

Relatório Analítico dos Investimentos em fevereiro de 2017

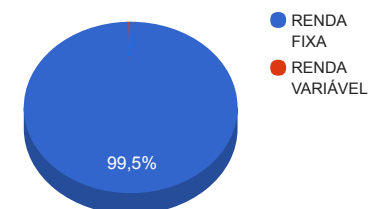
Carteira consolidada de investimentos - base (fevereiro / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			1.371.797,42	1,83%			Artigo 20
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	23.846.632,27	31,79%	1.341	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.546.271,86	7,39%	712	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	12.958.674,96	17,28%	722	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	4.250.148,40	5,67%	194	0,65%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	4.173.836,48	5,56%	319	0,22%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	8.346.154,24	11,13%	70	3,22%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.006.265,53	10,67%	433	0,42%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.505.487,09	2,01%	764	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	4.640.381,67	6,19%	776	0,10%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	D+43	5 anos	364.914,84	0,49%	55	0,34%	Artigo 8º, Inciso III
		TOTAL -	75.010.564,76				

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

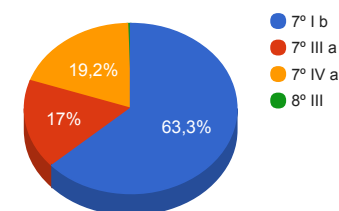
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	46.601.727,49	62,13%	30,00%	35,00%	70,00%	5.905.667,84
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	12.519.990,72	16,69%	15,00%	20,00%	60,00%	32.486.348,14
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	14.152.134,29	18,87%	5,00%	5,00%	30,00%	8.351.035,14
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	11.251.584,71
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	3.750.528,24
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	3.750.528,24
Total Renda Fixa	100,00%	73.273.852,50	97,68%	55,00	75,00	185,00	-

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	364.914,84	0,49%	5,00%	10,00%	15,00%	10.886.669,87
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	3.750.528,24
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	3.750.528,24
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	3.750.528,24
Total Renda Variável	30,00%	364.914,84	0,49%	11,00	25,00	30,00	-

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 "	46.601.727,49	62,13%	30,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	12.519.990,72	16,69%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	14.152.134,29	18,87%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	0,00	0,00%	5,00%	15,00%
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%
Total Renda Fixa	73.273.852,50	97,68%	55,00	185,00

Artigos - Renda Variável	Base: fevereiro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso III	364.914,84	0,49%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Total Renda Variável	364.914,84	0,49%	11,00	30,00

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

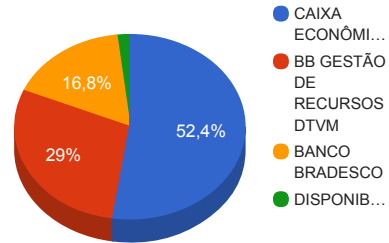
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5	1,49%	2,67%	4,10%	6,47%	13,40%	32,51%	-	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	1,60%	2,79%	4,26%	6,58%	13,40%	31,65%	0,20%	0,794%	2,59%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,48%	2,63%	4,03%	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%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,33%	2,42%	3,70%	6,10%	12,74%	31,60%	0,20%	0,609%	2,20%
IRF-M 1	1,01%	2,31%	3,53%	6,86%	14,23%	30,27%	-	-	-
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,01%	2,27%	3,47%	6,75%	14,02%	29,82%	0,20%	0,075%	0,31%
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%
CDI	0,86%	1,96%	3,10%	6,43%	13,88%	29,35%	-	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,90%	2,01%	3,14%	6,44%	13,86%	28,91%	0,20%	0,049%	0,09%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,89%	2,00%	3,16%	6,52%	13,85%	29,49%	0,20%	0,015%	0,17%
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%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

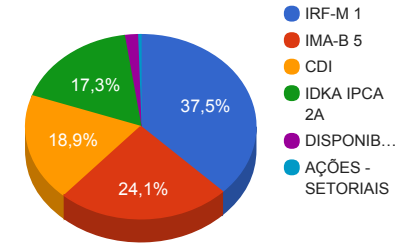
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
SMLL	5,73%	17,81%	17,17%	14,91%	62,13%	29,70%	-	-	-
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	4,24%	9,31%	10,71%	-3,42%	-12,75%	-18,31%	1,72%	4,078%	30,02%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	39.269.571,59	52,35%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	21.772.893,11	29,03%
BANCO BRADESCO	12.596.302,64	16,79%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	1.371.797,42	1,83%



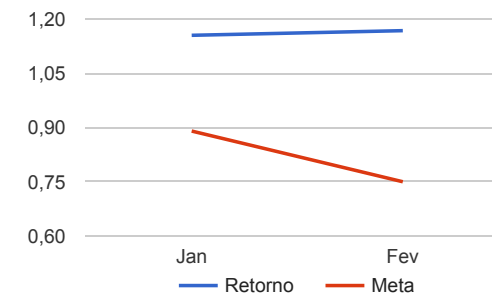
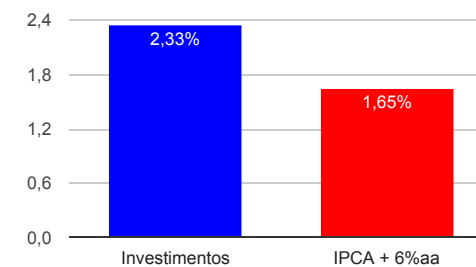
Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	28.096.780,67	37,46%
IMA-B 5	18.066.262,58	24,08%
CDI	14.152.134,29	18,87%
IDKA IPCA 2A	12.958.674,96	17,28%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	1.371.797,42	1,83%
AÇÕES - SETORIAIS	364.914,84	0,49%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	68.599.891,06	2.091.151,53	197.572,71	71.307.191,73	813.721,85	1,15%	0,89%	129,42%	0,65%
Fevereiro	71.307.191,73	1.842.013,24	360.000,00	73.638.767,34	849.562,37	1,17%	0,75%	155,94%	0,35%
Acumulado no ano					1.663.284,22	2,33%	1,65%	141,76%	

Acumulado no Ano



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(%)
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	7.380.897,74	841.174,46	0,00	8.346.154,24	124.082,04	1,51%	0,79%	1,60%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	4.113.046,11	0,00	0,00	4.173.836,48	60.790,37	1,48%	0,72%	1,48%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.465.511,16	0,00	0,00	5.546.271,86	80.760,70	1,48%	0,72%	1,48%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12.789.087,24	0,00	0,00	12.958.674,96	169.587,72	1,33%	0,61%	1,33%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.207.771,54	0,00	0,00	4.250.148,40	42.376,86	1,01%	0,08%	1,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	22.974.228,03	1.000.838,78	360.000,00	23.846.632,27	231.565,46	0,97%	0,08%	0,99%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.934.844,25	0,00	0,00	8.006.265,53	71.421,28	0,90%	0,05%	0,90%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.599.373,62	0,00	0,00	4.640.381,67	41.008,05	0,89%	0,02%	0,89%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.492.348,37	0,00	0,00	1.505.487,09	13.138,72	0,88%	0,04%	0,88%
Total Renda Fixa					834.731,20	1,15%	0,33%	

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(%)
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	350.083,67	0,00	0,00	364.914,84	14.831,17	4,24%	4,08%	4,24%
Total Renda Variável					14.831,17	4,24%	4,08%	