

# 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
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	9.986.300,57	10,58%	780	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.308,50	0,00%	312	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	13.945.256,23	14,78%	1.223	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	13.715.066,40	14,53%	610	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	54.683,06	0,06%	255	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	119.976,36	0,13%	699	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	10.936.622,39	11,59%	700	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	595.497,33	0,63%	193	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	10.136.076,99	10,74%	715	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	2.178.271,33	2,31%	167	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	171.592,18	0,18%	206	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	583.280,10	0,62%	223	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	12.362.432,46	13,10%	1.377	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	13.824.638,24	14,65%	604	0,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	7.210,43	0,01%	545	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	121.746,26	0,13%	639	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	2.997.087,67	3,18%	231	0,80%	Artigo 7º, Inciso IV
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	975.565,07	1,03%	6.450	1,02%	Artigo 8º, Inciso III
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	D+4	Não há	823.937,39	0,87%	122	0,41%	Artigo 8º, Inciso III
META VALOR FI AÇÕES	D+4	Não há	832.478,77	0,88%	25	1,11%	Artigo 8º, Inciso III
<b>Total</b>			<b>94.370.027,73</b>				

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

Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	88.612.002,14	93,90%	30,00%	35,00%	70,00%	-22.552.982,73
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	15,00%	20,00%	60,00%	56.622.016,64
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	0,00	0,00%	5,00%	5,00%	30,00%	28.311.008,32
Artigo 7º, Inciso VI	0,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	14.155.504,16
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	4.718.501,39
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	4.718.501,39
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	2.631.981,23	2,79%	5,00%	10,00%	15,00%	11.523.522,93
Artigo 8º, Inciso IV	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	4.718.501,39
Artigo 8º, Inciso V	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	4.718.501,39
Artigo 8º, Inciso VI	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	4.718.501,39
<b>Total Carteira</b>		<b>91.243.983,37</b>					

RENDA FIXA	91.738.046,50	100,54%
RENDA VARIÁVEL	2.631.981,23	2,88%

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: outubro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	88.612.002,14	93,90%	30,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00%	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%
Artigo 8º, Inciso III	2.631.981,23	2,79%	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</b>	<b>91.243.983,37</b>	<b>96,69%</b>	<b>66,00</b>	<b>215,00</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 DTVM	49.535.119,67	52,49%	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	42.588.001,37	45,13%	0,00%
META ASSET MANAGEMENT	832.478,77	0,88%	1,05%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	831.147,82	0,88%	0,00%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	583.280,10	0,62%	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
IDKA IPCA 2 Anos	0,801%	12,02%	2,70%	6,61%	14,10%	31,77%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,00%	9,57%	2,20%	5,20%	11,55%	27,34%	0,20%	0,368%	1,85%
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	0,643%	8,72%	2,10%	4,70%	11,08%	26,70%	-	-	-
BRANCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,65%	9,16%	2,32%	4,98%	11,62%	27,50%	0,20%	0,012%	0,13%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,58%	7,99%	1,89%	4,27%	10,19%	24,64%	0,80%	0,007%	0,11%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,56%	7,86%	1,83%	4,15%	10,07%	24,57%	1,00%	0,010%	0,12%
IRF-M 1	0,620%	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-B 5	0,484%	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%
IPCA	0,420%	2,21%	0,77%	1,09%	2,70%	10,79%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,67%	11,25%	2,56%	5,97%	13,17%	31,67%	0,20%	0,676%	3,52%
IMA Geral	0,128%	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
IRF-M	0,103%	13,68%	2,66%	6,77%	16,15%	42,35%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,08%	13,44%	2,59%	6,60%	15,82%	41,81%	0,20%	1,104%	4,83%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,00%	13,35%	2,46%	6,56%	15,72%	41,83%	0,20%	1,123%	4,86%
IMA-B 5+	-1,011%	13,46%	2,74%	5,58%	15,27%	52,38%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,03%	13,20%	2,67%	5,53%	14,99%	51,06%	0,20%	2,529%	12,65%
IMA-B	-0,382%	12,73%	2,78%	5,80%	14,59%	44,31%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,01%	3,68%	-0,56%	2,37%	5,50%	15,35%	0,20%	0,373%	4,39%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,40%	12,49%	2,71%	5,65%	14,29%	43,59%	0,20%	1,821%	9,76%
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%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
SMLL	-1,48%	43,01%	10,90%	19,12%	30,25%	74,95%	-	-	-
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	-0,79%	34,15%	8,45%	13,08%	23,69%	69,14%	1,50%	7,880%	18,59%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	-1,80%	37,69%	8,78%	15,10%	24,27%	63,67%	2,00%	8,132%	20,16%
IBX	-0,13%	24,13%	12,24%	13,79%	14,91%	60,54%	-	-	-
META VALOR FI AÇÕES	0,66%	39,06%	19,17%	22,33%	27,19%	84,97%	2,50%	9,481%	24,96%



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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	50.118.399,77	53,11%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	42.588.001,37	45,13%
BANCO DAYCOVAL	832.478,77	0,88%
BEM DTVM	823.937,39	0,87%
BANCO BRADESCO	7.210,43	0,01%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	26.307.688,69	27,88%
IDKA IPCA 2A	25.356.757,96	26,87%
IMA-B	23.701.366,97	25,12%
IMA-B 5	10.719.357,09	11,36%
CDI	3.126.044,36	3,31%
IPCA	2.178.271,33	2,31%
AÇÕES - SMALL / MID CAPS	1.799.502,46	1,91%
AÇÕES - VALOR	832.478,77	0,88%
IMA-GERAL	171.592,18	0,18%
IRF-M	122.284,86	0,13%
IMA-B 5+	54.683,06	0,06%

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

**Acumulado no Ano**

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	82.463.526,96	9.478,48	627.121,88	83.039.727,09	1.193.843,53	1,45%	0,89%	162,31%	1,63%
Fevereiro	83.039.727,09	26.094.947,59	25.631.156,13	85.660.017,26	2.156.498,71	2,58%	0,75%	345,05%	1,58%
Março	85.660.017,26	1.296.933,66	772.248,09	87.159.623,33	974.920,50	1,13%	0,78%	144,18%	1,73%
Abril	87.159.623,33	2.308.994,59	1.798.542,48	87.622.942,08	-47.133,36	-0,05%	0,56%	-9,64%	1,57%
Mai	87.622.942,08	45.902.418,89	44.735.839,92	87.824.300,02	-965.221,03	-1,09%	0,82%	-132,32%	10,69%
Junho	87.824.300,02	1.724.613,17	872.960,73	88.972.379,02	296.426,56	0,33%	0,26%	130,76%	2,02%
Julho	88.972.379,02	37.712.917,14	38.685.306,38	90.656.864,19	2.656.874,41	2,99%	0,73%	410,23%	1,16%
Agosto	90.656.864,19	1.393.614,31	1.118.490,55	91.917.405,98	985.418,03	1,08%	0,72%	149,63%	0,87%
Setembro	91.917.405,98	9.501.722,03	8.812.026,64	93.667.255,52	1.060.154,15	1,14%	0,62%	183,38%	0,68%
Outubro	93.667.255,52	16.863.485,64	16.386.109,70	94.370.027,73	225.396,27	0,24%	0,91%	26,34%	0,99%
Acumulado no ano					8.537.177,77	10,18%	7,27%	140,04%	

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(%)
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	577.458,61	0,00	0,00	583.280,10	5.821,49	1,01%	0,37%	1,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	589.592,00	0,00	0,00	595.497,33	5.905,33	1,00%	0,37%	1,00%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.854.641,56	0,00	0,00	10.936.622,39	81.980,83	0,76%	0,58%	0,76%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.163.811,17	0,00	0,00	2.178.271,33	14.460,16	0,67%	0,68%	0,67%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.286.281,70	0,00	0,00	12.362.432,46	76.150,76	0,62%	0,09%	0,62%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.240.967,32	2.500.000,00	0,00	13.824.638,24	83.670,92	0,61%	0,59%	0,74%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.915.595,25	0,00	55.000,00	13.945.256,23	84.660,98	0,61%	0,08%	0,61%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.206.141,79	2.900.000,00	0,00	10.136.076,99	29.935,20	0,30%	0,90%	0,46%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	149.372,95	750.405,71	780.292,89	121.746,26	2.260,49	0,25%	0,01%	0,56%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	463.817,18	0,00	345.000,00	119.976,36	1.159,18	0,25%	1,10%	0,08%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	506.509,45	0,00	500.000,00	7.210,43	700,98	0,14%	0,01%	0,65%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	171.416,76	0,00	0,00	171.592,18	175,42	0,10%	0,94%	0,10%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	283.358,84	8.513.079,93	5.805.816,81	2.997.087,67	6.465,71	0,07%	0,01%	0,58%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.901.160,82	0,00	7.900.000,00	2.308,50	1.147,68	0,01%	1,12%	-0,00%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.772.966,21	0,00	1.000.000,00	13.715.066,40	-57.899,81	-0,39%	1,82%	-0,40%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.027.667,44	0,00	0,00	9.986.300,57	-41.366,87	-0,41%	1,83%	-0,41%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	55.250,18	0,00	0,00	54.683,06	-567,12	-1,03%	2,53%	-1,03%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>294.661,33</b>	<b>0,32%</b>	<b>0,78%</b>	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
META VALOR FI AÇÕES	251.220,46	600.000,00	0,00	832.478,77	-18.741,69	-2,20%	9,48%	0,66%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	0,00	1.000.000,00	0,00	975.565,07	-24.434,93	-2,44%	8,13%	-1,80%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	250.025,83	600.000,00	0,00	823.937,39	-26.088,44	-3,07%	7,88%	-0,79%
Total Renda Variável					-69.265,06	-2,56%	8,48%	