



Relatório Analítico dos Investimentos em agosto de 2017

Carteira consolidada de investimentos - base (agosto / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.742.989,92	5,63%	707	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	222.250,50	0,72%	688	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.838.432,35	9,17%	754	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	4.458.980,68	14,41%	610	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.523.916,19	4,92%	113	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	250.156,24	0,81%	256	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
SICREDI INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	D+1	Não há	3.347.724,78	10,82%	66	2,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	2.079.199,21	6,72%	60	0,39%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	861.035,67	2,78%	334	0,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M LP	D+1	Não há	3.119.287,11	10,08%	48	4,19%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	3.781.096,22	12,22%	771	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	2.160.568,82	6,98%	766	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' '
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	1.410.181,63	4,56%	60	1,51%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	9.712,77	0,03%	628	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' '
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	878.724,55	2,84%	98	0,87%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a ' '
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	D+15	Não há	724.262,79	2,34%	284	2,12%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	D+4	Não há	734.141,84	2,37%	72	0,95%	Artigo 8º, Inciso I
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	803.151,01	2,60%	50	1,23%	Artigo 8º, Inciso IV
Total			30.945.812,28				

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

Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	10.786.569,64	34,86%	30,00%	46,00%	70,00%	10.875.498,96
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	9.657.403,01	31,21%	15,00%	20,00%	60,00%	8.910.084,36
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	7.361.559,44	23,79%	5,00%	5,00%	30,00%	1.922.184,24
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	10,00%	3.094.581,23
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	878.724,55	2,84%	0,00%	4,00%	5,00%	668.566,06
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	1.458.404,63	4,71%	0,00%	5,00%	10,00%	1.636.176,60
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	3.094.581,23
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	803.151,01	2,60%	0,00%	5,00%	5,00%	744.139,60
Total Carteira		30.945.812,28					

RENDA FIXA	28.684.256,64	92,69%
RENDA VARIÁVEL	2.261.555,64	7,31%

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: agosto / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	10.786.569,64	34,86%	30,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	9.657.403,01	31,21%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	7.361.559,44	23,79%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	878.724,55	2,84%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso I	1.458.404,63	4,71%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV	803.151,01	2,60%	0,00%	5,00%
Total	30.945.812,28	100,00%	50,00	200,00

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	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5+	1,36%	11,93%	6,04%	4,21%	16,45%	51,77%	-	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	1,33%	11,71%	5,92%	3,91%	16,16%	50,49%	0,20%	2,662%	13,08%
IMA-B	1,34%	11,14%	5,57%	5,06%	15,49%	44,95%	-	-	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,33%	11,15%	5,59%	5,01%	15,58%	44,34%	0,30%	1,812%	9,85%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,33%	11,00%	5,51%	4,97%	15,39%	43,43%	0,20%	1,813%	9,83%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,32%	10,97%	5,49%	4,92%	15,22%	44,11%	0,20%	1,808%	9,85%
SICREDI INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1,31%	10,87%	5,39%	4,80%	15,44%	43,41%	0,18%	1,803%	9,73%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1,31%	10,68%	5,33%	4,73%	15,02%	43,63%	0,20%	1,815%	9,84%
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%	3,64%
IRF-M	1,06%	11,91%	4,79%	7,25%	18,00%	40,09%	-	-	-
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M LP	1,04%	11,71%	4,78%	7,05%	17,63%	38,71%	0,20%	0,962%	5,07%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,04%	11,73%	4,73%	7,08%	17,74%	39,52%	0,20%	0,975%	4,87%
IDKA IPCA 2 Anos	0,97%	10,12%	4,34%	7,49%	14,33%	34,57%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,98%	9,35%	4,08%	6,76%	13,28%	33,34%	0,20%	0,487%	2,90%
CDI	0,80%	7,34%	2,43%	5,28%	12,05%	27,88%	-	-	-
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	0,91%	8,56%	2,44%	6,33%	13,82%	31,88%	0,75%	1,480%	9,19%

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	Volatilidade - 12 meses
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,79%	7,40%	2,43%	5,30%	12,17%	27,88%	0,20%	0,003%	0,11%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,79%	7,38%	2,42%	5,31%	12,08%	27,93%	0,20%	0,007%	0,11%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,70%	6,67%	2,16%	4,76%	11,07%	25,76%	1,00%	0,003%	0,10%
IPCA	0,19%	1,62%	0,20%	0,90%	2,46%	11,65%	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-1,76%	-5,28%	-2,87%	-4,45%	-10,43%	-17,90%	0,15%	1,272%	1,04%

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	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	7,46%	17,61%	12,95%	6,26%	22,34%	51,93%	-	-	-
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	4,07%	20,24%	10,07%	8,95%	25,95%	41,25%	2,50%	5,704%	21,16%
IBX-50	7,28%	17,56%	12,94%	6,72%	21,99%	47,93%	-	-	-
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	7,41%	16,26%	12,68%	5,89%	19,76%	31,13%	0,70%	5,820%	21,35%
CDI	0,80%	7,34%	2,43%	5,28%	12,05%	27,88%	-	-	-
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	0,99%	8,86%	2,81%	6,61%	15,92%	34,81%	1,00%	0,726%	11,64%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	9.705.694,60	31,36%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	7.353.670,41	23,76%
SICREDI	6.467.011,89	20,90%
BANCO BRADESCO	3.603.115,40	11,64%
Planner Corretora	2.213.332,64	7,15%
FINAXIS CORRETORA	878.724,55	2,84%
BANCO DAYCOVAL	724.262,79	2,34%

Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	12.419.210,24	40,13%
CDI	7.361.559,44	23,79%
IRF-M	3.341.537,61	10,80%
IMA-B 5+	2.079.199,21	6,72%
IDKA IPCA 2A	1.742.989,92	5,63%
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	1.458.404,63	4,71%
FIDC	878.724,55	2,84%
IMA-B 5	861.035,67	2,78%
MULTIMERCADO - MODERADO	803.151,01	2,60%

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Acumulado no Ano

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	27.053.897,10	499.795,15	507.599,75	27.536.894,48	490.801,98	1,81%	0,89%	203,40%	2,57%
Fevereiro	27.536.894,48	808.577,66	637.311,08	28.435.366,42	727.205,36	2,62%	0,75%	350,66%	1,54%
Março	28.435.366,42	856.882,67	692.277,77	28.872.399,23	272.427,91	0,95%	0,78%	121,41%	1,87%
Abril	28.872.399,23	476.716,80	274.170,44	29.128.766,89	53.821,30	0,19%	0,56%	33,19%	1,65%
Maiο	29.128.766,89	1.056.386,94	897.603,22	29.139.510,99	-148.039,62	-0,51%	0,82%	-61,52%	9,16%
Junho	29.139.510,99	636.879,34	551.020,29	29.348.025,82	122.655,78	0,42%	0,26%	164,17%	1,86%
Julho	29.348.025,82	773.832,37	592.773,18	30.356.688,18	827.603,17	2,80%	0,73%	385,02%	1,61%
Agosto	30.356.688,18	778.746,23	570.075,94	30.945.812,28	380.453,81	1,24%	0,72%	171,86%	1,45%
Acumulado no ano					2.726.929,69	9,89%	5,65%	175,26%	

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 - Mês (%)	Instituição(%)	
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	2.051.869,91	0,00	0,00	2.079.199,21	27.329,30	1,33%	2,66%	1,33%	
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	246.870,90	0,00	0,00	250.156,24	3.285,34	1,33%	1,81%	1,33%	
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.801.262,74	0,00	0,00	2.838.432,35	37.169,61	1,33%	1,81%	1,33%	
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.400.776,31	0,00	0,00	4.458.980,68	58.204,37	1,32%	1,81%	1,32%	
SICREDI INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	3.304.295,92	0,00	0,00	3.347.724,78	43.428,86	1,31%	1,80%	1,31%	
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1.504.250,38	0,00	0,00	1.523.916,19	19.665,81	1,31%	1,82%	1,31%	
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	850.454,72	0,00	0,00	861.035,67	10.580,95	1,24%	0,72%	1,24%	
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M LP	3.087.089,66	0,00	0,00	3.119.287,11	32.197,45	1,04%	0,96%	1,04%	
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.726.000,59	0,00	0,00	1.742.989,92	16.989,33	0,98%	0,49%	0,98%	
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	1.397.528,33	0,00	0,00	1.410.181,63	12.653,30	0,91%	1,48%	0,91%	
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	168.972,21	71.165,46	20.000,00	222.250,50	2.112,83	0,88%	0,98%	1,04%	
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	3.751.398,31	0,00	0,00	3.781.096,22	29.697,91	0,79%	0,01%	0,79%	
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	2.193.399,79	0,00	50.000,00	2.160.568,82	17.169,03	0,78%	0,00%	0,79%	
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	31.164,53	477.580,77	500.075,94	9.712,77	1.043,41	0,21%	0,00%	0,70%	
PREMIUM FIDC SÊNIOR	894.456,28	0,00	0,00	878.724,55	-15.731,73	-1,76%	1,27%	-1,33%	
Total Renda Fixa						295.795,77	1,04%	1,25%	

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 - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	683.473,49	0,00	0,00	734.141,84	50.668,35	7,41%	5,82%	7,41%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	695.961,23	0,00	0,00	724.262,79	28.301,56	4,07%	5,70%	4,07%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	567.462,88	230.000,00	0,00	803.151,01	5.688,13	0,71%	0,73%	0,99%
Total Renda Variável					84.658,04	3,89%	3,97%	