

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 IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	43.734.169,16	13,15%	1.176	0,53%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	40.356.708,82	12,13%	753	0,60%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	D+1	16/05/2019	11.337.200,80	3,41%	11	15,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	57.353.628,51	17,24%	731	0,99%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	20.928.670,83	6,29%	119	3,72%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.390.653,49	0,42%	298	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	14.435.298,79	4,34%	14	12,57%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	25.078.655,69	7,54%	83	2,27%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	39.899.263,50	12,00%	88	4,11%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BTG PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA	D+0 ou D+1	Não há	12.198.406,00	3,67%	12	8,43%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	13.063.258,98	3,93%	95	3,67%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	2.049.057,01	0,62%	51	0,18%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+30 a D+2880	Não há	6.278.533,79	1,89%	51	1,97%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FIAÇÕES	D+4	Não há	6.558.384,85	1,97%	21.645	1,34%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	23/08/2017	1.135.333,00	0,34%	116	0,33%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FIAÇÕES	D+4	Não há	8.118.946,73	2,44%	3.192	2,91%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	D+5	Não há	4.329.655,16	1,30%	28	2,60%	Artigo 8º, Inciso IV
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	7.494.439,23	2,25%	242	5,48%	Artigo 8º, Inciso IV
CAIXA BRASIL IPCA III FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+0	31/10/2016	3.755.454,00	1,13%	29	3,97%	Artigo 8º, Inciso IV
CAIXA BRASIL IPCA VIII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+0	06/12/2016	1.845.897,00	0,56%	21	2,00%	Artigo 8º, Inciso IV
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	Não se aplica	Não se aplica	3.822.989,90	1,15%	98	0,72%	Artigo 8º, Inciso V
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	821.197,94	0,25%	19	1,02%	Artigo 8º, Inciso V

Carteira consolidada de investimentos - base (agosto / 2016)

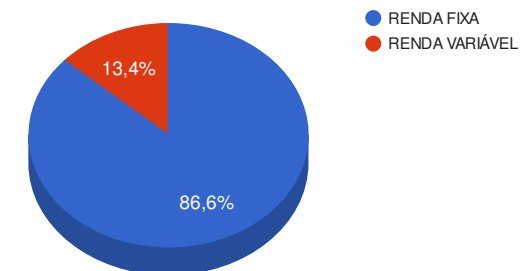
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	Não se aplica	Não se aplica	1.285.492,17	0,39%		0,77%	Artigo 8º, Inciso VI
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	Não se aplica	Não se aplica	5.318.199,01	1,60%			Artigo 8º, Inciso VI
		TOTAL -	332.589.494,36				

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

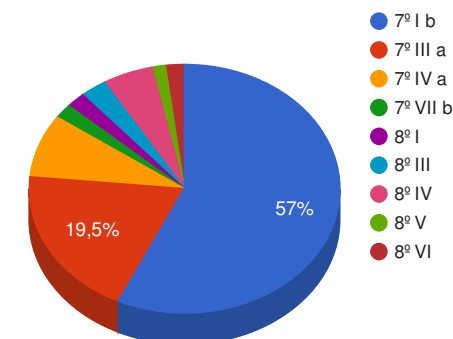
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	80,00%	189.536.330,40	56,99%	76.535.265,09
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	50,00%	64.977.919,19	19,54%	101.316.827,99
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	27.310.721,99	8,21%	72.466.126,32
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	16.629.474,72
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	16.629.474,72
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	6.278.533,79	1,89%	10.350.940,93
Total Renda Fixa	100,00%	175,00	288.103.505,37	86,62%	

Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	5,00%	6.558.384,85	1,97%	10.071.089,87
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	10,00%	9.254.279,73	2,78%	24.004.669,71
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	17.425.445,39	5,24%	-795.970,67
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	4.644.187,84	1,40%	11.985.286,88
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	6.603.691,18	1,99%	10.025.783,54
Total Renda Variável	30,00%	30,00	44.485.988,99	13,38%	

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 FIRENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,28%	10,91%	3,19%	6,25%	17,70%	30,36%	0,20%	0,755%	3,06%
IRF-M 1	1,19%	9,83%	3,35%	6,89%	14,87%	28,36%	-	-	-
BRADESCO IRF-M 1 FIRENDA FIXA	1,18%	9,75%	3,28%	6,84%	14,59%	27,89%	0,20%	0,055%	0,75%
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-B 5	1,09%	11,35%	3,27%	6,50%	18,11%	31,19%	-	-	-
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	1,10%	11,21%	3,22%	6,40%	17,90%	30,75%	0,10%	0,786%	3,32%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIRENDA FIXA LP	1,07%	11,13%	3,21%	6,38%	17,61%	30,24%	0,20%	0,801%	3,29%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FIRENDA FIXA	1,05%	14,02%	3,40%	7,33%	20,00%	29,61%	0,40%	1,163%	4,23%
IPCA + 6,00% ao ano	0,98%	9,60%	2,87%	6,29%	15,51%	34,14%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FIRENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,17%	16,66%	3,87%	11,12%	22,49%	28,58%	0,15%	1,511%	8,34%
BTG PACTUAL NTN-B FIRENDA FIXA	1,09%	6,82%	3,13%	3,59%	9,06%	19,57%	0,15%	0,131%	4,01%
IMA-B	0,89%	20,11%	5,41%	15,26%	25,51%	29,04%	-	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FIRENDA FIXA	1,13%	9,61%	2,96%	3,59%	-	-	0,20%	0,950%	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	0,92%	19,71%	5,43%	15,13%	24,88%	28,58%	0,20%	1,966%	9,28%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP	0,92%	20,05%	5,35%	15,23%	25,34%	28,00%	0,20%	1,864%	9,28%
IPCA	0,44%	5,42%	1,32%	3,17%	8,97%	19,36%	-	-	-

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 IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1,45%	15,03%	3,98%	8,99%	20,86%	30,99%	0,20%	1,245%	6,37%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,92%	15,95%	4,67%	12,46%	20,17%	-	0,40%	1,177%	3,68%

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
IDIV	1,88%	44,54%	23,66%	47,75%	28,38%	-25,39%	-	-	-
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	1,63%	-3,05%	15,11%	0,61%	-2,32%	-14,55%	3,00%	8,906%	21,82%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	0,87%	12,89%	8,68%	12,92%	19,14%	4,56%	1,72%	5,780%	15,70%
IFIX	1,84%	25,41%	9,62%	29,83%	21,19%	25,05%	-	-	-
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	1,56%	-	4,74%	38,52%	14,80%	9,04%	0,40%	-	22,51%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	-	-	-	-	-	-	0,30%	-	-
CDI	1,21%	9,21%	3,52%	7,00%	14,13%	28,23%	-	-	-
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	1,56%	11,06%	4,50%	7,88%	16,98%	38,67%	2,00%	0,833%	1,96%
Ibovespa	1,03%	33,57%	19,45%	35,30%	24,18%	-5,53%	-	-	-
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	0,82%	-2,15%	16,67%	4,15%	1,17%	-15,42%	4,00%	9,096%	21,28%
IPCA + 6,00% ao ano	0,98%	9,60%	2,87%	6,29%	15,51%	34,14%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA VIII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1,11%	10,45%	3,23%	6,95%	15,80%	34,00%	0,15%	0,071%	0,43%
CAIXA BRASIL IPCA III FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1,08%	10,27%	3,18%	6,84%	15,45%	33,83%	0,20%	0,076%	0,33%
IPCA	0,44%	5,42%	1,32%	3,17%	8,97%	19,36%	-	-	-
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FIEM QUOTAS DE FIP	-	-	-	-	-	-	2,00%	0,054%	9,14%
S&P 500	-0,12%	6,21%	3,53%	12,35%	10,08%	8,36%	-	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	1,12%	13,91%	6,96%	19,58%	24,53%	37,40%	1,00%	2,372%	15,09%

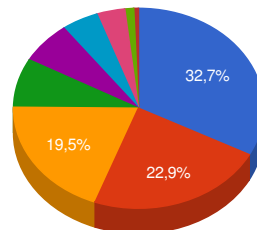
Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (agosto / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Não Possui	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,50%	0,018%	41,47%

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

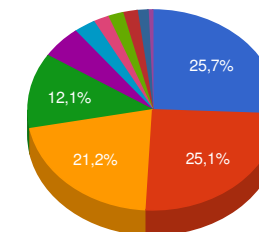
Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	108.750.869,76	32,70%
BANCO BRADESCO	76.315.119,99	22,95%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	64.911.510,45	19,52%
Western Asset	26.259.393,18	7,90%
BANCO SANTANDER	22.319.324,32	6,71%
GERAÇÃO FUTURO	15.962.823,75	4,80%
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS	12.198.406,00	3,67%
PÁTRIA INVESTIMENTOS	3.822.989,90	1,15%
Itaú Unibanco	2.049.057,01	0,62%

- BB GESTÃO DE RECURSO...
- BANCO BRADESCO
- CAIXA ECONÔMIC...
- Western Asset
- BANCO SANTANDER
- GERAÇÃO FUTURO
- BTG PACTUAL...
- PÁTRIA INVESTIM...
- Itaú Unibanco



Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5	85.377.986,79	25,67%
IRF-M 1	83.633.432,66	25,15%
IMA-B	70.407.786,30	21,17%
IDKA IPCA 2A	40.356.708,82	12,13%
MULTIMERCADO	17.425.445,39	5,24%
AÇÕES - SETORIAIS	9.254.279,73	2,78%
FUNDO IMOBILIÁRIO	6.603.691,18	1,99%
AÇÕES - INDEXADO	6.558.384,85	1,97%
CRÉDITO PRIVADO	6.278.533,79	1,89%
FIP	4.644.187,84	1,40%
GESTÃO LIVRE	2.049.057,01	0,62%

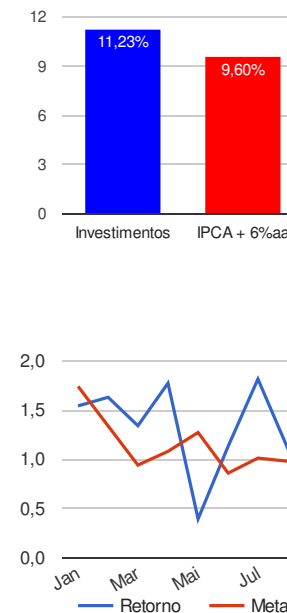
- IMA-B 5
- IRF-M 1
- IMA-B
- IDKA IPCA 2A
- MULTIMER...
- AÇÕES - SETORIAIS
- FUNDO IMOBILIÁRIO
- AÇÕES - INDEXADO
- CRÉDITO PRIVADO
- FIP
- GESTÃO LIVRE



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	308.051.335,34	6.737.337,95	5.182.608,69	314.380.496,84	4.774.432,24	1,54%	1,74%	88,66%	2,27%
Fevereiro	314.380.496,84	18.082.507,36	19.015.521,99	318.569.760,65	5.122.278,44	1,63%	1,34%	121,21%	2,16%
Março	318.569.760,65	74.303.565,24	75.371.269,37	321.768.125,22	4.266.068,70	1,34%	0,94%	142,13%	2,36%
Abril	321.768.125,22	4.872.718,61	8.379.525,53	323.960.554,45	5.699.236,15	1,77%	1,08%	164,56%	1,67%
Maio	323.960.554,45	8.123.178,31	6.763.556,47	326.600.595,78	1.280.419,49	0,39%	1,27%	30,98%	1,67%
Junho	326.600.595,78	12.976.057,50	17.141.219,13	326.134.537,68	3.699.103,53	1,13%	0,86%	131,43%	1,65%
Julho	326.134.537,68	27.311.591,63	28.839.384,43	330.529.053,26	5.922.308,38	1,82%	1,01%	179,92%	1,14%
Agosto	330.529.053,26	45.166.951,12	46.749.718,52	332.589.494,36	3.643.208,50	1,10%	0,98%	112,98%	1,20%
Acumulado no ano					34.407.055,43	11,23%	9,60%	117,07%	

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 IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	6.188.726,57	0,00	0,00	6.278.533,79	89.807,22	1,45%	1,24%	1,45%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	39.845.728,23	0,00	0,00	40.356.708,82	510.980,59	1,28%	0,75%	1,28%
BRDESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	39.434.399,85	0,00	0,00	39.899.263,50	464.863,65	1,18%	0,05%	1,18%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.280.122,64	0,00	372.966,98	13.063.258,98	156.103,32	1,18%	1,51%	1,17%
BRDESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	11.210.771,82	0,00	0,00	11.337.200,80	126.428,98	1,13%	0,95%	1,13%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	1.375.578,62	0,00	0,00	1.390.653,49	15.074,87	1,10%	0,79%	1,10%
BTG PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA	12.066.348,00	0,00	0,00	12.198.406,00	132.058,00	1,09%	0,13%	1,09%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	56.747.653,03	0,00	0,00	57.353.628,51	605.975,48	1,07%	0,80%	1,07%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	14.285.701,14	0,00	0,00	14.435.298,79	149.597,65	1,05%	1,16%	1,05%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.018.701,65	42.709.951,12	5.482.000,00	43.734.169,16	487.516,39	1,00%	0,05%	1,16%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	24.849.741,98	0,00	0,00	25.078.655,69	228.913,71	0,92%	1,97%	0,92%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.030.457,93	0,00	0,00	2.049.057,01	18.599,08	0,92%	1,18%	0,92%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIX...	20.738.740,83	0,00	0,00	20.928.670,83	189.930,00	0,92%	1,86%	0,92%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	38.355.973,91	2.457.000,00	40.834.708,65	0,00	21.734,74	0,05%	0,02%	1,25%
Total Renda Fixa					3.197.583,68	1,12%	0,80%	

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(%)
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FIAÇÕES	7.988.959,16	0,00	0,00	8.118.946,73	129.987,57	1,63%	8,91%	1,63%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	4.263.056,99	0,00	0,00	4.329.655,16	66.598,17	1,56%	0,83%	1,56%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	5.306.368,97	0,00	50.000,00	5.318.199,01	61.830,04	1,17%	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	7.411.741,88	0,00	0,00	7.494.439,23	82.697,35	1,12%	2,37%	1,12%
CAIXA BRASIL IPCA VIII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.825.679,00	0,00	0,00	1.845.897,00	20.218,00	1,11%	0,07%	1,11%
CAIXA BRASIL IPCA III FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	3.715.158,00	0,00	0,00	3.755.454,00	40.296,00	1,08%	0,08%	1,08%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.125.572,00	0,00	0,00	1.135.333,00	9.761,00	0,87%	5,78%	0,87%
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FIAÇÕES	6.504.897,79	0,00	0,00	6.558.384,85	53.487,06	0,82%	9,10%	0,82%
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FII QUOTAS DE FII	3.824.407,23	0,00	0,00	3.822.989,90	-1.417,33	-0,04%	0,05%	-0,04%
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA FII	822.408,05	0,00	0,00	821.197,94	-1.210,11	-0,15%	0,02%	-0,15%
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	1.312.157,99	0,00	10.042,89	1.285.492,17	-16.622,93	-1,27%	-	1,56%
				Total Renda Variável	445.624,82	1,01%	4,24%	

