

Relatório Analítico dos Investimentos em abril de 2017



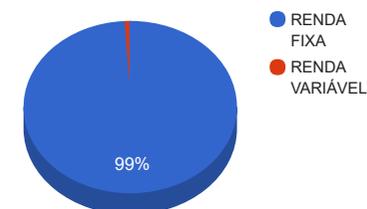
Carteira consolidada de investimentos - base (abril / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.562.507,72	18,77%	1.339	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.935.652,08	36,55%	720	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.498.203,32	18,43%	609	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	2.869.090,55	15,12%	333	0,14%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.595,66	0,01%	608	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	894.680,08	4,71%	748	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.030.659,57	5,43%	432	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
WESTERN ASSET DIVIDEND YIELD FI AÇÕES	D+4	Não há	183.140,10	0,97%	3	0,50%	Artigo 8º, Inciso III
		TOTAL -	18.976.529,08				

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

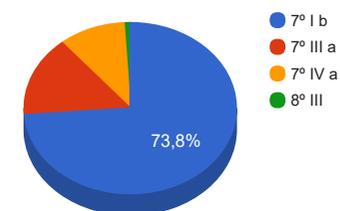
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	13.996.363,12	73,76%	30,00%	50,00%	70,00%	-712.792,76
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	2.869.090,55	15,12%	15,00%	20,00%	60,00%	8.516.826,90
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	1.927.935,31	10,16%	5,00%	5,00%	30,00%	3.765.023,41
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	2.846.479,36
Total Renda Fixa	100,00%	18.793.388,98	99,03%	55,00	85,00	175,00	-

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	183.140,10	0,97%	5,00%	10,00%	15,00%	2.663.339,26
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	948.826,45
Total Renda Variável	30,00%	183.140,10	0,97%	7,00	15,00	20,00	-

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 "	13.996.363,12	73,76%	30,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	2.869.090,55	15,12%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	1.927.935,31	10,16%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	0,00	0,00%	5,00%	15,00%
Total Renda Fixa	18.793.388,98	99,03%	55,00	175,00

Artigos - Renda Variável	Base: abril / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso III	183.140,10	0,97%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Total Renda Variável	183.140,10	0,97%	7,00	20,00

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

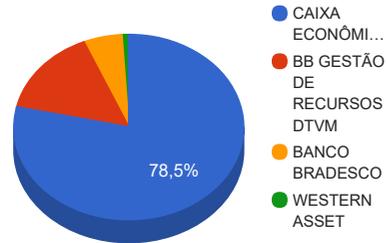
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDKA IPCA 2 Anos	0,92%	5,08%	3,95%	7,03%	13,24%	34,55%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,79%	4,64%	3,54%	6,53%	12,81%	33,04%	0,20%	0,465%	1,76%
IRF-M 1	0,87%	4,36%	3,04%	6,72%	13,86%	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%
Selic	0,79%	3,84%	2,73%	6,10%	13,47%	29,20%	-	-	-
BRABESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,91%	3,98%	2,86%	6,33%	13,90%	29,69%	0,20%	0,070%	0,07%
CDI	0,79%	3,84%	2,72%	6,09%	13,45%	29,16%	-	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,79%	3,87%	2,77%	6,12%	13,47%	29,25%	0,20%	0,018%	0,06%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,73%	3,57%	2,53%	5,68%	12,72%	27,15%	1,00%	0,014%	0,09%
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%

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

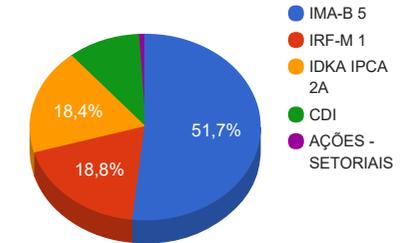
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDIV	0,92%	15,08%	5,98%	11,54%	39,29%	27,73%	-	-	-
WESTERN ASSET DIVIDEND YIELD FI AÇÕES	0,40%	10,91%	3,20%	0,69%	17,20%	10,90%	2,00%	6,265%	16,96%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	14.891.043,20	78,47%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	2.871.686,21	15,13%
BANCO BRADESCO	1.030.659,57	5,43%
WESTERN ASSET	183.140,10	0,97%



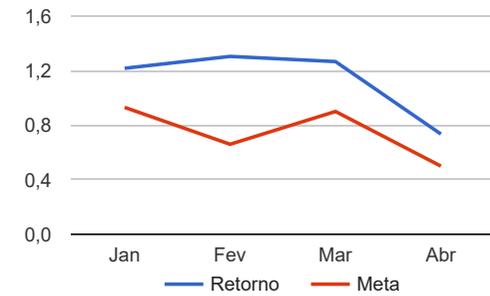
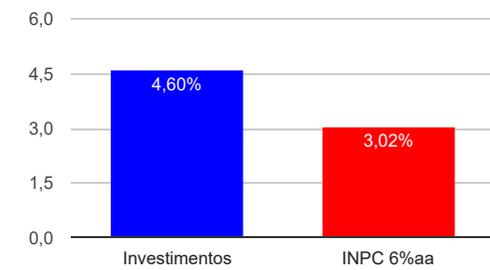
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5	9.804.742,63	51,67%
IRF-M 1	3.562.507,72	18,77%
IDKA IPCA 2A	3.498.203,32	18,43%
CDI	1.927.935,31	10,16%
AÇÕES - SETORIAIS	183.140,10	0,97%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	14.438.742,95	1.200.000,00	0,00	15.828.937,80	190.194,85	1,22%	0,93%	130,77%	0,95%
Fevereiro	15.828.937,80	0,00	0,00	16.035.218,12	206.280,32	1,30%	0,66%	197,45%	0,55%
Março	16.035.218,12	0,00	0,00	16.238.113,88	202.895,76	1,27%	0,90%	141,35%	0,60%
Abril	16.238.113,88	2.800.000,00	200.000,00	18.976.529,08	138.415,20	0,73%	0,50%	147,72%	0,45%
Acumulado no ano					737.786,13	4,60%	3,02%	152,40%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.021.374,77	0,00	0,00	1.030.659,57	9.284,80	0,91%	0,07%	0,91%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.731.220,41	0,00	200.000,00	3.562.507,72	31.287,31	0,84%	0,16%	0,86%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.576,88	0,00	0,00	2.595,66	18,78	0,73%	0,01%	0,73%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	688.362,74	200.000,00	0,00	894.680,08	6.317,34	0,71%	0,02%	0,79%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.873.727,51	1.600.000,00	0,00	3.498.203,32	24.475,81	0,70%	0,46%	0,79%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2.849.186,89	0,00	0,00	2.869.090,55	19.903,66	0,70%	0,52%	0,70%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.889.246,78	1.000.000,00	0,00	6.935.652,08	46.405,30	0,67%	0,52%	0,70%
Total Renda Fixa					137.693,00	0,74%	0,39%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
WESTERN ASSET DIVIDEND YIELD FI AÇÕES	182.417,90	0,00	0,00	183.140,10	722,20	0,40%	6,26%	0,40%
Total Renda Variável					722,20	0,40%	6,26%	