

Relatório Analítico dos Investimentos em fevereiro de 2017

Carteira consolidada de investimentos - base (fevereiro / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Colistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	17/08/2020	389.399,40	1,41%	20	0,64%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"
CAIXA BRASIL IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.524.251,21	5,52%	1.341	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	1.676.306,30	6,07%	282	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"
BB IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.324.896,75	8,41%	1.177	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.428.290,36	5,17%	712	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"
CAIXA BRASIL IRFM 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	169.010,58	0,61%	156	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.731.312,10	6,27%	248	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.820.817,26	10,21%	624	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.376.505,17	4,98%	203	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.148.647,83	7,78%	722	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	1.939.735,81	7,02%	319	0,10%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea "a"
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1800	Não há	1.124.287,11	4,07%	14	1,22%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea "a"
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.678.203,47	9,69%	334	0,11%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea "a"
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.060.645,92	3,84%	119	0,32%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea "a"
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.183.072,41	11,52%	776	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea "a"
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	186.919,21	0,68%	98	0,18%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea "a"
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	D+4	Não há	726.778,72	2,63%	80	0,92%	Artigo 8º, Inciso I
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	D+31 ou D+1461	Não há	1.144.955,52	4,14%	14	0,87%	Desenquadrado - RF
TOTAL -			27.634.035,13				

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

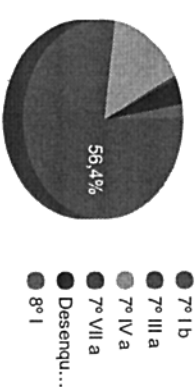
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	15.589.436,96	56,41%	30,00%	48,00%	70,00%	3.754.387,63
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	5.742.226,39	20,78%	15,00%	20,00%	60,00%	10.838.194,69
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	4.243.718,33	15,36%	5,00%	5,00%	30,00%	4.046.492,21
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	4.145.105,27
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	186.919,21	0,68%	0,00%	2,00%	5,00%	1.194.782,55
Desenquadrado - RF	0,00%	1.144.955,52	4,14%	0,00%	0,00%	0,00%	-1.144.955,52
Total Renda Fixa	100,00%	26.907.256,41	97,37%	55,00	85,00	180,00	-

Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	726.778,72	2,63%	0,00%	0,00%	0,00%	-726.778,72
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	4.145.105,27
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	1.381.701,76
Total Renda Variável	30,00%	726.778,72	2,63%	7,00	15,00	20,00	-

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: fevereiro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	15.589.436,96	56,41%	30,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	5.742.226,39	20,78%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	4.243.718,33	15,36%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	0,00	0,00%	5,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	186.919,21	0,68%	0,00%	5,00%
Desenquadrado - RF	1.144.955,52	4,14%	0,00%	0,00%
Total Renda Fixa	26.907.256,41	97,37%	55,00	180,00

Artigos - Renda Variável	Base: fevereiro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I	726.778,72	2,63%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Total Renda Variável	726.778,72	2,63%	7,00	20,00

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5+	5,06%	7,41%	11,40%	11,75%	35,35%	43,21%	-	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4,99%	7,26%	11,25%	11,47%	35,16%	42,32%	0,20%	2,464%	10,46%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4,97%	7,26%	11,23%	11,54%	34,89%	41,79%	0,20%	2,447%	10,42%
IMA-B	3,85%	5,79%	8,86%	9,92%	26,69%	38,66%	-	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,85%	5,76%	8,82%	9,81%	26,50%	37,94%	0,20%	1,855%	7,39%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	3,78%	5,74%	8,70%	9,99%	26,42%	37,57%	0,20%	1,780%	6,94%
TMU IMA-B FI RENDA FIXA	2,80%	4,15%	6,54%	8,91%	16,57%	32,06%	1,30%	1,411%	19,42%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,84%	0,37%	1,96%	4,01%	8,67%	18,17%	0,20%	5,485%	5,99%
IRF-M 1+	2,37%	5,09%	7,31%	11,32%	28,78%	37,63%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,40%	5,16%	7,35%	11,36%	28,98%	37,66%	0,20%	1,255%	5,29%
IMA Geral	2,26%	4,11%	6,07%	8,66%	21,43%	34,20%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,24%	4,03%	6,02%	8,81%	21,40%	33,51%	0,20%	0,910%	3,63%
IMA-B 5	1,49%	2,67%	4,10%	6,47%	13,40%	32,51%	-	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,48%	2,63%	4,03%	6,35%	13,21%	31,75%	0,20%	0,718%	2,39%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,48%	2,63%	4,05%	6,38%	13,17%	31,63%	0,20%	0,715%	2,39%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,49%	1,39%	4,44%	5,92%	20,04%	25,45%	1,30%	0,906%	16,40%
IDKA IPCA 2 Anos	1,35%	2,45%	3,77%	6,37%	12,42%	33,17%	-	-	-

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

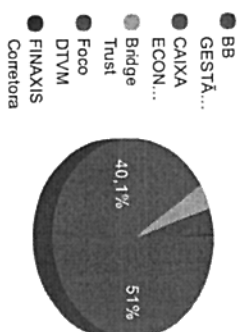
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,33%	2,42%	3,70%	6,10%	12,74%	31,60%	0,20%	0,609%	2,20%
IRFM 1	1,01%	2,31%	3,53%	6,86%	14,23%	30,27%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,99%	2,27%	3,47%	6,76%	14,05%	29,83%	0,20%	0,083%	0,30%
BB IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,99%	2,26%	3,45%	6,72%	13,95%	29,58%	0,10%	0,083%	0,31%
CDI	0,86%	1,96%	3,10%	6,43%	13,88%	29,35%	-	-	-
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,90%	2,01%	3,14%	6,42%	13,85%	28,82%	0,20%	0,051%	0,08%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,89%	2,00%	3,16%	6,52%	13,85%	29,49%	0,20%	0,015%	0,17%
101,50% do IPCA + 5,75% ao ano	0,73%	1,59%	2,39%	4,29%	10,68%	29,05%	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,35%	-0,87%	-1,08%	-6,25%	-13,95%	-17,95%	0,25%	0,220%	2,18%

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

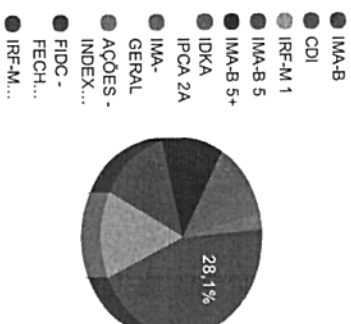
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IBX-50	2,84%	10,16%	7,08%	14,31%	52,53%	26,17%	-	-	-
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	3,10%	9,79%	7,12%	13,10%	38,88%	12,12%	0,70%	7,672%	23,00%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	14.093.476,36	51,00%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	11.084.396,93	40,11%
Bridge Trust	1.144.955,52	4,14%
Foco DTVM	1.124.287,11	4,07%
FINAXIS Corretora	186.919,21	0,68%

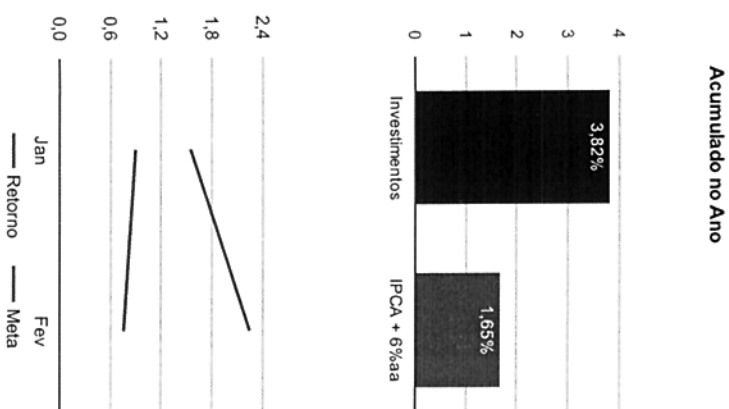


Sub-segmento	Valor	%
IMAB	7.768.263,36	28,11%
CDI	4.243.718,33	15,36%
IRF-M 1	3.849.147,96	13,93%
IMAB 5	3.757.425,57	13,60%
IMAB 5+	3.407.618,40	12,33%
IDKA IPCA 2A	2.148.647,83	7,78%
IMA-GERAL	1.376.505,17	4,98%
AÇÕES - INDEXADO	726.778,72	2,63%
FIDC - FECHADO	186.919,21	0,68%
IRF-M 1+	169.010,58	0,61%
Sub-segmento	Valor	%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VAR (%)
Janeiro	25.621.019,44	1.366.900,00	554.355,05	26.841.345,26	407.780,87	1,54%	0,89%	173,33%	1,97%
Fevereiro	26.841.345,26	1.682.000,00	1.494.964,05	27.634.035,13	605.653,92	2,24%	0,75%	298,77%	1,24%
Acumulado no ano					1.013.434,79	3,82%	1,65%	231,86%	



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de fevereiro / 2017

Ativos de Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Var - Mês (%)	Instituição(%)
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.578.879,28	18.000,00	0,00	1.676.306,30	79.427,02	4,97%	2,46%	4,99%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.649.279,30	0,00	0,00	1.731.312,10	82.032,80	4,97%	2,45%	4,97%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.716.333,96	0,00	0,00	2.820.817,26	104.483,30	3,85%	1,85%	3,85%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	2.580.746,94	0,00	0,00	2.678.203,47	97.456,53	3,78%	1,78%	3,78%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	1.113.726,54	0,00	0,00	1.144.955,52	31.228,98	2,80%	1,41%	2,80%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	165.052,21	0,00	0,00	169.010,58	3.958,37	2,40%	1,26%	2,40%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.346.376,04	0,00	0,00	1.376.505,17	30.129,13	2,24%	0,91%	2,24%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	392.696,10	0,00	10.686,26	389.399,40	7.389,56	1,88%	5,49%	-0,84%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.407.492,66	0,00	0,00	1.428.290,36	20.797,70	1,48%	0,72%	1,48%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.914.882,01	0,00	0,00	1.939.735,81	24.853,80	1,30%	0,72%	1,48%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.123.594,66	0,00	0,00	2.148.647,83	25.053,17	1,18%	0,51%	1,33%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.509.243,90	0,00	0,00	1.524.251,21	15.007,31	0,99%	0,08%	0,99%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.302.175,58	0,00	0,00	2.324.896,75	22.721,17	0,99%	0,08%	0,99%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.154.942,92	0,00	0,00	3.183.072,41	28.129,49	0,89%	0,02%	0,89%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.118.768,01	0,00	0,00	1.124.287,11	5.519,10	0,49%	0,91%	0,49%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	874.617,68	820.000,00	640.000,00	1.060.645,92	6.028,24	0,36%	0,05%	0,90%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,00	844.000,00	844.277,79	0,00	277,79	0,03%	0,00%	0,51%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	187.581,17	0,00	0,00	186.919,21	-661,96	-0,35%	0,22%	-0,35%
Total Renda Fixa					583.831,50	2,22%	1,07%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de fevereiro / 2017

Ativos de Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Var - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	704.956,30	0,00	0,00	726.778,72	21.822,42	3,10%	7,67%	3,10%
			Total Renda Variável		21.822,42	3,10%	7,67%	