

Relatório Analítico dos Investimentos em abril de 2017

Carteira consolidada de investimentos - base (abril / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.420.350,14	4,95%	179	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.458.045,85	5,09%	720	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.195.517,49	7,66%	717	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.839.746,14	9,91%	627	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	1.789.110,47	6,24%	314	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	17/08/2020	398.472,00	1,39%	20	0,64%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.370.616,46	8,27%	1.168	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.554.527,01	5,42%	1.339	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.731.496,50	6,04%	284	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.397.238,34	4,87%	206	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea "a"
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.689.375,43	9,38%	343	0,11%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea "a"
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1800	Não há	1.124.222,71	3,92%	15	1,16%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea "a"
TNU IMA-B FI RENDA FIXA	D+31 ou D+1461	Não há	1.150.688,37	4,01%	14	0,87%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea "a"
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	1.980.259,02	6,91%	333	0,10%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea "a"
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	429.570,11	1,50%	116	0,13%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea "a"
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.242.203,74	11,31%	754	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea "a"
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	184.900,25	0,64%	98	0,18%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea "a"
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	D+4	Não há	713.069,60	2,49%	80	0,88%	Artigo 8º, Inciso I
TOTAL -			28.669.409,63				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	17.155.120,40	59,84%	30,00%	48,00%	70,00%	2.913.486,34
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	6.944.545,53	24,22%	15,00%	20,00%	60,00%	10.257.100,25
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	3.671.773,85	12,81%	5,00%	5,00%	30,00%	4.929.049,04
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	4.300.411,44
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	184.900,25	0,64%	0,00%	2,00%	5,00%	1.248.570,23
Total Renda Fixa	100,00%	27.956.340,03	97,51%	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%	713.069,60	2,49%	0,00%	0,00%	0,00%	-713.069,60
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	4.300.411,44
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	1.433.470,48
Total Renda Variável	30,00%	713.069,60	2,49%	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: abril / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	17.155.120,40	59,84%	30,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	6.944.545,53	24,22%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	3.671.773,85	12,81%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	0,00	0,00%	5,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	184.900,25	0,64%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	27.956.340,03	97,51%	55,00	180,00

Artigos - Renda Variável	Base: abril / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I	713.069,60	2,49%	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	713.069,60	2,49%	7,00	20,00

Retorno dos Investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (abril / 2017)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	Var - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDKA IPCA 2 Anos	0,92%	5,08%	3,95%	7,03%	13,24%	34,55%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,76%	4,66%	3,54%	6,53%	12,72%	32,84%	0,20%	0,481%	1,83%
IRF-M 1	0,87%	4,36%	3,04%	6,72%	13,86%	30,56%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,86%	4,30%	3,00%	6,61%	13,65%	30,13%	0,20%	0,157%	0,29%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,86%	4,27%	2,97%	6,56%	13,53%	29,85%	0,10%	0,162%	0,29%
CDI	0,79%	3,84%	2,72%	6,09%	13,45%	29,16%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,78%	3,89%	2,77%	6,17%	13,57%	29,27%	0,20%	0,015%	0,18%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,77%	3,88%	2,75%	6,10%	13,35%	28,79%	0,20%	0,046%	0,08%
IMA-B 5	0,71%	4,83%	3,63%	6,72%	13,17%	33,32%	-	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,70%	4,78%	3,60%	6,61%	12,97%	32,63%	0,20%	0,517%	2,06%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,70%	4,77%	3,59%	6,62%	12,96%	32,50%	0,20%	0,516%	2,06%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,19%	1,39%	0,49%	4,97%	13,30%	24,21%	1,30%	-	-
101,50% do IPCA + 5,75% ao ano	0,53%	2,90%	2,02%	4,34%	9,93%	26,91%	-	-	-
PREMIUM FIDC SENIOR	-0,63%	-1,94%	-1,43%	-3,18%	-12,61%	-16,33%	0,25%	0,648%	2,05%
IRF-M 1+	0,41%	7,25%	4,47%	9,55%	19,19%	39,54%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,33%	7,11%	4,30%	9,29%	19,04%	39,41%	0,20%	1,517%	4,35%
IMA Geral	0,29%	5,68%	3,80%	7,66%	15,83%	34,03%	-	-	-

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

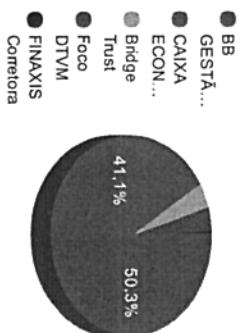
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VAR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,31%	5,60%	3,78%	7,66%	15,85%	33,40%	0,20%	0,997%	2,96%
IMA-B 5+	-0,82%	7,46%	5,11%	9,18%	18,67%	39,79%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,82%	7,27%	4,99%	8,96%	18,27%	38,38%	0,20%	2,560%	7,99%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,83%	7,26%	4,98%	8,87%	18,35%	38,65%	0,20%	2,592%	7,97%
IMA-B	-0,32%	6,55%	4,60%	8,31%	16,59%	36,72%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,68%	2,71%	1,47%	4,44%	7,51%	26,51%	0,20%	0,763%	5,33%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,34%	6,47%	4,54%	8,17%	16,36%	35,97%	0,20%	1,900%	5,85%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	-0,52%	4,68%	3,32%	6,60%	13,84%	30,56%	1,30%	1,344%	5,02%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	-0,53%	6,18%	4,21%	7,90%	16,38%	34,80%	0,20%	1,855%	5,57%

Retorno dos Investimentos de Renda Variável e Benchmarks - base (abril / 2017)

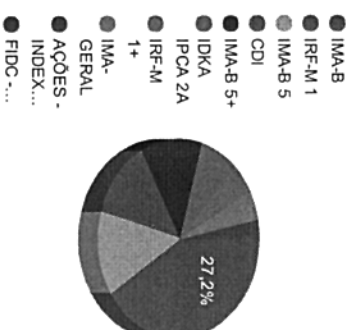
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VAR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IBX-50	0,60%	8,42%	1,21%	0,40%	20,25%	14,23%	-	-	-
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	0,46%	7,72%	1,15%	-0,43%	15,31%	3,34%	0,70%	8,078%	20,89%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	14.417.453,32	50,29%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	11.792.144,98	41,13%
Brdge Trust	1.150.688,37	4,01%
Foco DTVM	1.124.222,71	3,92%
FINAXIS Corretora	184.900,25	0,64%



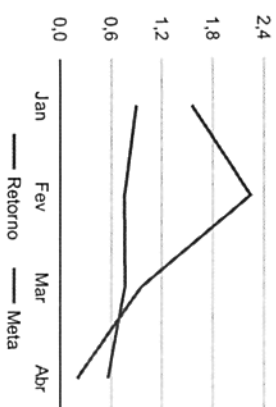
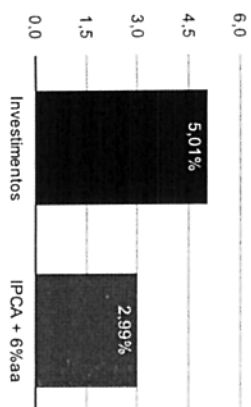
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	7.804.032,65	27,22%
IRFM 1	3.925.143,47	13,69%
IMA-B 5	3.836.776,87	13,38%
CDI	3.671.773,85	12,81%
IMA-B 5+	3.520.606,97	12,28%
IDKA IPCA 2A	2.195.517,49	7,66%
IRFM 1+	1.420.350,14	4,95%
IMA-GERAL	1.397.238,34	4,87%
AÇÕES - INDEXADO	713.069,60	2,49%
FIDC - FECHADO	184.900,25	0,64%
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%
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%
Abril	28.263.575,27	858.800,00	510.000,00	28.669.409,63	57.034,36	0,20%	0,56%	35,74%	1,24%
Acumulado no ano					1.335.909,29	5,01%	2,99%	167,32%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.541.235,36	0,00	0,00	1.554.527,01	13.291,65	0,86%	0,16%	0,86%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.350.492,77	0,00	0,00	2.370.616,46	20.123,69	0,86%	0,16%	0,86%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.217.022,63	0,00	0,00	3.242.203,74	25.181,11	0,78%	0,01%	0,78%
BB IDXA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.178.904,69	0,00	0,00	2.195.517,49	16.612,80	0,76%	0,48%	0,76%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.966.521,42	0,00	0,00	1.980.259,02	13.737,60	0,70%	0,52%	0,70%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.447.962,21	0,00	0,00	1.458.045,85	10.083,64	0,70%	0,52%	0,70%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	395.781,30	0,00	0,00	398.472,00	2.690,70	0,68%	0,76%	0,68%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.392.862,73	0,00	0,00	1.397.238,34	4.375,61	0,31%	1,00%	0,31%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	537.156,70	400.000,00	510.000,00	429.570,11	2.413,41	0,26%	0,05%	0,77%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.017.234,51	400.000,00	0,00	1.420.350,14	3.115,63	0,22%	1,52%	0,33%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.122.041,96	0,00	0,00	1.124.222,71	2.180,75	0,19%	-	-
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2.849.560,17	0,00	0,00	2.839.746,14	-9.814,03	-0,34%	1,90%	-0,34%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.156.652,13	0,00	0,00	1.150.688,37	-5.963,76	-0,52%	1,34%	-0,52%
TMU IMA-B FI RENDA FIXA	2.703.626,91	0,00	0,00	2.689.375,43	-14.251,48	-0,53%	1,85%	-0,53%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	186.071,26	0,00	0,00	184.900,25	-1.171,01	-0,63%	0,65%	-0,63%
PREMIUM FIDC SENIOR	1.744.884,76	58.800,00	0,00	1.789.110,47	-14.574,29	-0,81%	2,59%	-0,83%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.745.780,61	0,00	0,00	1.731.496,50	-14.284,11	-0,82%	2,56%	-0,82%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP								
Total Renda Fixa					53.747,91	0,19%	1,06%	

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

	Ativos de Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VAR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES		709.783,15	0,00	0,00	713.069,60	3.286,45	0,46%	8,08%	0,46%
				Total Renda Variável		3.286,45	0,46%	8,08%	