

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)

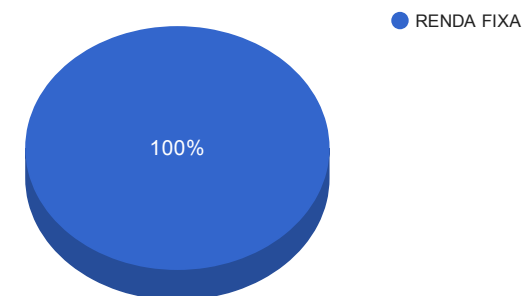
| Produto / Fundo | Disponibilidade Resgate | Carência | Saldo | Particip. S/ Total | Qtde. Cotistas | % S/ PL Fundo | RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014 |
|---|-------------------------|------------|----------------------|-----------------------|-------------------|------------------|--------------------------------------|
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+2 | Não há | 3.604.982,66 | 4,11% | 240 | 0,27% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+1 | Não há | 5.294.680,42 | 6,04% | 753 | 0,08% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | D+0 | Não há | 6.073.741,10 | 6,93% | 207 | 0,50% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | D+0 | Não há | 1.992.535,79 | 2,27% | 716 | 0,04% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | D+0 | Não há | 6.194.192,21 | 7,07% | 1.336 | 0,06% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | D+0 | Não há | 235.429,29 | 0,27% | 631 | 0,01% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+0 | 15/08/2020 | 2.803.781,59 | 3,20% | 122 | 0,36% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | D+0 | 16/08/2020 | 7.531.106,35 | 8,60% | 97 | 1,27% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+1 | Não há | 9.246.166,75 | 10,55% | 100 | 2,52% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+0 | Não há | 10.176.346,01 | 11,62% | 1.176 | 0,12% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP | D+0 | Não há | 8.328.046,81 | 9,51% | 340 | 0,36% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a " |
| BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+1 | Não há | 2.394.830,40 | 2,73% | 241 | 0,22% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a " |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+0 | Não há | 17.757.798,33 | 20,27% | 808 | 0,33% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | D+0 | Não há | 2.849.229,56 | 3,25% | 467 | 0,13% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+0 | Não há | 3.123.531,26 | 3,57% | 583 | 0,23% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| TOTAL - | | | 87.606.398,53 | | | | |

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

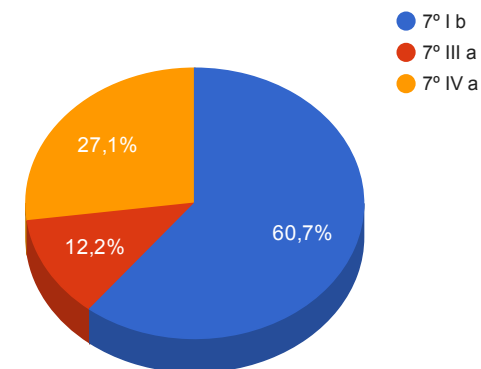
| Artigos - Renda Fixa | Limite Resolução | Limite Política | Total Artigo | % Carteira | GAP Política |
|-------------------------------------|------------------|-----------------|----------------------|----------------|---------------|
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " | 100,00% | 85,00% | 53.152.962,17 | 60,67% | 21.312.476,58 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a " | 80,00% | 30,00% | 10.722.877,21 | 12,24% | 15.559.042,35 |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " | 30,00% | 30,00% | 23.730.559,15 | 27,09% | 2.551.360,41 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b " | 5,00% | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 4.380.319,93 |
| Artigo 7º, Inciso VI | 15,00% | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 4.380.319,93 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a " | 5,00% | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 4.380.319,93 |
| Total Renda Fixa | 100,00% | 160,00 | 87.606.398,53 | 100,00% | |

| Artigos - Renda Variável | Limite Resolução | Limite Política | Total Artigo | % Carteira | GAP Política |
|-----------------------------|------------------|-----------------|--------------|--------------|--------------|
| Artigo 8º, Inciso III | 15,00% | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 4.380.319,93 |
| Artigo 8º, Inciso IV | 5,00% | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 4.380.319,93 |
| Artigo 8º, Inciso VI | 5,00% | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 4.380.319,93 |
| Total Renda Variável | 30,00% | 15,00 | 0,00 | 0,00% | |

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% | - | - | - |
| 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% |
| 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% |
| CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1,19% | 9,30% | 3,48% | 6,97% | 13,97% | 27,77% | 0,20% | 0,011% | 0,21% |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,16% | 8,63% | 3,42% | 6,60% | 13,22% | 26,27% | 1,00% | 0,016% | 0,08% |
| 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 Geral ex-C | 1,04% | 15,72% | 4,55% | 11,62% | 19,36% | 27,59% | - | - | - |
| BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,04% | 15,64% | 4,50% | 11,61% | 19,12% | 26,97% | 0,20% | 0,927% | 4,52% |
| 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% |
| IPCA + 6,00% ao ano | 0,98% | 9,60% | 2,87% | 6,29% | 15,51% | 34,14% | - | - | - |
| 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% |
| IMA-B | 0,89% | 20,11% | 5,41% | 15,26% | 25,51% | 29,04% | - | - | - |

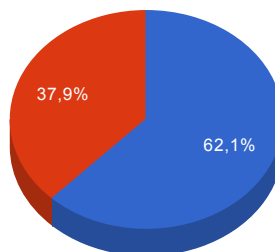
Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (agosto / 2016)

| | Mês | Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | Taxa adm | VaR - Mês | Volatilidade - 12 meses |
|---|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,98% | 19,70% | 5,37% | 14,95% | 24,89% | 28,27% | 0,30% | 1,894% | 9,19% |
| 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% |
| 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 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | -1,81% | 7,51% | 0,44% | 4,24% | 13,26% | - | 0,20% | 5,224% | 7,67% |
| 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% |

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

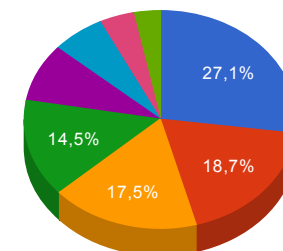
| Administrador | Valor | % |
|----------------------------|---------------|--------|
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM | 54.402.117,42 | 62,10% |
| CAIXA ECONÔMICA FEDERAL | 33.204.281,11 | 37,90% |

- BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM
- CAIXA ECONÔMICA FEDERAL



| Sub-segmento | Valor | % |
|--------------|---------------|--------|
| CDI | 23.730.559,15 | 27,09% |
| IRF-M 1 | 16.370.538,22 | 18,69% |
| IMA-GERAL | 15.319.907,85 | 17,49% |
| IMA-B | 12.715.413,00 | 14,51% |
| IMA-B 5 | 7.531.106,35 | 8,60% |
| IDKA IPCA 2A | 5.530.109,71 | 6,31% |
| IMA-B 5+ | 3.604.982,66 | 4,11% |
| IDKA IPCA 3A | 2.803.781,59 | 3,20% |

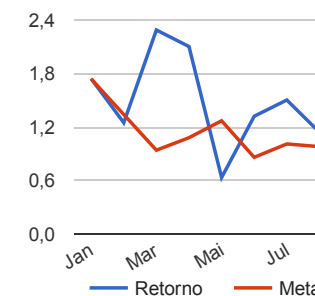
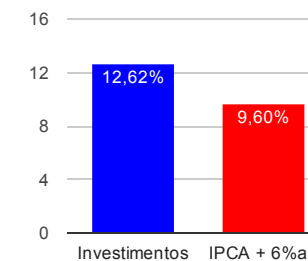
- CDI
- IRF-M 1
- IMA-GERAL
- IMA-B
- IMA-B 5
- IDKA IPCA 2A
- IMA-B 5+
- IDKA IPCA 3A



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

| Mês | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (\$) | Retorno (%) | Meta (%) | Gap (%) | VaR (%) |
|------------------|----------------|--------------|--------------|---------------|--------------|-------------|----------|---------|---------|
| Janeiro | 75.972.334,18 | 1.395.750,08 | 918.412,98 | 77.782.013,01 | 1.332.341,73 | 1,74% | 1,74% | 100,19% | 1,01% |
| Fevereiro | 77.782.013,01 | 1.820.519,76 | 1.133.534,42 | 79.448.523,97 | 979.525,62 | 1,25% | 1,34% | 92,86% | 1,48% |
| Março | 79.448.523,97 | 6.413.240,25 | 5.913.897,40 | 81.777.556,22 | 1.829.689,40 | 2,29% | 0,94% | 242,90% | 2,47% |
| Abril | 81.777.556,22 | 1.037.527,12 | 896.892,47 | 83.640.739,93 | 1.722.549,06 | 2,10% | 1,08% | 195,36% | 1,53% |
| Mai | 83.640.739,93 | 1.958.100,73 | 1.176.511,44 | 84.956.758,79 | 534.429,57 | 0,63% | 1,27% | 49,82% | 1,39% |
| Junho | 84.956.758,79 | 6.582.441,40 | 6.400.353,35 | 86.263.174,08 | 1.124.327,24 | 1,32% | 0,86% | 153,24% | 1,03% |
| Julho | 86.263.174,08 | 1.442.709,29 | 1.006.191,14 | 88.002.775,11 | 1.303.082,88 | 1,50% | 1,01% | 148,92% | 0,76% |
| Agosto | 88.002.775,11 | 2.800.270,91 | 4.201.734,14 | 87.606.398,53 | 1.005.086,65 | 1,14% | 0,98% | 117,07% | 1,07% |
| Acumulado no ano | | | | | 9.831.032,15 | 12,62% | 9,60% | 131,47% | |

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 IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 5.227.641,28 | 0,00 | 0,00 | 5.294.680,42 | 67.039,14 | 1,28% | 0,75% | 1,28% |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 17.537.870,57 | 0,00 | 0,00 | 17.757.798,33 | 219.927,76 | 1,25% | 0,02% | 1,25% |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 232.600,91 | 0,00 | 0,00 | 235.429,29 | 2.828,38 | 1,22% | 0,73% | 1,22% |
| CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 7.669.846,11 | 0,00 | 231.412,93 | 7.531.106,35 | 92.673,17 | 1,21% | 5,22% | -1,81% |
| CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 2.815.612,02 | 0,00 | 0,00 | 2.849.229,56 | 33.617,54 | 1,19% | 0,01% | 1,19% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 6.122.258,50 | 0,00 | 0,00 | 6.194.192,21 | 71.933,71 | 1,17% | 0,05% | 1,17% |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 10.059.377,27 | 0,00 | 0,00 | 10.176.346,01 | 116.968,74 | 1,16% | 0,05% | 1,16% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 3.814.330,70 | 0,00 | 1.052.725,34 | 2.803.781,59 | 42.176,23 | 1,11% | 0,90% | 1,05% |
| CAIXA BRASIL IPCA XV FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO | 1.921.068,00 | 0,00 | 1.942.270,00 | 0,00 | 21.202,00 | 1,10% | - | - |
| BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ... | 9.150.971,97 | 0,00 | 0,00 | 9.246.166,75 | 95.194,78 | 1,04% | 0,93% | 1,04% |
| BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 2.371.487,82 | 0,00 | 0,00 | 2.394.830,40 | 23.342,58 | 0,98% | 1,89% | 0,98% |
| CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 5.783.457,01 | 231.412,93 | 0,00 | 6.073.741,10 | 58.871,16 | 0,98% | 0,93% | 1,02% |
| CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP | 8.248.434,10 | 0,00 | 0,00 | 8.328.046,81 | 79.612,71 | 0,97% | 1,79% | 0,97% |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 3.573.133,12 | 0,00 | 0,00 | 3.604.982,66 | 31.849,54 | 0,89% | 2,56% | 0,89% |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1.976.112,38 | 0,00 | 0,00 | 1.992.535,79 | 16.423,41 | 0,83% | 1,87% | 0,83% |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1.498.573,35 | 2.568.857,98 | 975.325,87 | 3.123.531,26 | 31.425,80 | 0,77% | 0,02% | 1,16% |
| Total Renda Fixa | | | | | 1.005.086,65 | 1,14% | 1,07% | |