

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
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.968.883,44	3,66%	1.347	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	5.111.651,69	4,71%	604	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.978.746,66	4,59%	714	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	10.225.646,42	9,43%	216	1,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	6.063.440,65	5,59%	364	0,45%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	1.680.349,11	1,55%	193	0,48%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	8.990.670,27	8,29%	728	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.371.542,80	5,88%	619	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	4.147.733,21	3,82%	244	0,35%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	13.817.859,86	12,74%	91	0,92%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	12.699.238,70	11,71%	327	0,53%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	3.542.741,38	3,27%	322	0,17%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	6.640.519,65	6,12%	84	0,72%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.503,88	0,00%	596	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	8.980.007,67	8,28%	116	1,81%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	2.060.953,49	1,90%	410	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2030	5.166.928,89	4,76%			Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.999.915,51	3,69%	786	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
		TOTAL -	108.448.333,28				

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

Sem Política de Investimento cadastrada

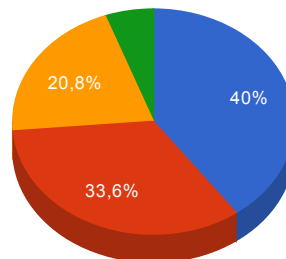
Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (janeiro / 2017)

Dados atualizados dos Benchmark's dos Fundos, referente à base (janeiro / 2017) ainda não disponíveis.

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

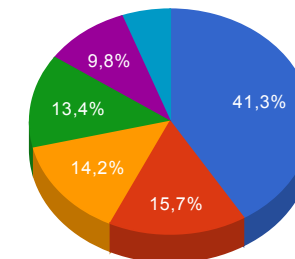
Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	43.410.986,91	40,03%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	36.454.572,72	33,61%
BANCO BRADESCO	22.519.333,00	20,77%
BANCO SANTANDER	6.063.440,65	5,59%

- CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
- BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM
- BANCO BRADESCO
- BANCO SANTANDER



Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	44.756.491,13	41,27%
IDKA IPCA 2A	17.042.562,18	15,71%
IMA-B 5+	15.392.575,31	14,19%
IMA-B 5	14.584.928,69	13,45%
IRF-M 1	10.609.403,09	9,78%
CDI	6.062.372,88	5,59%

- IMA-B
- IDKA IPCA 2A
- IMA-B 5+
- IMA-B 5
- IRF-M 1
- CDI



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Sem Meta Atuarial cadastrada

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(%)
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	10.000.000,00	0,00	10.225.646,42	225.646,42	2,26%	4,41%	2,18%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	13.556.909,10	0,00	0,00	13.817.859,86	260.950,76	1,92%	3,41%	1,92%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.070.758,57	0,00	0,00	4.147.733,21	76.974,64	1,89%	3,34%	1,89%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	12.463.899,65	0,00	0,00	12.699.238,70	235.339,05	1,89%	3,19%	1,89%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.485.202,34	0,00	571.202,04	3.968.883,44	54.883,14	1,22%	0,29%	1,26%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	5.750.923,51	1.393.494,25	587.800,31	6.640.519,65	83.902,20	1,17%	0,30%	1,25%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	5.995.086,06	0,00	0,00	6.063.440,65	68.354,59	1,14%	1,26%	1,14%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.502.882,29	0,00	0,00	3.542.741,38	39.859,09	1,14%	1,26%	1,14%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.922.746,92	0,00	0,00	4.978.746,66	55.999,74	1,14%	1,25%	1,14%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.956.479,10	0,00	0,00	3.999.915,51	43.436,41	1,10%	0,02%	1,10%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.038.657,64	0,00	0,00	2.060.953,49	22.295,85	1,09%	0,01%	1,09%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.894.327,95	0,00	0,00	8.990.670,27	96.342,32	1,08%	1,09%	1,08%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.304.472,87	0,00	0,00	6.371.542,80	67.069,93	1,06%	1,04%	1,06%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.488,77	0,00	0,00	1.503,88	15,11	1,01%	0,01%	1,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.663.619,17	0,00	0,00	1.680.349,11	16.729,94	1,01%	0,84%	1,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.899.084,71	0,00	0,00	8.980.007,67	80.922,96	0,91%	0,04%	0,91%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.130.826,40	0,00	0,00	5.166.928,89	36.102,49	0,70%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.010.132,46	0,00	10.000.000,00	5.111.651,69	101.519,23	0,68%	3,34%	1,84%
Total Renda Fixa					1.566.343,87	1,47%	1,97%	