

# Relatório Analítico dos Investimentos em fevereiro de 2017



Carteira consolidada de investimentos - base (fevereiro / 2017)

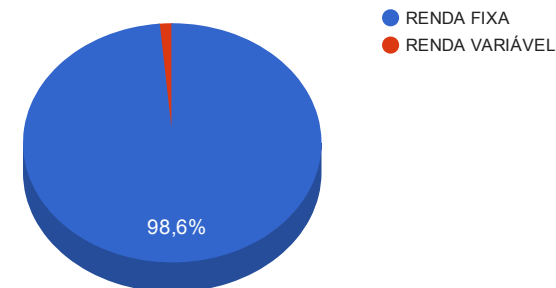
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
TÍTULOS PÚBLICOS			4.518.741,74	11,33%			Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.147.401,31	2,88%	31	1,69%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.848.395,74	9,65%	611	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	457.190,62	1,15%	248	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	3.992.488,76	10,01%	282	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	157.457,51	0,39%	203	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.994.321,84	10,01%	712	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.743.855,13	21,92%	746	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.519.397,26	3,81%	624	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	243.495,25	0,61%	1.177	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.366.173,93	8,44%	1.341	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	128.821,98	0,32%	193	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	141.077,92	0,35%	84	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	108.527,85	0,27%	53	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	2.852.765,86	7,15%	411	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.526.658,10	3,83%	764	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	D+3	Não há	2.575.372,27	6,46%	360	1,28%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER PETROBRÁS PLUS FIC AÇÕES	D+4	Não há	566.887,73	1,42%	1.870	1,53%	Artigo 8º, Inciso III
		<b>TOTAL -</b>	<b>39.889.030,80</b>				

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

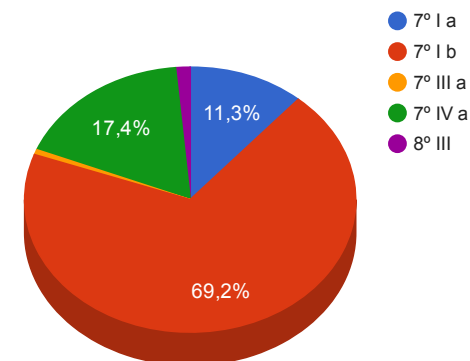
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	4.518.741,74	11,33%	0,00%	12,00%	12,00%	267.941,96
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	27.598.999,33	69,19%	30,00%	3,00%	78,00%	3.514.444,69
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	249.605,77	0,63%	15,00%	20,00%	60,00%	23.683.812,71
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	6.954.796,23	17,44%	5,00%	5,00%	30,00%	5.011.913,01
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	5.983.354,62
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>39.322.143,07</b>	<b>98,58%</b>	<b>55,00</b>	<b>50,00</b>	<b>205,00</b>	<b>-</b>

Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	566.887,73	1,42%	5,00%	10,00%	15,00%	5.416.466,89
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	1.994.451,54
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>566.887,73</b>	<b>1,42%</b>	<b>7,00</b>	<b>15,00</b>	<b>20,00</b>	<b>-</b>
Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	

Distribuição por Segmento



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 " a "	4.518.741,74	11,33%	0,00%	12,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	27.598.999,33	69,19%	30,00%	78,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	249.605,77	0,63%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	6.954.796,23	17,44%	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%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>39.322.143,07</b>	<b>98,58%</b>	<b>55,00</b>	<b>205,00</b>

Artigos - Renda Variável	Base: fevereiro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso III	566.887,73	1,42%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>566.887,73</b>	<b>1,42%</b>	<b>7,00</b>	<b>20,00</b>

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+	5,06%	7,41%	11,40%	11,75%	35,35%	43,21%	-	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4,99%	7,26%	11,25%	11,47%	35,16%	42,32%	0,20%	2,464%	10,46%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4,97%	7,26%	11,23%	11,54%	34,89%	41,79%	0,20%	2,447%	10,42%
IMA-B	3,85%	5,79%	8,86%	9,92%	26,69%	38,66%	-	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,85%	5,76%	8,82%	9,81%	26,50%	37,94%	0,20%	1,855%	7,39%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,83%	5,74%	8,78%	9,92%	26,54%	36,41%	0,20%	1,859%	7,37%
IMA Geral	2,26%	4,11%	6,07%	8,66%	21,43%	34,20%	-	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	2,42%	4,38%	6,47%	9,28%	22,36%	34,81%	0,25%	1,010%	3,91%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,24%	4,03%	6,02%	8,81%	21,40%	33,51%	0,20%	0,910%	3,63%
IMA-B 5	1,49%	2,67%	4,10%	6,47%	13,40%	32,51%	-	-	-
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%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,29%	2,37%	3,63%	6,06%	12,84%	31,83%	0,20%	0,596%	2,15%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,97%	1,99%	3,13%	5,65%	12,31%	-	0,20%	0,424%	1,21%
IRF-M 1	1,01%	2,31%	3,53%	6,86%	14,23%	30,27%	-	-	-
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1,03%	2,28%	3,46%	6,68%	13,88%	29,36%	0,40%	0,123%	0,35%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1,01%	2,27%	3,47%	6,77%	14,07%	29,93%	0,20%	0,076%	0,30%

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
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%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,99%	2,26%	3,45%	6,72%	13,95%	29,58%	0,10%	0,083%	0,31%
Selic	0,87%	1,96%	3,11%	6,44%	13,90%	29,39%	-	-	-
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,87%	1,98%	3,12%	6,65%	14,17%	29,75%	0,20%	0,006%	0,05%
CDI	0,86%	1,96%	3,10%	6,43%	13,88%	29,35%	-	-	-
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%
IPCA + 6,00% ao ano	0,75%	1,65%	2,47%	4,47%	11,04%	29,84%	-	-	-
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	1,52%	2,84%	4,28%	7,05%	14,88%	30,53%	0,30%	0,645%	2,29%

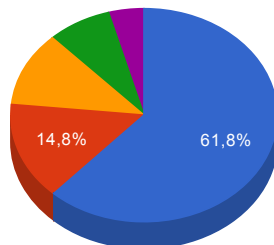
Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (fevereiro / 2017)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
PETROBRAS ON - PETR3	-1,42%	-5,79%	-13,59%	8,28%	117,14%	68,35%	-	-	-
SANTANDER PETROBRÁS PLUS FIC AÇÕES	-1,64%	-6,26%	-14,26%	6,61%	110,88%	62,43%	3,00%	14,174%	51,91%

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

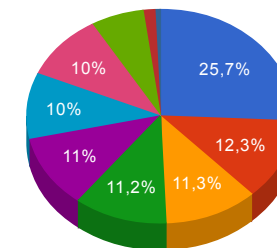
Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	24.669.425,14	61,85%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	5.884.203,25	14,75%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	4.518.741,74	11,33%
BANCO BRADESCO	3.102.371,63	7,78%
BANCO SANTANDER	1.714.289,04	4,30%

- CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
- BB GESTÃO DE RECURSO...
- TESOURO NACIONAL (TÍTULOS P...
- BANCO BRADESCO
- BANCO SANTANDER



Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	10.263.252,39	25,73%
IRF-M 1	4.898.148,41	12,28%
TÍTULOS PÚBLICOS	4.518.741,74	11,33%
IMA-B 5+	4.449.679,38	11,16%
CDI	4.379.423,96	10,98%
IMA-B 5	3.994.321,84	10,01%
IDKA IPCA 2A	3.977.217,72	9,97%
GESTÃO LIVRE	2.575.372,27	6,46%
AÇÕES - SETORIAIS	566.887,73	1,42%
IMA-GERAL	265.985,36	0,67%

- IMA-B
- IRF-M 1
- TÍTULOS PÚBLICOS
- IMA-B 5+
- CDI
- IMA-B 5
- IDKA IPCA 2A
- GESTÃO LIVRE
- AÇÕES - SETORIAIS
- IMA-GERAL





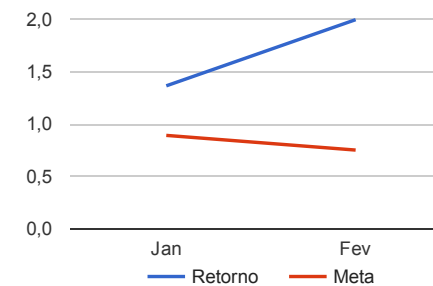
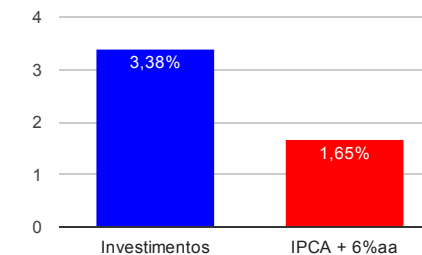
Carteira de Títulos Públicos - base (fevereiro / 2017)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde.	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	GAP (Atual - Pago)
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	11/08/2004	500	1.487,344824	3.109,635985	743.672,41	1.554.817,99	811.145,58
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	02/12/2004	270	1.494,58526	3.109,635985	403.538,02	839.601,72	436.063,70
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	02/03/2009	630	1.104,73659	3.371,939734	695.984,05	2.124.322,03	1.428.337,98

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	37.398.030,63	1.166.609,68	0,00	39.090.022,41	525.382,10	1,36%	0,89%	153,07%	1,68%
Fevereiro	39.090.022,41	5.260.453,24	5.240.904,84	39.889.030,80	779.459,99	1,99%	0,75%	265,74%	1,29%
Acumulado no ano					1.304.842,09	3,38%	1,65%	205,41%	

**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(%)
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.421.586,43	0,00	0,00	8.743.855,13	322.268,70	3,83%	1,86%	3,83%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.393.875,26	71.299,71	0,00	1.519.397,26	54.222,29	3,70%	1,85%	3,85%
TÍTULOS PÚBLICOS	4.378.373,48	0,00	0,00	4.518.741,74	140.368,26	3,21%	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	105.960,86	0,00	0,00	108.527,85	2.566,99	2,42%	1,01%	2,42%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	154.011,06	0,00	0,00	157.457,51	3.446,45	2,24%	0,91%	2,24%
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	2.536.932,41	0,00	0,00	2.575.372,27	38.439,86	1,52%	0,64%	1,52%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.387.134,16	0,00	457.190,62	3.994.321,84	64.378,30	1,47%	0,72%	1,48%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.799.302,75	0,00	0,00	3.848.395,74	49.092,99	1,29%	0,60%	1,29%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1.135.676,73	0,00	0,00	1.147.401,31	11.724,58	1,03%	0,12%	1,03%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	139.670,28	0,00	0,00	141.077,92	1.407,64	1,01%	0,08%	1,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	131.277,49	0,00	3.714,22	128.821,98	1.258,71	0,96%	0,42%	0,97%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.203.584,20	0,00	4.000.000,00	243.495,25	39.911,05	0,95%	0,08%	0,99%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.513.334,62	0,00	0,00	1.526.658,10	13.323,48	0,88%	0,04%	0,88%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.828.082,33	0,00	0,00	2.852.765,86	24.683,53	0,87%	0,01%	0,87%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.384.895,57	731.962,91	780.000,00	3.366.173,93	29.315,45	0,71%	0,08%	0,99%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	457.190,62	0,00	457.190,62	0,00	0,00%	2,45%	4,97%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	4.000.000,00	0,00	3.992.488,76	-7.511,24	-0,19%	2,46%	4,99%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>788.897,04</b>	<b>2,05%</b>	<b>1,08%</b>	

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(%)
SANTANDER PETROBRÁS PLUS FIC AÇÕES	576.324,78	0,00	0,00	566.887,73	-9.437,05	-1,64%	14,17%	-1,64%
				Total Renda Variável	-9.437,05	-1,64%	14,17%	