

Relatório Analítico dos Investimentos em março e 1º Trimestre de 2017

Carteira consolidada de investimentos - base (março / 2017)

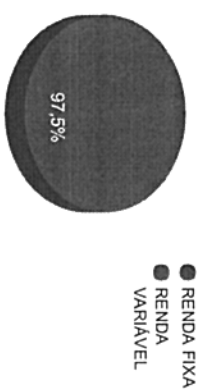
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Colistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO
CAIXA BRASIL IR-FM 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.017.234,51	3,60%	171	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.447.962,21	5,12%	718	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.178.904,69	7,71%	719	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.849.560,17	10,08%	628	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	1.744.884,76	6,17%	303	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	17/08/2020	395.781,30	1,40%	20	0,64%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"
BB IR-FM 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.350.492,77	8,32%	1.170	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"
CAIXA BRASIL IR-FM 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.541.235,36	5,45%	1.342	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.745.780,61	6,18%	273	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.392.862,73	4,93%	207	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.703.626,91	9,57%	340	0,11%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea "a"
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1800	Não há	1.122.041,96	3,97%	14	1,22%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea "a"
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	D+31 ou D+1461	Não há	1.156.652,13	4,09%	14	0,87%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea "a"
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	1.966.521,42	6,96%	327	0,10%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea "a"
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	537.156,70	1,90%	119	0,16%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea "a"
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.217.022,63	11,38%	762	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea "a"
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	186.071,26	0,66%	98	0,18%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea "a"
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	D+4	Não há	709.783,15	2,51%	81	0,88%	Artigo 8º, Inciso I
TOTAL -			28.263.575,27				

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

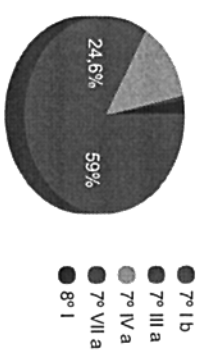
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	16.664.699,11	58,96%	30,00%	48,00%	70,00%	3.119.803,58
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	6.948.842,42	24,59%	15,00%	20,00%	60,00%	10.009.302,74
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	3.754.179,33	13,28%	5,00%	5,00%	30,00%	4.724.893,25
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	4.239.536,29
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	186.071,26	0,66%	0,00%	2,00%	5,00%	1.227.107,50
Total Renda Fixa	100,00%	27.553.792,12	97,49%	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%	709.783,15	2,51%	0,00%	0,00%	0,00%	-709.783,15
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	4.239.536,29
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	1.413.178,76
Total Renda Variável	30,00%	709.783,15	2,51%	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: março / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	16.664.699,11	58,96%	30,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	6.948.842,42	24,59%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	3.754.179,33	13,28%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	0,00	0,00%	5,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	186.071,26	0,66%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	27.553.792,12	97,49%	55,00	180,00

Artigos - Renda Variável	Base: março / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I	709.783,15	2,51%	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	709.783,15	2,51%	7,00	20,00

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	Var - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRFM 1+	1,63%	6,81%	6,81%	10,56%	24,40%	40,68%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRFM 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,52%	6,76%	6,76%	10,50%	24,42%	40,58%	0,20%	1,750%	4,66%
IDKA IPCA 2 Anos	1,62%	4,11%	4,11%	6,49%	14,06%	33,81%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,41%	3,87%	3,87%	6,17%	13,72%	32,21%	0,20%	0,680%	1,94%
IMA-B 5	1,39%	4,09%	4,09%	6,45%	14,11%	32,99%	-	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,38%	4,05%	4,05%	6,34%	13,92%	32,29%	0,20%	0,760%	2,16%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,38%	4,05%	4,05%	6,36%	13,89%	32,16%	0,20%	0,760%	2,16%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,20%	1,19%	1,19%	2,82%	18,07%	26,46%	1,30%	1,268%	15,89%
IMA Geral	1,22%	5,37%	5,37%	8,32%	18,84%	35,77%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,19%	5,27%	5,27%	8,39%	18,87%	35,01%	0,20%	1,130%	3,14%
IRFM 1	1,12%	3,46%	3,46%	6,79%	14,08%	30,52%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,11%	3,41%	3,41%	6,70%	13,92%	30,12%	0,20%	0,130%	0,29%
BB IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,10%	3,39%	3,39%	6,65%	13,82%	29,85%	0,10%	0,130%	0,30%
CDI	1,05%	3,03%	3,03%	6,37%	13,75%	29,37%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,07%	3,09%	3,09%	6,47%	13,79%	29,52%	0,20%	0,010%	0,17%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,05%	3,08%	3,08%	6,38%	13,72%	28,93%	0,20%	0,060%	0,08%
IMA-B	1,04%	6,89%	6,89%	9,36%	21,56%	40,51%	-	-	-

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

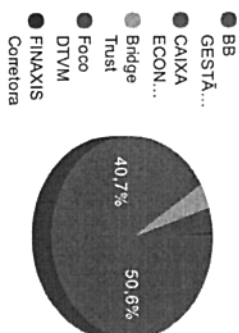
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,64%	2,02%	2,02%	4,19%	9,23%	20,02%	0,20%	1,070%	5,53%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	1,02%	5,22%	5,22%	7,19%	16,07%	32,54%	1,30%	1,441%	5,00%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,02%	6,84%	6,84%	9,22%	21,32%	39,81%	0,20%	2,050%	6,16%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	0,95%	6,74%	6,74%	9,38%	21,28%	38,79%	0,20%	1,980%	5,84%
IMA-B 5+	0,88%	8,35%	8,35%	10,88%	26,07%	45,95%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,84%	8,15%	8,15%	10,63%	25,55%	44,50%	0,20%	2,720%	8,47%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,83%	8,16%	8,16%	10,58%	25,74%	45,01%	0,20%	2,740%	8,46%
101,50% do IPCA + 5,75% ao ano	0,75%	2,36%	2,36%	4,52%	10,50%	27,70%	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,45%	-1,32%	-1,32%	-3,77%	-13,20%	-19,19%	0,25%	0,350%	2,12%

Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmarks - base (março / 2017)

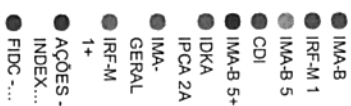
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	Var - Mes	Volatilidade - 12 meses
IBX-50	-2,16%	7,78%	7,78%	10,89%	28,19%	24,53%	-	-	-
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	-2,34%	7,22%	7,22%	9,73%	22,08%	11,69%	0,70%	9,960%	21,95%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	14.307.386,44	50,62%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	11.491.423,48	40,66%
Bridge Trust	1.156.652,13	4,09%
Foco DTVM	1.122.041,96	3,97%
FINAXIS Corretora	186.071,26	0,66%

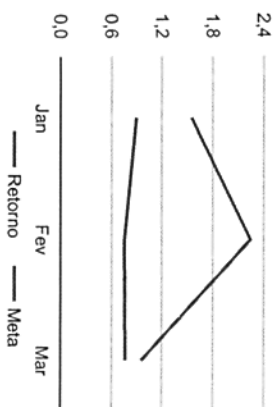
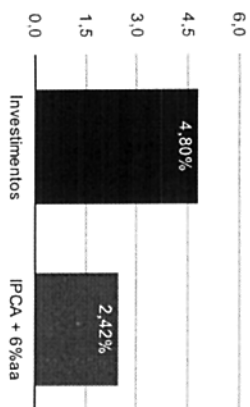


Sub-segmento	Valor	%
IMAB	7.831.881,17	27,71%
IRFM 1	3.891.728,13	13,77%
IMAB-5	3.810.264,93	13,48%
CDI	3.754.179,33	13,28%
IMAB-5+	3.490.665,37	12,35%
IDKA IPCA 2A	2.178.904,69	7,71%
IMA-GERAL	1.392.862,73	4,93%
IRFM 1+	1.017.234,51	3,60%
AÇÕES - INDEXADO	709.783,15	2,51%
FIDC - FECHADO	186.071,26	0,66%
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	26.621.019,44	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%
Março	27.634.035,13	894.100,00	530.000,00	28.263.575,27	265.440,14	0,95%	0,76%	124,02%	1,39%
Acumulado no ano					1.278.874,93	4,80%	2,42%	198,14%	

Acumulado no Ano


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

Ativos de Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Var - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	389.399,40	0,00	0,00	395.781,30	6.381,90	1,64%	1,07%	1,64%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.148.647,83	0,00	0,00	2.178.904,69	30.256,86	1,41%	0,68%	1,41%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.939.735,81	0,00	0,00	1.966.521,42	26.785,61	1,38%	0,76%	1,38%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.428.290,36	0,00	0,00	1.447.962,21	19.671,85	1,38%	0,76%	1,38%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.376.505,17	0,00	0,00	1.392.862,73	16.357,56	1,19%	1,13%	1,19%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.524.251,21	0,00	0,00	1.541.235,36	16.984,15	1,11%	0,13%	1,11%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.324.896,75	0,00	0,00	2.350.492,77	25.596,02	1,10%	0,13%	1,10%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.183.072,41	0,00	0,00	3.217.022,63	33.950,22	1,07%	0,01%	1,07%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	1.144.955,52	0,00	0,00	1.156.652,13	11.696,61	1,02%	1,44%	1,02%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.820.817,26	0,00	0,00	2.849.560,17	28.742,91	1,02%	2,05%	1,02%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	2.678.203,47	0,00	0,00	2.703.626,91	25.423,44	0,95%	1,98%	0,95%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.676.306,30	54.100,00	0,00	1.744.884,76	14.478,46	0,84%	2,74%	0,83%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.731.312,10	0,00	0,00	1.745.780,61	14.468,51	0,84%	2,72%	0,84%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	169.010,58	840.000,00	0,00	1.017.234,51	8.223,93	0,82%	1,75%	1,52%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.060.645,92	0,00	530.000,00	537.156,70	6.510,78	0,61%	0,06%	1,05%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.124.287,11	0,00	0,00	1.122.041,96	-2.245,15	-0,20%	1,27%	-0,20%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	186.919,21	0,00	0,00	186.071,26	-847,95	-0,45%	0,35%	-0,45%
Total Renda Fixa					282.435,71	1,04%	1,17%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	726.778,72	0,00	0,00	709.783,15	-16.995,57	-2,34%	9,96%	-2,34%
			Total Renda Variável		-16.995,57	-2,34%	9,96%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre / 2017

Ativos de Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.667.143,94	0,00	0,00	2.849.560,17	182.416,23	6,84%	6,84%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	2.532.921,20	0,00	0,00	2.703.626,91	170.705,71	6,74%	6,74%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.418.274,47	200.000,00	0,00	1.745.780,61	127.506,14	7,88%	8,15%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.244.784,90	379.000,00	0,00	1.744.884,76	121.099,86	7,71%	8,16%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.120.682,34	0,00	0,00	3.217.022,63	96.340,29	3,09%	3,09%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.097.805,70	0,00	0,00	2.178.904,69	81.098,99	3,87%	3,87%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.273.529,07	0,00	0,00	2.350.492,77	76.963,70	3,39%	3,39%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.889.978,34	0,00	0,00	1.966.521,42	76.543,08	4,05%	4,05%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.323.150,44	0,00	0,00	1.392.862,73	69.712,29	5,27%	5,27%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	1.099.284,02	0,00	0,00	1.156.652,13	57.368,11	5,22%	5,22%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.391.661,52	0,00	0,00	1.447.962,21	56.300,69	4,05%	4,05%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.490.482,90	0,00	0,00	1.541.235,36	50.752,46	3,41%	3,41%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	387.960,60	0,00	10.686,26	395.781,30	18.506,96	4,82%	2,02%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	429.851,88	1.680.000,00	1.590.000,00	537.156,70	17.304,82	1,34%	3,08%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	294.137,86	840.000,00	134.000,00	1.017.234,51	17.096,65	4,96%	6,76%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.108.833,07	0,00	0,00	1.122.041,96	13.208,89	1,19%	1,19%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,00	844.000,00	844.277,79	0,00	277,79	0,03%	1,76%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	188.556,70	0,00	355,05	186.071,26	-2.130,39	-1,13%	-1,32%
Total Renda Fixa					1.231.072,27	4,74%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre / 2017

Ativos de Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	661.980,49	0,00	0,00	709.783,15	47.802,66	7,22%	7,22%
			Total Renda Variável		47.802,66	7,22%	