

## Relatório Analítico dos Inv em ago



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

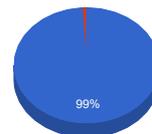
Carteira consolidada de investimentos - base (agosto / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.544.989,11	18,08%	1.381	0,02%	Art
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.598.027,54	33,66%	711	0,10%	Art
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.354.200,45	12,01%	601	0,06%	Art
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	3.005.521,55	15,33%	334	0,16%	Art
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.673,47	0,01%	628	0,00%	Art
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	2.839.210,28	14,48%	771	0,05%	Art
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.067.862,27	5,45%	534	0,01%	Art
WESTERN ASSET DIVIDEND YIELD FI AÇÕES	D+4	Não há	192.310,75	0,98%	7	0,52%	
		<b>TOTAL -</b>	<b>19.604.795,42</b>				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	12.497.217,10	63,75%	30,00%	50,00%	70,00%	1.226.139,69
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	3.005.521,55	15,33%	15,00%	20,00%	60,00%	8.757.355,70
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	3.909.746,02	19,94%	5,00%	5,00%	30,00%	1.971.692,61
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	2.940.719,31
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>19.412.484,67</b>	<b>99,02%</b>	<b>55,00</b>	<b>85,00</b>	<b>175,00</b>	<b>-</b>

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	192.310,75	0,98%	5,00%	10,00%	15,00%	2.748.408,56
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	980.239,77
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>192.310,75</b>	<b>0,98%</b>	<b>7,00</b>	<b>15,00</b>	<b>20,00</b>	<b>-</b>

Distribuição por Artigo / Re



**Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos**

Artigos - Renda Fixa	Base: agosto / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	12.497.217,10	63,75%	30,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	3.005.521,55	15,33%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	3.909.746,02	19,94%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	0,00	0,00%	5,00%	15,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>19.412.484,67</b>	<b>99,02%</b>	<b>55,00</b>	<b>175,00</b>

Artigos - Renda Variável	Base: agosto / 2017		Lin Inferi
	Carteira (\$)	Carteira (%)	
Artigo 8º, Inciso III	192.310,75	0,98%	5,0
Artigo 8º, Inciso IV	0,00	0,00%	2,0
<b>Total Renda Variável</b>	<b>192.310,75</b>	<b>0,98%</b>	<b>7,</b>

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês
IMA-B 5	1,25%	9,83%	4,68%	6,98%	13,91%	34,53%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,24%	9,76%	4,66%	6,94%	13,74%	33,96%	0,20%	0,720%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,24%	9,71%	4,63%	6,90%	13,72%	33,75%	0,20%	0,717%
IDKA IPCA 2 Anos	0,97%	10,12%	4,34%	7,49%	14,33%	34,57%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,96%	9,32%	4,05%	6,79%	13,26%	33,40%	0,20%	0,491%
IRF-M 1	0,90%	8,33%	2,86%	5,88%	13,15%	29,98%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,89%	8,21%	2,82%	5,81%	12,96%	29,61%	0,20%	0,081%
Selic	0,80%	7,35%	2,43%	5,29%	12,06%	27,92%	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,99%	7,74%	2,65%	5,65%	12,68%	28,66%	0,20%	0,074%
CDI	0,80%	7,34%	2,43%	5,28%	12,05%	27,88%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,79%	7,38%	2,42%	5,31%	12,08%	27,93%	0,20%	0,007%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,70%	6,67%	2,16%	4,76%	11,07%	25,76%	1,00%	0,003%

Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (agosto / 2017)

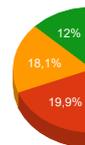
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês
IDIV	6,96%	20,19%	10,75%	3,45%	33,46%	71,33%	-	-
WESTERN ASSET DIVIDEND YIELD FI AÇÕES	5,86%	16,46%	9,03%	4,74%	12,71%	37,65%	2,00%	3,966%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	15.336.427,38	78,23%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	3.008.195,02	15,34%
BANCO BRADESCO	1.067.862,27	5,45%
WESTERN ASSET	192.310,75	0,98%



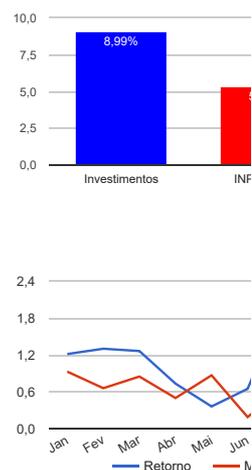
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5	9.603.549,09	48,99%
CDI	3.909.746,02	19,94%
IRF-M 1	3.544.989,11	18,08%
IDKA IPCA 2A	2.354.200,45	12,01%
AÇÕES - SETORIAIS	192.310,75	0,98%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	14.438.742,95	1.200.000,00	0,00	15.828.937,80	190.194,85	1,22%	0,93%	130,47%	0,95%
Fevereiro	15.828.937,80	0,00	0,00	16.035.218,12	206.280,32	1,30%	0,66%	198,03%	0,55%
Março	16.035.218,12	0,00	0,00	16.238.113,88	202.895,76	1,27%	0,85%	148,00%	0,60%
Abril	16.238.113,88	2.800.000,00	200.000,00	18.976.529,08	138.415,20	0,73%	0,50%	147,72%	0,45%
Mai	18.976.529,08	1.350.000,00	1.250.000,00	19.145.651,97	69.122,89	0,36%	0,87%	41,56%	3,29%
Junho	19.145.651,97	0,00	0,00	19.270.159,20	124.507,23	0,65%	0,19%	350,96%	0,64%
Julho	19.270.159,20	1.200.000,00	1.195.000,00	19.667.726,59	392.567,39	2,04%	0,66%	309,72%	0,78%
Agosto	19.667.726,59	800.000,00	1.078.000,00	19.604.795,42	215.068,83	1,09%	0,50%	217,37%	0,47%
Acumulado no ano					1.539.052,47	8,99%	5,28%	170,35%	

Acumulado no An



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR -
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2.968.587,81	0,00	0,00	3.005.521,55	36.933,74	1,24%	0
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.717.236,11	800.000,00	1.000.000,00	6.598.027,54	80.791,43	1,07%	0
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.057.415,51	0,00	0,00	1.067.862,27	10.446,76	0,99%	0
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.331.723,11	0,00	0,00	2.354.200,45	22.477,34	0,96%	0
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.513.728,73	0,00	0,00	3.544.989,11	31.260,38	0,89%	0
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.894.721,20	0,00	78.000,00	2.839.210,28	22.489,08	0,78%	0
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.654,77	0,00	0,00	2.673,47	18,70	0,70%	0
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>204.417,43</b>	<b>1,05%</b>	<b>0</b>

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR -
WESTERN ASSET DIVIDEND YIELD FI AÇÕES	181.659,35	0,00	0,00	192.310,75	10.651,40	5,86%	3
				<b>Total Renda Variável</b>	<b>10.651,40</b>	<b>5,86%</b>	<b>3</b>