

# Relatório Analítico dos Investimentos em agosto de 2017



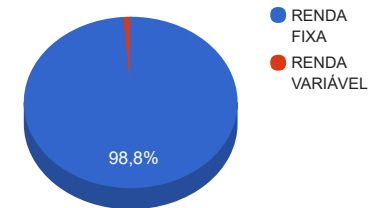
Carteira consolidada de investimentos - base (agosto / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
TÍTULOS PÚBLICOS			4.608.374,66	11,56%			Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.991.102,78	22,56%	754	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.249.091,93	3,13%	28	2,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	132.577,64	0,33%	193	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	773.770,63	1,94%	1.381	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.594.193,57	4,00%	610	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	166.667,44	0,42%	205	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	4.390.183,41	11,01%	1.211	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.269.970,70	10,71%	711	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	476.238,59	1,19%	276	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.109.783,96	10,31%	601	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADERCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	149.270,90	0,37%	85	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	114.958,73	0,29%	56	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.607.695,64	4,03%	771	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	3.013.967,36	7,56%	534	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	16.262,65	0,04%	65	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	D+3	Não há	2.737.810,63	6,87%	352	1,28%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	972.268,76	2,44%	221	0,30%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER PETROBRÁS PLUS FIC AÇÕES	D+4	Não há	488.198,94	1,22%	1.794	1,57%	Artigo 8º, Inciso III
		<b>TOTAL -</b>	<b>39.862.388,92</b>				

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

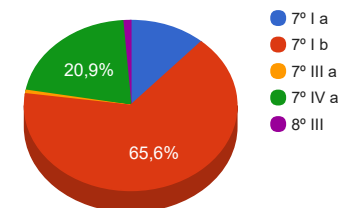
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	4.608.374,66	11,56%	0,00%	12,00%	12,00%	175.112,01
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	26.153.580,65	65,61%	30,00%	38,00%	90,00%	9.722.569,38
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	264.229,63	0,66%	1,00%	20,00%	60,00%	23.653.203,72
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	8.348.005,04	20,94%	5,00%	5,00%	30,00%	3.610.711,64
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	5.979.358,34
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>39.374.189,98</b>	<b>98,78%</b>	<b>41,00</b>	<b>85,00</b>	<b>217,00</b>	<b>-</b>

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	488.198,94	1,22%	1,00%	10,00%	15,00%	5.491.159,40
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	1.993.119,45
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>488.198,94</b>	<b>1,22%</b>	<b>3,00</b>	<b>15,00</b>	<b>20,00</b>	<b>-</b>

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 " a "	4.608.374,66	11,56%	0,00%	12,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	26.153.580,65	65,61%	30,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	264.229,63	0,66%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	8.348.005,04	20,94%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	0,00	0,00%	5,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>39.374.189,98</b>	<b>98,78%</b>	<b>55,00</b>	<b>197,00</b>

Artigos - Renda Variável	Base: agosto / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso III	488.198,94	1,22%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>488.198,94</b>	<b>1,22%</b>	<b>7,00</b>	<b>20,00</b>

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 5+	1,36%	11,93%	6,04%	4,21%	16,45%	51,77%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,33%	11,73%	5,93%	4,17%	16,18%	50,38%	0,20%	2,644%	12,76%
IMA-B	1,34%	11,14%	5,57%	5,06%	15,49%	44,95%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,33%	11,00%	5,51%	4,97%	15,39%	43,43%	0,20%	1,813%	9,83%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,32%	10,97%	5,49%	4,92%	15,22%	44,11%	0,20%	1,808%	9,85%
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%
IMA Geral	1,07%	10,21%	4,28%	5,86%	15,03%	37,79%	-	-	-
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	1,08%	10,57%	4,46%	5,93%	15,76%	38,62%	0,25%	0,969%	5,33%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,03%	10,12%	4,20%	5,85%	15,17%	37,24%	0,20%	0,879%	4,78%
IDKA IPCA 2 Anos	0,97%	10,12%	4,34%	7,49%	14,33%	34,57%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,96%	9,32%	4,05%	6,79%	13,26%	33,40%	0,20%	0,491%	2,83%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,68%	7,94%	2,91%	5,84%	11,82%	29,95%	0,20%	0,287%	1,90%
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%
BRADERCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,88%	8,21%	2,86%	5,81%	12,97%	29,45%	0,20%	0,080%	0,68%
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%

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

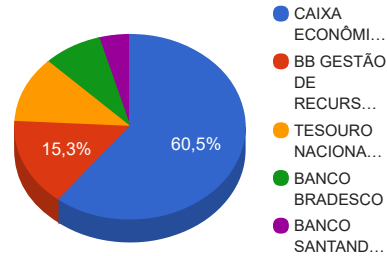
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	0,86%	8,14%	2,80%	5,73%	12,80%	29,12%	0,40%	0,083%	0,67%
Selic	0,80%	7,35%	2,43%	5,29%	12,06%	27,92%	-	-	-
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,99%	7,74%	2,65%	5,65%	12,68%	28,66%	0,20%	0,074%	0,12%
CDI	0,80%	7,34%	2,43%	5,28%	12,05%	27,88%	-	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,79%	7,38%	2,42%	5,31%	12,08%	27,93%	0,20%	0,007%	0,11%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,72%	6,76%	2,21%	4,84%	11,14%	25,78%	0,80%	0,000%	0,10%
IPCA + 6,00% ao ano	0,72%	5,65%	1,72%	3,93%	8,58%	25,42%	-	-	-
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	1,04%	9,33%	3,76%	6,31%	13,80%	32,70%	0,30%	0,357%	2,55%
IPCA	0,19%	1,62%	0,20%	0,90%	2,46%	11,65%	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1,08%	8,71%	3,60%	5,82%	-	-	0,002	0,453%	-

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

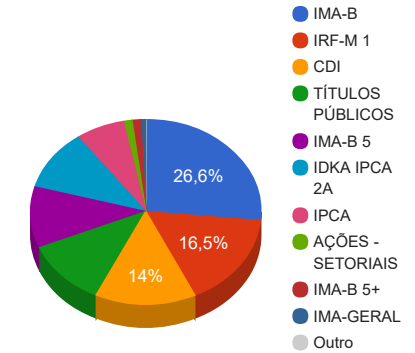
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
PETROBRAS ON - PETR3	1,23%	-17,53%	2,57%	-12,47%	-5,22%	31,54%	-	-	-
SANTANDER PETROBRÁS PLUS FIC AÇÕES	0,92%	-19,27%	1,71%	-13,88%	-8,19%	26,44%	3,00%	12,099%	38,45%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	24.121.571,78	60,51%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	6.116.954,62	15,35%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	4.608.374,66	11,56%
BANCO BRADESCO	3.278.196,99	8,22%
BANCO SANTANDER	1.737.290,87	4,36%



Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	10.585.296,35	26,55%
IRF-M 1	6.562.316,87	16,46%
CDI	5.593.931,76	14,03%
TÍTULOS PÚBLICOS	4.608.374,66	11,56%
IMA-B 5	4.269.970,70	10,71%
IDKA IPCA 2A	4.242.361,60	10,64%
IPCA	2.737.810,63	6,87%
AÇÕES - SETORIAIS	488.198,94	1,22%
IMA-B 5+	476.238,59	1,19%
IMA-GERAL	281.626,17	0,71%
GESTÃO DURATION	16.262,65	0,04%





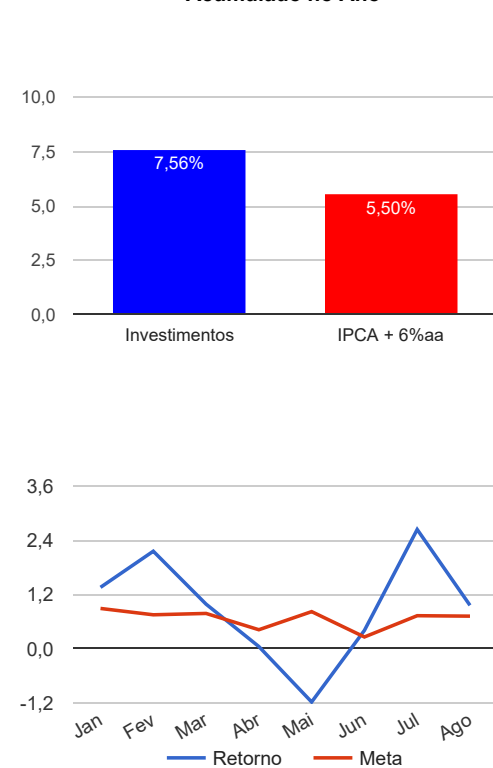
Carteira de Títulos Públicos - base (agosto / 2017)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde.	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	GAP (Atual - Pago)
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	11/08/2004	500	1.487,344824	3.232,296981	743.672,41	1.616.148,49	872.476,08
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	02/12/2004	270	1.494,58526	3.232,296981	403.538,02	872.720,18	469.182,16
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	02/03/2009	630	1.104,73659	3.364,295206	695.984,05	2.119.505,98	1.423.521,93

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	37.595.805,54	1.306.329,31	22.502,67	39.407.079,85	527.447,67	1,36%	0,89%	152,10%	1,66%
Fevereiro	39.407.079,85	6.147.532,31	6.345.314,77	40.058.204,80	848.907,41	2,15%	0,75%	287,82%	1,29%
Março	40.058.204,80	2.186.090,77	2.288.263,43	40.350.647,24	394.615,10	0,99%	0,78%	125,56%	1,48%
Abril	40.350.647,24	2.107.444,78	2.504.739,18	39.972.953,76	19.600,92	0,05%	0,42%	11,54%	1,27%
Mai	39.972.953,76	22.011.049,65	22.290.013,29	39.223.932,01	-470.058,11	-1,18%	0,82%	-143,13%	5,92%
Junho	39.223.932,01	2.018.132,02	2.345.703,65	39.055.295,84	158.935,46	0,41%	0,26%	158,51%	1,18%
Julho	39.055.295,84	1.244.165,71	1.482.584,64	39.845.645,58	1.028.768,67	2,63%	0,73%	361,87%	1,25%
Agosto	39.845.645,58	1.035.373,55	1.400.836,74	39.862.388,92	382.206,53	0,96%	0,72%	132,44%	0,95%
Acumulado no ano					2.890.423,65	7,56%	5,50%	137,33%	

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 IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	469.986,57	0,00	0,00	476.238,59	6.252,02	1,33%	2,64%	1,33%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.873.363,22	0,00	0,00	8.991.102,78	117.739,56	1,33%	1,81%	1,33%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.573.384,10	0,00	0,00	1.594.193,57	20.809,47	1,32%	1,81%	1,32%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.217.686,36	0,00	0,00	4.269.970,70	52.284,34	1,24%	0,72%	1,24%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	113.725,29	0,00	0,00	114.958,73	1.233,44	1,08%	0,97%	1,08%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	16.088,74	0,00	0,00	16.262,65	173,91	1,08%	0,45%	1,08%
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	2.709.515,55	0,00	0,00	2.737.810,63	28.295,08	1,04%	0,36%	1,04%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	164.972,16	0,00	0,00	166.667,44	1.695,28	1,03%	0,88%	1,03%
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.984.482,13	0,00	0,00	3.013.967,36	29.485,23	0,99%	0,07%	0,99%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.070.544,72	0,00	0,00	4.109.783,96	39.239,24	0,96%	0,49%	0,96%
BRADERCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	147.968,30	0,00	0,00	149.270,90	1.302,60	0,88%	0,08%	0,88%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.351.995,79	0,00	0,00	4.390.183,41	38.187,62	0,88%	0,08%	0,88%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1.202.777,83	35.736,85	0,00	1.249.091,93	10.577,25	0,85%	0,08%	0,86%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.595.068,31	0,00	0,00	1.607.695,64	12.627,33	0,79%	0,01%	0,79%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	135.422,67	0,00	3.753,63	132.577,64	908,60	0,67%	0,29%	0,68%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.865.505,81	0,00	1.100.000,00	773.770,63	8.264,82	0,44%	0,08%	0,89%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	264.648,29	999.636,70	297.083,11	972.268,76	5.066,88	0,40%	0,00%	0,72%
TÍTULOS PÚBLICOS	4.604.772,65	0,00	0,00	4.608.374,66	3.602,01	0,08%	-	-
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>377.744,68</b>	<b>0,96%</b>	<b>0,79%</b>	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
SANTANDER PETROBRÁS PLUS FIC AÇÕES	483.737,09	0,00	0,00	488.198,94	4.461,85	0,92%	12,10%	0,92%
Total Renda Variável					4.461,85	0,92%	12,10%	