



# Relatório Analítico dos Investimentos em maio de 2017

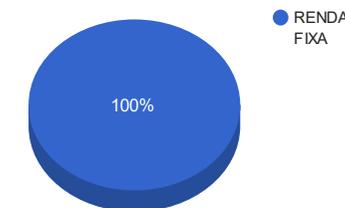
Carteira consolidada de investimentos - base (maio / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			455.640,78	1,07%			Artigo 20
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.056.432,49	7,17%	744	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.646.795,22	8,55%	30	4,32%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	17.042.152,72	39,95%	1.348	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.526.234,75	3,58%	191	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.104.979,22	7,28%	716	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.717.265,73	6,37%	1.184	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	5.272.056,88	12,36%	761	0,12%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.336.842,51	5,48%	426	0,12%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	644.892,34	1,51%	199	0,19%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	2.854.302,53	6,69%	2.640	0,30%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
		<b>TOTAL -</b>	<b>42.657.595,17</b>				

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

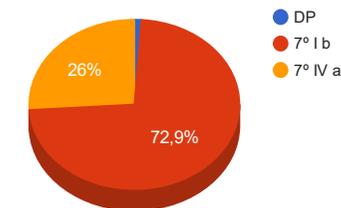
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 20	100,00%	455.640,78	1,07%	0,00%	0,00%	0,00%	-455.640,78
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	31.093.860,13	72,89%	20,00%	80,00%	85,00%	5.165.095,76
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	11.108.094,26	26,04%	5,00%	20,00%	30,00%	1.689.184,29
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>42.657.595,17</b>	<b>100,00%</b>	<b>25,00</b>	<b>100,00</b>	<b>145,00</b>	<b>-</b>

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>15,00</b>	<b>-</b>

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: maio / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 20	455.640,78	1,07%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	31.093.860,13	72,89%	30,00%	80,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	20,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	11.108.094,26	26,04%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>42.657.595,17</b>	<b>100,00%</b>	<b>40,00</b>	<b>145,00</b>

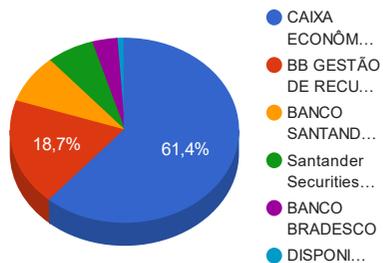
Artigos - Renda Variável	Base: maio / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>15,00</b>

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

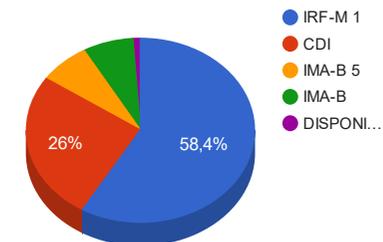
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M 1	0,89%	6,25%	2,69%	6,25%	13,46%	30,44%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,90%	5,24%	2,91%	6,48%	13,48%	30,10%	0,20%	0,955%	0,65%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	0,89%	5,19%	2,85%	6,41%	13,41%	29,57%	0,40%	0,960%	0,67%
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%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,88%	5,20%	2,86%	6,43%	13,40%	29,88%	0,20%	0,973%	0,66%
CDI	0,81%	5,65%	2,54%	5,65%	12,85%	28,75%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO	0,92%	4,85%	2,80%	6,04%	13,32%	29,13%	0,20%	0,022%	0,18%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,85%	4,45%	2,58%	5,55%	12,32%	26,95%	0,80%	0,000%	0,06%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,84%	4,75%	2,69%	5,91%	13,10%	28,65%	0,20%	0,161%	0,14%
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	0,83%	4,68%	2,68%	5,83%	12,35%	27,61%	0,50%	0,299%	0,34%
IMA-B 5	0,52%	5,47%	1,32%	5,47%	11,91%	30,87%	-	-	-
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%
IMA-B	0,16%	5,46%	-1,34%	5,46%	13,32%	32,28%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,19%	5,20%	-0,51%	8,22%	15,18%	29,64%	0,20%	13,312%	9,77%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	26.185.299,28	61,38%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	7.989.322,61	18,73%
BANCO SANTANDER	3.646.795,22	8,55%
Santander Securities Services	2.854.302,53	6,69%
BANCO BRADESCO	1.526.234,75	3,58%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	455.640,78	1,07%

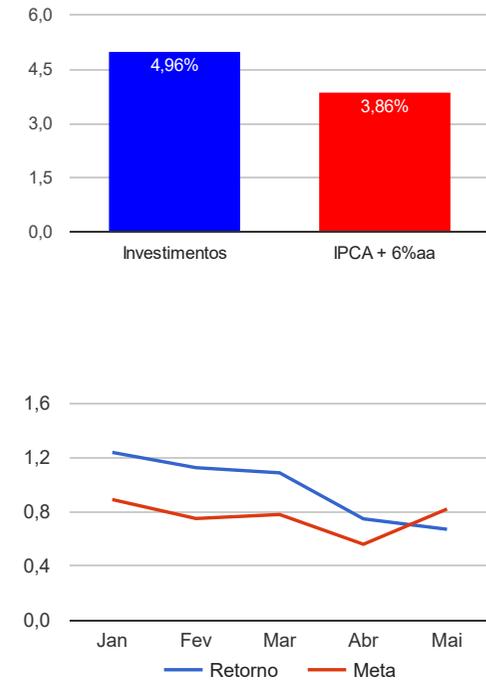


Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	24.932.448,42	58,45%
CDI	11.108.094,26	26,04%
IMA-B 5	3.104.979,22	7,28%
IMA-B	3.056.432,49	7,17%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	455.640,78	1,07%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

**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(%)
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO	5.223.876,33	0,00	0,00	5.272.056,88	48.180,55	0,92%	0,02%	0,92%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	16.889.906,74	0,00	0,00	17.042.152,72	152.245,98	0,90%	0,96%	0,90%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	3.614.569,95	0,00	0,00	3.646.795,22	32.225,27	0,89%	0,96%	0,89%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.693.377,16	0,00	0,00	2.717.265,73	23.888,57	0,89%	0,96%	0,89%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.512.899,23	0,00	0,00	1.526.234,75	13.335,52	0,88%	0,97%	0,88%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.317.337,25	0,00	0,00	2.336.842,51	19.505,26	0,84%	0,16%	0,84%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	1.071.382,35	0,00	434.962,57	644.892,34	8.472,56	0,79%	0,00%	0,85%
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	2.483.615,22	350.000,00	0,00	2.854.302,53	20.687,31	0,73%	0,30%	0,83%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.562.069,58	540.728,20	0,00	3.104.979,22	2.181,44	0,07%	4,89%	0,08%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.542.457,47	553.771,55	0,00	3.056.432,49	-39.796,53	-1,29%	13,31%	-1,19%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>280.925,93</b>	<b>0,67%</b>	<b>1,92%</b>	