

Relatório Analítico dos Investimentos em março e 1º Trimestre de 2017



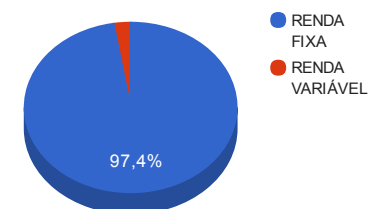
Carteira consolidada de investimentos - base (março / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	980.563,44	12,18%	609	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	36.070,59	0,45%	1.170	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.585.686,86	32,11%	1.342	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	181.606,94	2,26%	207	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	612.556,27	7,61%	719	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	360.217,36	4,47%	171	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	1.168.303,30	14,51%	327	0,06%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	911.712,52	11,32%	119	0,27%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	D+3	Não há	963.516,21	11,96%	367	0,46%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	46.369,14	0,58%	193	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	206.751,52	2,57%	1.316	0,62%	Artigo 8º, Inciso IV
		TOTAL -	8.053.354,15				

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

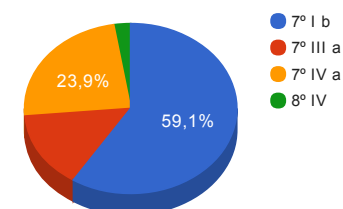
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	4.756.701,46	59,06%	30,00%	50,00%	75,00%	1.283.314,15
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	1.168.303,30	14,51%	15,00%	30,00%	60,00%	3.663.709,19
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	1.921.597,87	23,86%	5,00%	7,50%	30,00%	494.408,38
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	402.667,71
Total Renda Fixa	100,00%	7.846.602,63	97,43%	50,00	90,00	170,00	-

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	15,00%	1.208.003,12
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	206.751,52	2,57%	0,00%	5,00%	5,00%	195.916,19
Total Renda Variável	30,00%	206.751,52	2,57%	0,00	10,00	20,00	-

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: março / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	4.756.701,46	59,06%	30,00%	75,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	1.168.303,30	14,51%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	1.921.597,87	23,86%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	7.846.602,63	97,43%	50,00	170,00

Artigos - Renda Variável	Base: março / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	206.751,52	2,57%	0,00%	5,00%
Total Renda Variável	206.751,52	2,57%	0,00	20,00

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

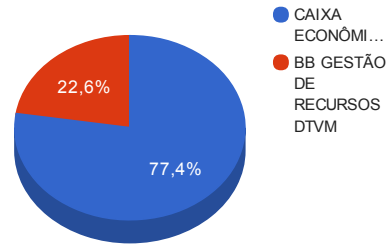
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M 1+	1,63%	6,81%	6,81%	10,56%	24,40%	40,68%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,52%	6,76%	6,76%	10,50%	24,42%	40,58%	0,20%	1,750%	4,66%
IDKA IPCA 2 Anos	1,62%	4,11%	4,11%	6,49%	14,06%	33,81%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,42%	3,82%	3,82%	6,15%	13,74%	32,33%	0,20%	0,660%	1,88%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,41%	3,87%	3,87%	6,17%	13,72%	32,21%	0,20%	0,680%	1,94%
IMA-B 5	1,39%	4,09%	4,09%	6,45%	14,11%	32,99%	-	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,38%	4,05%	4,05%	6,34%	13,92%	32,29%	0,20%	0,760%	2,16%
IMA Geral	1,22%	5,37%	5,37%	8,32%	18,84%	35,77%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,19%	5,27%	5,27%	8,39%	18,87%	35,01%	0,20%	1,130%	3,14%
IRF-M 1	1,12%	3,46%	3,46%	6,79%	14,08%	30,52%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,11%	3,41%	3,41%	6,70%	13,92%	30,12%	0,20%	0,130%	0,29%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,10%	3,39%	3,39%	6,65%	13,82%	29,85%	0,10%	0,130%	0,30%
CDI	1,05%	3,03%	3,03%	6,37%	13,75%	29,37%	-	-	-
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,05%	3,08%	3,08%	6,38%	13,72%	28,93%	0,20%	0,060%	0,08%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,97%	2,82%	2,82%	5,94%	12,81%	27,23%	0,80%	0,000%	0,04%
IPCA + 6,00% ao ano	0,78%	2,44%	2,44%	4,69%	10,87%	28,50%	-	-	-
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	1,31%	4,19%	4,19%	7,01%	14,98%	30,93%	0,30%	0,700%	2,05%

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

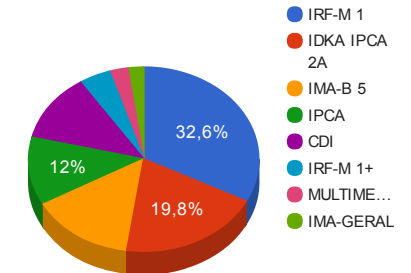
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	1,05%	3,03%	3,03%	6,37%	13,75%	29,37%	-	-	-
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	0,37%	4,27%	4,27%	7,56%	17,50%	-	1,00%	2,440%	6,10%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	6.236.423,99	77,44%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	1.816.930,16	22,56%



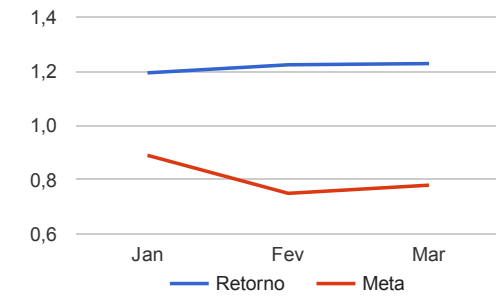
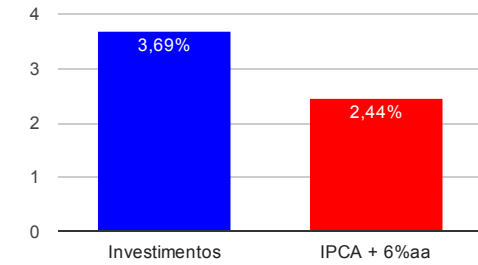
Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	2.621.757,45	32,55%
IDKA IPCA 2A	1.593.119,71	19,78%
IMA-B 5	1.168.303,30	14,51%
IPCA	963.516,21	11,96%
CDI	958.081,66	11,90%
IRF-M 1+	360.217,36	4,47%
MULTIMERCADO	206.751,52	2,57%
IMA-GERAL	181.606,94	2,26%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	7.238.944,76	668.654,72	437.235,69	7.559.525,48	89.161,69	1,19%	0,89%	134,11%	0,70%
Fevereiro	7.559.525,48	805.474,43	666.874,48	7.792.287,39	94.161,96	1,22%	0,75%	163,09%	0,43%
Março	7.792.287,39	849.339,62	685.939,45	8.053.354,15	97.666,59	1,23%	0,78%	156,47%	0,54%
Acumulado no ano					280.990,24	3,69%	2,44%	150,92%	

Acumulado no Ano



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de março / 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	354.823,35	0,00	0,00	360.217,36	5.394,01	1,52%	1,75%	1,52%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	966.841,39	0,00	0,00	980.563,44	13.722,05	1,42%	0,66%	1,42%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	604.050,15	0,00	0,00	612.556,27	8.506,12	1,41%	0,68%	1,41%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.114.019,55	38.551,55	0,00	1.168.303,30	15.732,20	1,36%	0,76%	1,38%
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	951.072,17	0,00	0,00	963.516,21	12.444,04	1,31%	0,70%	1,31%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	174.589,86	4.942,35	0,00	181.606,94	2.074,73	1,16%	1,13%	1,19%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.557.192,96	0,00	0,00	2.585.686,86	28.493,90	1,11%	0,13%	1,11%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	35.677,80	0,00	0,00	36.070,59	392,79	1,10%	0,13%	1,10%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	902.218,90	0,00	0,00	911.712,52	9.493,62	1,05%	0,06%	1,05%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	25.764,31	629.110,18	609.387,90	46.369,14	882,55	0,13%	0,00%	0,97%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	76.519,47	76.551,55	0,00	32,08	0,04%	0,00%	0,97%
Total Renda Fixa					97.168,09	1,25%	0,49%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	106.036,95	100.216,07	0,00	206.751,52	498,50	0,24%	2,44%	0,37%
				Total Renda Variável	498,50	0,24%	2,44%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre / 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	3.323.759,23	0,00	835.000,00	2.585.686,86	96.927,63	3,29%	3,41%
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	790.755,98	134.340,93	0,00	963.516,21	38.419,30	4,15%	4,19%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	847.483,39	98.059,58	0,00	980.563,44	35.020,47	3,70%	3,82%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	570.879,61	563.996,57	0,00	1.168.303,30	33.427,12	3,56%	4,05%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	884.430,18	0,00	0,00	911.712,52	27.282,34	3,08%	3,08%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	589.756,88	0,00	0,00	612.556,27	22.799,39	3,87%	3,87%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	345.112,12	0,00	360.217,36	15.105,24	4,39%	6,76%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	167.822,60	4.942,35	0,00	181.606,94	8.841,99	5,23%	5,27%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	29.167,38	868.686,13	853.053,05	46.369,14	1.568,68	0,61%	2,82%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	34.889,51	0,00	0,00	36.070,59	1.181,08	3,39%	3,39%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	101.941,73	101.996,57	0,00	54,84	0,13%	2,82%
Total Renda Fixa					280.628,08	3,74%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	0,00	206.389,36	0,00	206.751,52	362,16	0,11%	4,27%
Total Renda Variável					362,16		

Microsoft
 VBScript runtime
 error '800a000d'
 Type mismatch:
 'FormatNumber'
 /plataforma/relatorios/uRetornoTriRV.asp,
 line 143