

Relatório Analítico dos Investimentos em maio de 2017

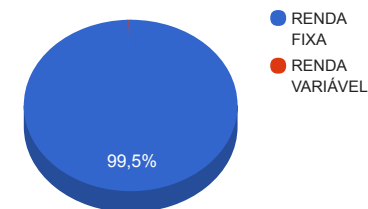
Carteira consolidada de investimentos - base (maio / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			2.237.415,51	2,82%			Artigo 20
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.681.747,74	7,17%	716	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	13.293.260,00	16,76%	716	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	9.784.761,09	12,34%	291	0,60%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	105.345,53	0,13%	181	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	13.083.454,68	16,50%	744	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	452.801,10	0,57%	1.348	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	4.371.757,63	5,51%	191	0,64%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	4.264.945,36	5,38%	334	0,22%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	11.124.295,40	14,03%	77	3,98%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.547.928,82	1,95%	745	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	4.770.179,13	6,02%	761	0,10%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.220.419,46	10,37%	426	0,43%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	D+43	5 anos	360.286,79	0,45%	53	0,37%	Artigo 8º, Inciso III
		TOTAL -	79.298.598,24				

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

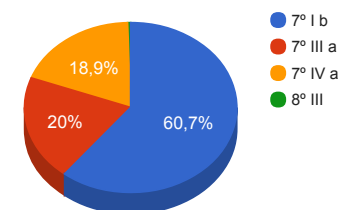
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	46.773.127,77	58,98%	30,00%	35,00%	70,00%	8.735.891,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	15.389.240,76	19,41%	15,00%	20,00%	60,00%	32.189.918,18
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	14.538.527,41	18,33%	5,00%	5,00%	30,00%	9.251.052,06
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	11.894.789,74
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	3.964.929,91
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	3.964.929,91
Total Renda Fixa	100,00%	76.700.895,94	96,72%	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%	360.286,79	0,45%	5,00%	10,00%	15,00%	11.534.502,95
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	3.964.929,91
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	3.964.929,91
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	3.964.929,91
Total Renda Variável	30,00%	360.286,79	0,45%	11,00	25,00	30,00	-

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 7º, Inciso I, Alínea " b "	46.773.127,77	58,98%	30,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	15.389.240,76	19,41%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	14.538.527,41	18,33%	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	76.700.895,94	96,72%	55,00	185,00

Artigos - Renda Variável	Base: maio / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso III	360.286,79	0,45%	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	360.286,79	0,45%	11,00	30,00

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+	1,51%	8,97%	2,02%	8,97%	18,13%	39,00%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,09%	7,21%	1,96%	9,44%	19,17%	36,79%	0,20%	8,320%	6,49%
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%
BRASESCO 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%	-	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,93%	4,84%	2,82%	6,00%	13,27%	29,19%	0,20%	0,030%	0,07%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,92%	4,85%	2,80%	6,04%	13,32%	29,13%	0,20%	0,022%	0,18%
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%
IDKA IPCA 2 Anos	0,79%	6,38%	2,18%	6,38%	12,88%	32,07%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,39%	5,07%	2,58%	6,38%	12,32%	30,95%	0,20%	3,873%	2,93%
IMA-B 5	0,52%	5,47%	1,32%	5,47%	11,91%	30,87%	-	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,09%	4,87%	2,18%	6,30%	12,18%	30,60%	0,20%	4,910%	3,59%
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%
BRASESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	0,04%	5,02%	2,17%	6,52%	12,31%	30,40%	0,20%	5,231%	3,87%
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%

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

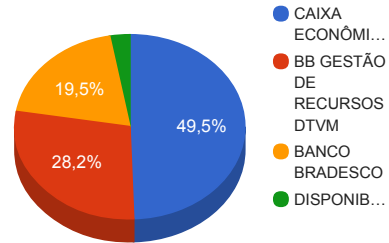
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5+	-0,06%	5,50%	-2,63%	5,50%	14,42%	34,03%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,67%	5,47%	-1,66%	9,38%	17,23%	31,89%	0,20%	16,974%	12,71%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

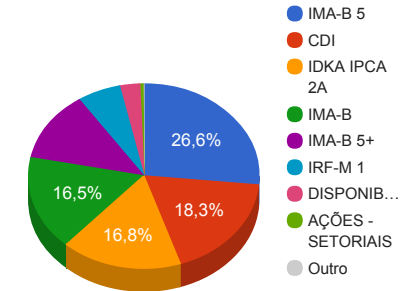
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
SMLL	-1,05%	18,79%	0,61%	22,88%	45,16%	28,88%	-	-	-
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	-2,80%	7,92%	-1,27%	9,30%	5,76%	-17,27%	1,72%	13,771%	17,89%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	39.236.745,21	49,48%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	22.328.384,49	28,16%
BANCO BRADESCO	15.496.053,03	19,54%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	2.237.415,51	2,82%



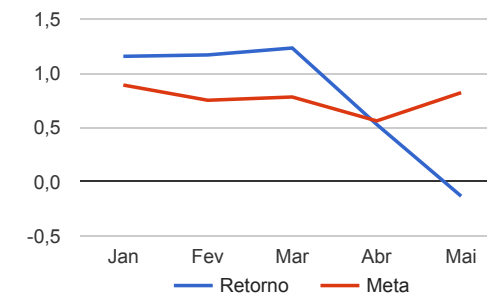
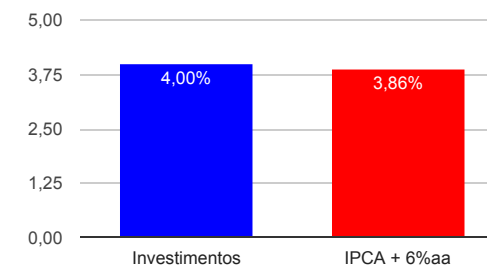
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5	21.070.988,50	26,57%
CDI	14.538.527,41	18,33%
IDKA IPCA 2A	13.293.260,00	16,76%
IMA-B	13.083.454,68	16,50%
IMA-B 5+	9.784.761,09	12,34%
IRF-M 1	4.824.558,73	6,08%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	2.237.415,51	2,82%
AÇÕES - SETORIAIS	360.286,79	0,45%
IRF-M 1+	105.345,53	0,13%



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%
Mai	76.725.130,95	1.831.482,79	1.393.188,80	77.061.182,73	-102.242,21	-0,13%	0,82%	-16,13%	6,63%
Acumulado no ano					2.879.368,14	4,00%	3,86%	103,65%	

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(%)
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.533.636,29	0,00	0,00	1.547.928,82	14.292,53	0,93%	0,03%	0,93%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.726.585,16	0,00	0,00	4.770.179,13	43.593,97	0,92%	0,02%	0,92%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.333.559,31	0,00	0,00	4.371.757,63	38.198,32	0,88%	0,97%	0,88%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.001.914,26	0,00	557.722,49	452.801,10	8.609,33	0,86%	0,96%	0,90%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.151.804,83	0,00	0,00	8.220.419,46	68.614,63	0,84%	0,16%	0,84%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.241.349,84	0,00	0,00	13.293.260,00	51.910,16	0,39%	3,87%	0,39%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	10.250.118,07	859.702,54	0,00	11.124.295,40	14.474,79	0,13%	5,23%	0,04%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	4.261.032,50	0,00	0,00	4.264.945,36	3.912,86	0,09%	4,91%	0,09%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.661.817,00	15.261,75	0,00	5.681.747,74	4.668,99	0,08%	4,89%	0,08%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	13.241.398,52	0,00	0,00	13.083.454,68	-157.943,84	-1,19%	13,31%	-1,19%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	956.518,50	835.466,31	105.345,53	-15.706,66	-1,64%	8,32%	0,09%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.951.266,05	0,00	0,00	9.784.761,09	-166.504,96	-1,67%	16,97%	-1,67%
Total Renda Fixa					-91.879,88	-0,12%	6,59%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	370.649,12	0,00	0,00	360.286,79	-10.362,33	-2,80%	13,77%	-2,80%
Total Renda Variável					-10.362,33	-2,80%	13,77%	