

Relatório Analítico dos Investimentos em outubro de 2017

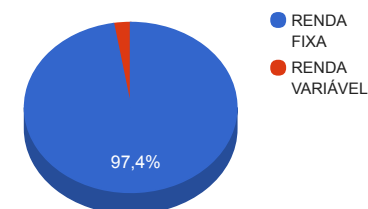
Carteira consolidada de investimentos - base (outubro / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	2.167.896,10	6,87%	347	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1800	Não há	1.249.336,42	3,96%			Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.473.594,25	11,01%	756	0,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.843.683,99	9,01%	330	0,11%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	3.000.252,81	9,51%	610	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.549.117,03	4,91%	715	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.520.380,51	4,82%	203	0,10%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	156.019,57	0,49%	699	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	911.740,89	2,89%	1.377	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	D+31 ou D+1461	Não há	1.224.901,04	3,88%	18	0,61%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.531.899,88	8,02%	1.223	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.331.105,74	7,39%	700	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.482.597,64	7,87%	255	0,20%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	2.245.826,64	7,12%	274	0,17%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	981.871,38	3,11%	112	0,30%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.477.215,24	4,68%	206	0,11%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	17/08/2020	413.126,10	1,31%	20	0,64%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	177.559,32	0,56%	98	0,18%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	D+4	Não há	820.717,27	2,60%	69	0,97%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
		TOTAL -	31.558.841,82				

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%	2.167.896,10	6,87%	30,00%	48,00%	70,00%	19.923.293,17
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	15,00%	20,00%	60,00%	18.935.305,09
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	28.392.669,13	89,97%	5,00%	5,00%	30,00%	-18.925.016,58
Artigo 7º, Inciso VI	0,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	4.733.826,27
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	177.559,32	0,56%	0,00%	2,00%	5,00%	1.400.382,77
Total Renda Fixa	100,00%	30.738.124,55	97,40%	55,00	85,00	180,00	-

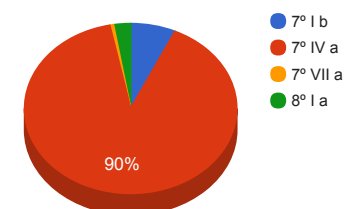
Distribuição por Segmento



 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 I, Alínea " a "	30,00%	820.717,27	2,60%	0,00%	0,00%	0,00%	-820.717,27
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	4.733.826,27
Artigo 8º, Inciso IV	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	1.577.942,09
Total Renda Variável	30,00%	820.717,27	2,60%	7,00	15,00	20,00	-

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 "	2.167.896,10	6,87%	30,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	28.392.669,13	89,97%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	0,00	0,00%	5,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	177.559,32	0,56%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	30.738.124,55	97,40%	55,00	180,00

Artigos - Renda Variável	Base: outubro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	820.717,27	2,60%	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%
Total Renda Variável	820.717,27	2,60%	7,00	20,00

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
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	15.906.594,99	50,40%	0,00%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	13.000.450,05	41,19%	0,00%
ROMA ASSET	1.249.336,42	3,96%	0,81%
TMJ CAPITAL	1.224.901,04	3,88%	0,39%
FINAXIS CORRETORA	177.559,32	0,56%	0,18%

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
101,50% do IPCA + 5,75% ao ano	0,84%	6,53%	2,06%	3,68%	7,93%	22,43%	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,07%	-5,83%	-2,33%	-3,97%	-7,02%	-17,79%	0,25%	0,145%	0,96%
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%
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 ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,65%	8,69%	2,10%	4,63%	11,00%	26,57%	0,20%	0,020%	0,17%
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%	-	-	-
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1,13%	12,67%	7,24%	11,13%	16,65%	42,54%	1,30%	-	-
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%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,46%	11,35%	2,71%	6,28%	13,30%	31,71%	0,20%	0,903%	3,65%
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)

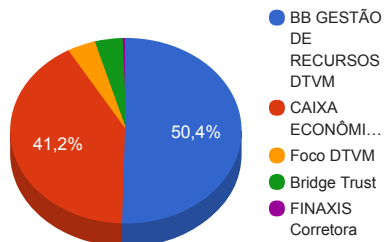
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,08%	13,44%	2,59%	6,60%	15,82%	41,81%	0,20%	1,104%	4,83%
IMA-B 5+	-1,01%	13,46%	2,74%	5,58%	15,27%	52,38%	-	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,99%	12,95%	2,66%	5,31%	14,65%	51,23%	0,20%	2,512%	12,74%
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 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,61%	6,49%	0,11%	3,68%	8,28%	22,91%	0,20%	0,741%	5,78%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	-0,13%	11,43%	2,42%	6,45%	13,48%	27,54%	1,30%	1,267%	5,10%
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%
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%
IRF-M 1+	-0,07%	15,09%	2,78%	7,31%	17,56%	50,69%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,21%	14,66%	2,53%	7,04%	16,99%	50,11%	0,20%	1,478%	6,39%

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

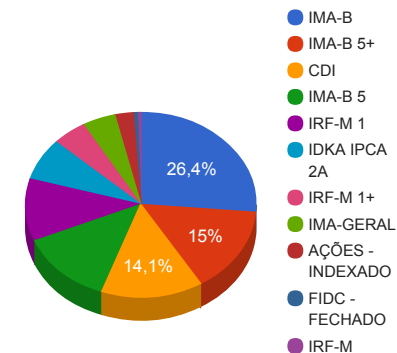
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IBX-50	-0,01%	23,37%	12,58%	13,79%	14,25%	58,77%	-	-	-
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	0,49%	23,98%	14,55%	15,10%	14,60%	43,67%	0,70%	8,173%	20,85%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	15.906.594,99	50,40%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	13.000.450,05	41,19%
Foco DTVM	1.249.336,42	3,96%
Bridge Trust	1.224.901,04	3,88%
FINAXIS Corretora	177.559,32	0,56%

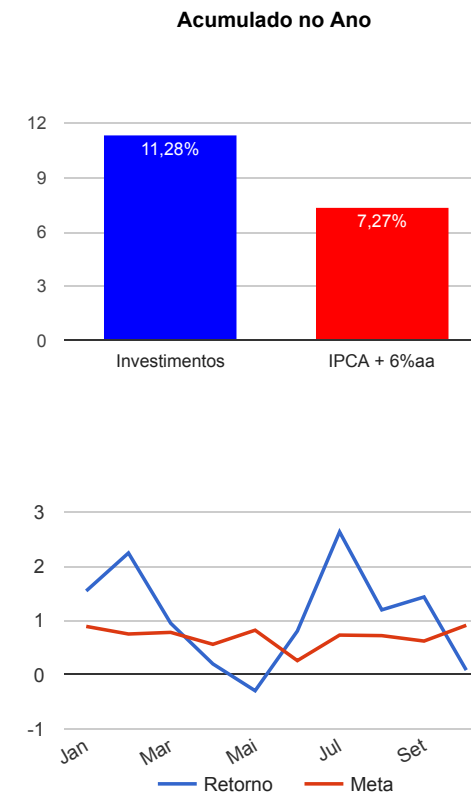


Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	8.318.174,26	26,36%
IMA-B 5+	4.728.424,28	14,98%
CDI	4.455.465,63	14,12%
IMA-B 5	4.130.139,23	13,09%
IRF-M 1	3.443.640,77	10,91%
IDKA IPCA 2A	2.331.105,74	7,39%
IRF-M 1+	1.520.380,51	4,82%
IMA-GERAL	1.477.215,24	4,68%
AÇÕES - INDEXADO	820.717,27	2,60%
FIDC - FECHADO	177.559,32	0,56%
IRF-M	156.019,57	0,49%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	25.621.019,44	1.366.900,00	554.355,05	26.841.345,26	407.780,87	1,54%	0,89%	172,96%	1,97%
Fevereiro	26.841.345,26	1.682.000,00	1.494.964,05	27.634.035,13	605.653,92	2,24%	0,75%	299,39%	1,24%
Março	27.634.035,13	894.100,00	530.000,00	28.263.575,27	265.440,14	0,95%	0,78%	120,84%	1,39%
Abril	28.263.575,27	858.800,00	510.000,00	28.669.409,63	57.034,36	0,20%	0,56%	35,74%	1,24%
Mai	28.669.409,63	429.000,00	425.708,83	28.588.429,97	-84.270,83	-0,29%	0,82%	-35,77%	7,22%
Junho	28.588.429,97	789.600,00	435.709,50	29.175.173,22	232.852,75	0,80%	0,26%	314,72%	1,81%
Julho	29.175.173,22	675.500,00	450.408,11	30.173.078,10	772.812,99	2,63%	0,73%	361,11%	1,42%
Agosto	30.173.078,10	900.100,00	930.000,00	30.503.562,68	360.384,58	1,19%	0,72%	164,91%	1,27%
Setembro	30.503.562,68	1.057.074,47	712.185,68	31.290.026,54	441.575,07	1,43%	0,62%	229,30%	1,04%
Outubro	31.290.026,54	711.930,00	470.000,00	31.558.841,82	26.885,28	0,09%	0,91%	9,38%	1,31%
Acumulado no ano					3.086.149,13	11,28%	7,27%	155,10%	



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(%)
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.235.426,93	0,00	0,00	1.249.336,42	13.909,49	1,13%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.313.631,80	0,00	0,00	2.331.105,74	17.473,94	0,76%	0,58%	0,76%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.450.257,10	0,00	0,00	3.473.594,25	23.337,15	0,68%	0,03%	0,68%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	906.124,70	0,00	0,00	911.740,89	5.616,19	0,62%	0,09%	0,62%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.516.570,56	0,00	0,00	2.531.899,88	15.329,32	0,61%	0,08%	0,61%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	410.639,10	0,00	0,00	413.126,10	2.487,00	0,61%	0,74%	0,61%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.542.000,81	0,00	0,00	1.549.117,03	7.116,22	0,46%	0,90%	0,46%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2.094.939,33	63.360,00	0,00	2.167.896,10	9.596,77	0,44%	0,90%	0,46%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	848.865,45	600.000,00	470.000,00	981.871,38	3.005,93	0,21%	0,02%	0,65%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.475.705,08	0,00	0,00	1.477.215,24	1.510,16	0,10%	0,94%	0,10%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	125.169,98	30.770,00	0,00	156.019,57	79,59	0,05%	1,10%	0,08%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	177.691,19	0,00	0,00	177.559,32	-131,87	-0,07%	0,14%	-0,07%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	1.226.499,82	0,00	0,00	1.224.901,04	-1.598,78	-0,13%	1,27%	-0,13%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.523.521,46	0,00	0,00	1.520.380,51	-3.140,95	-0,21%	1,48%	-0,21%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	2.854.922,81	0,00	0,00	2.843.683,99	-11.238,82	-0,39%	1,74%	-0,39%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.012.384,30	0,00	0,00	3.000.252,81	-12.131,49	-0,40%	1,82%	-0,40%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.250.576,83	17.800,00	0,00	2.245.826,64	-22.550,19	-0,99%	2,51%	-0,99%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.508.344,93	0,00	0,00	2.482.597,64	-25.747,29	-1,03%	2,53%	-1,03%
Total Renda Fixa					22.922,37	0,07%	1,12%	

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(%)
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	816.754,36	0,00	0,00	820.717,27	3.962,91	0,49%	8,17%	0,49%
Total Renda Variável					3.962,91	0,49%	8,17%	