



Relatório Analítico dos Investimentos em junho, 2º Trimestre e 1º semestre de 2017

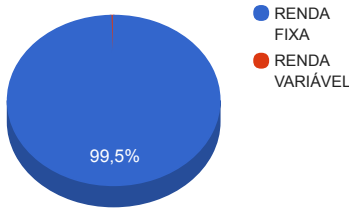
Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			866.325,22	1,07%			Artigo 20
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.710.835,67	7,08%	703	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	13.374.543,97	16,58%	706	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	9.784.024,63	12,13%	293	0,61%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	106.913,90	0,13%	178	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	13.100.903,31	16,24%	740	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.975.724,21	2,45%	1.360	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.273.317,69	6,54%	193	0,75%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	4.286.640,94	5,31%	331	0,23%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	11.177.723,18	13,86%	77	3,99%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.560.690,09	1,93%	757	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	4.809.100,19	5,96%	774	0,10%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.287.213,39	10,27%	432	0,42%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	D+43	5 anos	361.389,28	0,45%	53	0,37%	Artigo 8º, Inciso III
		TOTAL -	80.675.345,67				

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

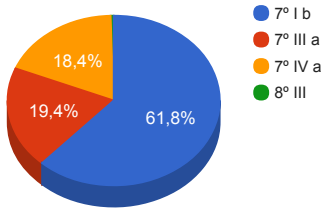
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	49.326.263,38	61,14%	30,00%	35,00%	70,00%	7.146.478,59
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	15.464.364,12	19,17%	15,00%	20,00%	60,00%	32.940.843,28
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	14.657.003,67	18,17%	5,00%	5,00%	30,00%	9.545.600,03
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	12.101.301,85
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	4.033.767,28
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	4.033.767,28
Total Renda Fixa	100,00%	79.447.631,17	98,48%	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%	361.389,28	0,45%	5,00%	10,00%	15,00%	11.739.912,57
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	4.033.767,28
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	4.033.767,28
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	4.033.767,28
Total Renda Variável	30,00%	361.389,28	0,45%	11,00	25,00	30,00	-

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: junho / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	49.326.263,38	61,14%	30,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	15.464.364,12	19,17%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	14.657.003,67	18,17%	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	79.447.631,17	98,48%	55,00	185,00

Artigos - Renda Variável	Base: junho / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso III	361.389,28	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	361.389,28	0,45%	11,00	30,00

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (junho / 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	1,49%	8,81%	1,92%	8,81%	17,98%	38,93%	0,20%	1,814%	6,47%

IRF-M 1	0,89%	6,25%	2,69%	6,25%	13,46%	30,44%	-	-	-
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,90%	6,14%	2,65%	6,14%	13,22%	29,91%	0,20%	0,184%	0,67%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,87%	6,15%	2,65%	6,15%	13,27%	30,05%	0,20%	0,178%	0,66%

CDI	0,81%	5,65%	2,54%	5,65%	12,85%	28,75%	-	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,82%	5,70%	2,57%	5,70%	12,90%	28,87%	0,20%	0,015%	0,09%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,81%	5,71%	2,54%	5,71%	13,04%	28,78%	0,20%	0,026%	0,09%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,81%	5,61%	2,44%	5,61%	12,72%	28,40%	0,20%	0,007%	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	0,61%	5,71%	1,78%	5,71%	12,09%	30,65%	0,20%	0,756%	2,89%

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	0,51%	5,40%	1,30%	5,40%	11,73%	30,08%	0,20%	0,925%	3,57%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,51%	5,41%	1,30%	5,41%	11,74%	30,22%	0,20%	0,929%	3,58%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	0,48%	5,52%	1,19%	5,52%	11,86%	30,02%	0,20%	1,009%	3,86%

IMA-B	0,16%	5,46%	-1,34%	5,46%	13,32%	32,28%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,15%	5,36%	-1,38%	5,36%	13,17%	30,39%	0,20%	2,446%	9,80%

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

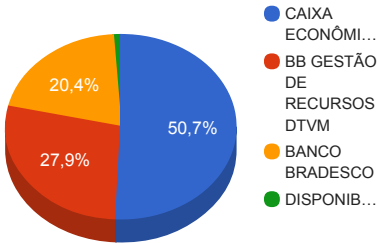
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5+	-0,06%	5,50%	-2,63%	5,50%	14,42%	34,03%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,07%	5,40%	-2,55%	5,40%	14,20%	32,72%	0,20%	3,268%	12,71%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

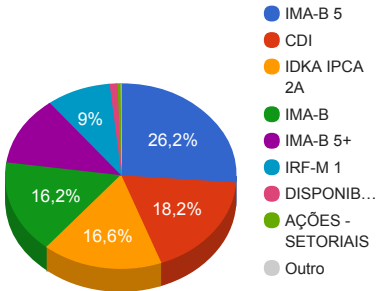
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
SMLL	0,38%	19,24%	2,71%	19,24%	33,53%	30,90%	-	-	-
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	0,31%	8,25%	-1,20%	8,25%	2,67%	-13,93%	1,72%	3,267%	17,61%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	40.887.694,48	50,68%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	22.470.285,10	27,85%
BANCO BRADESCO	16.451.040,87	20,39%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	866.325,22	1,07%

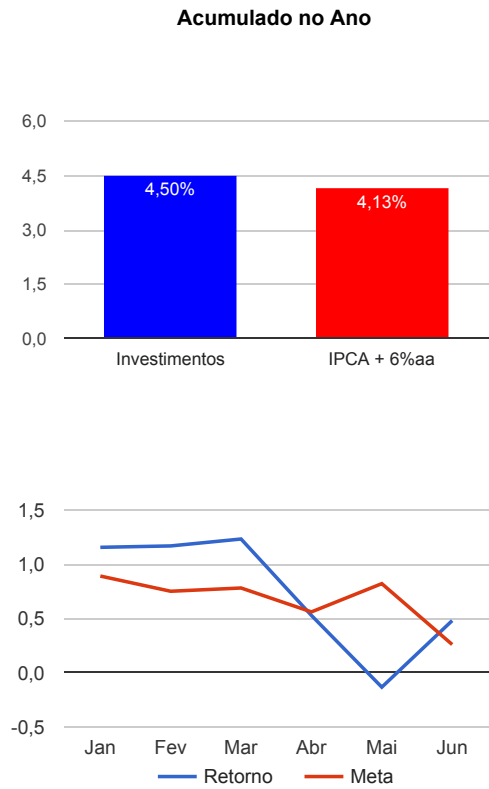


Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5	21.175.199,79	26,25%
CDI	14.657.003,67	18,17%
IDKA IPCA 2A	13.374.543,97	16,58%
IMA-B	13.100.903,31	16,24%
IMA-B 5+	9.784.024,63	12,13%
IRF-M 1	7.249.041,90	8,99%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	866.325,22	1,07%
AÇÕES - SETORIAIS	361.389,28	0,45%
IRF-M 1+	106.913,90	0,13%



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%
Junho	77.061.182,73	3.793.819,89	1.427.122,59	79.809.020,45	381.140,42	0,48%	0,26%	187,71%	1,22%
Acumulado no ano					3.260.508,56	4,50%	4,13%	109,07%	



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de junho / 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 LP	105.345,53	0,00	0,00	106.913,90	1.568,37	1,49%	1,81%	1,49%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.371.757,63	855.009,77	0,00	5.273.317,69	46.550,29	0,89%	0,18%	0,90%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.547.928,82	0,00	0,00	1.560.690,09	12.761,27	0,82%	0,02%	0,82%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.770.179,13	100,00	0,00	4.809.100,19	38.821,06	0,81%	0,03%	0,81%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.220.419,46	0,00	0,00	8.287.213,39	66.793,93	0,81%	0,01%	0,81%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.293.260,00	0,00	0,00	13.374.543,97	81.283,97	0,61%	0,76%	0,61%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.681.747,74	0,00	0,00	5.710.835,67	29.087,93	0,51%	0,93%	0,51%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	4.264.945,36	0,00	0,00	4.286.640,94	21.695,58	0,51%	0,93%	0,51%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	11.124.295,40	0,00	0,00	11.177.723,18	53.427,78	0,48%	1,01%	0,48%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	452.801,10	2.932.458,88	1.425.000,00	1.975.724,21	15.464,23	0,46%	0,18%	0,87%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	13.083.454,68	0,00	2.122,59	13.100.903,31	19.571,22	0,15%	2,45%	0,15%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.784.761,09	6.251,24	0,00	9.784.024,63	-6.987,70	-0,07%	3,27%	-0,07%
Total Renda Fixa					380.037,93	0,48%	1,21%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	360.286,79	0,00	0,00	361.389,28	1.102,49	0,31%	3,27%	0,31%
Total Renda Variável					1.102,49	0,31%	3,27%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre / 2017

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.141.156,62	0,00	0,00	13.374.543,97	233.387,35	1,78%	1,78%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.089.479,20	0,00	0,00	8.287.213,39	197.734,19	2,44%	2,44%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	9.321.957,56	1.721.617,39	0,00	11.177.723,18	134.148,23	1,27%	1,19%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.297.033,35	855.009,77	0,00	5.273.317,69	121.274,57	2,65%	2,65%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.689.875,36	100,00	0,00	4.809.100,19	119.124,83	2,54%	2,54%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	24.029.434,85	3.905.918,56	26.046.904,36	1.975.724,21	87.275,16	1,58%	2,65%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.622.660,67	15.261,75	0,00	5.710.835,67	72.913,25	1,30%	1,30%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	4.231.472,55	0,00	0,00	4.286.640,94	55.168,39	1,30%	1,30%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.521.570,49	0,00	0,00	1.560.690,09	39.119,60	2,57%	2,57%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	956.518,50	835.466,31	106.913,90	-14.138,29	-0,18%	1,92%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	13.236.401,78	2.122,59	13.100.903,31	-133.375,88	-1,01%	-1,38%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	10.010.692,70	0,00	9.784.024,63	-226.668,07	-2,27%	-2,55%
Total Renda Fixa					685.963,33	0,89%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre / 2017

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	365.793,85	0,00	0,00	361.389,28	-4.404,57	-1,20%	-1,20%
Total Renda Variável					-4.404,57	-1,20%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre / 2017

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	22.433.014,78	6.066.899,31	27.398.477,07	1.975.724,21	874.287,19	4,98%	6,15%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12.652.041,81	0,00	0,00	13.374.543,97	722.502,16	5,71%	5,71%
BRABESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	5.680.078,27	5.044.859,74	0,00	11.177.723,18	452.785,17	5,17%	5,52%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.848.357,34	0,00	1.056,75	8.287.213,39	439.912,80	5,61%	5,61%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.404.036,42	15.261,75	0,00	5.710.835,67	291.537,50	5,39%	5,40%
BRABESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.155.835,14	855.009,77	0,00	5.273.317,69	262.472,78	6,13%	6,14%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.549.427,50	100,00	0,00	4.809.100,19	259.572,69	5,71%	5,71%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	4.066.770,56	0,00	0,00	4.286.640,94	219.870,38	5,41%	5,41%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.476.485,64	0,00	0,00	1.560.690,09	84.204,45	5,70%	5,70%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	956.518,50	835.466,31	106.913,90	-14.138,29	-0,18%	8,81%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	13.236.401,78	2.122,59	13.100.903,31	-133.375,88	-1,01%	5,36%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	10.010.692,70	0,00	9.784.024,63	-226.668,07	-2,27%	5,40%
Total Renda Fixa					3.232.962,88	4,48%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre / 2017

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	333.843,60	0,00	0,00	361.389,28	27.545,68	8,25%	8,25%
Total Renda Variável					27.545,68	8,25%	