

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
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	32.769.567,42	14,48%	1.336	0,32%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	28.748.196,53	12,70%	753	0,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2020	1.408.882,23	0,62%	122	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
DAYCOVAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+3	Não há	7.150.304,67	3,16%	51	14,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.846.299,31	3,02%	716	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	2.862.421,44	1,26%	20	1,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.975.336,34	0,87%	1.176	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	4.493.558,31	1,99%	601	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	13.522.518,86	5,97%	240	1,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	27.791.543,22	12,28%	207	2,31%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	7.560.067,60	3,34%	38	15,50%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
SICREDI INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	9.940.198,46	4,39%	60	7,41%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	11.072.973,22	4,89%	67	3,60%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	5.375.390,37	2,37%	143	0,54%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2030	17.298.624,00	7,64%	34	9,15%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	23.667.332,95	10,46%	808	0,44%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	10.021.951,80	4,43%	38	6,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SUL INVEST FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 6	Não se aplica	Não se aplica	1.004.862,59	0,44%	20	1,68%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	1.145.181,20	0,51%	98	1,02%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
BB RPPS I FI RENDA FIXA IPCA CRÉDITO PRIVADO	Término do fundo	Não há	955.160,45	0,42%	29	1,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	D+15	Não há	917.529,03	0,41%	28	7,11%	Artigo 8º, Inciso I
BB INDEXADO IBRX FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.520.027,83	0,67%	5.160	1,37%	Artigo 8º, Inciso I

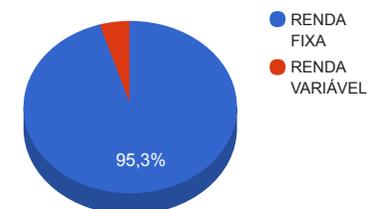
Carteira consolidada de investimentos - base (agosto / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	2.893.990,75	1,28%	16	10,16%	Artigo 8º, Inciso II
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	D+4	Não há	968.401,49	0,43%	9.082	0,56%	Artigo 8º, Inciso III
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	2.190.075,07	0,97%	476	1,66%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	2.243.712,98	0,99%	193	10,67%	Artigo 8º, Inciso III
		TOTAL -	226.344.108,12				

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

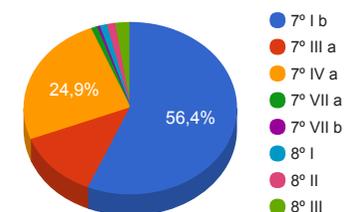
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	70,00%	127.568.628,33	56,36%	30.872.247,35
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	18,00%	28.573.239,28	12,62%	12.168.700,18
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	56.363.299,12	24,90%	11.539.933,32
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	3,00%	2.150.043,79	0,95%	4.640.279,45
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	4,00%	955.160,45	0,42%	8.098.603,87
Total Renda Fixa	100,00%	125,00	215.610.370,97	95,26%	

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	5,00%	2.437.556,86	1,08%	8.879.648,55
Artigo 8º, Inciso II	20,00%	0,00%	2.893.990,75	1,28%	-2.893.990,75
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	5,00%	5.402.189,54	2,39%	5.915.015,87
Total Renda Variável	30,00%	10,00	10.733.737,15	4,74%	

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%	-	-	-
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%
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%
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%
IPCA + 7,50% ao ano	1,11%	10,63%	3,25%	7,06%	17,15%	37,97%	-	-	-
SUL INVEST FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 6	-12,27%	-4,13%	-10,48%	-7,23%	1,51%	1,49%	0,18%	20,900%	-
IMA-B 5	1,09%	11,35%	3,27%	6,50%	18,11%	31,19%	-	-	-
DAYCOVAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1,12%	10,57%	3,10%	6,08%	16,90%	-	0,50%	0,842%	3,50%
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%
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%	-	-	-
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	0,96%	16,25%	4,42%	11,34%	17,93%	26,29%	0,20%	0,959%	4,09%
IPCA + 6,00% ao ano	0,98%	9,60%	2,87%	6,29%	15,51%	34,14%	-	-	-

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

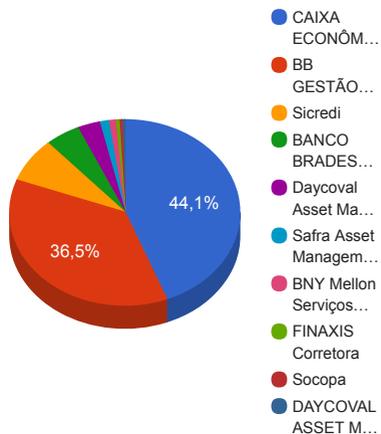
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,13%	10,15%	3,20%	6,73%	15,90%	34,89%	0,20%	0,130%	0,34%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,05%	11,73%	3,25%	6,70%	18,38%	29,53%	0,15%	0,896%	3,86%
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,75%	3,85%	0,20%	3,58%	9,17%	19,87%	0,20%	4,420%	3,99%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,78%	3,81%	0,19%	3,59%	9,17%	19,87%	0,20%	4,487%	4,06%
101,50% do IPCA + 5,75% ao ano	0,97%	9,57%	2,85%	6,26%	15,47%	34,01%	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-4,45%	-8,52%	-4,90%	-8,21%	-8,34%	-14,58%	0,25%	5,173%	4,98%
IMA-B	0,89%	20,11%	5,41%	15,26%	25,51%	29,04%	-	-	-
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%
SICREDI INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	0,83%	18,93%	5,22%	14,48%	24,23%	27,53%	0,20%	1,884%	9,12%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	0,80%	18,12%	5,14%	13,68%	23,74%	31,65%	0,45%	1,937%	8,00%
IMA-B 5+	0,87%	25,95%	6,93%	21,12%	30,33%	28,94%	-	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,89%	25,80%	6,92%	21,25%	29,82%	28,63%	0,20%	2,561%	13,42%
IPCA	0,44%	5,42%	1,32%	3,17%	8,97%	19,36%	-	-	-
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)

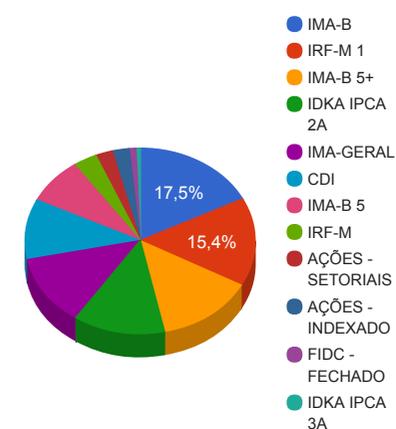
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IBX	1,12%	32,53%	19,85%	34,26%	23,14%	-4,30%	-	-	-
BB INDEXADO IBRX FIC AÇÕES	1,03%	30,43%	19,54%	32,66%	21,51%	-8,28%	1,50%	7,536%	25,25%
Ibovespa	1,03%	33,57%	19,45%	35,30%	24,18%	-5,53%	-	-	-
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	0,79%	32,70%	18,77%	34,59%	22,11%	-5,78%	0,50%	8,262%	31,46%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	-0,46%	23,45%	12,84%	22,39%	12,15%	-21,94%	2,80%	7,680%	23,05%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	-1,19%	40,66%	22,17%	42,71%	28,69%	-10,82%	2,00%	7,193%	22,91%
SMLL	0,18%	35,07%	25,27%	41,09%	28,67%	-13,77%	-	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	-1,95%	18,99%	13,15%	18,53%	21,34%	-1,17%	2,00%	7,217%	16,73%
BBSEGURIDADE ON NM - BBSE3	-0,58%	27,40%	9,92%	24,23%	8,00%	-8,31%	-	-	-
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	-0,62%	25,76%	9,56%	22,97%	6,14%	-11,35%	1,5%	7,975%	43,97%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	99.865.689,48	44,12%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	82.634.805,36	36,51%
Sicredi	17.500.266,06	7,73%
BANCO BRADESCO	11.072.973,22	4,89%
Daycoval Asset Management	7.150.304,67	3,16%
Safra Asset Management	2.862.421,44	1,26%
BNY Mellon Serviços Financeiros	2.190.075,07	0,97%
FINAXIS Corretora	1.145.181,20	0,51%
Socopa	1.004.862,59	0,44%
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT ADMINISTRAÇÃO DE RECURSOS	917.529,03	0,41%



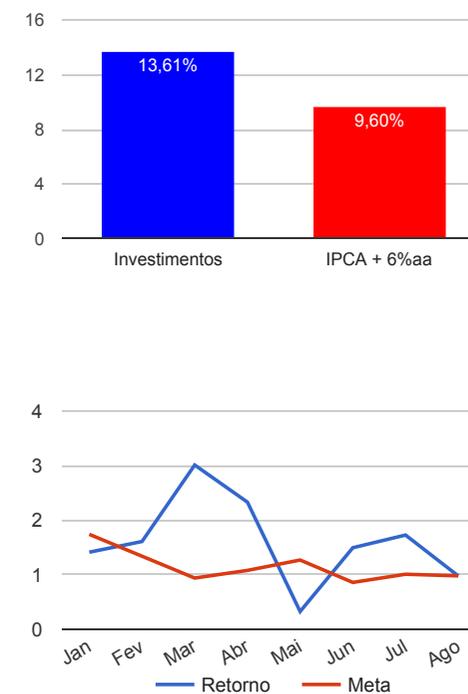
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	39.539.819,69	17,47%
IRF-M 1	34.744.903,76	15,35%
IMA-B 5+	30.821.142,86	13,62%
IDKA IPCA 2A	28.748.196,53	12,70%
IMA-GERAL	27.791.543,22	12,28%
CDI	23.667.332,95	10,46%
IMA-B 5	18.223.277,89	8,05%
IRF-M	7.560.067,60	3,34%
AÇÕES - SETORIAIS	5.402.189,54	2,39%
AÇÕES - INDEXADO	5.331.547,61	2,36%
FIDC - FECHADO	2.150.043,79	0,95%
IDKA IPCA 3A	1.408.882,23	0,62%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	185.108.965,39	6.957.443,56	5.100.594,69	189.608.288,02	2.642.473,76	1,41%	1,74%	81,25%	1,48%
Fevereiro	189.608.288,02	4.245.836,11	2.362.897,71	194.572.326,68	3.081.100,26	1,61%	1,34%	119,69%	2,33%
Março	194.572.326,68	3.352.000,00	1.395.129,18	202.442.046,61	5.912.849,11	3,01%	0,94%	319,33%	3,15%
Abril	202.442.046,61	3.246.705,33	1.451.295,33	208.995.012,47	4.757.555,86	2,33%	1,08%	216,42%	2,09%
Mai	208.995.012,47	9.123.050,72	7.395.409,74	211.413.837,88	691.184,43	0,33%	1,27%	25,82%	2,23%
Junho	211.413.837,88	10.626.971,23	8.905.122,57	216.321.844,89	3.186.158,35	1,49%	0,86%	173,47%	1,40%
Julho	216.321.844,89	12.203.584,49	8.632.494,66	223.690.655,65	3.797.720,93	1,73%	1,01%	171,12%	0,97%
Agosto	223.690.655,65	13.883.074,35	13.423.759,04	226.344.108,12	2.194.137,16	0,98%	0,98%	100,34%	1,70%
Acumulado no ano					26.263.179,86	13,61%	9,60%	141,87%	

Acumulado no Ano



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 RPPS I FI RENDA FIXA IPCA CRÉDITO PRIVADO	942.818,34	0,00	0,00	955.160,45	12.342,11	1,31%	0,18%	1,31%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	23.869.947,23	0,00	500.000,00	23.667.332,95	297.385,72	1,25%	0,02%	1,25%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	26.945.287,33	1.458.717,23	0,00	28.748.196,53	344.191,97	1,21%	0,75%	1,28%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.952.631,47	0,00	0,00	1.975.336,34	22.704,87	1,16%	0,05%	1,16%
DAYCOVAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	7.071.320,91	0,00	0,00	7.150.304,67	78.983,76	1,12%	0,84%	1,12%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.470.602,42	0,00	156.019,52	5.375.390,37	60.807,47	1,11%	0,13%	1,13%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.916.676,66	0,00	528.987,72	1.408.882,23	21.193,29	1,11%	0,90%	1,05%
SUL INVEST FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 6	1.145.432,64	0,00	153.002,92	1.004.862,59	12.432,87	1,09%	20,90%	-12,27%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	17.612.462,00	0,00	504.296,33	17.298.624,00	190.458,33	1,08%	4,49%	-1,78%
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.200.240,90	0,00	287.681,47	10.021.951,80	109.392,37	1,07%	4,42%	-1,75%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	33.244.773,02	1.790.000,00	2.639.000,00	32.769.567,42	373.794,40	1,07%	0,05%	1,17%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	27.510.064,43	0,00	0,00	27.791.543,22	281.478,79	1,02%	0,93%	1,02%
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	7.487.858,87	0,00	0,00	7.560.067,60	72.208,73	0,96%	0,96%	0,96%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.403.049,21	0,00	0,00	13.522.518,86	119.469,65	0,89%	2,56%	0,89%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.453.915,12	0,00	0,00	4.493.558,31	39.643,19	0,89%	1,90%	0,89%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.789.868,90	0,00	0,00	6.846.299,31	56.430,41	0,83%	1,87%	0,83%
SICREDI INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	9.858.533,97	0,00	0,00	9.940.198,46	81.664,49	0,83%	1,88%	0,83%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	2.839.799,33	0,00	0,00	2.862.421,44	22.622,11	0,80%	1,94%	0,80%
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	2.418.559,98	8.605.369,40	0,00	11.072.973,22	49.043,84	0,44%	0,83%	1,07%
BRADERCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.573.114,68	0,00	8.605.369,40	0,00	32.254,72	0,38%	0,05%	1,18%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.198.545,36	0,00	49.401,68	1.145.181,20	-3.962,48	-0,33%	5,17%	-4,45%
Total Renda Fixa					2.274.540,61	1,06%	1,41%	

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 BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	2.387.353,92	500.000,00	0,00	2.893.990,75	6.636,83	0,23%	8,26%	0,79%
BB INDEXADO IBRX FIC AÇÕES	1.020.844,24	500.000,00	0,00	1.520.027,83	-816,41	-0,05%	7,54%	1,03%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	921.751,77	0,00	0,00	917.529,03	-4.222,74	-0,46%	7,68%	-0,46%
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	974.394,94	0,00	0,00	968.401,49	-5.993,45	-0,62%	7,97%	-0,62%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	1.770.579,55	500.000,00	0,00	2.243.712,98	-26.866,57	-1,18%	7,19%	-1,19%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	1.710.228,46	528.987,72	0,00	2.190.075,07	-49.141,11	-2,19%	7,22%	-1,95%
Total Renda Variável					-80.403,45	-0,74%	7,65%	