

Relatório Analítico dos Investimentos em janeiro de 2017



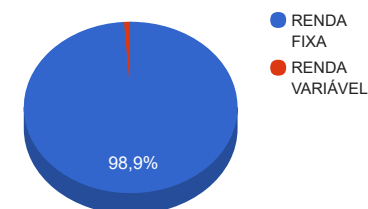
Carteira consolidada de investimentos - base (janeiro / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.724.646,37	36,17%	714	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.823.938,33	11,52%	619	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.653.771,36	23,08%	1.347	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	2.769.446,55	17,50%	322	0,13%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	675.142,56	4,27%	770	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.531,72	0,02%	596	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.002.002,36	6,33%	410	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
WESTERN ASSET DIVIDEND YIELD FI AÇÕES	D+4	Não há	177.458,55	1,12%	3	0,48%	Artigo 8º, Inciso III
		TOTAL -	15.828.937,80				

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

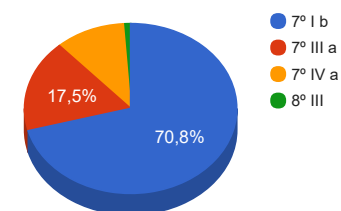
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	11.202.356,06	70,77%	30,00%	50,00%	70,00%	-122.099,60
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	2.769.446,55	17,50%	15,00%	20,00%	60,00%	6.727.916,13
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	1.679.676,64	10,61%	5,00%	5,00%	30,00%	3.069.004,70
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	2.374.340,67
Total Renda Fixa	100,00%	15.651.479,25	98,88%	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%	177.458,55	1,12%	5,00%	10,00%	15,00%	2.196.882,12
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	791.446,89
Total Renda Variável	30,00%	177.458,55	1,12%	7,00	15,00	20,00	-

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: janeiro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	11.202.356,06	70,77%	30,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	2.769.446,55	17,50%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	1.679.676,64	10,61%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	0,00	0,00%	5,00%	15,00%
Total Renda Fixa	15.651.479,25	98,88%	55,00	175,00

Artigos - Renda Variável	Base: janeiro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso III	177.458,55	1,12%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Total Renda Variável	177.458,55	1,12%	7,00	20,00

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

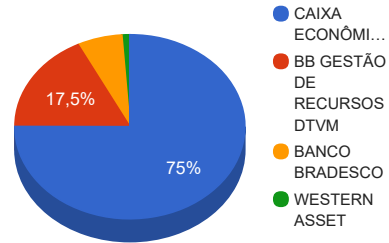
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M 1	1,29%	1,29%	3,58%	7,06%	14,32%	29,93%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,26%	1,26%	3,50%	6,95%	14,17%	29,47%	0,20%	0,288%	0,31%
IMA-B 5	1,16%	1,16%	2,97%	6,05%	13,45%	32,16%	-	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,14%	1,14%	2,91%	5,97%	13,25%	31,31%	0,20%	1,255%	2,49%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,14%	1,14%	2,92%	5,95%	13,21%	31,19%	0,20%	1,254%	2,49%
IDKA IPCA 2 Anos	1,09%	1,09%	2,97%	6,30%	12,25%	32,94%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,06%	1,06%	2,89%	5,98%	12,92%	31,70%	0,20%	1,042%	2,26%
Selic	1,09%	1,09%	3,28%	6,81%	14,05%	29,34%	-	-	-
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,09%	1,09%	3,37%	7,02%	14,30%	29,71%	0,20%	0,015%	0,05%
CDI	1,08%	1,08%	3,28%	6,80%	14,03%	29,29%	-	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,07%	1,07%	3,27%	6,77%	14,03%	29,36%	0,20%	0,035%	0,05%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,01%	1,01%	3,08%	6,40%	13,15%	27,30%	1,00%	0,011%	0,08%

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

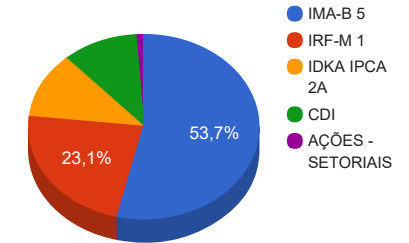
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDIV	8,58%	8,58%	5,25%	22,83%	92,63%	42,36%	-	-	-
WESTERN ASSET DIVIDEND YIELD FI AÇÕES	7,46%	7,46%	-2,43%	3,32%	35,38%	17,52%	2,00%	7,752%	19,72%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	11.877.498,62	75,04%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	2.771.978,27	17,51%
BANCO BRADESCO	1.002.002,36	6,33%
WESTERN ASSET	177.458,55	1,12%



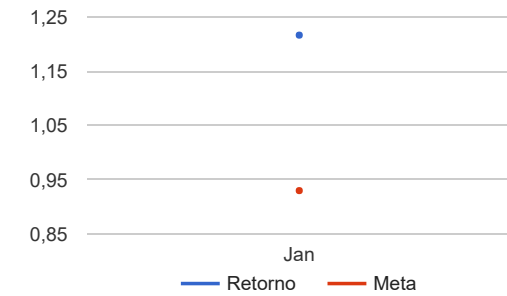
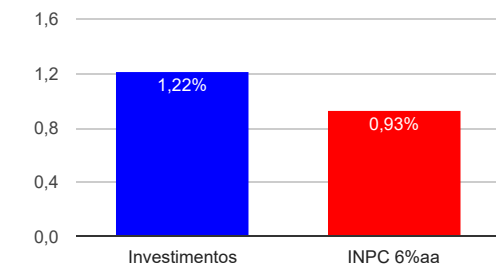
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5	8.494.092,92	53,66%
IRF-M 1	3.653.771,36	23,08%
IDKA IPCA 2A	1.823.938,33	11,52%
CDI	1.679.676,64	10,61%
AÇÕES - SETORIAIS	177.458,55	1,12%



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%
Acumulado no ano					190.194,85	1,22%	0,93%	130,77%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.809.428,77	800.000,00	0,00	3.653.771,36	44.342,59	1,23%	0,29%	1,26%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	267.230,59	400.000,00	0,00	675.142,56	7.911,97	1,19%	0,03%	1,07%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2.738.287,73	0,00	0,00	2.769.446,55	31.158,82	1,14%	1,26%	1,14%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.660.256,93	0,00	0,00	5.724.646,37	64.389,44	1,14%	1,25%	1,14%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	991.162,47	0,00	0,00	1.002.002,36	10.839,89	1,09%	0,01%	1,09%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.804.738,68	0,00	0,00	1.823.938,33	19.199,65	1,06%	1,04%	1,06%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.506,28	0,00	0,00	2.531,72	25,44	1,02%	0,01%	1,01%
Total Renda Fixa					177.867,80	1,15%	0,87%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
WESTERN ASSET DIVIDEND YIELD FI AÇÕES	165.131,50	0,00	0,00	177.458,55	12.327,05	7,46%	7,75%	7,46%
				Total Renda Variável	12.327,05	7,46%	7,75%	