

# Relatório Analítico dos Investimentos em agosto de 2016



Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

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 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	1.157.815,00	1,61%	26	0,87%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	12.280.107,59	17,09%	716	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.265.366,22	4,54%	76	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	17/08/2020	1.871.988,00	2,61%	20	3,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.813.679,60	3,92%	753	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.434.699,78	10,35%	631	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	70.733,26	0,10%	601	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	359.013,38	0,50%	54	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	634.232,27	0,88%	1.336	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.484.542,62	3,46%	1.176	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	3.279.240,55	4,56%	67	1,07%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	45.125,08	0,06%	88	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	12.495.339,63	17,39%	340	0,53%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	6.577.180,32	9,15%	808	0,12%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	3.396.201,37	4,73%	763	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	51.792,34	0,07%	61	0,09%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	2.921.260,16	4,07%	384	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	843.694,82	1,17%	125	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
OURINVEST SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	D+45 a D+75	Não há	71.167,57	0,10%	164	0,02%	Artigo 7º, Inciso VI
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	615.553,00	0,86%	100	0,31%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	4.157.396,20	5,79%	84	3,64%	Artigo 8º, Inciso III
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	3.010.541,84	4,19%	58	1,57%	Artigo 8º, Inciso IV

Carteira consolidada de investimentos - base (agosto / 2016)

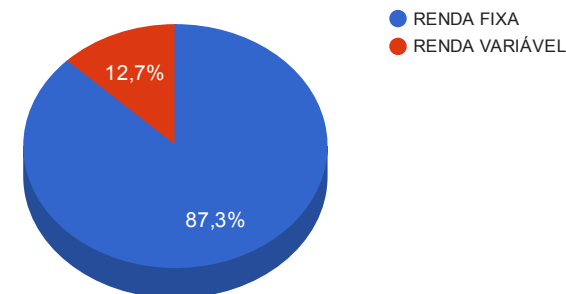
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se aplica	Não se aplica	1.960.000,00	2,73%		1,25%	Artigo 8º, Inciso VI
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	Término do fundo	Não há	55.928,35	0,08%	752	0,63%	Desenquadrado - RF
		<b>TOTAL -</b>	<b>71.852.598,95</b>				

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

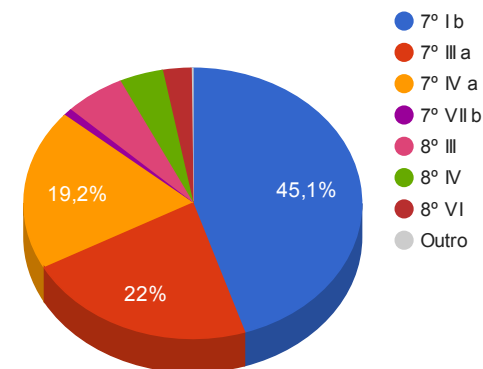
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	80,00%	32.372.177,72	45,05%	25.109.901,44
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	50,00%	15.819.705,26	22,02%	20.106.594,22
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	13.790.129,01	19,19%	7.765.650,68
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	71.167,57	0,10%	3.521.462,38
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	615.553,00	0,86%	2.977.076,95
<b>Desenquadrado - RF</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>55.928,35</b>	<b>0,08%</b>	<b>-55.928,35</b>
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	80,00%	10,00%	0,00	0,00%	7.185.259,90
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	30,00%	10,00%	0,00	0,00%	7.185.259,90
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.592.629,95
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>195,00</b>	<b>62.724.660,91</b>	<b>87,30%</b>	

Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	10,00%	4.157.396,20	5,79%	3.027.863,70
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	3.010.541,84	4,19%	582.088,11
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	1.960.000,00	2,73%	1.632.629,95
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.592.629,95
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.592.629,95
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>30,00</b>	<b>9.127.938,04</b>	<b>12,70%</b>	

Distribuição por Segmento



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
115% do CDI	1,40%	10,66%	4,06%	8,09%	16,42%	33,10%	-	-	-
OURINVEST SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	1,40%	10,67%	4,06%	8,09%	16,42%	33,09%	0,20%	0,000%	0,00%
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%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,22%	10,94%	3,23%	6,39%	17,78%	30,85%	0,20%	0,732%	2,94%
Selic	1,22%	9,22%	3,53%	7,01%	14,15%	28,31%	-	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,22%	9,24%	3,57%	7,04%	14,18%	28,51%	0,20%	0,007%	0,02%
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%
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	1,23%	10,18%	3,84%	7,69%	15,88%	30,73%	0,75%	2,555%	6,71%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	1,22%	9,27%	3,57%	7,06%	14,23%	28,49%	0,18%	0,008%	0,03%
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%	-	-	-
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1,18%	9,75%	3,28%	6,84%	14,59%	27,89%	0,20%	0,055%	0,75%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1,18%	9,63%	3,28%	6,75%	14,52%	27,72%	0,20%	0,054%	0,46%
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%

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
IMA-B 5	1,09%	11,35%	3,27%	6,50%	18,11%	31,19%	-	-	-
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	1,07%	11,23%	3,14%	6,40%	17,65%	29,84%	0,20%	0,827%	3,45%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	1,06%	11,05%	3,17%	6,29%	17,62%	30,08%	0,40%	0,787%	3,31%
IMA-B	0,89%	20,11%	5,41%	15,26%	25,51%	29,04%	-	-	-
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	0,97%	19,34%	5,35%	14,94%	24,37%	28,43%	0,20%	1,795%	8,44%
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%
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,35%	13,09%	1,58%	10,51%	18,18%	-	0,20%	4,845%	10,59%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,57%	7,99%	0,68%	4,48%	13,80%	15,29%	0,20%	4,859%	7,52%
IPCA	0,44%	5,42%	1,32%	3,17%	8,97%	19,36%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,78%	13,35%	3,27%	8,03%	18,95%	-	0,20%	0,705%	3,35%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,69%	16,33%	4,60%	13,84%	30,58%	85,80%	0,00%	0,085%	7,99%

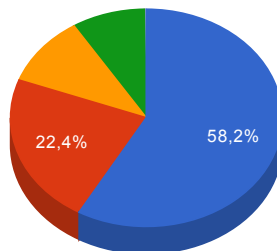
Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (agosto / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	1,84%	25,41%	9,62%	29,83%	21,19%	25,05%	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	2,55%	24,20%	8,31%	34,27%	19,71%	3,50%	1,20%	-	25,73%
CDI	1,21%	9,21%	3,52%	7,00%	14,13%	28,23%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO	1,22%	9,48%	3,48%	7,15%	14,20%	28,00%	0,35%	0,074%	0,34%
IGC	0,03%	27,79%	17,12%	28,02%	20,86%	-0,93%	-	-	-
BB GOVERNANÇA FIAÇÕES PREVIDENCIÁRIO	0,00%	27,40%	16,94%	27,79%	20,65%	-1,40%	1,00%	6,793%	22,75%

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

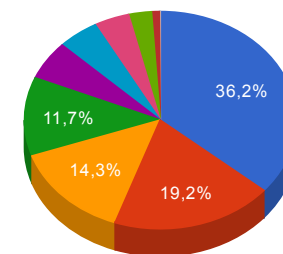
Administrador	Valor	%
Caixa Econômica Federal	41.845.936,64	58,24%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	16.103.532,00	22,41%
ITAÚ UNIBANCO	7.478.616,26	10,41%
BANCO BRADESCO	6.245.625,79	8,69%
OLIVEIRA TRUST DTVM	71.167,57	0,10%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	55.928,35	0,08%
BRB DTVM	51.792,34	0,07%

- Caixa Econômica Federal
- BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM
- ITAÚ UNIBANCO
- BANCO BRADESCO
- Outro



Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	26.003.995,48	36,19%
CDI	13.790.129,01	19,19%
IDKA IPCA 2A	10.248.379,38	14,26%
IMA-B 5	8.416.594,77	11,71%
AÇÕES - SETORIAIS	4.157.396,20	5,79%
IRF-M 1	3.522.913,35	4,90%
MULTIMERCADO	3.010.541,84	4,19%
FUNDO IMOBILIÁRIO	1.960.000,00	2,73%
CRÉDITO PRIVADO	671.481,35	0,93%
FIDC - ABERTO	71.167,57	0,10%

- IMA-B
- CDI
- IDKA IPCA 2A
- IMA-B 5
- AÇÕES - SETORIAIS
- IRF-M 1
- MULTIMER...
- FUNDO IMOBILIÁRIO
- CRÉDITO PRIVADO
- Outro





Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

**Acumulado no Ano**

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	62.277.696,34	3.749.404,56	3.710.428,93	63.141.520,41	824.848,44	1,32%	1,74%	76,10%	1,67%
Fevereiro	63.141.520,41	8.298.722,63	7.841.510,77	64.642.122,27	1.043.390,00	1,64%	1,34%	122,04%	2,26%
Março	64.642.122,27	3.738.261,49	2.934.465,86	66.743.676,02	1.297.758,12	1,98%	0,94%	210,46%	2,09%
Abril	66.743.676,02	688.061,74	426.640,36	68.144.370,91	1.139.273,51	1,70%	1,08%	157,97%	1,55%
Mai	68.144.370,91	6.653.130,12	6.560.846,88	68.792.712,16	556.058,01	0,81%	1,27%	64,14%	1,65%
Junho	68.792.712,16	5.755.185,90	5.540.792,06	69.943.026,73	935.920,73	1,36%	0,86%	157,38%	1,36%
Julho	69.943.026,73	4.327.901,06	4.428.967,53	71.173.759,23	1.331.798,97	1,90%	1,01%	188,66%	0,99%
Agosto	71.173.759,23	12.499.550,72	12.494.481,40	71.852.598,95	673.770,40	0,95%	0,98%	97,03%	1,47%
Acumulado no ano					7.802.818,18	12,28%	9,60%	127,92%	

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 IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	604.796,00	0,00	0,00	615.553,00	10.757,00	1,78%	0,71%	1,78%
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	54.997,09	0,00	0,00	55.928,35	931,26	1,69%	0,08%	1,69%
OURINVEST SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	70.186,96	0,00	0,00	71.167,57	980,61	1,40%	0,00%	1,40%
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.173.676,00	0,00	32.097,08	1.157.815,00	16.236,08	1,38%	4,84%	-1,35%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.770.421,24	7.735,38	0,00	2.813.679,60	35.522,98	1,28%	0,75%	1,28%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.921.207,22	0,00	429.673,15	6.577.180,32	85.646,25	1,24%	0,02%	1,25%
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	51.162,04	0,00	0,00	51.792,34	630,30	1,23%	2,55%	1,23%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	833.509,18	0,00	0,00	843.694,82	10.185,64	1,22%	0,01%	1,22%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.886.107,04	0,00	0,00	2.921.260,16	35.153,12	1,22%	0,01%	1,22%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.345.381,40	0,00	0,00	7.434.699,78	89.318,38	1,22%	0,73%	1,22%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	3.355.695,71	0,00	0,00	3.396.201,37	40.505,66	1,21%	0,01%	1,21%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.901.790,00	0,00	52.733,77	1.871.988,00	22.931,77	1,21%	4,86%	-1,57%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	44.599,32	0,00	0,00	45.125,08	525,76	1,18%	0,05%	1,18%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	354.840,61	0,00	0,00	359.013,38	4.172,77	1,18%	0,05%	1,18%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	626.866,89	0,00	0,00	634.232,27	7.365,38	1,17%	0,05%	1,17%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.436.090,02	20.000,00	0,00	2.484.542,62	28.452,60	1,16%	0,05%	1,16%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	3.244.650,76	0,00	0,00	3.279.240,55	34.589,79	1,07%	0,83%	1,07%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	3.231.058,18	0,00	0,00	3.265.366,22	34.308,04	1,06%	0,79%	1,06%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	14.258.252,13	90.011,90	2.000.000,00	12.495.339,63	147.075,60	1,03%	1,79%	0,97%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	70.109,23	0,00	0,00	70.733,26	624,03	0,89%	1,90%	0,89%
CAIXA BRASIL 2016 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.597.940,80	0,00	6.642.641,40	0,00	44.700,60	0,68%	-	-
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.299.016,00	0,00	3.321.336,00	0,00	22.320,00	0,68%	-	-

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 IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	12.381.803,44	0,00	12.280.107,59	-101.695,85	-0,82%	1,87%	0,83%
				Total Renda Fixa	571.237,77	0,92%	1,18%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de agosto / 2016

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.910.000,00	0,00	16.000,00	1.960.000,00	66.000,00	3,46%	-	2,55%
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO	2.974.184,81	0,00	0,00	3.010.541,84	36.357,03	1,22%	0,07%	1,22%
BB GOVERNANÇA FIAÇÕES PREVIDENCIÁRIO	4.157.220,60	0,00	0,00	4.157.396,20	175,60	0,00%	6,79%	0,00%
Total Renda Variável					102.532,63	1,13%	3,97%	

