

Relatório Analítico dos Investimentos em agosto de 2017

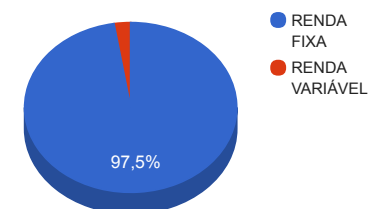
Carteira consolidada de investimentos - base (agosto / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.457.019,02	4,78%	205	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.498.355,99	4,91%	195	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.526.856,95	5,01%	711	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.293.969,80	7,52%	707	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.959.679,39	9,70%	610	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	2.181.178,14	7,15%	295	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	17/08/2020	406.093,50	1,33%	20	0,64%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.459.213,93	8,06%	1.211	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.359.566,56	4,46%	1.381	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.669.061,34	8,75%	276	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	2.074.424,29	6,80%	334	0,11%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.804.696,69	9,19%	329	0,11%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1800	Não há	1.224.448,51	4,01%	14	0,99%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	D+31 ou D+1461	Não há	1.211.181,24	3,97%	18	0,61%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.427.987,55	11,24%	766	0,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.632,25	0,01%	114	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	178.603,23	0,59%	98	0,18%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	D+4	Não há	769.594,30	2,52%	72	1,00%	Artigo 8º, Inciso I
TOTAL -			30.503.562,68				

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

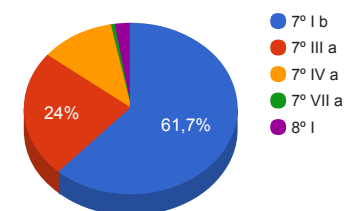
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	18.810.994,62	61,67%	30,00%	48,00%	70,00%	2.541.499,26
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	7.314.750,73	23,98%	15,00%	20,00%	60,00%	10.987.386,88
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	3.429.619,80	11,24%	5,00%	5,00%	30,00%	5.721.449,00
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	4.575.534,40
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	178.603,23	0,59%	0,00%	2,00%	5,00%	1.346.574,90
Total Renda Fixa	100,00%	29.733.968,38	97,48%	55,00	85,00	180,00	-

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	769.594,30	2,52%	0,00%	0,00%	0,00%	-769.594,30
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	4.575.534,40
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	1.525.178,13
Total Renda Variável	30,00%	769.594,30	2,52%	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 "	18.810.994,62	61,67%	30,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	7.314.750,73	23,98%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	3.429.619,80	11,24%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	0,00	0,00%	5,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	178.603,23	0,59%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	29.733.968,38	97,48%	55,00	180,00

Artigos - Renda Variável	Base: agosto / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I	769.594,30	2,52%	0,00%	0,00%
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	769.594,30	2,52%	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 5+	1,36%	11,93%	6,04%	4,21%	16,45%	51,77%	-	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,34%	11,49%	6,00%	3,94%	15,86%	50,41%	0,20%	2,654%	12,85%
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 NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	1,36%	10,73%	5,30%	4,72%	15,18%	43,25%	0,20%	1,756%	9,40%
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%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	1,27%	10,18%	4,65%	5,78%	15,21%	32,22%	1,30%	1,098%	5,45%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,60%	4,67%	1,88%	4,29%	8,47%	23,43%	0,20%	4,085%	5,83%
IMA-B 5	1,25%	9,83%	4,68%	6,98%	13,91%	34,53%	-	-	-
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	5,10%	10,43%	7,87%	8,91%	15,36%	38,19%	1,30%	0,598%	9,29%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,24%	9,76%	4,66%	6,94%	13,74%	33,96%	0,20%	0,720%	3,64%
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%
IRF-M 1+	1,11%	13,22%	5,47%	7,73%	19,92%	45,81%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,05%	13,00%	5,39%	7,45%	19,66%	45,75%	0,20%	1,312%	6,45%
IMA Geral	1,07%	10,21%	4,28%	5,86%	15,03%	37,79%	-	-	-
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%	-	-	-

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

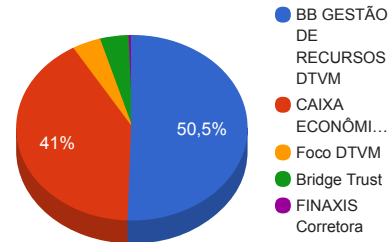
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,98%	9,35%	4,08%	6,76%	13,28%	33,34%	0,20%	0,487%	2,90%
IRF-M 1	0,90%	8,33%	2,86%	5,88%	13,15%	29,98%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	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%
CDI	0,80%	7,34%	2,43%	5,28%	12,05%	27,88%	-	-	-
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,80%	7,31%	2,44%	5,19%	11,95%	27,55%	0,20%	0,020%	0,16%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,79%	7,40%	2,43%	5,30%	12,17%	27,88%	0,20%	0,003%	0,11%
101,50% do IPCA + 5,75% ao ano	0,69%	5,39%	1,62%	3,74%	8,19%	24,61%	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-1,76%	-5,28%	-2,87%	-4,45%	-10,43%	-17,90%	0,25%	1,272%	1,04%

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

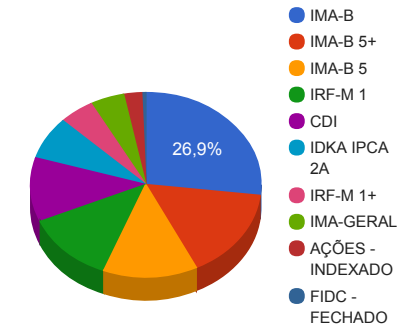
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IBX-50	7,28%	17,56%	12,94%	6,72%	21,99%	47,93%	-	-	-
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	7,41%	16,26%	12,68%	5,89%	19,76%	31,13%	0,70%	5,820%	21,35%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	15.396.453,10	50,47%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	12.492.876,60	40,96%
Foco DTVM	1.224.448,51	4,01%
Bridge Trust	1.211.181,24	3,97%
FINAXIS Corretora	178.603,23	0,59%



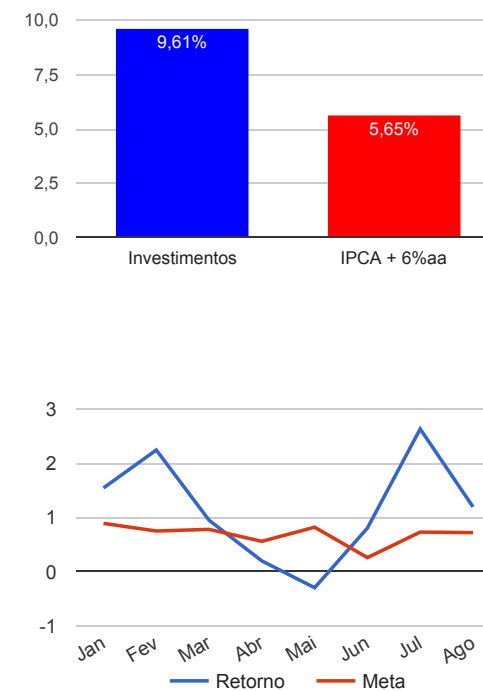
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	8.200.005,83	26,88%
IMA-B 5+	4.850.239,48	15,90%
IMA-B 5	4.007.374,74	13,14%
IRF-M 1	3.818.780,49	12,52%
CDI	3.429.619,80	11,24%
IDKA IPCA 2A	2.293.969,80	7,52%
IRF-M 1+	1.498.355,99	4,91%
IMA-GERAL	1.457.019,02	4,78%
AÇÕES - INDEXADO	769.594,30	2,52%
FIDC - FECHADO	178.603,23	0,59%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	25.621.019,44	1.366.900,00	554.355,05	26.841.345,26	407.780,87	1,54%	0,89%	172,96%	1,97%
Fevereiro	26.841.345,26	1.682.000,00	1.494.964,05	27.634.035,13	605.653,92	2,24%	0,75%	299,39%	1,24%
Março	27.634.035,13	894.100,00	530.000,00	28.263.575,27	265.440,14	0,95%	0,78%	120,84%	1,39%
Abril	28.263.575,27	858.800,00	510.000,00	28.669.409,63	57.034,36	0,20%	0,56%	35,74%	1,24%
Mai	28.669.409,63	429.000,00	425.708,83	28.588.429,97	-84.270,83	-0,29%	0,82%	-35,77%	7,22%
Junho	28.588.429,97	789.600,00	435.709,50	29.175.173,22	232.852,75	0,80%	0,26%	314,72%	1,81%
Julho	29.175.173,22	675.500,00	450.408,11	30.173.078,10	772.812,99	2,63%	0,73%	361,11%	1,42%
Agosto	30.173.078,10	900.100,00	930.000,00	30.503.562,68	360.384,58	1,19%	0,72%	164,91%	1,27%
Acumulado no ano					2.617.688,78	9,61%	5,65%	170,28%	

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 NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	2.767.138,80	0,00	0,00	2.804.696,69	37.557,89	1,36%	1,76%	1,36%	
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.112.507,21	40.100,00	0,00	2.181.178,14	28.570,93	1,33%	2,65%	1,34%	
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.921.045,83	0,00	0,00	2.959.679,39	38.633,56	1,32%	1,81%	1,32%	
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	1.195.943,21	0,00	0,00	1.211.181,24	15.238,03	1,27%	1,10%	1,27%	
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2.048.932,46	0,00	0,00	2.074.424,29	25.491,83	1,24%	0,72%	1,24%	
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.508.161,11	0,00	0,00	1.526.856,95	18.695,84	1,24%	0,72%	1,24%	
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.779.768,43	860.000,00	0,00	2.669.061,34	29.292,91	1,11%	2,64%	1,33%	
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.482.823,32	0,00	0,00	1.498.355,99	15.532,67	1,05%	1,31%	1,05%	
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.442.198,73	0,00	0,00	1.457.019,02	14.820,29	1,03%	0,88%	1,03%	
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.271.609,95	0,00	0,00	2.293.969,80	22.359,85	0,98%	0,49%	0,98%	
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.437.822,68	0,00	0,00	2.459.213,93	21.391,25	0,88%	0,08%	0,88%	
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.517.058,64	0,00	170.000,00	1.359.566,56	12.507,92	0,82%	0,08%	0,89%	
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.401.020,52	0,00	0,00	3.427.987,55	26.967,03	0,79%	0,00%	0,79%	
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.214.918,59	0,00	0,00	1.224.448,51	9.529,92	0,78%	0,60%	0,78%	
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	761.170,24	0,00	760.000,00	1.632,25	462,01	0,06%	0,02%	0,80%	
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	412.678,50	0,00	0,00	406.093,50	-6.585,00	-1,60%	4,09%	-1,60%	
PREMIUM FIDC SÊNIOR	181.800,75	0,00	0,00	178.603,23	-3.197,52	-1,76%	1,27%	-1,33%	
Total Renda Fixa						307.269,41	1,04%	1,15%	

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(%)
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	716.479,13	0,00	0,00	769.594,30	53.115,17	7,41%	5,82%	7,41%
Total Renda Variável					53.115,17	7,41%	5,82%	