

# Relatório Analítico dos Investimentos em agosto de 2017

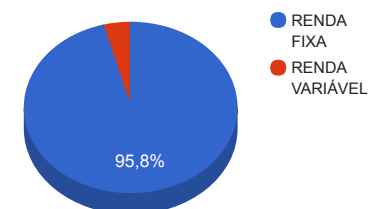
Carteira consolidada de investimentos - base (agosto / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			3.986.015,09	4,73%			Artigo 20
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	959.515,05	1,14%	195	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	24.203.258,22	28,73%	754	0,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.376.128,92	6,38%	192	0,74%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.944.856,93	7,06%	711	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	13.835.123,89	16,42%	707	0,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	4.463.653,12	5,30%	334	0,23%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	7.261.492,27	8,62%	77	2,36%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.395.681,94	9,97%	440	0,43%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.585.400,84	1,88%	771	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	4.886.283,31	5,80%	766	0,11%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	D+43	5 anos	411.396,49	0,49%	53	0,41%	Artigo 8º, Inciso III
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	2.937.772,75	3,49%			Artigo 8º, Inciso V
		<b>TOTAL -</b>	<b>84.246.578,82</b>				

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

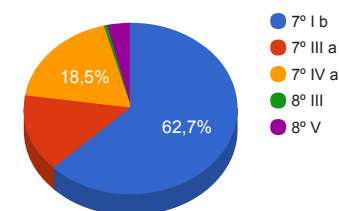
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	50.318.883,01	59,73%	30,00%	35,00%	70,00%	8.653.722,16
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	11.725.145,39	13,92%	15,00%	20,00%	60,00%	38.822.801,90
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	14.867.366,09	17,65%	5,00%	5,00%	30,00%	10.406.607,56
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	12.636.986,82
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	4.212.328,94
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	4.212.328,94
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>76.911.394,49</b>	<b>91,29%</b>	<b>55,00</b>	<b>75,00</b>	<b>185,00</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%	411.396,49	0,49%	5,00%	10,00%	15,00%	12.225.590,33
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	4.212.328,94
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	2.937.772,75	3,49%	2,00%	5,00%	5,00%	1.274.556,19
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	4.212.328,94
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>3.349.169,24</b>	<b>3,98%</b>	<b>11,00</b>	<b>25,00</b>	<b>30,00</b>	<b>-</b>

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 "	50.318.883,01	59,73%	30,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	11.725.145,39	13,92%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	14.867.366,09	17,65%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	0,00	0,00%	5,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>76.911.394,49</b>	<b>91,29%</b>	<b>55,00</b>	<b>185,00</b>

Artigos - Renda Variável	Base: agosto / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso III	411.396,49	0,49%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	2.937.772,75	3,49%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>3.349.169,24</b>	<b>3,98%</b>	<b>11,00</b>	<b>30,00</b>

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

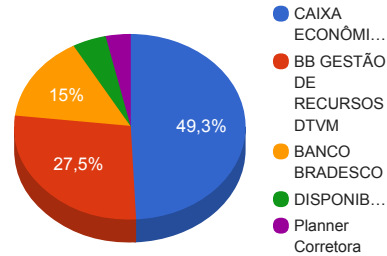
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	1,34%	11,14%	5,57%	5,06%	15,49%	44,95%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,33%	11,00%	5,51%	4,97%	15,39%	43,43%	0,20%	1,813%	9,83%
IMA-B 5	1,25%	9,83%	4,68%	6,98%	13,91%	34,53%	-	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	1,33%	10,06%	4,80%	7,07%	14,11%	34,25%	0,20%	0,783%	3,93%
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%
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%
IRF-M 1+	1,11%	13,22%	5,47%	7,73%	19,92%	45,81%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,05%	13,00%	5,39%	7,45%	19,66%	45,75%	0,20%	1,312%	6,45%
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%
IRF-M 1	0,90%	8,33%	2,86%	5,88%	13,15%	29,98%	-	-	-
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,88%	8,21%	2,86%	5,81%	12,95%	29,38%	0,20%	0,081%	0,68%
CDI	0,80%	7,34%	2,43%	5,28%	12,05%	27,88%	-	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,80%	7,32%	2,45%	5,20%	11,97%	27,62%	0,20%	0,019%	0,15%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	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%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

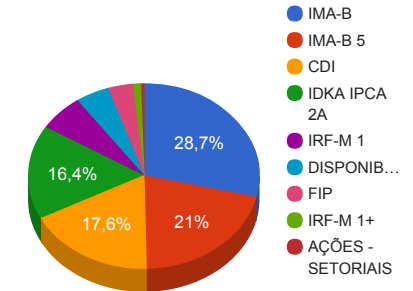
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
SMLL	8,58%	40,02%	17,87%	18,86%	36,58%	75,74%	-	-	-
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	8,52%	23,23%	14,19%	12,74%	8,88%	1,65%	1,72%	3,510%	17,52%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,50%	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	41.500.109,47	49,26%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	23.185.060,32	27,52%
BANCO BRADESCO	12.637.621,19	15,00%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	3.986.015,09	4,73%
Planner Corretora	2.937.772,75	3,49%



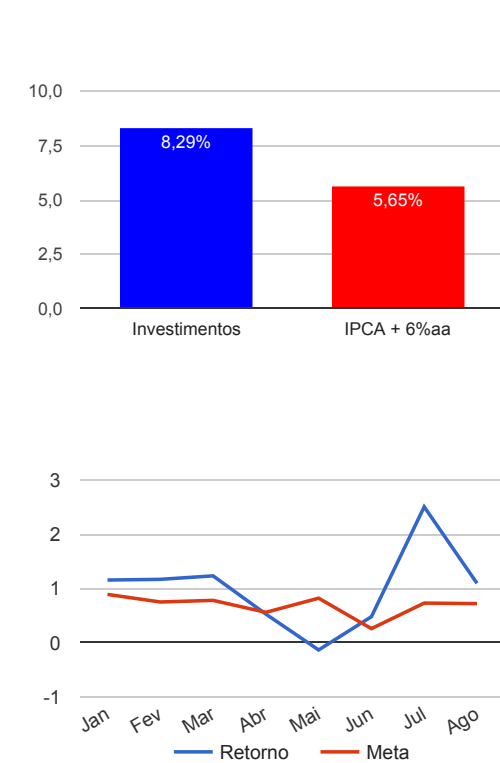
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	24.203.258,22	28,73%
IMA-B 5	17.670.002,32	20,97%
CDI	14.867.366,09	17,65%
IDKA IPCA 2A	13.835.123,89	16,42%
IRF-M 1	5.376.128,92	6,38%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	3.986.015,09	4,73%
FIP	2.937.772,75	3,49%
IRF-M 1+	959.515,05	1,14%
AÇÕES - SETORIAIS	411.396,49	0,49%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	68.599.891,06	2.091.151,53	197.572,71	71.307.191,73	813.721,85	1,15%	0,89%	129,42%	0,65%
Fevereiro	71.307.191,73	1.842.013,24	360.000,00	73.638.767,34	849.562,37	1,17%	0,75%	155,94%	0,35%
Março	73.638.767,34	1.551.058,33	795.056,75	75.310.434,50	915.665,58	1,23%	0,78%	156,88%	0,41%
Abril	75.310.434,50	25.076.217,77	24.064.181,87	76.725.130,95	402.660,55	0,53%	0,56%	94,61%	0,93%
Mai	76.725.130,95	1.831.482,79	1.393.188,80	77.061.182,73	-102.242,21	-0,13%	0,82%	-16,13%	6,63%
Junho	77.061.182,73	3.793.819,89	1.427.122,59	79.809.020,45	381.140,42	0,48%	0,26%	187,71%	1,22%
Julho	79.809.020,45	3.874.974,46	3.526.800,00	82.162.949,92	2.005.755,01	2,50%	0,73%	343,76%	1,28%
Agosto	82.162.949,92	11.464.737,08	14.266.126,80	80.260.563,73	899.003,53	1,09%	0,72%	151,08%	0,87%
Acumulado no ano					6.165.267,10	8,29%	5,65%	146,83%	

**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(%)
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	4.408.800,95	0,00	0,00	4.463.653,12	54.852,17	1,24%	0,72%	1,24%
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	9.295.947,45	0,00	2.150.000,00	7.261.492,27	115.544,82	1,24%	0,78%	1,33%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.872.064,18	0,00	0,00	5.944.856,93	72.792,75	1,24%	0,72%	1,24%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.259.711,28	0,00	10.364.762,67	0,00	105.051,39	1,02%	2,64%	1,33%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.700.269,77	0,00	0,00	13.835.123,89	134.854,12	0,98%	0,49%	0,98%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	13.621.386,11	10.368.452,81	0,00	24.203.258,22	213.419,30	0,89%	1,81%	1,33%
BRADERCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.329.185,61	0,00	0,00	5.376.128,92	46.943,31	0,88%	0,08%	0,88%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.329.116,70	0,00	0,00	8.395.681,94	66.565,24	0,80%	0,02%	0,80%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.847.844,27	0,00	0,00	4.886.283,31	38.439,04	0,79%	0,00%	0,79%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.572.948,61	0,00	0,00	1.585.400,84	12.452,23	0,79%	0,01%	0,79%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.491.221,28	136.769,22	1.640.595,09	0,00	12.604,59	0,77%	0,08%	0,89%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	109.875,78	959.515,05	110.769,04	959.515,05	893,26	0,08%	1,31%	1,05%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>874.412,22</b>	<b>1,11%</b>	<b>0,85%</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 - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	379.089,66	0,00	0,00	411.396,49	32.306,83	8,52%	3,51%	8,52%
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	2.945.488,27	0,00	0,00	2.937.772,75	-7.715,52	-0,26%	-	-
Total Renda Variável					24.591,31	0,74%	3,51%	