

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 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 IV, Alínea 'a' |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+0 | 15/08/2018 | 595.497,33 | 0,63% | 193 | 0,17% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a' |
| 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 IV, Alínea 'a' |
| 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 IV, Alínea 'a' |
| 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 IV, Alínea 'a' |
| 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 IV, Alínea 'a' |
| BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | D+0 | Não há | 7.210,43 | 0,01% | 545 | 0,00% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a' |
| 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 IV, Alínea 'a' |
| 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 IV, Alínea 'a' |
| 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 IV, Alínea 'a' |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA | D+0 | Não há | 2.997.087,67 | 3,18% | 231 | 0,80% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a' |
| 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 IV, Alínea 'a' |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+1 | Não há | 119.976,36 | 0,13% | 699 | 0,00% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a' |
| 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 IV, Alínea 'a' |
| 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 IV, Alínea 'a' |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+0 | Não há | 121.746,26 | 0,13% | 639 | 0,01% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a' |
| 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 IV, Alínea 'a' |
| META VALOR FI AÇÕES | D+4 | Não há | 832.478,77 | 0,88% | 25 | 1,11% | Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'a' |
| BB SMALL CAPS FIC AÇÕES | D+4 | Não há | 975.565,07 | 1,03% | 6.450 | 1,02% | Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'a' |
| BRDESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES | D+4 | Não há | 823.937,39 | 0,87% | 122 | 0,41% | Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'a' |
| | | Total | 94.370.027,73 | | | | |

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% | 0,00 | 0,00% | 30,00% | 35,00% | 70,00% | 66.059.019,41 |
| 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% | 91.738.046,50 | 97,21% | 5,00% | 5,00% | 30,00% | -63.427.038,18 |
| 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 I, Alínea ' a ' | 30,00% | 2.631.981,23 | 2,79% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | -2.631.981,23 |
| Artigo 8º, Inciso III | 10,00% | 0,00 | 0,00% | 5,00% | 10,00% | 15,00% | 14.155.504,16 |
| 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 |
| Total Carteira | | 94.370.027,73 | | | | | |

| | | |
|----------------|---------------|--------|
| RENDA FIXA | 91.738.046,50 | 97,21% |
| RENDA VARIÁVEL | 2.631.981,23 | 2,79% |

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

| Artigos | 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 ' | 91.738.046,50 | 97,21% | 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 I, Alínea ' a ' | 2.631.981,23 | 2,79% | 0,00% | 0,00% |
| 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% |
| Total | 94.370.027,73 | 100,00% | 66,00 | 215,00 |

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 | 50.118.399,77 | 53,11% | 0,01% |
| 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% |

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 | 0,80% | 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% |
| Selic | 0,64% | 8,73% | 2,10% | 4,71% | 11,10% | 26,74% | - | - | - |
| BRASESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 0,65% | 9,16% | 2,32% | 4,98% | 11,62% | 27,50% | 0,20% | 0,012% | 0,13% |
| CDI | 0,64% | 8,72% | 2,10% | 4,70% | 11,08% | 26,70% | - | - | - |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI 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 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-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 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% |
| IRF-M | 0,10% | 13,68% | 2,66% | 6,77% | 16,15% | 42,35% | - | - | - |

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 |
|---|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| 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+ | -1,01% | 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 | -0,38% | 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 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% |
| 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 |
|---------------------------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| 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% |
| Não definido | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| BRDESCO 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% | 3,00% | 8,132% | 20,16% |

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% |
| IMA-B | 25.879.638,30 | 27,42% |
| IDKA IPCA 2A | 25.356.757,96 | 26,87% |
| IMA-B 5 | 10.719.357,09 | 11,36% |
| CDI | 3.126.044,36 | 3,31% |
| 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

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 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% |
| BRDESCO 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 FI 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% |
| | | | | Total Renda Fixa | 294.661,33 | 0,32% | 0,78% | |

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% | |

