

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

Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
go 7º, Inciso I, Alínea "b"	100,00%	90,00%	16.171.985,65	81,06%	1.783.924,95
go 7º, Inciso III, Alínea "a"	80,00%	50,00%	281.214,88	1,41%	9.694.291,01
go 7º, Inciso IV, Alínea "a"	30,00%	30,00%	1.869.490,23	9,37%	4.115.813,30
go 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	997.550,59
go 7º, Inciso VII, Alínea "a"	5,00%	5,00%	322.120,27	1,61%	675.430,32
go 7º, Inciso VII, Alínea "b"	5,00%	5,00%	273.319,41	1,37%	724.231,18
Total Renda Fixa	100,00%	185,00	18.918.130,44	94,82%	

Distribuição por Segmento

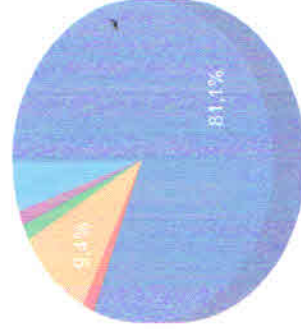
● RENDA FIXA
● RENDA VARIÁVEL



Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
go 8º, Inciso I	30,00%	5,00%	0,00	0,00%	997.550,59
go 8º, Inciso III	15,00%	5,00%	1.032.881,34	5,13%	-35.330,75
go 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	997.550,59
Total Renda Variável	30,00%	15,00	1.032.881,34	5,18%	

Distribuição por Artigo / Resolução

● 7º I b
● 7º III a
● 7º IV a
● 7º VII a
● 7º VII b
● 8º III



e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Acumulado no Ano									
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
01	18.077.641,74	3.556.097,51	3.482.852,92	18.530.972,33	380.086,00	2,09%	1,98%	105,73%	1,31%
02	18.530.972,33	302.079,21	265.210,73	18.801.376,76	233.535,95	1,26%	1,39%	90,19%	1,07%
03	18.801.376,76	346.739,27	323.395,48	18.982.269,12	157.548,57	0,84%	0,95%	87,89%	1,40%
04	18.982.269,12	486.696,25	497.022,34	19.249.942,01	277.998,98	1,46%	1,11%	132,36%	1,11%
05	19.249.942,01	748.274,50	732.897,36	19.393.278,67	127.959,52	0,66%	1,47%	45,14%	1,12%
06	19.393.278,67	2.581.090,65	1.675.914,27	19.599.967,89	-698.487,16	-3,44%	0,98%	-350,28%	1,51%
07	19.599.967,89	2.479.600,14	2.466.453,82	19.951.011,78	337.897,57	1,72%	1,13%	152,48%	1,18%
ACUMULADO no ano					816.539,43	4,58%	9,37%	48,88%	

Investimentos INPC 6%aa

9,37%

4,58%

Retorno Meta

Jul

Jun

Mai

Abr

dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de julho / 2016

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VarR - Mês (%)	Instituição(%)
1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.158.454,88	0,00	0,00	1.187.447,58	28.992,70	2,50%	1,91%	2,50%
2 RASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.183.853,12	2.285.053,39	0,00	3.518.529,59	49.623,08	1,43%	1,89%	2,48%
3 RASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.471.979,09	8.079,52	8.079,52	4.525.224,77	53.245,68	1,19%	0,67%	1,19%
4 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	289.121,85	0,00	0,00	272.284,99	3.163,34	1,18%	0,69%	1,18%
5 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.831.009,36	0,00	0,00	3.871.475,77	40.466,41	1,06%	0,75%	1,06%
6 RASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.018.074,15	0,00	2.000.000,00	3.069.307,94	51.233,79	1,02%	0,70%	1,11%
7 CO IREF-M 1 FI RENDA FIXA	8.840,35	0,00	0,00	8.929,89	89,54	1,01%	0,11%	1,01%
8 RASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.284.685,35	19.467,23	457.780,48	1.869.490,23	23.118,13	1,00%	0,01%	1,10%
9 N VALORE FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	271.028,45	0,00	0,00	273.319,41	2.290,96	0,85%	0,28%	0,94%
10 V FIDC SÊNIOR	323.312,80	0,00	593,82	322.120,27	-598,71	-0,19%	-	-
Total Renda Fixa					251.624,92	1,34%	0,93%	

dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de julho / 2016

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VarR - Mês (%)	Instituição(%)
N BRASIL FIAÇÕES	779.608,69	167.000,00	0,00	1.032.881,34	86.272,65	9,11%	5,78%	9,21%
Total Renda Variável					86.272,65	10,88%	5,78%	