

# Relatório Analítico dos Investimentos em outubro de 2017



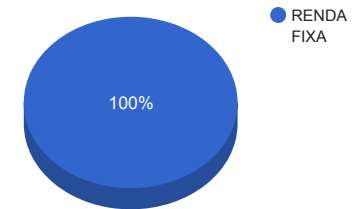
Carteira consolidada de investimentos - base (outubro / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	9.725.737,02	8,83%	330	0,36%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.596.984,61	4,17%	780	0,09%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.153.143,82	1,96%	639	0,18%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	8.298.072,35	7,53%	107	0,87%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	271.032,28	0,25%	604	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.231.464,74	2,93%	437	0,17%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	20.178.297,67	18,32%	756	0,48%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	7.090.580,99	6,44%	1.377	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	5.614.114,17	5,10%	129	0,27%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	4.231.524,24	3,84%	274	0,32%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.806.829,04	2,55%	262	0,22%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	11.639.281,07	10,57%	1.223	0,11%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.559.668,48	6,86%	206	0,58%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	6.094.950,39	5,53%	700	0,12%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	13.590.517,57	12,34%	110	2,69%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2020	3.049.894,52	2,77%	122	0,36%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
		<b>TOTAL -</b>	<b>110.132.092,96</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 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	0,00	0,00%	30,00%	35,00%	70,00%	77.092.465,07
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	15,00%	20,00%	60,00%	66.079.255,78
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	110.132.092,96	100,00%	5,00%	5,00%	30,00%	-77.092.465,07
Artigo 7º, Inciso VI	0,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	16.519.813,94
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	5.506.604,65
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	5.506.604,65
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>110.132.092,96</b>	<b>100,00%</b>	<b>55,00</b>	<b>75,00</b>	<b>185,00</b>	<b>-</b>

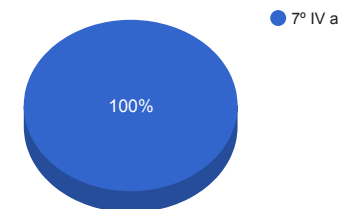
Distribuição por Segmento



 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 %	
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	16.519.813,94
Artigo 8º, Inciso IV	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	5.506.604,65
Artigo 8º, Inciso V	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	5.506.604,65
Artigo 8º, Inciso VI	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	5.506.604,65
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>11,00</b>	<b>25,00</b>	<b>30,00</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 7º, Inciso I, Alínea " b "	0,00	0,00%	30,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	110.132.092,96	100,00%	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>110.132.092,96</b>	<b>100,00%</b>	<b>55,00</b>	<b>185,00</b>

Artigos - Renda Variável	Base: outubro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>11,00</b>	<b>30,00</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
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	69.358.552,49	62,98%	0,01%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	40.773.540,47	37,02%	0,01%

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

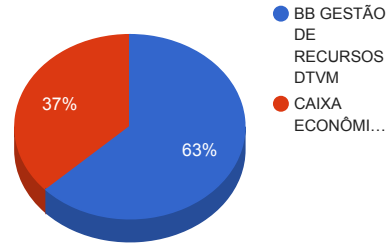
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA + 6,00% ao ano	0,91%	7,27%	2,27%	4,13%	8,84%	24,42%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,82%	11,00%	2,51%	5,86%	12,95%	32,07%	0,15%	0,520%	2,97%
IDKA IPCA 2 Anos	0,80%	12,02%	2,70%	6,61%	14,10%	31,77%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,76%	11,12%	2,62%	6,18%	13,11%	30,79%	0,20%	0,577%	2,89%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,74%	11,12%	2,62%	6,19%	13,13%	30,89%	0,20%	0,586%	2,81%
CDI	0,64%	8,72%	2,10%	4,70%	11,08%	26,70%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,68%	8,83%	2,13%	4,75%	11,22%	26,72%	0,20%	0,029%	0,12%
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%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,56%	7,86%	1,83%	4,15%	10,07%	24,57%	1,00%	0,010%	0,12%
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%
IMA Geral ex-C	0,14%	11,90%	2,53%	5,88%	14,13%	38,24%	-	-	-
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,10%	11,67%	2,44%	5,72%	13,82%	37,66%	0,20%	0,938%	4,90%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,01%	11,40%	2,42%	5,36%	13,27%	-	0,30%	1,069%	5,17%
IMA Geral	0,13%	11,83%	2,55%	5,82%	13,93%	38,11%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,10%	11,64%	2,43%	5,72%	13,82%	37,81%	0,20%	0,939%	4,74%

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

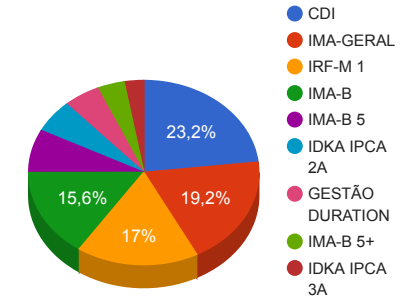
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5+	-1,01%	13,46%	2,74%	5,58%	15,27%	52,38%	-	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,99%	12,95%	2,66%	5,31%	14,65%	51,23%	0,20%	2,512%	12,74%
IMA-B	-0,38%	12,73%	2,78%	5,80%	14,59%	44,31%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,61%	6,35%	0,09%	3,68%	8,11%	22,15%	0,20%	0,741%	5,86%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	-0,39%	12,27%	2,77%	5,74%	14,09%	42,80%	0,20%	1,745%	9,32%
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%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,43%	12,72%	2,76%	5,75%	14,57%	43,84%	0,30%	1,830%	9,76%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	69.358.552,49	62,98%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	40.773.540,47	37,02%



Sub-segmento	Valor	%
CDI	25.562.906,23	23,21%
IMA-GERAL	21.150.186,05	19,20%
IRF-M 1	18.729.862,06	17,01%
IMA-B	17.129.550,67	15,55%
IMA-B 5	8.298.072,35	7,53%
IDKA IPCA 2A	6.365.982,67	5,78%
GESTÃO DURATION	5.614.114,17	5,10%
IMA-B 5+	4.231.524,24	3,84%
IDKA IPCA 3A	3.049.894,52	2,77%

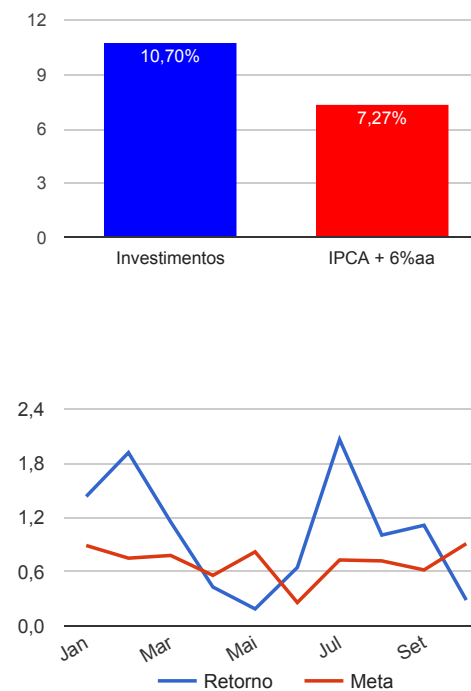




Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	95.696.156,30	1.574.937,24	1.157.292,05	97.489.878,54	1.376.077,05	1,43%	0,89%	160,52%	1,30%
Fevereiro	97.489.878,54	1.573.911,02	1.331.272,75	99.604.792,00	1.872.275,19	1,92%	0,75%	255,96%	1,10%
Março	99.604.792,00	1.791.920,77	1.146.253,94	101.403.652,15	1.153.193,32	1,15%	0,78%	146,62%	0,83%
Abril	101.403.652,15	1.463.616,71	1.041.252,00	102.265.225,90	439.209,04	0,43%	0,56%	77,35%	0,73%
Mai	102.265.225,90	1.629.916,12	1.358.370,94	102.731.302,57	194.531,49	0,19%	0,82%	23,09%	4,89%
Junho	102.731.302,57	2.203.436,42	1.892.077,34	103.709.881,30	667.219,65	0,65%	0,26%	253,30%	0,90%
Julho	103.709.881,30	7.068.953,20	6.733.375,54	106.189.122,26	2.143.663,30	2,06%	0,73%	283,04%	0,88%
Agosto	106.189.122,26	7.618.459,83	7.073.401,69	107.806.827,33	1.072.646,93	1,00%	0,72%	138,76%	0,97%
Setembro	107.806.827,33	1.623.989,23	1.186.489,33	109.449.451,88	1.205.124,65	1,11%	0,62%	178,34%	0,60%
Outubro	109.449.451,88	1.558.960,46	1.192.197,03	110.132.092,96	315.877,65	0,29%	0,91%	31,65%	0,73%
Acumulado no ano					10.439.818,27	10,70%	7,27%	147,11%	

**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 TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.025.185,73	0,00	0,00	3.049.894,52	24.708,79	0,82%	0,52%	0,82%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.049.262,70	0,00	0,00	6.094.950,39	45.687,69	0,76%	0,58%	0,76%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	269.030,08	0,00	0,00	271.032,28	2.002,20	0,74%	0,59%	0,74%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	20.042.730,94	0,00	0,00	20.178.297,67	135.566,73	0,68%	0,03%	0,68%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.211.289,56	0,00	0,00	3.231.464,74	20.175,18	0,63%	0,03%	0,63%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.046.904,06	0,00	0,00	7.090.580,99	43.676,93	0,62%	0,09%	0,62%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.247.782,55	0,00	0,00	8.298.072,35	50.289,80	0,61%	0,74%	0,61%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.568.811,35	0,00	0,00	11.639.281,07	70.469,72	0,61%	0,08%	0,61%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.773.373,59	1.558.960,46	1.192.197,03	2.153.143,82	13.006,80	0,39%	0,01%	0,56%
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	13.576.350,47	0,00	0,00	13.590.517,57	14.167,10	0,10%	0,94%	0,10%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.551.940,19	0,00	0,00	7.559.668,48	7.728,29	0,10%	0,94%	0,10%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.613.686,00	0,00	0,00	5.614.114,17	428,17	0,01%	1,07%	0,01%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	9.764.175,13	0,00	0,00	9.725.737,02	-38.438,11	-0,39%	1,74%	-0,39%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.616.026,99	0,00	0,00	4.596.984,61	-19.042,38	-0,41%	1,83%	-0,41%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.818.952,85	0,00	0,00	2.806.829,04	-12.123,81	-0,43%	1,83%	-0,43%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.273.949,69	0,00	0,00	4.231.524,24	-42.425,45	-0,99%	2,51%	-0,99%
Total Renda Fixa					315.877,65	0,29%	0,73%	