

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.

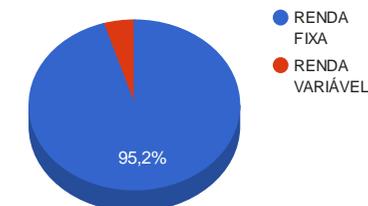
Carteira consolidada de investimentos - base (agosto / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			37.213,91	0,21%			Artigo 20
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	436.894,87	2,44%	276	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	3.572.406,49	19,96%	610	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	24.158,47	0,14%	1.211	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	40.714,19	0,23%	290	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	841.552,24	4,70%	113	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
AUSTRO IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+4 ou D+1473	Não há	4.366.096,76	24,40%	27	3,33%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	D+1009	Não há	1.768.170,37	9,88%			Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CATÂNIA FI RENDA FIXA LP	D+30 ou D+2521	Não há	2.635.192,09	14,73%	10	3,32%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	15.287,72	0,09%	628	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	500.375,64	2,80%	70	0,65%	Artigo 7º, Inciso VI
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	D+90 ou D+150 a D+450	18 meses	695.462,07	3,89%	14	6,28%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BRS PARTICIPAÇÕES FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+1	4 anos	850.024,50	4,75%	34	0,96%	Artigo 8º, Inciso IV
RHODES FIC RENDA FIXA LP	D+30 a D+1008	Não há	2.110.688,56	11,80%	6	3,75%	Desenquadrado - RF
		TOTAL -	17.894.237,88				

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

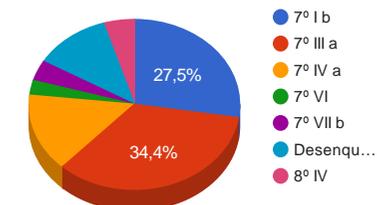
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	4.915.726,26	27,47%	30,00%	45,00%	70,00%	7.610.240,26
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	6.134.267,13	34,28%	15,00%	20,00%	60,00%	4.602.275,60
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	2.650.479,81	14,81%	5,00%	5,00%	30,00%	2.717.791,55
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	500.375,64	2,80%	0,00%	10,00%	15,00%	2.183.760,04
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	695.462,07	3,89%	0,00%	5,00%	5,00%	199.249,82
Desenquadrado - RF	0,00%	2.110.688,56	11,80%	0,00%	0,00%	0,00%	-2.110.688,56
Total Renda Fixa	100,00%	17.006.999,47	95,04%	50,00	85,00	180,00	-

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	2.684.135,68
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	850.024,50	4,75%	2,00%	5,00%	5,00%	44.687,39
Total Renda Variável	30,00%	850.024,50	4,75%	7,00	15,00	20,00	-

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 "	4.915.726,26	27,47%	30,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	6.134.267,13	34,28%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	2.650.479,81	14,81%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	500.375,64	2,80%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	695.462,07	3,89%	0,00%	5,00%
Desenquadrado - RF	2.110.688,56	11,80%	0,00%	0,00%
Total Renda Fixa	17.006.999,47	95,04%	50,00	180,00

Artigos - Renda Variável	Base: agosto / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	850.024,50	4,75%	2,00%	5,00%
Total Renda Variável	850.024,50	4,75%	7,00	20,00

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%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,33%	11,73%	5,93%	4,17%	16,18%	50,38%	0,20%	2,644%	12,76%
IMA-B	1,34%	11,14%	5,57%	5,06%	15,49%	44,95%	-	-	-
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%
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%
AUSTRO IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	0,58%	5,31%	2,33%	2,84%	9,05%	27,88%	0,30%	0,841%	3,59%
RHODES FIC RENDA FIXA LP	0,14%	0,26%	-0,89%	-0,77%	2,10%	5,71%	0,30%	0,266%	3,30%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	-	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	0,00%	-	-
IRF-M	1,06%	11,91%	4,79%	7,25%	18,00%	40,09%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,01%	11,75%	4,73%	7,05%	17,80%	39,40%	0,20%	0,989%	4,89%
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%
IPCA + 7,00% ao ano	0,81%	6,31%	1,96%	4,43%	9,60%	27,80%	-	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1,59%	-46,10%	-47,66%	-45,11%	-61,77%	-78,88%	0,00%	8,285%	-
IMA-S	0,81%	7,53%	2,55%	5,46%	12,19%	27,94%	-	-	-
CATÂNIA FI RENDA FIXA LP	-0,21%	-2,12%	-1,31%	-0,80%	-1,33%	-1,06%	0,90%	0,019%	2,87%
CDI	0,80%	7,34%	2,43%	5,28%	12,05%	27,88%	-	-	-

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

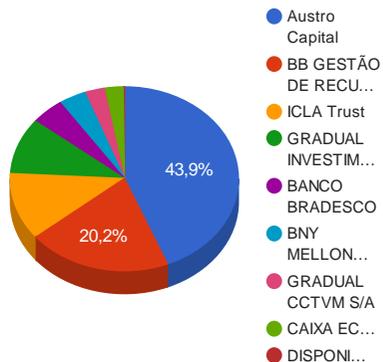
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,70%	6,67%	2,16%	4,76%	11,07%	25,76%	1,00%	0,003%	0,10%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	0,40%	3,36%	0,96%	2,38%	5,55%	-21,03%	1,00%	0,030%	0,29%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

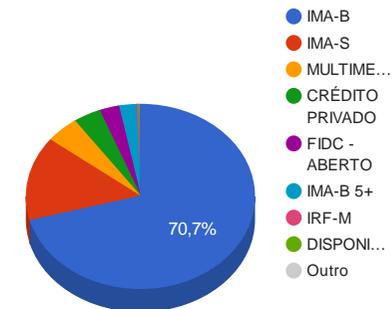
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA	0,19%	1,62%	0,20%	0,90%	2,46%	11,65%	-	-	-
BRS PARTICIPAÇÕES FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-0,21%	-1,52%	-0,81%	-1,17%	-7,45%	21,03%	1,50%	0,048%	5,54%

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

Administrador	Valor	%
Austro Capital	7.851.313,35	43,88%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	3.611.852,68	20,18%
ICLA Trust	2.110.688,56	11,80%
GRADUAL INVESTIMENTOS	1.768.170,37	9,88%
BANCO BRADESCO	841.552,24	4,70%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	695.462,07	3,89%
GRADUAL CCTVM S/A	500.375,64	2,80%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	477.609,06	2,67%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	37.213,91	0,21%

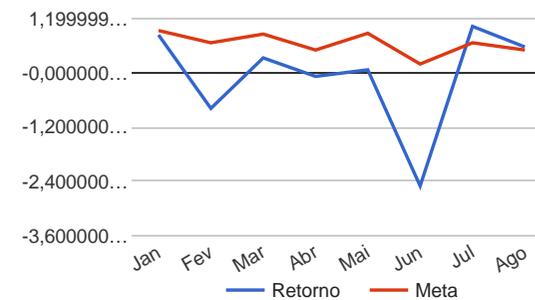
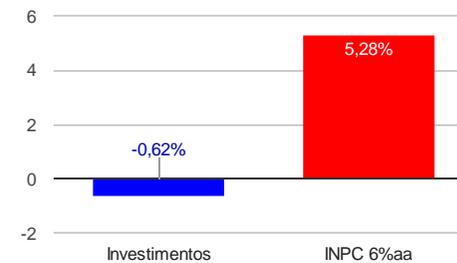


Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	12.658.914,42	70,74%
IMA-S	2.635.192,09	14,73%
MULTIMERCADO	850.024,50	4,75%
CRÉDITO PRIVADO	695.462,07	3,89%
FIDC - ABERTO	500.375,64	2,80%
IMA-B 5+	436.894,87	2,44%
IRF-M	40.714,19	0,23%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	37.213,91	0,21%
IRF-M 1	24.158,47	0,14%
CDI	15.287,72	0,09%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

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(%)	
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	492.523,54	0,00	0,00	500.375,64	7.852,10	1,59%	8,28%	1,59%	
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	431.159,35	0,00	0,00	436.894,87	5.735,52	1,33%	2,64%	1,33%	
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	830.692,19	0,00	0,00	841.552,24	10.860,05	1,31%	1,82%	1,31%	
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.320.619,28	980.000,00	775.273,26	3.572.406,49	47.060,47	1,09%	1,81%	1,32%	
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	40.308,29	0,00	0,00	40.714,19	405,90	1,01%	0,99%	1,01%	
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	28.814,18	0,00	4.905,59	24.158,47	249,88	0,87%	0,08%	0,88%	
AUSTRO IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	4.341.132,83	0,00	0,00	4.366.096,76	24.963,93	0,58%	0,84%	0,58%	
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	17.036,92	14.707,48	16.589,42	15.287,72	132,74	0,42%	0,00%	0,70%	
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	692.724,53	0,00	0,00	695.462,07	2.737,54	0,40%	0,03%	0,40%	
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	1.763.405,51	0,00	0,00	1.768.170,37	4.764,86	0,27%	-	-	
RHODES FIC RENDA FIXA LP	2.107.723,34	0,00	0,00	2.110.688,56	2.965,22	0,14%	0,27%	0,14%	
CATÂNIA FI RENDA FIXA LP	2.640.655,28	0,00	0,00	2.635.192,09	-5.463,19	-0,21%	0,02%	-0,21%	
Total Renda Fixa						102.265,02	0,60%	1,16%	

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(%)
BRS PARTICIPAÇÕES FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	851.791,16	0,00	0,00	850.024,50	-1.766,66	-0,21%	0,05%	-0,21%
Total Renda Variável					-1.766,66	-0,21%	0,05%	

