

Relatório Analítico dos Investimentos em fevereiro de 2017



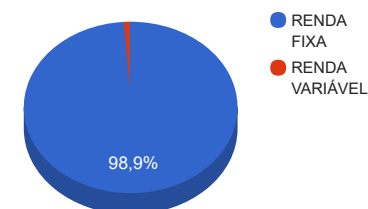
Carteira consolidada de investimentos - base (fevereiro / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.847.506,48	11,52%	611	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.690.102,99	23,01%	1.341	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.809.236,16	36,23%	712	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	2.810.378,66	17,53%	319	0,14%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.552,08	0,02%	599	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	681.086,55	4,25%	764	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.010.747,85	6,30%	411	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
WESTERN ASSET DIVIDEND YIELD FI AÇÕES	D+4	Não há	183.607,35	1,15%	3	0,48%	Artigo 8º, Inciso III
		TOTAL -	16.035.218,12				

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

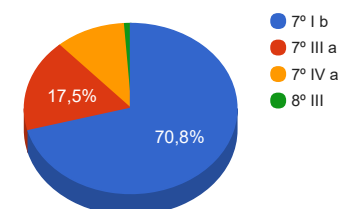
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	11.346.845,63	70,76%	30,00%	50,00%	70,00%	-122.192,95
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	2.810.378,66	17,53%	15,00%	20,00%	60,00%	6.810.752,21
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	1.694.386,48	10,57%	5,00%	5,00%	30,00%	3.116.178,96
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	2.405.282,72
Total Renda Fixa	100,00%	15.851.610,77	98,85%	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%	183.607,35	1,15%	5,00%	10,00%	15,00%	2.221.675,37
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	801.760,91
Total Renda Variável	30,00%	183.607,35	1,15%	7,00	15,00	20,00	-

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: fevereiro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	11.346.845,63	70,76%	30,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	2.810.378,66	17,53%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	1.694.386,48	10,57%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	0,00	0,00%	5,00%	15,00%
Total Renda Fixa	15.851.610,77	98,85%	55,00	175,00

Artigos - Renda Variável	Base: fevereiro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso III	183.607,35	1,15%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Total Renda Variável	183.607,35	1,15%	7,00	20,00

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

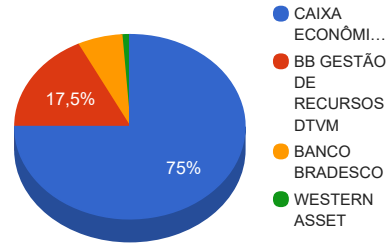
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5	1,49%	2,67%	4,10%	6,47%	13,40%	32,51%	-	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,48%	2,63%	4,03%	6,35%	13,21%	31,75%	0,20%	0,718%	2,39%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,48%	2,63%	4,05%	6,38%	13,17%	31,63%	0,20%	0,715%	2,39%
IDKA IPCA 2 Anos	1,35%	2,45%	3,77%	6,37%	12,42%	33,17%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,29%	2,37%	3,63%	6,06%	12,84%	31,83%	0,20%	0,596%	2,15%
IRF-M 1	1,01%	2,31%	3,53%	6,86%	14,23%	30,27%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,99%	2,27%	3,47%	6,76%	14,05%	29,83%	0,20%	0,083%	0,30%
Selic	0,87%	1,96%	3,11%	6,44%	13,90%	29,39%	-	-	-
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,87%	1,98%	3,12%	6,65%	14,17%	29,75%	0,20%	0,006%	0,05%
CDI	0,86%	1,96%	3,10%	6,43%	13,88%	29,35%	-	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,88%	1,96%	3,09%	6,43%	13,90%	29,43%	0,20%	0,044%	0,05%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,80%	1,83%	2,90%	6,03%	13,03%	27,35%	1,00%	0,007%	0,08%

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

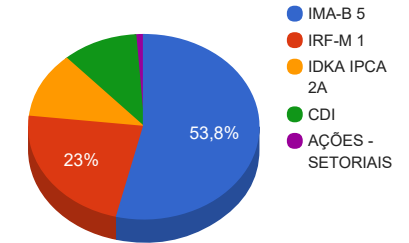
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDIV	7,00%	16,18%	15,16%	29,01%	90,61%	38,26%	-	-	-
WESTERN ASSET DIVIDEND YIELD FI AÇÕES	3,46%	11,19%	10,35%	7,61%	34,79%	16,66%	2,00%	6,439%	19,29%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	12.027.932,18	75,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	2.812.930,74	17,54%
BANCO BRADESCO	1.010.747,85	6,30%
WESTERN ASSET	183.607,35	1,15%

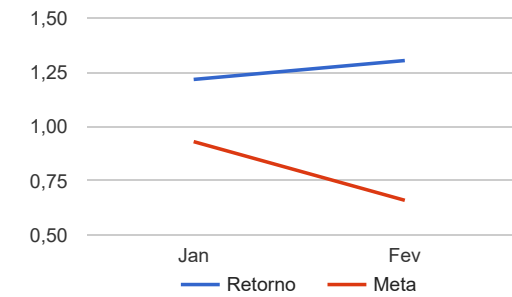
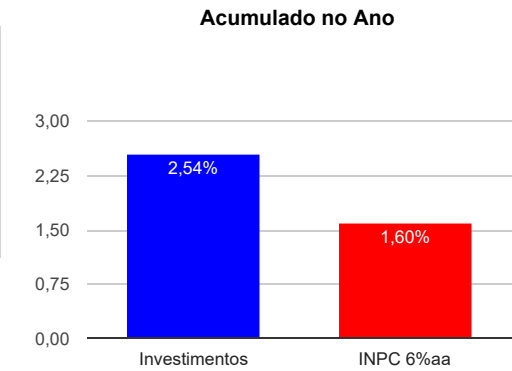


Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5	8.619.614,82	53,75%
IRF-M 1	3.690.102,99	23,01%
IDKA IPCA 2A	1.847.506,48	11,52%
CDI	1.694.386,48	10,57%
AÇÕES - SETORIAIS	183.607,35	1,15%



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%
Acumulado no ano					396.475,17	2,54%	1,60%	158,83%	



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2.769.446,55	0,00	0,00	2.810.378,66	40.932,11	1,48%	0,72%	1,48%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.724.646,37	0,00	0,00	5.809.236,16	84.589,79	1,48%	0,72%	1,48%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.823.938,33	0,00	0,00	1.847.506,48	23.568,15	1,29%	0,60%	1,29%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.653.771,36	0,00	0,00	3.690.102,99	36.331,63	0,99%	0,08%	0,99%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	675.142,56	0,00	0,00	681.086,55	5.943,99	0,88%	0,04%	0,88%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.002.002,36	0,00	0,00	1.010.747,85	8.745,49	0,87%	0,01%	0,87%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.531,72	0,00	0,00	2.552,08	20,36	0,80%	0,01%	0,80%
Total Renda Fixa					200.131,52	1,28%	0,48%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
WESTERN ASSET DIVIDEND YIELD FI AÇÕES	177.458,55	0,00	0,00	183.607,35	6.148,80	3,46%	6,44%	3,46%
Total Renda Variável					6.148,80	3,46%	6,44%	