



# Relatório Analítico dos Investimentos em outubro de 2017



Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

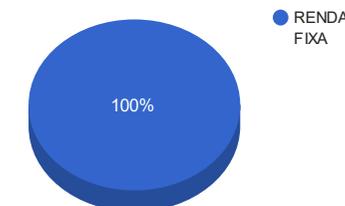
Carteira consolidada de investimentos - base (outubro / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			13.835,24	0,03%			Artigo 20
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.556.122,45	7,81%	780	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	5.472.110,39	12,01%	756	0,13%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.797.679,45	8,34%	29	6,41%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.069.526,71	2,35%	231	0,28%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.424.880,28	5,32%	437	0,13%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	17.757.977,22	38,99%	1.377	0,12%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.831.050,71	6,22%	1.223	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.590.576,46	3,49%	193	0,23%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.592.574,52	7,89%	715	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	3.444.406,64	7,56%	3.078	0,32%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
		<b>TOTAL -</b>	<b>45.550.740,07</b>				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 20	100,00%	13.835,24	0,03%	0,00%	0,00%	0,00%	-13.835,24
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	0,00	0,00%	20,00%	80,00%	85,00%	38.718.129,06
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	45.536.904,83	99,97%	5,00%	20,00%	30,00%	-31.871.682,81
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>45.550.740,07</b>	<b>100,00%</b>	<b>25,00</b>	<b>100,00</b>	<b>145,00</b>	<b>-</b>

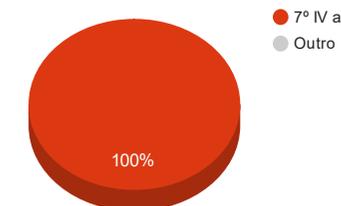
Distribuição por Segmento



**⚠** O Somatório dos incisos "a" e "b" do Artigo 7º IV não podem ultrapassar 40% (quarenta por cento).

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

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: outubro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 20	13.835,24	0,03%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	0,00	0,00%	30,00%	80,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	20,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	45.536.904,83	99,97%	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%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>45.550.740,07</b>	<b>100,00%</b>	<b>40,00</b>	<b>145,00</b>

Artigos - Renda Variável	Base: outubro / 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%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>15,00</b>

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (outubro / 2017)

Artigo 14º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR)

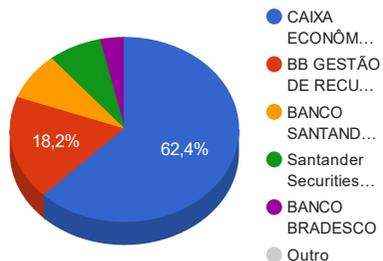
Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	28.401.081,18	62,35%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	8.303.161,10	18,23%	0,00%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	3.797.679,45	8,34%	0,00%
BANCO DO NORDESTE DO BRASIL	3.444.406,64	7,56%	0,04%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	1.590.576,46	3,49%	0,00%

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

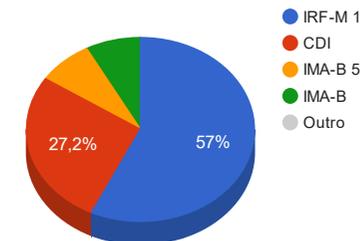
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	0,64%	8,72%	2,10%	4,70%	11,08%	26,70%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO	0,68%	8,83%	2,13%	4,75%	11,22%	26,72%	0,20%	0,029%	0,12%
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	0,64%	8,58%	2,03%	4,58%	10,52%	25,51%	0,50%	0,044%	0,32%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,63%	8,70%	2,10%	4,64%	11,03%	26,63%	0,20%	0,029%	0,17%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,58%	7,99%	1,89%	4,27%	10,19%	24,64%	0,80%	0,007%	0,11%
IRF-M 1	0,62%	9,81%	2,28%	5,22%	12,29%	28,83%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,62%	9,66%	2,24%	5,14%	12,09%	28,45%	0,20%	0,091%	0,67%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,61%	9,60%	2,21%	5,11%	12,01%	28,25%	0,10%	0,077%	0,68%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	0,60%	9,55%	2,17%	5,07%	11,96%	27,97%	0,40%	0,079%	0,68%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,60%	9,63%	2,21%	5,13%	12,05%	28,29%	0,20%	0,079%	0,68%
IMA-B 5	0,48%	11,48%	2,77%	6,34%	13,48%	32,18%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,46%	11,31%	2,72%	6,25%	13,27%	31,57%	0,20%	0,898%	3,64%
IMA-B	-0,38%	12,73%	2,78%	5,80%	14,59%	44,31%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,41%	12,53%	2,73%	5,69%	14,41%	43,66%	0,20%	1,825%	9,75%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	28.401.081,18	62,35%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	8.303.161,10	18,23%
BANCO SANTANDER	3.797.679,45	8,34%
Santander Securities Services	3.444.406,64	7,56%
BANCO BRADESCO	1.590.576,46	3,49%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	13.835,24	0,03%

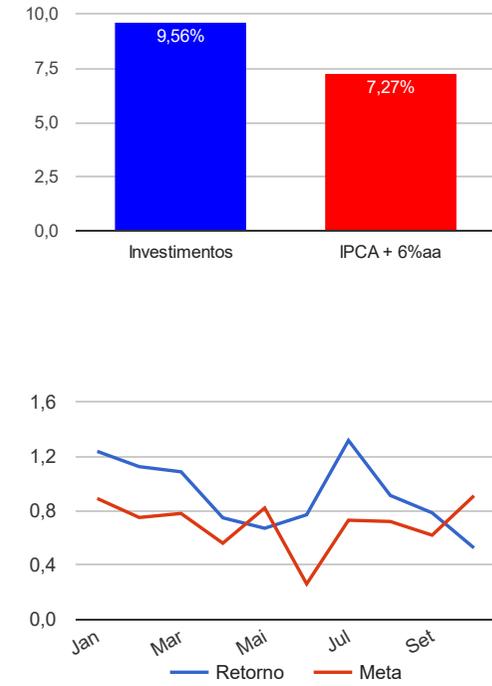


Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	25.977.283,84	57,03%
CDI	12.410.924,02	27,25%
IMA-B 5	3.592.574,52	7,89%
IMA-B	3.556.122,45	7,81%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	13.835,24	0,03%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

**Acumulado no Ano**



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)	
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO	5.435.346,33	0,00	0,00	5.472.110,39	36.764,06	0,68%	0,03%	0,68%	
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	3.422.392,56	0,00	0,00	3.444.406,64	22.014,08	0,64%	0,04%	0,64%	
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.409.740,90	0,00	0,00	2.424.880,28	15.139,38	0,63%	0,03%	0,63%	
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	17.648.590,68	0,00	0,00	17.757.977,22	109.386,54	0,62%	0,09%	0,62%	
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.813.910,19	0,00	0,00	2.831.050,71	17.140,52	0,61%	0,08%	0,61%	
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	3.774.975,70	0,00	0,00	3.797.679,45	22.703,75	0,60%	0,08%	0,60%	
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.581.155,54	0,00	0,00	1.590.576,46	9.420,92	0,60%	0,08%	0,60%	
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.546.276,99	30.000,00	0,00	3.592.574,52	16.297,53	0,46%	0,90%	0,46%	
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	846.024,75	949.011,57	729.825,07	1.069.526,71	4.315,46	0,24%	0,01%	0,58%	
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.548.183,92	22.859,77	0,00	3.556.122,45	-14.921,24	-0,42%	1,83%	-0,41%	
<b>Total Renda Fixa</b>						<b>238.261,00</b>	<b>0,53%</b>	<b>0,27%</b>	