

Relatório Analítico dos Investimentos em julho de 2017

Carteira consolidada de investimentos - base (julho / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.045.654,52	2,36%	706	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	17/08/2020	2.063.392,50	2,38%	20	3,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.366.688,94	1,57%	594	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	975.414,67	1,12%	1.367	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.660.498,86	4,21%	78	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.195.244,13	2,53%	1.197	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	14.228.920,17	16,38%	292	0,87%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	3.069.850,93	3,53%	304	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	80.432,95	0,09%	605	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	14.475.609,73	16,67%	739	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	1.278.896,00	1,47%	26	0,87%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	401.733,34	0,46%	59	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
INFINITY IMA-B 5+ TIGER FI RENDA FIXA	D+1	Não há	697.823,77	0,80%	20	2,46%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	10.249.881,18	11,80%	325	0,41%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	3.073.873,92	3,54%	75	1,12%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	57.967,85	0,07%	86	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.588.060,52	4,13%	772	0,09%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	937.953,48	1,08%	138	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	7.815.320,34	9,00%	766	0,14%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	2.560.381,04	2,95%	493	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	58.418,81	0,07%	61	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	676.340,50	0,78%	100	0,31%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "

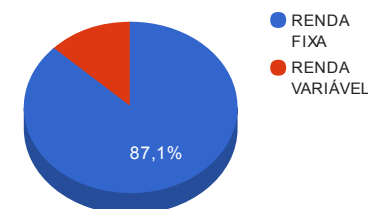
Carteira consolidada de investimentos - base (julho / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIAÇÕES	D+24	Não há	1.510.587,42	1,74%	25	0,72%	Artigo 8º, Inciso III
BB GOVERNANÇA FIAÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	846.631,58	0,97%	84	0,63%	Artigo 8º, Inciso III
ITAÚ DIVIDENDOS FIAÇÕES	D+4	Não há	200.148,57	0,23%	294	0,13%	Artigo 8º, Inciso III
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.085.270,56	1,25%	4.074	1,36%	Artigo 8º, Inciso III
BRADESCO DIVIDENDOS FIAÇÕES	D+4	Não há	1.138.089,40	1,31%	491	0,22%	Artigo 8º, Inciso III
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	1.538.413,97	1,77%	50	2,57%	Artigo 8º, Inciso IV
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	1.374.061,16	1,58%	52	0,66%	Artigo 8º, Inciso IV
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	1.323.766,21	1,52%	2.720	0,28%	Artigo 8º, Inciso IV
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se aplica	Não se aplica	2.198.000,00	2,53%		1,27%	Artigo 8º, Inciso VI
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	Término do fundo	Não há	71.807,13	0,08%	750	0,63%	Desenquadrado - RF
		TOTAL -	86.845.134,15				

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

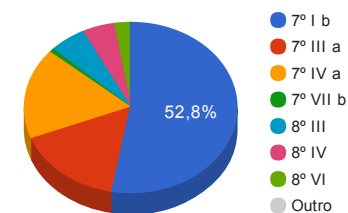
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	45.842.336,74	52,79%	30,00%	35,00%	70,00%	14.949.257,17
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	14.079.546,72	16,21%	15,00%	20,00%	60,00%	38.027.533,77
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	14.960.134,19	17,23%	5,00%	5,00%	30,00%	11.093.406,06
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	13.026.770,12
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	4.342.256,71
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	676.340,50	0,78%	0,00%	2,50%	5,00%	3.665.916,21
Desenquadrado - RF	0,00%	71.807,13	0,08%	0,00%	0,00%	0,00%	-71.807,13
Total Renda Fixa	100,00%	75.630.165,28	87,09%	55,00	75,00	185,00	-

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	4.780.727,53	5,50%	5,00%	10,00%	15,00%	8.246.042,59
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	4.236.241,34	4,88%	2,00%	5,00%	5,00%	106.015,37
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	4.342.256,71
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	2.198.000,00	2,53%	2,00%	5,00%	5,00%	2.144.256,71
Total Renda Variável	30,00%	11.214.968,87	12,91%	11,00	25,00	30,00	-

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: julho / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	45.842.336,74	52,79%	30,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	14.079.546,72	16,21%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	14.960.134,19	17,23%	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 "	676.340,50	0,78%	0,00%	5,00%
Desenquadrado - RF	71.807,13	0,08%	0,00%	0,00%
Total Renda Fixa	75.630.165,28	87,09%	55,00	185,00

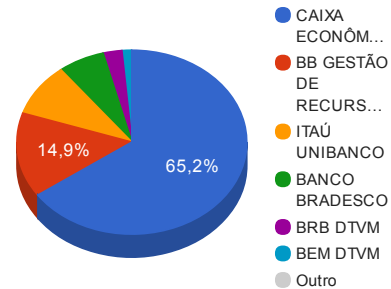
Artigos - Renda Variável	Base: julho / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso III	4.780.727,53	5,50%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	4.236.241,34	4,88%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	2.198.000,00	2,53%	2,00%	5,00%
Total Renda Variável	11.214.968,87	12,91%	11,00	30,00

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

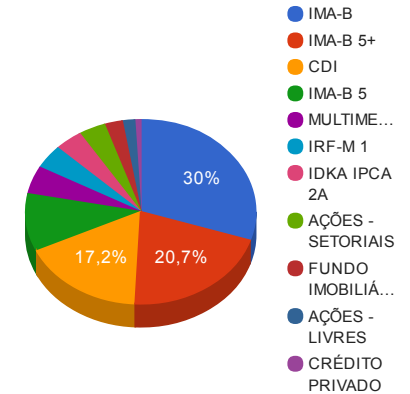
Dados atualizados dos Benchmark's dos Fundos, referente à base (julho / 2017) ainda não disponíveis.

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	56.652.230,24	65,23%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	12.911.145,19	14,87%
ITAÚ UNIBANCO	8.084.982,83	9,31%
BANCO BRADESCO	5.692.222,81	6,55%
BRB DTVM	2.294.656,55	2,64%
BEM DTVM	1.138.089,40	1,31%
ICLA Trust	71.807,13	0,08%



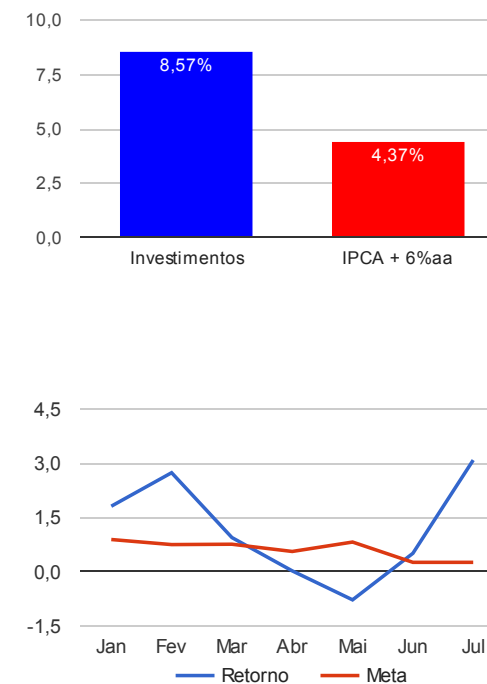
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	26.084.819,86	30,04%
IMA-B 5+	17.996.594,87	20,72%
CDI	14.960.134,19	17,23%
IMA-B 5	8.797.765,28	10,13%
MULTIMERCADO	4.236.241,34	4,88%
IRF-M 1	3.630.359,99	4,18%
IDKA IPCA 2A	3.412.343,46	3,93%
AÇÕES - SETORIAIS	3.270.140,11	3,77%
FUNDO IMOBILIÁRIO	2.198.000,00	2,53%
AÇÕES - LIVRES	1.510.587,42	1,74%
CRÉDITO PRIVADO	748.147,63	0,86%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	75.102.528,80	1.059.200,80	414.015,02	77.118.447,26	1.370.732,68	1,81%	0,89%	203,33%	2,63%
Fevereiro	77.118.447,26	1.331.834,76	609.909,46	79.968.658,81	2.128.286,25	2,73%	0,75%	364,56%	1,91%
Março	79.968.658,81	6.468.003,91	5.118.485,98	82.085.798,00	767.621,26	0,94%	0,76%	123,48%	2,09%
Abril	82.085.798,00	8.589.696,50	8.007.337,06	82.688.115,68	19.958,24	0,02%	0,56%	4,33%	1,93%
Mai	82.688.115,68	847.141,68	749.900,00	82.143.176,79	-642.180,57	-0,78%	0,82%	-94,42%	9,80%
Junho	82.143.176,79	8.093.997,48	6.834.477,61	83.827.094,68	424.398,02	0,51%	0,26%	199,05%	2,14%
Julho	83.827.094,68	961.557,95	540.618,29	86.845.134,15	2.597.099,81	3,08%	0,26%	1.205,89%	2,07%
Acumulado no ano					6.665.915,69	8,57%	4,37%	195,92%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.932.182,78	0,00	0,00	3.069.850,93	137.668,15	4,70%	2,97%	4,70%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	13.601.653,02	0,00	0,00	14.228.920,17	627.267,15	4,61%	2,94%	4,61%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	13.922.486,45	0,00	0,00	14.475.609,73	553.123,28	3,97%	2,25%	3,97%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	77.371,60	0,00	0,00	80.432,95	3.061,35	3,96%	2,24%	3,96%
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.231.828,00	0,00	0,00	1.278.896,00	47.068,00	3,82%	2,28%	3,82%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	9.877.135,30	0,00	0,00	10.249.881,18	372.745,88	3,77%	2,15%	3,77%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.004.420,00	0,00	0,00	2.063.392,50	58.972,50	2,94%	1,22%	2,94%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	2.986.272,58	0,00	0,00	3.073.873,92	87.601,34	2,93%	1,30%	2,93%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	3.560.586,44	0,00	0,00	3.660.498,86	99.912,42	2,81%	1,22%	2,81%
INFINITY IMA-B 5+ TIGER FI RENDA FIXA	679.476,47	0,00	0,00	697.823,77	18.347,30	2,70%	1,49%	2,70%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.997.018,80	0,00	0,00	2.045.654,52	48.635,72	2,44%	0,95%	2,44%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.773.495,57	0,00	448.292,00	1.366.688,94	41.485,37	2,34%	0,94%	2,41%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	667.627,00	0,00	0,00	676.340,50	8.713,50	1,31%	0,47%	1,31%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	57.359,56	0,00	0,00	57.967,85	608,29	1,06%	0,19%	1,06%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	397.523,07	0,00	0,00	401.733,34	4.210,27	1,06%	0,19%	1,06%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.104.636,53	84.943,50	17.326,29	2.195.244,13	22.990,39	1,05%	0,21%	1,06%
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	71.134,15	0,00	0,00	71.807,13	672,98	0,95%	0,40%	0,95%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	679.348,32	287.462,89	0,00	975.414,67	8.603,46	0,89%	0,20%	1,04%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.539.825,91	0,00	0,00	2.560.381,04	20.555,13	0,81%	0,01%	0,81%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.618.177,16	0,00	59.000,00	3.588.060,52	28.883,36	0,80%	0,01%	0,81%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	930.634,79	0,00	0,00	937.953,48	7.318,69	0,79%	0,01%	0,79%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	7.366.100,85	389.151,56	0,00	7.815.320,34	60.067,93	0,77%	0,02%	0,79%

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	58.046,88	0,00	0,00	58.418,81	371,93	0,64%	1,35%	0,64%
				Total Renda Fixa	2.258.884,39	3,08%	1,66%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
ITA Ú INSTITUCIONAL PHOENIX FIAÇÕES	1.425.902,74	0,00	0,00	1.510.587,42	84.684,68	5,94%	3,83%	5,94%
ITA Ú DIVIDENDOS FIAÇÕES	190.466,20	0,00	0,00	200.148,57	9.682,37	5,08%	5,00%	5,08%
BRADESCO DIVIDENDOS FIAÇÕES	1.085.422,46	0,00	0,00	1.138.089,40	52.666,94	4,85%	4,41%	4,85%
BB GOVERNANÇA FIAÇÕES PREVIDENCIÁRIO	809.458,18	0,00	0,00	846.631,58	37.173,40	4,59%	4,34%	4,59%
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	1.043.791,05	0,00	0,00	1.085.270,56	41.479,51	3,97%	5,77%	3,97%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	2.140.000,00	0,00	16.000,00	2.198.000,00	74.000,00	3,46%	14,03%	2,71%
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	1.310.606,65	0,00	0,00	1.323.766,21	13.159,56	1,00%	0,32%	1,00%
ITA Ú INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	1.361.733,27	0,00	0,00	1.374.061,16	12.327,89	0,91%	0,09%	0,91%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	1.325.372,90	200.000,00	0,00	1.538.413,97	13.041,07	0,85%	0,71%	0,91%
Total Renda Variável					338.215,42	3,11%	4,83%	