

Relatório Analítico dos Investimentos em janeiro de 2017

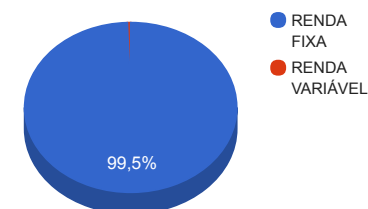
Carteira consolidada de investimentos - base (janeiro / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			1.024.325,67	1,42%			Artigo 20
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	22.974.228,03	31,76%	1.347	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	12.789.087,24	17,68%	728	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	4.207.771,54	5,82%	193	0,64%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.465.511,16	7,56%	714	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	7.380.897,74	10,20%	70	2,66%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	4.113.046,11	5,69%	322	0,20%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.492.348,37	2,06%	770	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.934.844,25	10,97%	439	0,39%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	4.599.373,62	6,36%	786	0,09%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	D+43	5 anos	350.083,67	0,48%	58	0,33%	Artigo 8º, Inciso III
		TOTAL -	72.331.517,40				

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

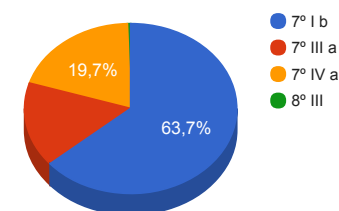
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	45.436.597,97	62,82%	30,00%	35,00%	70,00%	5.195.464,21
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	11.493.943,85	15,89%	15,00%	20,00%	60,00%	31.904.966,59
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	14.026.566,24	19,39%	5,00%	5,00%	30,00%	7.672.888,98
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	10.849.727,61
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	3.616.575,87
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	3.616.575,87
Total Renda Fixa	100,00%	70.957.108,06	98,10%	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%	350.083,67	0,48%	5,00%	10,00%	15,00%	10.499.643,94
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	3.616.575,87
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	3.616.575,87
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	3.616.575,87
Total Renda Variável	30,00%	350.083,67	0,48%	11,00	25,00	30,00	-

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: janeiro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	45.436.597,97	62,82%	30,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	11.493.943,85	15,89%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	14.026.566,24	19,39%	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	70.957.108,06	98,10%	55,00	185,00

Artigos - Renda Variável	Base: janeiro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso III	350.083,67	0,48%	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	350.083,67	0,48%	11,00	30,00

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

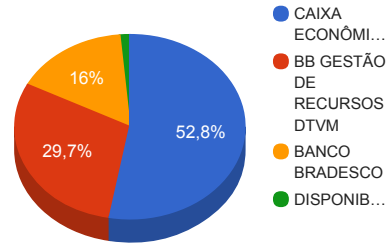
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M 1	1,29%	1,29%	3,58%	7,06%	14,32%	29,93%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,26%	1,26%	3,50%	6,95%	14,17%	29,47%	0,20%	0,288%	0,31%
BRASESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,25%	1,25%	3,48%	6,93%	14,08%	29,39%	0,20%	0,297%	0,32%
IMA-B 5	1,16%	1,16%	2,97%	6,05%	13,45%	32,16%	-	-	-
BRASESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	1,17%	1,17%	2,94%	6,02%	13,31%	30,99%	0,20%	1,335%	2,68%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,14%	1,14%	2,91%	5,97%	13,25%	31,31%	0,20%	1,255%	2,49%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,14%	1,14%	2,92%	5,95%	13,21%	31,19%	0,20%	1,254%	2,49%
IDKA IPCA 2 Anos	1,09%	1,09%	2,97%	6,30%	12,25%	32,94%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,08%	1,08%	2,89%	6,06%	12,74%	31,45%	0,20%	1,089%	2,32%
CDI	1,08%	1,08%	3,28%	6,80%	14,03%	29,29%	-	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,10%	1,10%	3,27%	6,75%	13,98%	28,81%	0,20%	0,052%	0,09%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,10%	1,10%	3,32%	6,91%	13,93%	29,41%	0,20%	0,020%	0,17%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,07%	1,07%	3,27%	6,77%	14,03%	29,36%	0,20%	0,035%	0,05%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

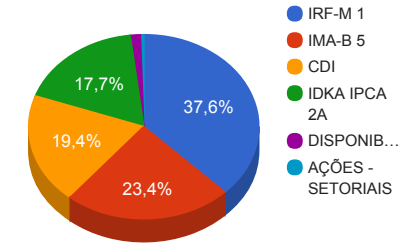
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
SMLL	11,42%	11,42%	1,47%	8,88%	60,49%	29,60%	-	-	-
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	4,86%	4,86%	-9,70%	-7,17%	-14,89%	-18,94%	1,72%	5,340%	29,99%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	38.217.015,48	52,84%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	21.501.506,97	29,73%
BANCO BRADESCO	11.588.669,28	16,02%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	1.024.325,67	1,42%



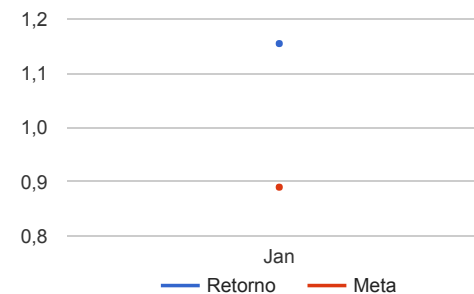
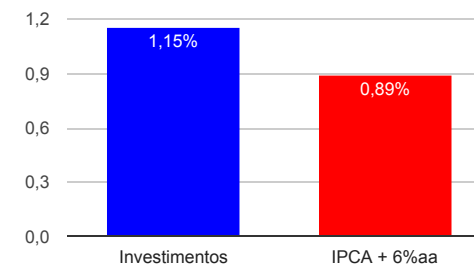
Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	27.181.999,57	37,58%
IMA-B 5	16.959.455,01	23,45%
CDI	14.026.566,24	19,39%
IDKA IPCA 2A	12.789.087,24	17,68%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	1.024.325,67	1,42%
AÇÕES - SETORIAIS	350.083,67	0,48%



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%
Acumulado no ano					813.721,85	1,15%	0,89%	129,42%	

Acumulado no Ano



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de janeiro / 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	4.155.835,14	0,00	0,00	4.207.771,54	51.936,40	1,25%	0,30%	1,25%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	22.433.014,78	454.567,90	197.572,71	22.974.228,03	284.218,06	1,24%	0,29%	1,26%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	4.066.770,56	0,00	0,00	4.113.046,11	46.275,55	1,14%	1,26%	1,14%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.404.036,42	0,00	0,00	5.465.511,16	61.474,74	1,14%	1,25%	1,14%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.848.357,34	0,00	0,00	7.934.844,25	86.486,91	1,10%	0,05%	1,10%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.549.427,50	0,00	0,00	4.599.373,62	49.946,12	1,10%	0,02%	1,10%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12.652.041,81	0,00	0,00	12.789.087,24	137.045,43	1,08%	1,09%	1,08%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.476.485,64	0,00	0,00	1.492.348,37	15.862,73	1,07%	0,03%	1,07%
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	5.680.078,27	1.636.583,63	0,00	7.380.897,74	64.235,84	0,88%	1,34%	1,17%
Total Renda Fixa					797.481,78	1,14%	0,62%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	333.843,60	0,00	0,00	350.083,67	16.240,07	4,86%	5,34%	4,86%
Total Renda Variável					16.240,07	4,86%	5,34%	