



Relatório Analítico dos Investimentos em agosto de 2017



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	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			1.030,92	0,00%			Artigo 20
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	888.053,79	1,02%	29	2,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	656.161,26	0,75%	193	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	7.934.869,24	9,09%	610	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BANRISUL FOCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+1	Não há	7.263.615,91	8,32%	242	0,51%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.497.232,00	4,01%	1.211	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	18/08/2018	8.280.723,38	9,49%	100	0,71%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	2.374.952,00	2,72%	222	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2024	2.833.472,00	3,25%	104	0,75%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	8.329.035,81	9,54%	102	0,47%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.113.061,23	2,42%	1.381	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.363.901,94	2,71%	754	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	5.068.988,00	5,81%	26	3,46%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.862.087,34	7,86%	711	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	7.085.021,33	8,12%	707	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL III FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.498.022,03	2,86%	130	0,82%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.898.423,25	3,32%	75	1,76%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	840.515,82	0,96%	628	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	8.437.530,25	9,67%	771	0,14%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BANRISUL PREVIDÊNCIA IPCA 2024 FI RENDA FIXA LP	D+0	15/08/2024	2.527.440,00	2,90%	96	2,27%	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	1.710.413,12	1,96%	61	0,40%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE	D+3	Não há	1.609.280,00	1,84%	9.127	0,05%	Artigo 8º, Inciso II

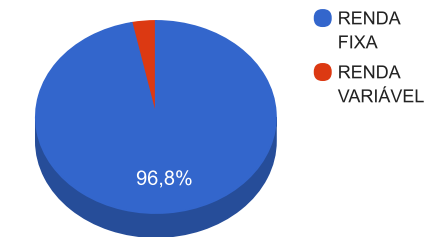
Carteira consolidada de investimentos - base (agosto / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se aplica	Não se aplica	1.222.800,00	1,40%		0,76%	Artigo 8º, Inciso VI
		TOTAL -	87.296.630,62				

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

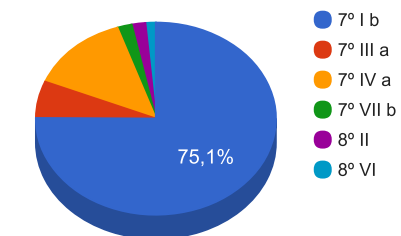
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	65.551.175,23	75,09%	50,00%	60,00%	100,00%	21.745.455,39
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	5.396.445,28	6,18%	0,00%	5,00%	80,00%	64.440.859,22
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	80,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	80,00%	69.837.304,50
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	11.805.486,07	13,52%	10,00%	15,00%	30,00%	14.383.503,12
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	30,00%	26.188.989,19
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	1.710.413,12	1,96%	0,00%	2,00%	5,00%	2.654.418,41
Total Renda Fixa	100,00%	84.463.519,70	96,75%	60,00	90,00	355,00	-

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso II	20,00%	1.609.280,00	1,84%	0,00%	5,00%	10,00%	7.120.383,06
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	4.364.831,53
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	1.222.800,00	1,40%	0,00%	0,00%	5,00%	3.142.031,53
Total Renda Variável	30,00%	2.832.080,00	3,24%	0,00	10,00	60,00	-

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 " b "	65.551.175,23	75,09%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	5.396.445,28	6,18%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	11.805.486,07	13,52%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	1.710.413,12	1,96%	0,00%	0,00%
Total Renda Fixa	84.463.519,70	96,75%	0,00	0,00

Artigos - Renda Variável	Base: agosto / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso II	1.609.280,00	1,84%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso VI	1.222.800,00	1,40%	0,00%	0,00%
Total Renda Variável	2.832.080,00	3,24%	0,00	0,00

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	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%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL III FI RENDA FIXA LP	1,25%	10,76%	5,35%	4,52%	14,81%	42,49%	0,35%	1,748%	9,54%
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 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,91%	6,29%	3,03%	3,93%	9,45%	29,35%	0,20%	4,221%	8,56%
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%
IMA-B 5	1,25%	9,83%	4,68%	6,98%	13,91%	34,53%	-	-	-
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%	3,64%
IDKA IPCA 20 Anos	1,18%	13,11%	6,98%	0,23%	18,20%	73,49%	-	-	-
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,04%	11,93%	6,25%	1,47%	17,61%	60,45%	0,20%	3,988%	18,69%
IMA Geral	1,07%	10,21%	4,28%	5,86%	15,03%	37,79%	-	-	-
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL FI RENDA FIXA LP	1,04%	10,34%	4,10%	5,74%	15,00%	36,53%	0,20%	0,860%	4,65%
IMA Geral ex-C	1,06%	10,29%	4,29%	6,01%	15,40%	37,75%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,08%	9,94%	4,36%	5,59%	14,58%	-	0,30%	1,024%	5,20%
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%

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

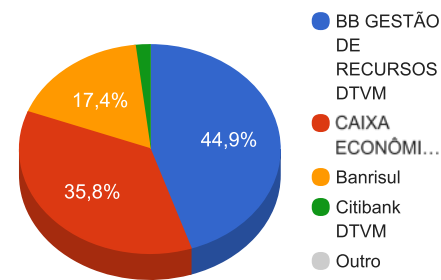
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,68%	7,96%	2,92%	5,85%	11,82%	-	0,20%	0,290%	1,92%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,68%	7,94%	2,91%	5,84%	11,82%	29,95%	0,20%	0,287%	1,90%
IRF-M 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%	0,67%
BANRISUL FOCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,88%	8,19%	2,83%	5,78%	12,93%	29,37%	0,20%	0,083%	0,68%
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%
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%	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%	-	-	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1,37%	11,68%	5,31%	7,75%	16,49%	40,79%	0,20%	0,736%	4,68%
BANRISUL PREVIDÊNCIA IPCA 2024 FI RENDA FIXA LP	-1,86%	0,22%	-0,97%	1,37%	3,17%	12,67%	0,15%	4,416%	3,98%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

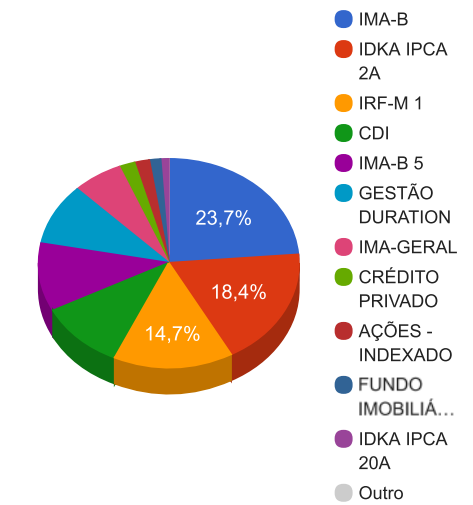
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	7,46%	17,61%	12,95%	6,26%	22,34%	51,93%	-	-	-
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE	7,45%	17,38%	12,87%	6,12%	22,00%	51,28%	0,54%	5,917%	21,29%
IFIX	0,87%	11,80%	1,36%	2,76%	17,94%	42,94%	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	-7,28%	-0,10%	0,89%	-5,65%	2,56%	22,77%	1,20%	12,124%	22,33%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	39.222.025,75	44,93%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	31.276.792,76	35,83%
Banrisul	15.187.501,19	17,40%
Citibank DTVM	1.609.280,00	1,84%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	1.030,92	0,00%

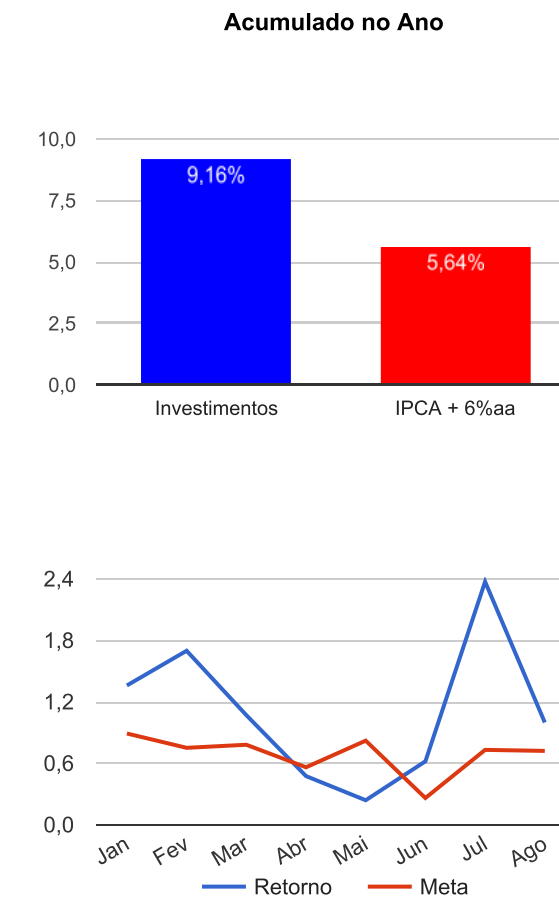


Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	20.699.253,21	23,71%
IDKA IPCA 2A	16.021.905,97	18,35%
IRF-M 1	12.873.909,14	14,75%
CDI	9.278.046,07	10,63%
IMA-B 5	9.237.039,34	10,58%
GESTÃO DURATION	8.329.035,81	9,54%
IMA-GERAL	5.425.863,25	6,22%
CRÉDITO PRIVADO	1.710.413,12	1,96%
AÇÕES - INDEXADO	1.609.280,00	1,84%
FUNDO IMOBILIÁRIO	1.222.800,00	1,40%
IDKA IPCA 20A	888.053,79	1,02%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	1.030,92	0,00%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	76.016.321,52	6.840.417,77	5.468.959,71	78.439.278,32	1.051.498,74	1,36%	0,89%	152,67%	1,58%
Fevereiro	78.439.278,32	3.635.696,80	3.194.580,78	80.219.431,91	1.339.037,57	1,70%	0,75%	226,34%	1,66%
Março	80.219.431,91	2.646.157,08	2.340.547,66	81.385.852,83	860.811,50	1,07%	0,78%	136,25%	1,20%
Abril	81.385.852,83	1.330.393,50	677.227,00	82.427.966,61	388.947,28	0,47%	0,56%	85,02%	0,95%
Mai	82.427.966,61	1.867.142,48	1.423.342,32	83.069.277,15	197.510,38	0,24%	0,82%	29,01%	4,80%
Junho	83.069.277,15	7.290.992,51	6.851.215,20	84.025.354,96	516.300,50	0,62%	0,26%	241,85%	1,30%
Julho	84.025.354,96	2.828.167,16	2.421.708,32	86.434.424,86	2.002.611,06	2,37%	0,73%	325,84%	1,37%
Agosto	86.434.424,86	3.217.512,88	3.218.426,15	87.295.599,70	862.088,11	1,00%	0,72%	137,71%	1,49%
Acumulado no ano					7.218.805,14	9,16%	5,64%	162,19%	



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	2.859.464,00	0,00	74.534,32	2.833.472,00	48.542,32	1,70%	4,22%	-0,91%
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.115.584,00	0,00	133.378,63	5.068.988,00	86.782,63	1,70%	4,22%	-0,91%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1.687.230,76	0,00	0,00	1.710.413,12	23.182,36	1,37%	0,74%	1,37%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.332.946,36	0,00	0,00	2.363.901,94	30.955,58	1,33%	1,81%	1,33%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.831.293,08	0,00	0,00	7.934.869,24	103.576,16	1,32%	1,81%	1,32%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL III FI RENDA FIXA LP	2.467.252,55	0,00	0,00	2.498.022,03	30.769,48	1,25%	1,75%	1,25%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.778.063,42	0,00	0,00	6.862.087,34	84.023,92	1,24%	0,72%	1,24%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.240.018,14	0,00	0,00	8.329.035,81	89.017,67	1,08%	1,02%	1,08%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL FI RENDA FIXA LP	2.868.582,29	0,00	0,00	2.898.423,25	29.840,96	1,04%	0,86%	1,04%
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	878.954,41	0,00	0,00	888.053,79	9.099,38	1,04%	3,99%	1,04%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.015.962,01	0,00	0,00	7.085.021,33	69.059,32	0,98%	0,49%	0,98%
BANRISUL PREVIDÊNCIA IPCA 2024 FI RENDA FIXA LP	2.575.280,00	0,00	72.425,92	2.527.440,00	24.585,92	0,95%	4,42%	-1,86%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.094.427,85	0,00	0,00	2.113.061,23	18.633,38	0,89%	0,08%	0,89%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.466.811,64	0,00	0,00	3.497.232,00	30.420,36	0,88%	0,08%	0,88%
BANRISUL FOCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	6.655.650,26	548.000,00	0,00	7.263.615,91	59.965,65	0,83%	0,08%	0,88%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	8.090.204,91	282.412,57	0,00	8.437.530,25	64.912,77	0,78%	0,01%	0,79%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.424.554,00	0,00	65.919,62	2.374.952,00	16.317,62	0,67%	4,29%	-2,05%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.460.689,90	0,00	236.753,70	8.280.723,38	56.787,18	0,67%	0,29%	0,68%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	670.242,05	0,00	18.577,68	656.161,26	4.496,89	0,67%	0,29%	0,68%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	597.123,23	787.940,11	551.641,28	840.515,82	7.093,76	0,51%	0,00%	0,70%
Total Renda Fixa					888.063,31	1,06%	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(%)
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE	2.005.290,00	1.599.160,20	2.065.195,00	1.609.280,00	70.024,80	1,94%	5,92%	7,45%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.318.800,00	0,00	0,00	1.222.800,00	-96.000,00	-7,28%	12,12%	-7,28%
Total Renda Variável					-25.975,20	-0,78%	8,60%	