

Relatório Analítico dos Investimentos em abril de 2017

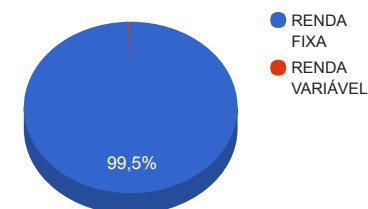
Carteira consolidada de investimentos - base (abril / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			1.712.735,96	2,18%			Artigo 20
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	13.241.398,52	16,88%	769	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.001.914,26	1,28%	1.339	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	4.333.559,31	5,52%	193	0,63%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.661.817,00	7,22%	720	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	13.241.349,84	16,88%	717	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	9.951.266,05	12,69%	284	0,68%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	4.261.032,50	5,43%	333	0,21%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	10.250.118,07	13,07%	75	3,78%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	4.726.585,16	6,03%	754	0,10%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.151.804,83	10,39%	430	0,42%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.533.636,29	1,96%	748	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	D+43	5 anos	370.649,12	0,47%	54	0,37%	Artigo 8º, Inciso III
		TOTAL -	78.437.866,91				

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

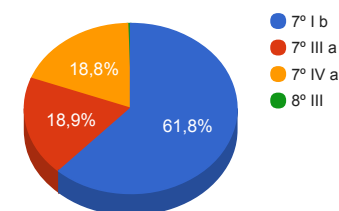
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	47.431.304,98	60,47%	30,00%	35,00%	70,00%	7.475.201,86
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	14.511.150,57	18,50%	15,00%	20,00%	60,00%	32.551.569,58
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	14.412.026,28	18,37%	5,00%	5,00%	30,00%	9.119.333,79
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	11.765.680,04
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	3.921.893,35
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	3.921.893,35
Total Renda Fixa	100,00%	76.354.481,83	97,34%	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%	370.649,12	0,47%	5,00%	10,00%	15,00%	11.395.030,92
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	3.921.893,35
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	3.921.893,35
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	3.921.893,35
Total Renda Variável	30,00%	370.649,12	0,47%	11,00	25,00	30,00	-

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 "	47.431.304,98	60,47%	30,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	14.511.150,57	18,50%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	14.412.026,28	18,37%	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	76.354.481,83	97,34%	55,00	185,00

Artigos - Renda Variável	Base: abril / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso III	370.649,12	0,47%	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	370.649,12	0,47%	11,00	30,00

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%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,76%	4,66%	3,54%	6,53%	12,72%	32,84%	0,20%	0,481%	1,83%
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%
BRADERCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,85%	4,28%	2,99%	6,58%	13,60%	29,86%	0,20%	0,162%	0,29%
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 PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,78%	3,89%	2,77%	6,17%	13,57%	29,27%	0,20%	0,015%	0,18%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,77%	3,88%	2,75%	6,10%	13,37%	28,86%	0,20%	0,048%	0,08%
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%
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	0,66%	4,97%	3,76%	6,80%	13,09%	42,49%	0,20%	0,586%	2,27%
IMA-B 5+	-0,82%	7,46%	5,11%	9,18%	18,67%	39,79%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,82%	7,27%	4,99%	8,96%	18,27%	38,38%	0,20%	2,560%	7,99%
IMA-B	-0,32%	6,55%	4,60%	8,31%	16,59%	36,72%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,34%	6,47%	4,54%	8,25%	16,41%	34,52%	0,20%	1,894%	5,83%

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

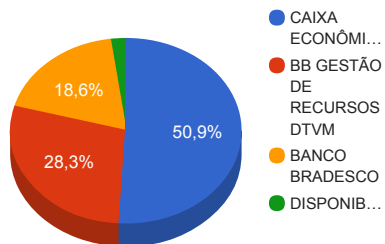
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

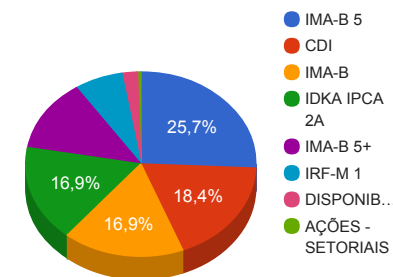
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
SMLL	3,41%	20,05%	7,75%	9,34%	40,53%	27,14%	-	-	-
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	1,33%	11,02%	5,87%	-4,39%	-19,85%	-18,18%	1,72%	4,434%	29,92%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	39.912.486,07	50,88%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	22.228.967,50	28,34%
BANCO BRADESCO	14.583.677,38	18,59%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	1.712.735,96	2,18%



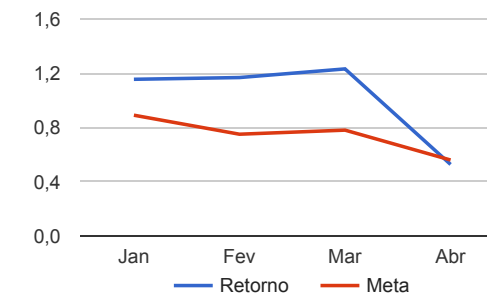
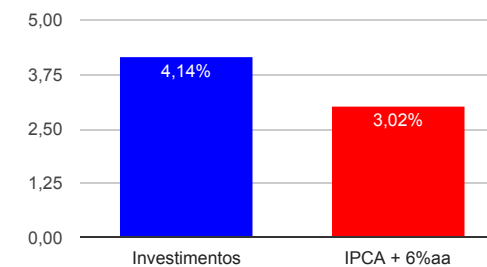
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5	20.172.967,57	25,72%
CDI	14.412.026,28	18,37%
IMA-B	13.241.398,52	16,88%
IDKA IPCA 2A	13.241.349,84	16,88%
IMA-B 5+	9.951.266,05	12,69%
IRF-M 1	5.335.473,57	6,80%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	1.712.735,96	2,18%
AÇÕES - SETORIAIS	370.649,12	0,47%



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%
Março	73.638.767,34	1.551.058,33	795.056,75	75.310.434,50	915.665,58	1,23%	0,78%	156,88%	0,41%
Abril	75.310.434,50	25.076.217,77	24.064.181,87	76.725.130,95	402.660,55	0,53%	0,56%	94,61%	0,93%
Acumulado no ano					2.981.610,35	4,14%	3,02%	137,31%	

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 IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.297.033,35	0,00	0,00	4.333.559,31	36.525,96	0,85%	0,16%	0,85%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.521.570,49	0,00	0,00	1.533.636,29	12.065,80	0,79%	0,02%	0,79%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.689.875,36	0,00	0,00	4.726.585,16	36.709,80	0,78%	0,01%	0,78%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.089.479,20	0,00	0,00	8.151.804,83	62.325,63	0,77%	0,05%	0,77%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.141.156,62	0,00	0,00	13.241.349,84	100.193,22	0,76%	0,48%	0,76%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	4.231.472,55	0,00	0,00	4.261.032,50	29.559,95	0,70%	0,52%	0,70%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.622.660,67	0,00	0,00	5.661.817,00	39.156,33	0,70%	0,52%	0,70%
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	9.321.957,56	861.914,85	0,00	10.250.118,07	66.245,66	0,65%	0,59%	0,66%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	24.029.434,85	973.459,68	24.064.181,87	1.001.914,26	63.201,60	0,25%	0,16%	0,86%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	13.236.401,78	0,00	13.241.398,52	4.996,74	0,04%	1,89%	-0,34%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	10.004.441,46	0,00	9.951.266,05	-53.175,41	-0,53%	2,56%	-0,82%
Total Renda Fixa					397.805,28	0,52%	0,91%	

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(%)
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	365.793,85	0,00	0,00	370.649,12	4.855,27	1,33%	4,43%	1,33%
Total Renda Variável					4.855,27	1,33%	4,43%	