

Relatório Analítico dos Investimentos em maio de 2017

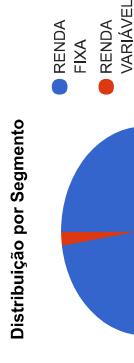


Carteira consolidada de investimentos - base (maio / 2017)

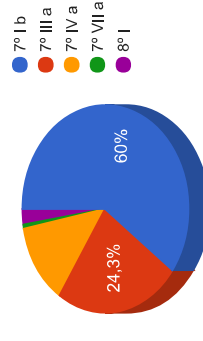
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.702.525,03	5,96%	291	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.398.301,91	4,89%	206	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.421.685,56	4,97%	181	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.459.280,88	5,10%	716	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.199.610,51	7,69%	716	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.797.464,64	9,79%	612	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	1.822.888,08	6,38%	314	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	17/08/2020	398.619,00	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	2.390.174,78	8,36%	1.184	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.568.539,55	5,49%	1.348	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1800	Não há	1.135.140,51	3,97%			Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	D+31 ou D+1461	Não há	1.157.342,28	4,05%	16	0,72%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	1.977.337,65	6,92%	334	0,10%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.663.426,69	9,32%	332	0,11%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	358.502,18	1,25%	115	0,11%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.270.719,27	11,44%	761	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	183.889,54	0,64%	98	0,18%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	D+4	Não há	682.981,91	2,39%	78	0,89%	Artigo 8º, Inciso I
TOTAL -			28.588.429,97				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	17.159.089,94	60,02%	30,00%	48,00%	70,00%	2.852.811,04
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	6.933.247,13	24,25%	15,00%	20,00%	60,00%	10.219.810,85
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	3.629.221,45	12,69%	5,00%	5,00%	30,00%	4.947.307,54
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	4.288.264,50
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	183.889,54	0,64%	0,00%	2,00%	5,00%	1.245.531,96
Total Renda Fixa	100,00%	27.905.448,06	97,61%	55,00	85,00	180,00	-



Distribuição por Artigo / Resolução



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	682.981,91	2,39%	0,00%	0,00%	0,00%	-682.981,91
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	4.288.264,50
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	1.429.421,50
Total Renda Variável	30,00%	682.981,91	2,39%	7,00	15,00	20,00	-

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: maio / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	17.159.089,94	60,02%	30,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	6.933.247,13	24,25%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	3.629.221,45	12,69%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	0,00	0,00%	5,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	183.889,54	0,64%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	27.905.448,06	97,61%	55,00	180,00

Artigos - Renda Variável	Base: maio / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I	682.981,91	2,39%	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	682.981,91	2,39%	7,00	20,00

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M 1+	1,51%	8,97%	2,02%	8,97%	18,13%	39,00%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,09%	7,21%	1,96%	9,44%	19,17%	36,79%	0,20%	8,320%	6,49%
IRF-M 1	0,89%	6,25%	2,69%	6,25%	13,46%	30,44%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,90%	5,24%	2,91%	6,48%	13,48%	30,10%	0,20%	0,955%	0,65%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,89%	5,20%	2,87%	6,42%	13,36%	29,82%	0,10%	0,964%	0,66%
IMA Geral	0,82%	6,55%	1,12%	6,55%	14,23%	32,35%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,08%	5,68%	1,58%	7,70%	15,49%	31,07%	0,20%	6,387%	4,77%
CDI	0,81%	5,65%	2,54%	5,65%	12,85%	28,75%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,92%	4,85%	2,80%	6,04%	13,32%	29,13%	0,20%	0,022%	0,18%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,84%	4,75%	2,68%	5,90%	13,07%	28,56%	0,20%	0,169%	0,14%
IDKA IPCA 2 Anos	0,79%	6,38%	2,18%	6,38%	12,88%	32,07%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,39%	5,07%	2,58%	6,38%	12,32%	30,95%	0,20%	3,873%	2,93%
IMA-B 5	0,52%	5,47%	1,32%	5,47%	11,91%	30,87%	-	-	-
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,97%	2,37%	0,97%	5,45%	12,17%	23,38%	1,30%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,09%	4,87%	2,18%	6,30%	12,18%	30,60%	0,20%	4,910%	3,59%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,08%	4,86%	2,17%	6,30%	12,18%	30,41%	0,20%	4,893%	3,58%
101,50% do IPCA + 5,75% ao ano	0,22%	3,94%	1,55%	3,94%	8,77%	25,12%	-	-	-

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

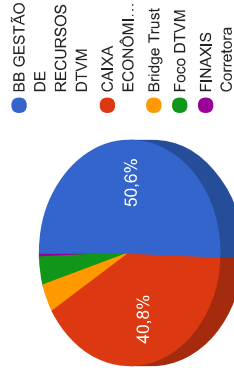
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,54%	-2,48%	-1,62%	-2,68%	-12,29%	-16,43%	0,25%	0,615%	2,03%
IMA-B	0,16%	5,46%	-1,34%	5,46%	13,32%	32,28%	-	-	-
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	0,58%	5,28%	1,08%	7,70%	16,01%	28,98%	1,30%	5,807%	5,56%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,04%	2,75%	2,37%	4,37%	7,19%	17,80%	0,20%	5,377%	6,14%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	-0,96%	5,15%	-0,55%	8,10%	15,23%	30,33%	0,20%	12,692%	9,34%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,20%	5,20%	-0,53%	8,24%	15,11%	30,93%	0,20%	13,324%	9,79%
IMA-B 5+	-0,06%	5,50%	-2,63%	5,50%	14,42%	34,03%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,67%	5,47%	-1,66%	9,38%	17,23%	31,89%	0,20%	16,974%	12,71%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,94%	5,18%	-1,95%	9,08%	16,86%	31,74%	0,20%	17,162%	12,79%

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

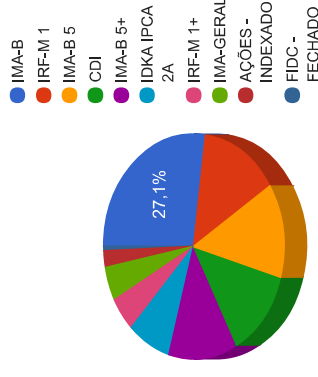
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IBX-50	0,50%	4,61%	-2,94%	4,61%	21,55%	16,57%	-	-	-
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	-4,22%	3,17%	-6,03%	0,66%	22,38%	5,37%	0,70%	17,857%	22,53%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	14.458.194,93	50,57%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	11.653.862,71	40,76%
Bridge Trust	1.157.342,28	4,05%
Foco DTVM	1.135.140,51	3,97%
FINAXIS Corretora	183.889,54	0,64%



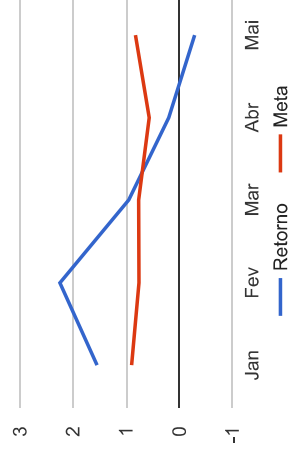
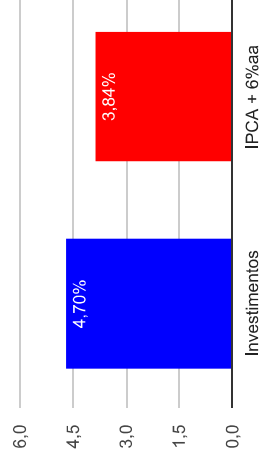
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	7.753.374,12	27,12%
IRF-M 1	3.958.714,33	13,85%
IMA-B 5	3.835.237,53	13,42%
CDI	3.629.221,45	12,69%
IMA-B 5+	3.525.413,11	12,33%
IDKA IPCA 2A	2.199.610,51	7,69%
IRF-M 1+	1.421.685,56	4,97%
IMA-GERAL	1.398.301,91	4,89%
AÇÕES - INDEXADO	682.981,91	2,39%
FIDC - FECHADO	183.889,54	0,64%



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%
Mai	28.669.409,63	429.000,00	425.708,83	28.588.429,97	-84.270,83	-0,29%	0,82%	-35,77%	7,38%
Acumulado no ano					1.251.638,46	4,70%	3,84%	122,43%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.124.222,71	0,00	0,00	1.135.140,51	10.917,80	0,97%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.554.527,01	0,00	0,00	1.568.539,55	14.012,54	0,90%	0,96%	0,90%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.242.203,74	0,00	0,00	3.270.719,27	28.515,53	0,88%	0,02%	0,92%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.370.616,46	0,00	0,00	2.390.174,78	19.558,32	0,83%	0,96%	0,89%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	1.150.688,37	0,00	0,00	1.157.342,28	6.653,91	0,58%	5,81%	0,58%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	429.570,11	352.000,00	425.000,00	358.502,18	1.932,07	0,25%	0,17%	0,84%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.195.517,49	0,00	0,00	2.199.610,51	4.093,02	0,19%	3,87%	0,39%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.420.350,14	0,00	0,00	1.421.685,56	1.335,42	0,09%	8,32%	0,09%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.458.045,85	0,00	0,00	1.459.280,88	1.235,03	0,08%	4,89%	0,08%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.397.238,34	0,00	0,00	1.398.301,91	1.063,57	0,08%	6,39%	0,08%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	398.472,00	0,00	0,00	398.619,00	147,00	0,04%	5,38%	0,04%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.980.259,02	0,00	0,00	1.977.337,65	-2.921,37	-0,15%	4,91%	0,09%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	184.900,25	0,00	708,83	183.889,54	-301,88	-0,16%	0,62%	-0,54%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	2.689.375,43	0,00	0,00	2.663.426,69	-25.948,74	-0,96%	12,69%	-0,96%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.839.746,14	0,00	0,00	2.797.464,64	-42.281,50	-1,49%	13,32%	-1,20%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.731.496,50	0,00	0,00	1.702.525,03	-28.971,47	-1,67%	16,97%	-1,67%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.789.110,47	77.000,00	0,00	1.822.888,08	-43.222,39	-2,32%	17,16%	-1,94%
Total Renda Fixa					-54.183,14	-0,19%	7,11%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IBX 50 FIAÇÕES	713.069,60	0,00	0,00	682.981,91	-30.087,69	-4,22%	17,86%	-4,22%
			Total Renda Variável		-30.087,69	-4,22%	17,86%	