

Relatório Analítico dos Investimentos em julho de 2017

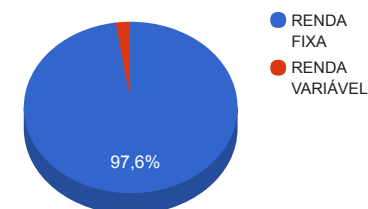
Carteira consolidada de investimentos - base (julho / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.442.198,73	4,78%	202	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.482.823,32	4,91%	185	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.508.161,11	5,00%	703	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.271.609,95	7,53%	706	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.921.045,83	9,68%	605	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	2.112.507,21	7,00%	304	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	17/08/2020	412.678,50	1,37%	20	0,64%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.437.822,68	8,08%	1.197	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.517.058,64	5,03%	1.367	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.779.768,43	5,90%	292	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	2.048.932,46	6,79%	329	0,11%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.767.138,80	9,17%	325	0,11%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1800	Não há	1.214.918,59	4,03%			Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	D+31 ou D+1461	Não há	1.195.943,21	3,96%	18	0,61%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.401.020,52	11,27%	772	0,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	761.170,24	2,52%	115	0,23%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	181.800,75	0,60%	98	0,18%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	D+4	Não há	716.479,13	2,37%	75	0,99%	Artigo 8º, Inciso I
TOTAL -			30.173.078,10				

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

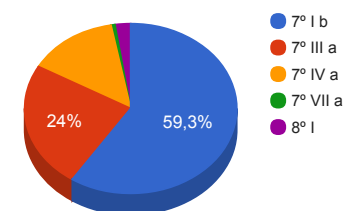
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	17.885.674,40	59,28%	30,00%	48,00%	70,00%	3.235.480,27
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	7.226.933,06	23,95%	15,00%	20,00%	60,00%	10.876.913,80
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	4.162.190,76	13,79%	5,00%	5,00%	30,00%	4.889.732,67
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	4.525.961,72
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	181.800,75	0,60%	0,00%	2,00%	5,00%	1.326.853,16
Total Renda Fixa	100,00%	29.456.598,97	97,63%	55,00	85,00	180,00	-

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	716.479,13	2,37%	0,00%	0,00%	0,00%	-716.479,13
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	4.525.961,72
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	1.508.653,91
Total Renda Variável	30,00%	716.479,13	2,37%	7,00	15,00	20,00	-

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: julho / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	17.885.674,40	59,28%	30,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	7.226.933,06	23,95%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	4.162.190,76	13,79%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	0,00	0,00%	5,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	181.800,75	0,60%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	29.456.598,97	97,63%	55,00	180,00

Artigos - Renda Variável	Base: julho / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I	716.479,13	2,37%	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	716.479,13	2,37%	7,00	20,00

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5+	4,67%	10,43%	2,76%	8,01%	15,89%	42,86%	-	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4,70%	10,02%	2,58%	7,69%	15,35%	41,51%	0,20%	2,971%	12,84%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4,61%	10,26%	2,79%	7,91%	15,61%	41,52%	0,20%	2,937%	12,75%
IMA-B	4,00%	9,67%	2,93%	7,66%	14,97%	38,57%	-	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,96%	9,52%	2,86%	7,54%	14,73%	37,86%	0,20%	2,242%	9,85%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	3,77%	9,25%	2,89%	7,22%	14,74%	37,15%	0,20%	2,150%	9,41%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	3,14%	8,79%	3,93%	7,38%	14,68%	29,22%	1,30%	1,617%	5,50%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,94%	6,37%	3,57%	5,09%	8,50%	19,67%	0,20%	1,225%	6,06%
IMA-B 5	2,85%	8,47%	3,47%	7,23%	13,72%	32,24%	-	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2,85%	8,41%	3,47%	7,19%	13,59%	31,63%	0,20%	1,221%	3,65%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,82%	8,37%	3,44%	7,15%	13,53%	31,44%	0,20%	1,220%	3,64%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-3,31%	5,06%	3,63%	4,13%	10,35%	27,10%	1,30%	-	-
IRF-M 1+	2,76%	11,98%	4,41%	9,07%	19,64%	41,12%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,77%	11,82%	4,40%	8,89%	19,48%	41,17%	0,20%	1,341%	6,47%
IDKA IPCA 2 Anos	2,53%	9,07%	3,80%	7,90%	14,69%	32,93%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,44%	8,29%	3,47%	7,12%	13,62%	31,55%	0,20%	0,949%	2,92%
IMA Geral	2,34%	9,05%	3,19%	7,11%	14,99%	34,75%	-	-	-

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

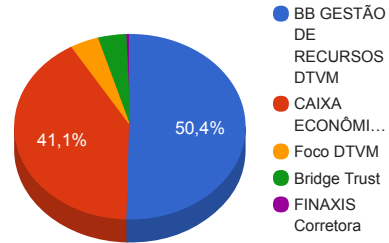
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,30%	9,00%	3,22%	7,12%	15,17%	34,15%	0,20%	1,022%	4,79%
IRF-M 1	1,05%	7,36%	2,87%	5,99%	13,48%	30,14%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,06%	7,23%	2,83%	5,89%	13,20%	29,51%	0,10%	0,212%	0,67%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,04%	7,25%	2,84%	5,92%	13,28%	29,76%	0,20%	0,199%	0,66%
CDI	0,80%	6,49%	2,55%	5,35%	12,51%	28,27%	-	-	-
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,82%	6,45%	2,48%	5,29%	12,38%	27,82%	0,20%	0,037%	0,15%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,81%	6,56%	2,56%	5,40%	12,68%	28,28%	0,20%	0,007%	0,10%
101,50% do IPCA + 5,75% ao ano	0,70%	4,67%	1,72%	3,77%	8,46%	24,59%	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,51%	-3,58%	-1,67%	-3,08%	-12,88%	-16,73%	0,25%	0,374%	1,90%

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

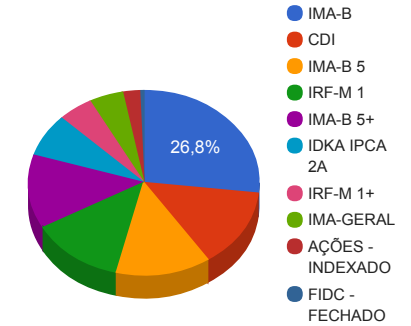
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IBX-50	4,76%	9,59%	1,07%	2,30%	14,76%	26,88%	-	-	-
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	4,80%	8,23%	0,48%	1,63%	11,31%	13,14%	0,70%	5,466%	21,58%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	15.192.938,65	50,35%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	12.387.476,90	41,05%
Foco DTVM	1.214.918,59	4,03%
Bridge Trust	1.195.943,21	3,96%
FINAXIS Corretora	181.800,75	0,60%



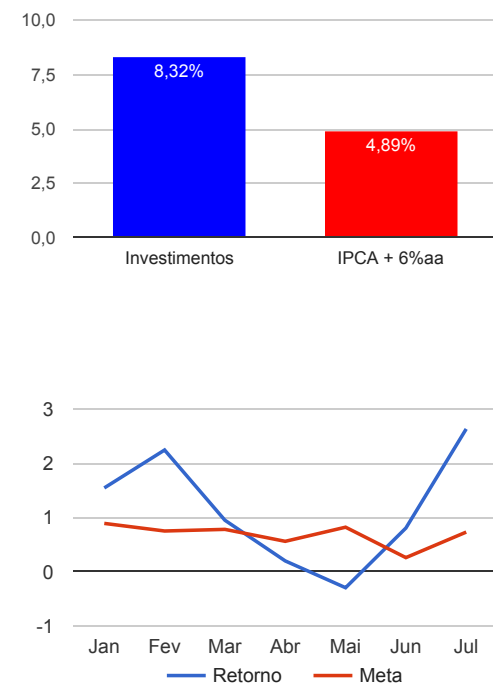
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	8.099.046,43	26,84%
CDI	4.162.190,76	13,79%
IMA-B 5	3.969.772,07	13,16%
IRF-M 1	3.954.881,32	13,11%
IMA-B 5+	3.892.275,64	12,90%
IDKA IPCA 2A	2.271.609,95	7,53%
IRF-M 1+	1.482.823,32	4,91%
IMA-GERAL	1.442.198,73	4,78%
AÇÕES - INDEXADO	716.479,13	2,37%
FIDC - FECHADO	181.800,75	0,60%



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%	172,96%	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%	299,39%	1,24%
Março	27.634.035,13	894.100,00	530.000,00	28.263.575,27	265.440,14	0,95%	0,78%	120,84%	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%	7,22%
Junho	28.588.429,97	789.600,00	435.709,50	29.175.173,22	232.852,75	0,80%	0,26%	314,72%	1,81%
Julho	29.175.173,22	675.500,00	450.408,11	30.173.078,10	772.812,99	2,63%	0,73%	361,11%	1,42%
Acumulado no ano					2.257.304,20	8,32%	4,89%	170,28%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.017.771,35	0,00	0,00	2.112.507,21	94.735,86	4,70%	2,97%	4,70%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.701.309,19	0,00	0,00	1.779.768,43	78.459,24	4,61%	2,94%	4,61%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.809.868,13	0,00	0,00	2.921.045,83	111.177,70	3,96%	2,24%	3,96%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	2.666.509,38	0,00	0,00	2.767.138,80	100.629,42	3,77%	2,15%	3,77%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	1.159.543,22	0,00	0,00	1.195.943,21	36.399,99	3,14%	1,62%	3,14%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	400.884,00	0,00	0,00	412.678,50	11.794,50	2,94%	1,22%	2,94%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.992.160,20	0,00	0,00	2.048.932,46	56.772,26	2,85%	1,22%	2,85%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.466.751,73	0,00	0,00	1.508.161,11	41.409,38	2,82%	1,22%	2,82%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.442.851,35	0,00	0,00	1.482.823,32	39.971,97	2,77%	1,34%	2,77%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.217.602,11	0,00	0,00	2.271.609,95	54.007,84	2,44%	0,95%	2,44%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.409.777,89	0,00	0,00	1.442.198,73	32.420,84	2,30%	1,02%	2,30%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.412.358,35	0,00	0,00	2.437.822,68	25.464,33	1,06%	0,21%	1,06%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.501.402,63	0,00	0,00	1.517.058,64	15.656,01	1,04%	0,20%	1,04%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.204.823,13	0,00	0,00	1.214.918,59	10.095,46	0,84%	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.298.736,27	75.500,00	0,00	3.401.020,52	26.784,25	0,79%	0,01%	0,81%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	606.420,59	600.000,00	450.000,00	761.170,24	4.749,65	0,39%	0,04%	0,82%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	182.726,34	0,00	408,11	181.800,75	-517,48	-0,28%	0,37%	-0,51%
				Total Renda Fixa	740.011,22	2,58%	1,32%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	683.677,36	0,00	0,00	716.479,13	32.801,77	4,80%	5,47%	4,80%
Total Renda Variável					32.801,77	4,80%	5,47%	