6.296.330,12	28,05%	1.381	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.522.473,28	11,24%	711	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.315.902,79	10,32%	707	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	2.042.375,39	9,10%	355	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.194.635,13	5,32%	6.655	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	1.934.829,58	8,62%	143	0,19%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	432.776,33	1,93%	766	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
		TOTAL -	22.446.037,94				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (agosto / 2017)

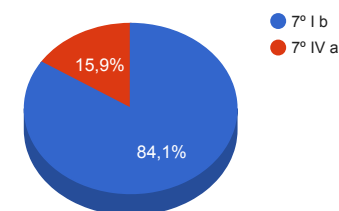
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	18.883.796,90	84,13%	30,00%	50,00%	85,00%	195.335,35
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	0,00	0,00%	15,00%	20,00%	60,00%	13.467.622,76
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	3.562.241,04	15,87%	5,00%	5,00%	30,00%	3.171.570,34
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	3.366.905,69
Total Renda Fixa	100,00%	22.446.037,94	100,00%	55,00	85,00	190,00	-

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	3.366.905,69
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	1.122.301,90
Total Renda Variável	30,00%	0,00	0,00%	7,00	15,00	20,00	-

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: agosto / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	18.883.796,90	84,13%	30,00%	85,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	3.562.241,04	15,87%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	0,00	0,00%	5,00%	15,00%
Total Renda Fixa	22.446.037,94	100,00%	55,00	190,00

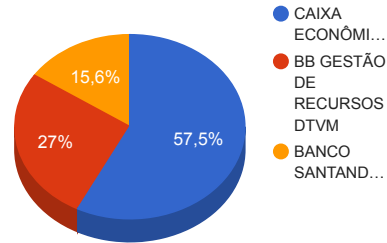
Artigos - Renda Variável	Base: agosto / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Total Renda Variável	0,00	0,00%	7,00	20,00

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (agosto / 2017)

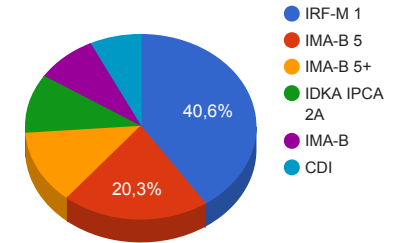
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	1,34%	11,14%	5,57%	5,06%	15,49%	44,95%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,09%	5,36%	3,09%	1,23%	8,65%	34,14%	0,20%	4,006%	12,19%
IMA-B 5	1,25%	9,83%	4,68%	6,98%	13,91%	34,53%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,24%	9,71%	4,63%	6,90%	13,72%	33,75%	0,20%	0,717%	3,64%
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1,24%	9,68%	4,62%	6,86%	13,68%	34,03%	0,10%	0,721%	3,64%
IDKA IPCA 2 Anos	0,97%	10,12%	4,34%	7,49%	14,33%	34,57%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,98%	9,35%	4,08%	6,76%	13,28%	33,34%	0,20%	0,487%	2,90%
IRF-M 1	0,90%	8,33%	2,86%	5,88%	13,15%	29,98%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,89%	8,21%	2,82%	5,81%	12,96%	29,61%	0,20%	0,081%	0,67%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,88%	8,17%	2,83%	5,78%	12,88%	29,36%	0,10%	0,081%	0,68%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	0,86%	8,14%	2,80%	5,73%	12,80%	29,12%	0,40%	0,083%	0,67%
CDI	0,80%	7,34%	2,43%	5,28%	12,05%	27,88%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,79%	7,40%	2,43%	5,30%	12,17%	27,88%	0,20%	0,003%	0,11%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,78%	7,35%	2,41%	5,28%	12,08%	27,99%	0,25%	0,004%	0,11%
IPCA + 6,00% ao ano	0,72%	5,65%	1,72%	3,93%	8,58%	25,42%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,97%	6,15%	1,93%	4,37%	9,32%	26,71%	0,20%	0,182%	0,30%

Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (agosto / 2017)

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	12.899.714,53	57,47%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	6.051.319,99	26,96%
BANCO SANTANDER	3.495.003,42	15,57%



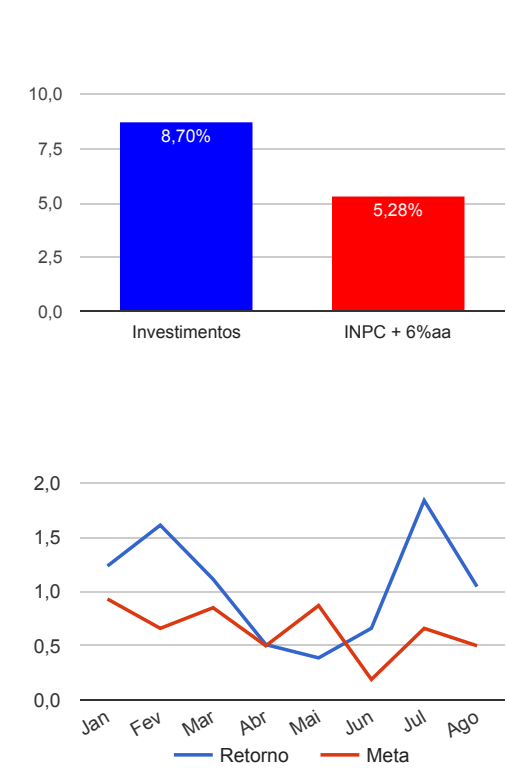
Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	9.116.769,44	40,62%
IMA-B 5	4.564.848,67	20,34%
IMA-B 5+	2.886.276,00	12,86%
IDKA IPCA 2A	2.315.902,79	10,32%
IMA-B	1.934.829,58	8,62%
CDI	1.627.411,46	7,25%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	19.993.242,62	350.000,00	0,00	20.594.264,51	251.021,89	1,23%	0,93%	132,38%	0,98%
Fevereiro	20.594.264,51	0,00	129.733,56	20.796.033,87	331.502,92	1,61%	0,66%	244,61%	1,11%
Março	20.796.033,87	359.733,56	13.000,00	21.378.048,81	235.281,38	1,11%	0,85%	130,16%	0,58%
Abril	21.378.048,81	0,00	0,00	21.487.209,25	109.160,44	0,51%	0,50%	102,66%	0,52%
Mai	21.487.209,25	0,00	0,00	21.570.657,98	83.448,73	0,39%	0,87%	44,55%	3,78%
Junho	21.570.657,98	0,00	0,00	21.713.287,92	142.629,94	0,66%	0,19%	356,85%	0,71%
Julho	21.713.287,92	100.000,00	0,00	22.213.948,59	400.660,67	1,84%	0,66%	279,32%	0,77%
Agosto	22.213.948,59	130.936,93	130.925,58	22.446.037,94	232.078,00	1,04%	0,50%	207,67%	0,76%
Acumulado no ano					1.785.783,97	8,70%	5,28%	164,96%	

Acumulado no Ano



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de agosto / 2017

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	2.918.202,00	0,00	74.936,93	2.886.276,00	43.010,93	1,47%	4,01%	-1,09%
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	2.017.442,54	0,00	0,00	2.042.375,39	24.932,85	1,24%	0,72%	1,24%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.417.049,44	74.936,93	0,00	2.522.473,28	30.486,91	1,22%	0,72%	1,24%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.293.329,16	0,00	0,00	2.315.902,79	22.573,63	0,98%	0,49%	0,98%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.972.027,78	0,00	55.988,65	1.934.829,58	18.790,45	0,95%	0,18%	0,97%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.240.807,87	0,00	0,00	6.296.330,12	55.522,25	0,89%	0,08%	0,89%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.355.913,50	0,00	0,00	1.367.811,29	11.897,79	0,88%	0,08%	0,88%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1.440.198,80	0,00	0,00	1.452.628,03	12.429,23	0,86%	0,08%	0,86%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.185.336,54	0,00	0,00	1.194.635,13	9.298,59	0,78%	0,00%	0,78%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	373.640,96	56.000,00	0,00	432.776,33	3.135,37	0,73%	0,00%	0,79%
				Total Renda Fixa	232.078,00	1,04%	0,76%	