



Relatório Analítico dos Investimentos em setembro e 3º Trimestre de 2017

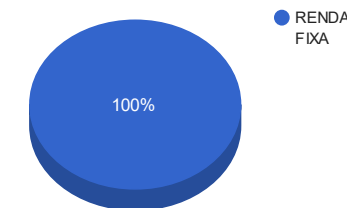
Carteira consolidada de investimentos - base (setembro / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			22.268,07	0,05%			Artigo 20
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.581.155,54	3,51%	195	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.546.276,99	7,87%	711	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.813.910,19	6,25%	1.221	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.548.183,92	7,88%	771	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.774.975,70	8,38%	29	6,41%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	17.648.590,68	39,18%	1.382	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	5.435.346,33	12,07%	763	0,13%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.409.740,90	5,35%	442	0,13%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	846.024,75	1,88%	229	0,25%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	3.422.392,56	7,60%	3.032	0,32%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
		TOTAL -	45.048.865,63				

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

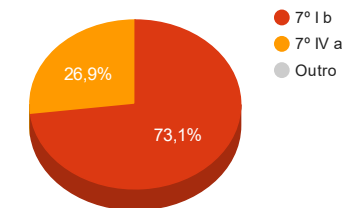
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 20	100,00%	22.268,07	0,05%	0,00%	0,00%	0,00%	-22.268,07
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	32.913.093,02	73,06%	20,00%	80,00%	85,00%	5.378.442,77
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	12.113.504,54	26,89%	5,00%	20,00%	30,00%	1.401.155,15
Total Renda Fixa	100,00%	45.048.865,63	100,00%	25,00	100,00	145,00	-

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Total Renda Variável	30,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00	15,00	-

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: setembro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 20	22.268,07	0,05%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	32.913.093,02	73,06%	30,00%	80,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	20,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	12.113.504,54	26,89%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
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	45.048.865,63	100,00%	40,00	145,00

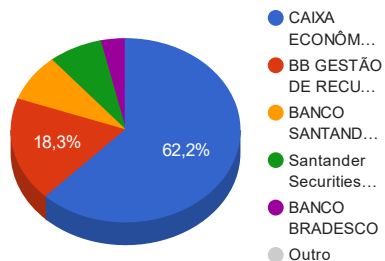
Artigos - Renda Variável	Base: setembro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Total Renda Variável	0,00	0,00%	0,00	15,00

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

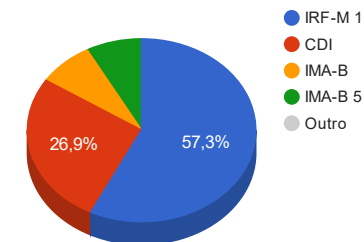
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	1,81%	13,16%	7,30%	5,86%	15,76%	48,59%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,80%	12,99%	7,25%	5,77%	15,63%	47,62%	0,20%	1,346%	9,79%
IMA-B 5	1,01%	10,94%	5,18%	6,58%	13,45%	34,82%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,99%	10,80%	5,13%	6,49%	13,27%	34,14%	0,20%	0,646%	3,63%
IRF-M 1	0,74%	9,14%	2,72%	5,49%	12,65%	29,70%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,71%	8,98%	2,67%	5,39%	12,45%	29,31%	0,20%	0,071%	0,67%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,71%	8,98%	2,68%	5,40%	12,45%	29,47%	0,20%	0,077%	0,68%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,71%	8,94%	2,67%	5,37%	12,38%	29,13%	0,10%	0,074%	0,68%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	0,69%	8,89%	2,61%	5,32%	12,32%	28,85%	0,40%	0,072%	0,68%
CDI	0,64%	8,03%	2,25%	4,85%	11,53%	27,29%	-	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,65%	8,02%	2,29%	4,79%	11,48%	27,22%	0,20%	0,030%	0,16%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO	0,65%	8,10%	2,27%	4,86%	11,65%	27,28%	0,20%	0,014%	0,11%
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	0,62%	7,89%	2,23%	4,71%	10,78%	26,09%	0,50%	0,019%	0,33%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,57%	7,38%	2,04%	4,43%	10,63%	25,21%	0,80%	0,012%	0,11%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	27.998.817,24	62,15%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	8.249.256,52	18,31%
BANCO SANTANDER	3.774.975,70	8,38%
Santander Securities Services	3.422.392,56	7,60%
BANCO BRADESCO	1.581.155,54	3,51%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	22.268,07	0,05%

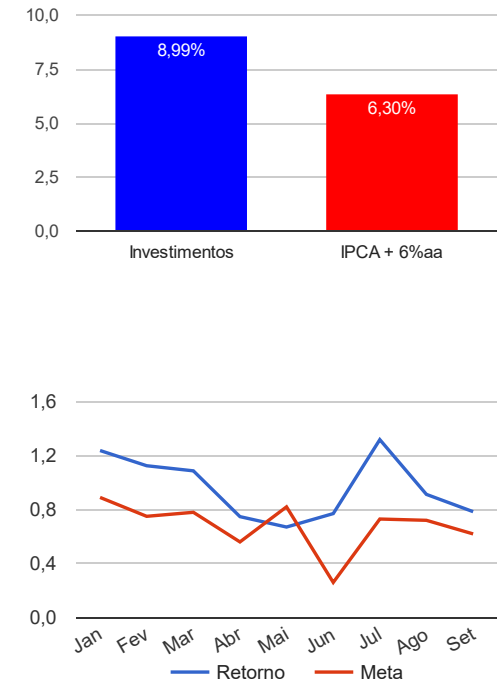


Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	25.818.632,11	57,31%
CDI	12.113.504,54	26,89%
IMA-B	3.548.183,92	7,88%
IMA-B 5	3.546.276,99	7,87%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	22.268,07	0,05%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Acumulado no Ano



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de setembro / 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	3.224.850,38	265.290,76	0,00	3.548.183,92	58.042,78	1,66%	1,35%	1,80%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.248.763,91	265.290,75	0,00	3.546.276,99	32.222,33	0,92%	0,65%	0,99%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	17.523.360,92	0,00	0,00	17.648.590,68	125.229,76	0,71%	0,07%	0,71%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.569.959,42	0,00	0,00	1.581.155,54	11.196,12	0,71%	0,08%	0,71%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.794.037,23	0,00	0,00	2.813.910,19	19.872,96	0,71%	0,07%	0,71%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	3.748.964,88	0,00	0,00	3.774.975,70	26.010,82	0,69%	0,07%	0,69%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.394.072,79	0,00	0,00	2.409.740,90	15.668,11	0,65%	0,03%	0,65%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO	5.400.264,08	0,00	0,00	5.435.346,33	35.082,25	0,65%	0,01%	0,65%
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	3.225.718,54	175.751,59	0,00	3.422.392,56	20.922,43	0,62%	0,02%	0,62%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	1.148.783,01	0,00	308.891,87	846.024,75	6.133,61	0,53%	0,01%	0,57%
Total Renda Fixa					350.381,17	0,78%	0,20%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º 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	17.189.590,59	0,00	0,00	17.648.590,68	459.000,09	2,67%	2,67%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.061.010,40	265.290,76	0,00	3.548.183,92	221.882,76	7,10%	7,25%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.120.875,26	265.290,75	0,00	3.546.276,99	160.110,98	5,05%	5,13%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO	5.314.962,18	0,00	0,00	5.435.346,33	120.384,15	2,27%	2,27%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	3.679.077,12	0,00	0,00	3.774.975,70	95.898,58	2,61%	2,61%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.740.802,24	0,00	0,00	2.813.910,19	73.107,95	2,67%	2,67%
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	2.877.534,91	475.751,59	0,00	3.422.392,56	69.106,06	2,22%	2,23%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.355.830,22	0,00	0,00	2.409.740,90	53.910,68	2,29%	2,29%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.539.936,05	0,00	0,00	1.581.155,54	41.219,49	2,68%	2,68%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	1.087.199,37	676.225,49	939.773,69	846.024,75	22.373,58	1,82%	2,04%
				Total Renda Fixa	1.316.994,32	3,04%	