

## Relatório Analítico dos Investimentos em agosto de 2016



Carteira consolidada de investimentos - base (agosto / 2016)

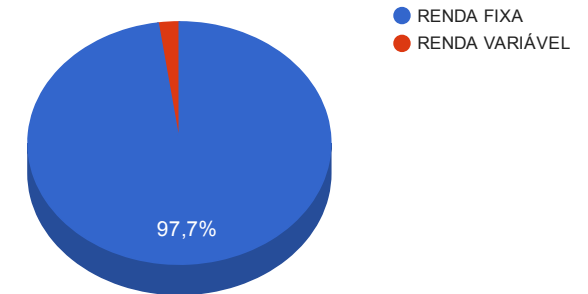
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.173.038,16	1,22%	1.176	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	9.736.994,19	3,75%	207	0,81%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	19.698.332,83	7,59%	194	1,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	18.729.431,02	7,22%	731	0,32%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.958.171,67	1,91%	716	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	60.542.976,80	23,33%	1.336	0,60%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	5.692.655,37	2,19%	167	0,54%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	4.776.594,38	1,84%	193	1,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	65.584.984,69	25,27%	631	1,46%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VIII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	01/01/2017	13.250.653,14	5,11%	49	2,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	26.069.771,61	10,05%	763	0,52%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	12.353.771,24	4,76%	116	2,59%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB RPPS I FI RENDA FIXA IPCA CRÉDITO PRIVADO	Término do fundo	Não há	1.910.320,90	0,74%	29	2,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+30 a D+2880	Não há	7.176.546,14	2,77%	51	2,25%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	827.565,09	0,32%	84	0,72%	Artigo 8º, Inciso III
BB CONSUMO FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.820.650,67	0,70%	2.325	2,33%	Artigo 8º, Inciso III
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	Não se aplica	Não se aplica	3.190.919,40	1,23%			Artigo 8º, Inciso VI
<b>TOTAL -</b>			<b>259.493.377,30</b>				

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

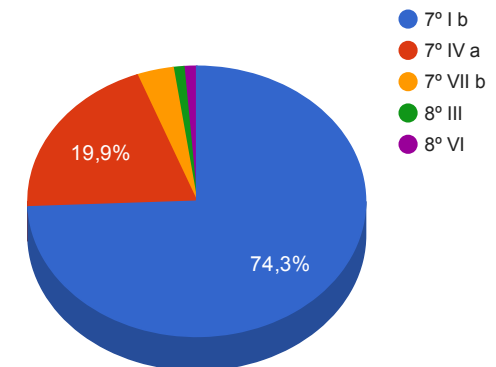
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	100,00%	192.893.179,11	74,33%	66.600.198,19
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	51.674.195,99	19,91%	26.173.817,20
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	9.086.867,04	3,50%	3.887.801,83
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	30,00%	0,00	0,00%	77.848.013,19
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	12.974.668,87
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	12.974.668,87
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>175,00</b>	<b>253.654.242,14</b>	<b>97,75%</b>	

Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	5,00%	2.648.215,76	1,02%	10.326.453,11
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	3.190.919,40	1,23%	9.783.749,47
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	5,00%	0,00	0,00%	12.974.668,87
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	12.974.668,87
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	12.974.668,87
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>25,00</b>	<b>5.839.135,16</b>	<b>2,25%</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
IDKA IPCA 2 Anos	1,29%	10,97%	3,16%	5,69%	17,70%	31,48%	-	-	-
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%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,69%	9,33%	3,13%	6,31%	16,22%	-	0,20%	0,552%	1,24%
CDI	1,21%	9,21%	3,52%	7,00%	14,13%	28,23%	-	-	-
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%	-	-	-
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%
IMA-B 5	1,09%	11,35%	3,27%	6,50%	18,11%	31,19%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,07%	11,13%	3,21%	6,38%	17,61%	30,24%	0,20%	0,801%	3,29%
IMA Geral	1,03%	15,92%	4,57%	11,75%	19,78%	27,84%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,02%	15,64%	4,49%	11,57%	19,16%	26,88%	0,20%	0,925%	4,52%
IRF-M	0,98%	17,01%	4,49%	12,10%	18,72%	27,21%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VIII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,17%	10,64%	3,24%	6,91%	14,05%	22,56%	0,20%	0,038%	2,09%
IPCA + 6,00% ao ano	0,98%	9,60%	2,87%	6,29%	15,51%	34,14%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,09%	9,89%	3,12%	6,58%	15,49%	34,24%	0,20%	0,123%	0,32%
IMA-B	0,89%	20,11%	5,41%	15,26%	25,51%	29,04%	-	-	-

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
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,86%	11,11%	3,21%	6,88%	17,72%	-	0,20%	0,869%	3,09%
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 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,60%	4,88%	0,19%	3,26%	11,34%	-	0,20%	4,583%	5,70%
IPCA	0,44%	5,42%	1,32%	3,17%	8,97%	19,36%	-	-	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1,45%	15,03%	3,98%	8,99%	20,86%	30,99%	0,20%	1,245%	6,37%
BB RPPS I FI RENDA FIXA IPCA CRÉDITO PRIVADO	1,31%	10,07%	3,78%	7,16%	16,23%	32,53%	0,20%	0,184%	0,90%

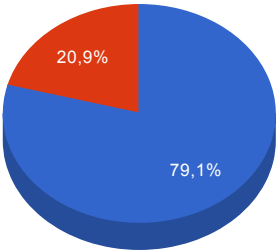
Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (agosto / 2016)

	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%	-	-	-
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	-	-	-	-	-	-	0,30%	-	-
ICON	0,43%	22,25%	16,37%	22,50%	14,80%	9,72%	-	-	-
BB CONSUMO FIC AÇÕES	0,27%	21,01%	15,64%	21,37%	12,89%	6,80%	1,00%	4,666%	20,23%
IGC	0,03%	27,79%	17,12%	28,02%	20,86%	-0,93%	-	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES 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)

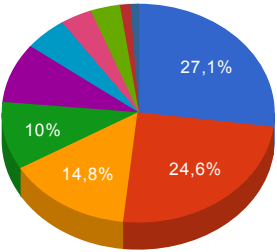
Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	205.320.662,81	79,12%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	54.172.714,49	20,88%

- CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
- BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM



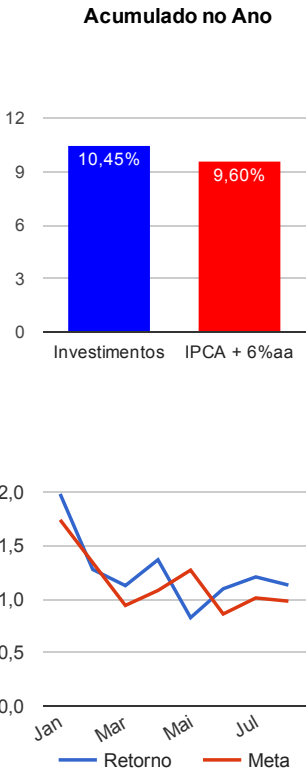
Sub-segmento	Valor	%
IDKA IPCA 2A	70.361.579,07	27,11%
IRF-M 1	63.716.014,96	24,55%
IMA-B 5	38.427.763,85	14,81%
CDI	26.069.771,61	10,05%
IMA-B	23.004.598,28	8,87%
IRF-M	13.250.653,14	5,11%
IMA-GERAL	9.736.994,19	3,75%
CRÉDITO PRIVADO	9.086.867,04	3,50%
FUNDO IMOBILIÁRIO	3.190.919,40	1,23%
AÇÕES - SETORIAIS	2.648.215,76	1,02%

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



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	222.268.582,18	3.111.515,01	1.401.422,52	228.418.541,38	4.439.866,71	1,98%	1,74%	113,96%	1,00%
Fevereiro	228.418.541,38	5.467.304,09	2.845.550,27	233.988.550,54	2.948.255,34	1,28%	1,34%	94,93%	0,86%
Março	233.988.550,54	2.396.477,84	1.480.622,63	237.547.464,51	2.643.058,76	1,13%	0,94%	119,42%	1,08%
Abril	237.547.464,51	42.986.621,86	41.530.622,63	242.270.910,87	3.267.447,13	1,37%	1,08%	127,01%	0,78%
Mai	242.270.910,87	109.647.050,75	107.454.053,59	246.482.891,25	2.018.983,22	0,83%	1,27%	65,00%	0,76%
Junho	246.482.891,25	2.800.885,53	1.628.378,25	250.368.415,38	2.713.016,85	1,10%	0,86%	127,12%	0,64%
Julho	250.368.415,38	27.051.418,00	24.945.799,02	255.520.444,18	3.046.409,82	1,21%	1,01%	119,55%	0,46%
Agosto	255.520.444,18	38.712.397,11	37.639.743,03	259.493.377,30	2.900.279,04	1,13%	0,98%	115,86%	0,81%
Acumulado no ano					23.977.316,87	10,45%	9,60%	108,93%	





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(%)
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	7.073.893,89	0,00	0,00	7.176.546,14	102.652,25	1,45%	1,24%	1,45%
BB RPPS I FI RENDA FIXA IPCA CRÉDITO PRIVADO	1.885.636,68	0,00	0,00	1.910.320,90	24.684,22	1,31%	0,18%	1,31%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	20.019.365,07	0,00	578.476,20	19.698.332,83	257.443,96	1,29%	4,58%	-1,60%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	64.797.065,32	0,00	0,00	65.584.984,69	787.919,37	1,22%	0,73%	1,22%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VIII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.097.412,75	0,00	0,00	13.250.653,14	153.240,39	1,17%	0,04%	1,17%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12.572.313,30	0,00	354.179,53	12.353.771,24	135.637,47	1,08%	0,12%	1,09%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	49.911.289,84	10.000.000,00	0,00	60.542.976,80	631.686,96	1,05%	0,05%	1,17%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.638.375,80	0,00	0,00	9.736.994,19	98.618,39	1,02%	0,93%	1,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.355.617,24	0,00	5.772.105,43	5.692.655,37	109.143,56	0,96%	0,87%	0,86%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	689.012,81	2.741.347,98	288.886,21	3.173.038,16	31.563,58	0,92%	0,05%	1,16%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	16.264.413,60	10.971.049,13	1.410.973,60	26.069.771,61	245.282,48	0,90%	0,01%	1,21%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	33.753.503,12	0,00	29.235.122,06	4.776.594,38	258.213,32	0,76%	0,55%	0,69%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.635.447,27	10.000.000,00	0,00	18.729.431,02	93.983,75	0,50%	0,80%	1,07%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	5.000.000,00	0,00	4.958.171,67	-41.828,33	-0,84%	1,87%	0,83%
Total Renda Fixa					2.888.241,37	1,15%	0,76%	

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(%)
BB CONSUMO FIC AÇÕES	1.815.745,99	0,00	0,00	1.820.650,67	4.904,68	0,27%	4,67%	0,27%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	3.183.821,37	0,00	0,00	3.190.919,40	7.098,03	0,22%	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	827.530,13	0,00	0,00	827.565,09	34,96	0,00%	6,79%	0,00%
Total Renda Variável					12.037,67	0,21%	5,33%	