

Relatório Analítico dos Investimentos em setembro e 3º Trimestre de 2017



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

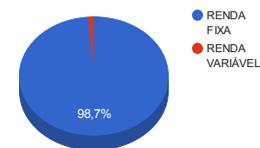
Carteira consolidada de investimentos - base (setembro / 2017)

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 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	38.743,61	0,16%	259	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	4.012.225,00	16,16%	1.221	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	57.424,59	0,23%	27	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	629.202,66	2,53%	601	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.369.412,24	9,55%	696	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.223.908,16	12,99%	771	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	116.755,10	0,47%	193	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.893.726,85	15,69%	1.382	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.005.203,03	4,05%	113	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	180.247,00	0,73%	167	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	32.987,25	0,13%	711	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	4.040.737,79	16,28%	701	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	265.608,75	1,07%	345	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.793.658,97	7,23%	262	0,14%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	D+3	Não há	368.277,05	1,48%	359	0,17%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	383.571,08	1,55%	116	0,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.226.642,52	4,94%	442	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	860.851,76	3,47%	776	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	D+4	Não há	35.827,18	0,14%	70	0,04%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se aplica	Não se aplica	287.207,26	1,16%		0,17%	Artigo 8º, Inciso VI
TOTAL -			24.822.217,85				

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

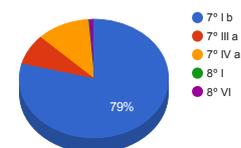
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	19.600.573,28	78,96%	30,00%	45,00%	80,00%	257.201,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	2.059.267,72	8,30%	15,00%	20,00%	60,00%	12.834.062,99
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	2.839.342,41	11,44%	5,00%	5,00%	30,00%	4.607.322,95
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	3.723.332,68
Total Renda Fixa	100,00%	24.499.183,41	98,70%	55,00	80,00	185,00	-

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	35.827,18	0,14%	0,00%	0,00%	0,00%	-35.827,18
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	3.723.332,68
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	1.241.110,89
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	287.207,26	1,16%	2,00%	5,00%	5,00%	953.903,63
Total Renda Variável	30,00%	323.034,44	1,30%	9,00	20,00	25,00	-

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: setembro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	19.600.573,28	78,96%	30,00%	80,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	2.059.267,72	8,30%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	2.839.342,41	11,44%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	0,00	0,00%	5,00%	15,00%
Total Renda Fixa	24.499.183,41	98,70%	55,00	185,00

Artigos - Renda Variável	Base: setembro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I	35.827,18	0,14%	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 VI	287.207,26	1,16%	2,00%	5,00%
Total Renda Variável	323.034,44	1,30%	9,00	25,00

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDKA IPCA 20 Anos	3,75%	17,34%	11,59%	4,03%	20,78%	88,79%	-	-	-
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,17%	15,49%	10,05%	4,35%	18,77%	69,42%	0,20%	2,855%	18,62%
IMA-B 5+	2,40%	14,62%	8,64%	5,79%	17,29%	57,99%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,37%	14,38%	8,52%	5,75%	16,99%	56,58%	0,20%	2,004%	12,71%
IMA-B	1,81%	13,16%	7,30%	5,86%	15,76%	48,59%	-	-	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,84%	13,20%	7,34%	5,84%	15,81%	47,99%	0,30%	1,357%	9,80%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,80%	12,99%	7,25%	5,77%	15,63%	47,62%	0,20%	1,346%	9,79%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1,79%	12,67%	7,22%	5,53%	15,28%	47,27%	0,20%	1,344%	9,80%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,88%	10,51%	4,45%	5,97%	12,92%	33,75%	0,20%	0,487%	3,55%
IRF-M	1,48%	13,57%	4,92%	7,23%	17,44%	43,51%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,45%	13,36%	4,87%	7,06%	17,16%	43,01%	0,20%	1,005%	4,84%
IMA-B 5	1,01%	10,94%	5,18%	6,58%	13,45%	34,82%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,99%	10,80%	5,13%	6,49%	13,27%	34,14%	0,20%	0,646%	3,63%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,99%	10,84%	5,16%	6,53%	13,28%	34,30%	0,20%	0,647%	3,64%
IDKA IPCA 2 Anos	0,91%	11,13%	4,46%	6,74%	13,66%	34,61%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,89%	10,30%	4,32%	6,24%	12,77%	33,38%	0,20%	0,491%	2,83%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,86%	10,29%	4,33%	6,18%	12,73%	33,31%	0,20%	0,476%	2,90%

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

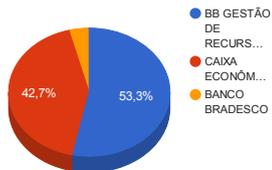
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,50%	8,48%	2,84%	4,98%	10,90%	28,86%	0,20%	0,276%	1,89%
IRF-M 1	0,74%	9,14%	2,72%	5,49%	12,65%	29,70%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,71%	8,98%	2,67%	5,39%	12,45%	29,31%	0,20%	0,071%	0,67%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,71%	8,94%	2,67%	5,37%	12,38%	29,13%	0,10%	0,074%	0,68%
CDI	0,64%	8,03%	2,25%	4,85%	11,53%	27,29%	-	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,65%	8,02%	2,29%	4,79%	11,48%	27,22%	0,20%	0,030%	0,16%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,63%	8,06%	2,23%	4,86%	11,56%	27,32%	0,20%	0,017%	0,12%
IPCA + 6,00% ao ano	0,62%	6,30%	2,09%	3,77%	8,64%	24,92%	-	-	-
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	0,80%	10,20%	3,98%	5,77%	13,18%	34,46%	0,30%	0,321%	2,53%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,49%	6,40%	1,84%	3,82%	8,58%	25,31%	0,20%	0,237%	0,33%

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

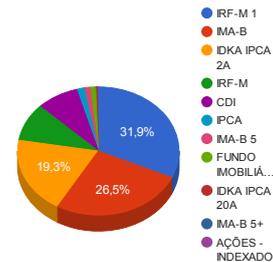
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	6,58%	19,16%	7,09%	9,30%	22,30%	58,65%	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	7,95%	7,84%	2,80%	4,76%	11,22%	39,24%	1,20%	11,303%	22,79%
IBX-50	4,95%	23,39%	17,95%	14,48%	26,94%	60,47%	-	-	-
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	6,13%	23,38%	19,46%	15,07%	26,26%	43,18%	0,70%	6,758%	20,68%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	13.219.640,52	53,26%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	10.597.374,30	42,69%
BANCO BRADESCO	1.005.203,03	4,05%

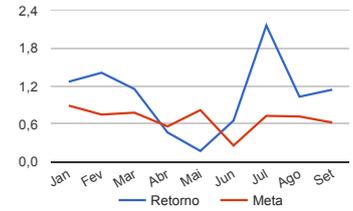
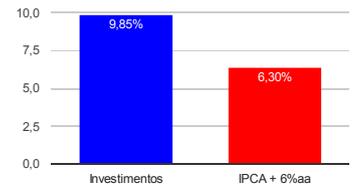


Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	7.905.951,85	31,85%
IMA-B	6.586.588,24	26,54%
IDKA IPCA 2A	4.786.695,55	19,28%
IRF-M	2.369.412,24	9,55%
CDI	2.087.494,28	8,41%
IPCA	368.277,05	1,48%
IMA-B 5	298.596,00	1,20%
FUNDO IMOBILIÁRIO	287.207,26	1,16%
IDKA IPCA 20A	57.424,59	0,23%
IMA-B 5+	38.743,61	0,16%
AÇÕES - INDEXADO	35.827,18	0,14%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	55.658,72	0,00	0,00	57.424,59	1.765,87	3,17%	2,86%	3,17%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	37.845,72	0,00	0,00	38.743,61	897,89	2,37%	2,00%	2,37%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.761.169,28	0,00	0,00	1.793.658,97	32.489,69	1,84%	1,36%	1,84%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.166.908,28	0,00	0,00	3.223.908,16	56.999,88	1,80%	1,35%	1,80%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	987.480,17	0,00	0,00	1.005.203,03	17.722,86	1,79%	1,34%	1,79%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.335.456,02	0,00	0,00	2.369.412,24	33.956,22	1,45%	1,00%	1,45%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	32.663,29	0,00	0,00	32.987,25	323,96	0,99%	0,65%	0,99%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	263.007,73	0,00	0,00	265.808,75	2.801,02	0,99%	0,65%	0,99%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	623.641,75	0,00	0,00	629.202,66	5.560,91	0,89%	0,49%	0,89%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	178.682,57	0,00	0,00	180.247,00	1.564,43	0,88%	0,49%	0,88%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.006.398,28	0,00	0,00	4.040.737,79	34.339,51	0,86%	0,48%	0,86%
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	365.366,05	0,00	0,00	368.277,05	2.911,00	0,80%	0,32%	0,80%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.866.097,99	0,00	0,00	3.893.726,85	27.628,86	0,71%	0,07%	0,71%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.218.666,89	0,00	0,00	1.226.642,52	7.975,63	0,65%	0,03%	0,65%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.813.709,15	614.000,00	444.000,00	4.012.225,00	28.515,85	0,64%	0,07%	0,71%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	855.428,44	0,00	0,00	860.851,76	5.423,32	0,63%	0,02%	0,63%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	116.175,35	0,00	0,00	116.755,10	579,75	0,50%	0,28%	0,50%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	381.690,42	0,00	0,00	383.571,08	1.880,66	0,49%	0,24%	0,49%
				Total Renda Fixa	263.137,31	1,09%	0,58%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	33.758,49	0,00	0,00	35.827,18	2.068,69	6,13%	6,76%	6,13%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	274.108,26	0,00	1.875,00	287.207,26	14.974,00	5,46%	11,30%	7,95%
			Total Renda Variável		17.042,69	5,54%	10,80%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre / 2017

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.006.012,07	0,00	0,00	3.223.908,16	217.896,09	7,25%	7,25%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.873.022,77	0,00	0,00	4.040.737,79	167.715,02	4,33%	4,33%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.671.064,67	0,00	0,00	1.793.658,97	122.594,30	7,34%	7,34%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.259.381,82	0,00	0,00	2.369.412,24	110.030,42	4,87%	4,87%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.792.459,76	0,00	0,00	3.893.726,85	101.267,09	2,67%	2,67%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.429.626,72	1.871.000,00	1.389.000,00	4.012.225,00	100.598,28	2,40%	2,67%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	937.548,02	0,00	0,00	1.005.203,03	67.655,01	7,22%	7,22%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.199.200,09	0,00	0,00	1.226.642,52	27.442,43	2,29%	2,29%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	603.136,97	0,00	0,00	629.202,66	26.065,69	4,32%	4,32%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	842.095,37	0,00	0,00	860.851,76	18.756,39	2,23%	2,23%
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	354.194,54	0,00	0,00	368.277,05	14.082,51	3,98%	3,98%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	252.577,80	0,00	0,00	265.608,75	13.030,95	5,16%	5,16%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	177.466,12	0,00	5.038,33	180.247,00	7.819,21	4,43%	4,45%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	387.477,63	0,00	10.940,69	383.571,08	7.034,14	1,83%	1,84%
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	52.180,25	0,00	0,00	57.424,59	5.244,34	10,05%	10,05%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	116.751,32	0,00	3.289,23	116.755,10	3.293,01	2,83%	2,84%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	35.702,40	0,00	0,00	38.743,61	3.041,21	8,52%	8,52%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	31.377,49	0,00	0,00	32.987,25	1.609,76	5,13%	5,13%
				Total Renda Fixa	1.015.175,85	4,36%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre / 2017

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	277.401,90	0,00	5.662,50	287.207,26	15.467,86	5,65%	2,80%
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	29.989,72	0,00	0,00	35.827,18	5.837,46	19,46%	19,46%
				Total Renda Variável	21.305,32	7,01%	

