

Relatório Analítico dos Investimentos em agosto de 2017



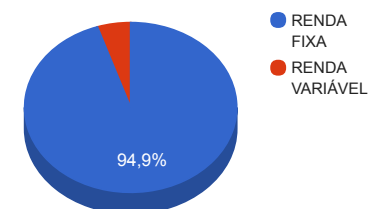
Carteira consolidada de investimentos - base (agosto / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			3.087.201,13	3,73%			Artigo 20
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2030	5.761.083,75	6,96%	26	2,35%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	55.610,37	0,07%	707	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	5.708.459,84	6,90%	46	3,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	1.535.658,23	1,86%	167	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.368.071,05	2,86%	601	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	335.504,25	0,41%	610	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.519.845,08	1,84%	688	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	10.469.258,85	12,65%	1.211	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2024	3.541.840,00	4,28%	104	0,94%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	24.140.680,99	29,17%	754	0,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	1.955.872,00	2,36%	45	0,81%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	356.242,80	0,43%	222	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	16/05/2023	6.403.276,58	7,74%	52	2,23%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	8.086.569,58	9,77%	628	0,66%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	372.377,25	0,45%	221	0,11%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
AZ LEGAN VALORE FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+5	Não há	3.015.239,65	3,64%	1.019	2,84%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
AZ LEGAN BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	3.148.756,66	3,80%	74	3,84%	Artigo 8º, Inciso III
JHSF RIO BRAVO FAZENDA BOA VISTA CAPITAL PROTEGIDO FII - RBBV11	Não se aplica	Não se aplica	897.750,00	1,08%		1,20%	Artigo 8º, Inciso VI
TOTAL -			82.759.298,06				

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

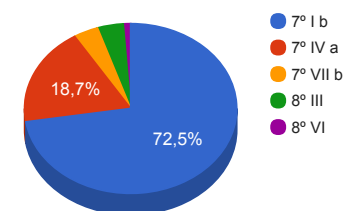
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	57.748.127,21	69,78%	20,00%	70,00%	90,00%	16.735.241,04
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	30,00%	24.827.789,42
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	14.862.223,41	17,96%	10,00%	20,00%	30,00%	9.965.566,01
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	3.015.239,65	3,64%	0,00%	0,00%	5,00%	1.122.725,25
Total Renda Fixa	100,00%	75.625.590,27	91,38%	30,00	95,00	167,50	-

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	3.148.756,66	3,80%	3,00%	3,50%	10,00%	5.127.173,15
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	897.750,00	1,08%	0,00%	1,50%	3,00%	1.585.028,94
Total Renda Variável	30,00%	4.046.506,66	4,89%	3,00	5,00	21,00	-

Distribuição por Artigo / Resolução



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 " a "	0,00	0,00%	0,00%	2,50%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	57.748.127,21	69,78%	20,00%	90,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	14.862.223,41	17,96%	10,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	3.015.239,65	3,64%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	75.625.590,27	91,38%	30,00	167,50

Artigos - Renda Variável	Base: agosto / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I	0,00	0,00%	0,00%	3,00%
Artigo 8º, Inciso III	3.148.756,66	3,80%	3,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	897.750,00	1,08%	0,00%	3,00%
Total Renda Variável	4.046.506,66	4,89%	3,00	21,00

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
IDKA IPCA 5 Anos	1,80%	12,16%	6,17%	7,65%	16,30%	42,60%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,57%	11,32%	5,67%	7,41%	15,24%	-	0,20%	1,153%	6,32%
IMA-B	1,34%	11,14%	5,57%	5,06%	15,49%	44,95%	-	-	-
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%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,99%	9,56%	4,09%	6,64%	13,51%	33,62%	0,20%	0,547%	3,58%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,91%	6,28%	3,04%	3,94%	9,45%	29,35%	0,20%	4,220%	8,57%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,13%	5,16%	3,06%	1,19%	8,45%	33,14%	0,20%	4,061%	12,23%
CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,60%	4,64%	1,87%	4,29%	8,45%	23,30%	0,20%	4,102%	5,85%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-2,05%	2,14%	0,14%	2,99%	5,74%	17,74%	0,20%	4,288%	4,41%
IRF-M	1,06%	11,91%	4,79%	7,25%	18,00%	40,09%	-	-	-
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%
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%	2,83%
IRF-M 1	0,90%	8,33%	2,86%	5,88%	13,15%	29,98%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,88%	8,17%	2,83%	5,78%	12,88%	29,36%	0,10%	0,081%	0,68%

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

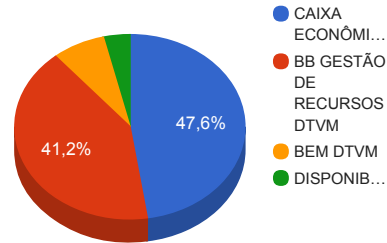
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	0,80%	7,34%	2,43%	5,28%	12,05%	27,88%	-	-	-
AZ LEGAN VALORE FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,90%	8,09%	2,79%	5,76%	12,88%	29,00%	1,00%	0,088%	0,32%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,72%	6,76%	2,21%	4,84%	11,14%	25,78%	0,80%	0,000%	0,10%
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 + 6,00% ao ano	0,72%	5,65%	1,72%	3,93%	8,58%	25,42%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,67%	11,58%	5,71%	7,16%	15,30%	42,49%	0,15%	1,271%	7,00%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

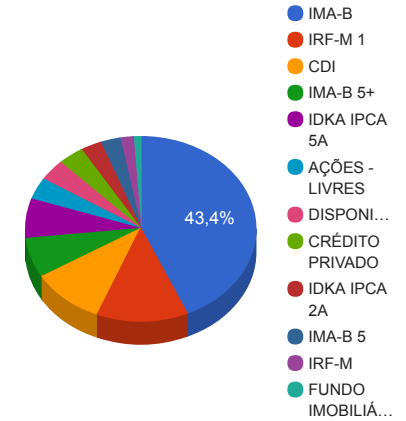
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	7,46%	17,61%	12,95%	6,26%	22,34%	51,93%	-	-	-
AZ LEGAN BRASIL FI AÇÕES	6,95%	16,39%	11,91%	6,88%	21,46%	42,15%	2,00%	5,148%	18,03%
IFIX	0,87%	11,80%	1,36%	2,76%	17,94%	42,94%	-	-	-
JHSF RIO BRAVO FAZENDA BOA VISTA CAPITAL PROTEGIDO FII - RBBV11	-4,01%	-17,15%	-10,60%	-17,37%	-6,70%	-7,85%	0,10%	8,190%	24,69%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	39.393.917,84	47,60%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	34.114.182,78	41,22%
BEM DTVM	6.163.996,31	7,45%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	3.087.201,13	3,73%



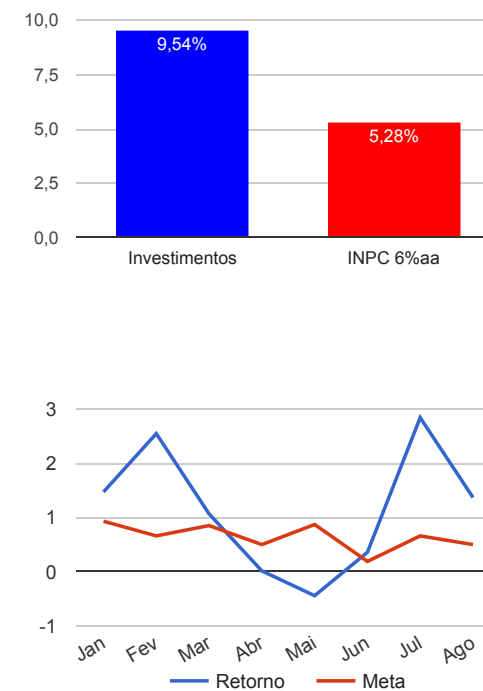
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	35.956.960,05	43,45%
IRF-M 1	10.469.258,85	12,65%
CDI	8.458.946,83	10,22%
IMA-B 5+	5.761.083,75	6,96%
IDKA IPCA 5A	5.708.459,84	6,90%
AÇÕES - LIVRES	3.148.756,66	3,80%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	3.087.201,13	3,73%
CRÉDITO PRIVADO	3.015.239,65	3,64%
IDKA IPCA 2A	2.423.681,42	2,93%
IMA-B 5	2.312.114,80	2,79%
IRF-M	1.519.845,08	1,84%
FUNDO IMOBILIÁRIO	897.750,00	1,08%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	68.422.204,11	6.751.145,09	4.655.961,42	71.553.256,60	1.035.868,82	1,47%	0,93%	157,59%	2,36%
Fevereiro	71.553.256,60	5.134.807,78	6.721.712,79	71.785.784,05	1.819.432,46	2,54%	0,66%	386,39%	2,27%
Março	71.785.784,05	1.780.601,68	1.393.865,82	72.941.615,41	769.095,50	1,07%	0,85%	124,64%	1,69%
Abril	72.941.615,41	4.333.728,45	1.807.058,46	75.480.129,16	11.843,76	0,02%	0,50%	3,16%	1,55%
Mai	75.480.129,16	1.759.920,67	1.718.437,54	75.188.523,55	-333.088,74	-0,44%	0,87%	-50,59%	8,30%
Junho	75.188.523,55	2.014.219,94	1.542.652,48	75.931.554,34	271.463,33	0,36%	0,19%	193,63%	1,76%
Julho	75.931.554,34	1.869.251,06	1.489.210,95	78.476.378,68	2.164.784,23	2,84%	0,66%	431,39%	1,68%
Agosto	78.476.378,68	5.048.439,68	4.927.163,50	79.672.096,93	1.074.442,07	1,37%	0,50%	271,73%	1,70%
Acumulado no ano					6.813.841,43	9,54%	5,28%	180,90%	

Acumulado no Ano



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(%)
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.574.330,00	0,00	93.167,90	3.541.840,00	60.677,90	1,70%	4,22%	-0,91%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.298.064,92	0,00	0,00	6.403.276,58	105.211,66	1,67%	1,27%	1,67%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.773.178,96	0,00	153.820,41	5.708.459,84	89.101,29	1,54%	1,15%	1,57%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.827.037,88	0,00	151.930,46	5.761.083,75	85.976,33	1,48%	4,06%	-1,13%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	23.824.555,92	0,00	0,00	24.140.680,99	316.125,07	1,33%	1,81%	1,33%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	331.124,82	0,00	0,00	335.504,25	4.379,43	1,32%	1,81%	1,32%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.504.243,55	0,00	0,00	1.519.845,08	15.601,53	1,04%	0,98%	1,04%
CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.987.747,20	0,00	52.486,83	1.955.872,00	20.611,63	1,04%	4,10%	-1,60%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	55.068,32	0,00	0,00	55.610,37	542,05	0,98%	0,49%	0,98%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.563.730,38	0,00	43.301,12	1.535.658,23	15.228,97	0,97%	0,55%	0,99%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.345.461,28	0,00	0,00	2.368.071,05	22.609,77	0,96%	0,49%	0,96%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.378.192,95	0,00	0,00	10.469.258,85	91.065,90	0,88%	0,08%	0,88%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	369.701,30	0,00	0,00	372.377,25	2.675,95	0,72%	0,00%	0,72%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	363.683,10	0,00	9.887,94	356.242,80	2.447,64	0,67%	4,29%	-2,05%
AZ LEGAN VALORE FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,00	3.000.000,00	0,00	3.015.239,65	15.239,65	0,51%	0,09%	0,90%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.401.526,88	2.048.439,68	4.422.568,84	8.086.569,58	59.171,86	0,48%	0,00%	0,70%
Total Renda Fixa					906.666,63	1,21%	1,48%	

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(%)
AZ LEGAN BRASIL FI AÇÕES	2.944.231,22	0,00	0,00	3.148.756,66	204.525,44	6,95%	5,15%	6,95%
JHSF RIO BRAVO FAZENDA BOA VISTA CAPITAL PROTEGIDO FII - RBB...	934.500,00	0,00	0,00	897.750,00	-36.750,00	-3,93%	8,19%	-4,01%
Total Renda Variável					167.775,44	4,33%	5,82%	