

# Relatório Analítico dos Investimentos em abril de 2018



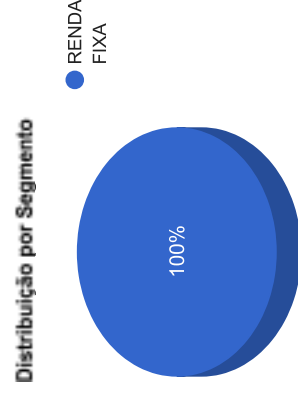
Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

Carteira consolidada de investimentos - base (abril / 2018)

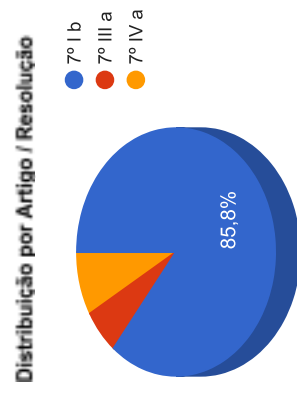
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			0,23	0,00%			Artigo 20
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.452.309,96	11,80%	742	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	2.378.157,76	5,15%	372	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	454.408,01	0,98%	654	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.725.756,53	12,40%	239	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	5.402.242,90	11,70%	589	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.141.124,94	4,64%	1.411	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.494.482,39	3,24%	371	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	4.069.049,27	8,81%	1.222	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	4.437.761,68	9,61%	729	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.179.383,89	2,55%	208	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.565.105,97	9,88%	760	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	2.346.041,12	5,08%	224	0,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SICREDI INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA REFERENCIADO LP	D+1	Não há	1.939.398,25	4,20%	66	1,19%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA REFERENCIADO	D+1	Não há	189.008,85	0,41%	50	0,14%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M LP	D+1	Não há	592.432,82	1,28%	52	0,45%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.470.734,37	3,18%	434	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.069.135,53	2,31%	296	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	525.249,44	1,14%	719	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	759.642,72	1,64%	257	0,15%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
<b>TOTAL -</b>			<b>46.191.426,63</b>				

**Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (abril / 2018)**

Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	39.645.824,42	85,83%	15,00%	25,00%	70,00%	-7.311.825,78
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	2.720.839,92	5,89%	5,00%	10,00%	60,00%	24.994.016,06
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	3.824.762,06	8,28%	5,00%	10,00%	30,00%	10.032.665,93
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	7,00%	15,00%	15,00%	6.928.713,99
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	2.309.571,33
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	2.309.571,33
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>46.191.426,40</b>	<b>100,00%</b>	<b>36,00</b>	<b>70,00</b>	<b>190,00</b>	<b>-</b>



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	10,00%	4.619.142,66
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	10,00%	4.619.142,66
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	7,00%	10,00%	10,00%	4.619.142,66
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	2.309.571,33
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	2.309.571,33
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>15,00</b>	<b>30,00</b>	<b>40,00</b>	<b>-</b>



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: abril / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alinea " b "	39.645.824,42	85,83%	15,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alinea " a "	2.720.839,92	5,89%	5,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alinea " a "	3.824.762,06	8,28%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alinea " a "	0,00	0,00%	7,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alinea " a "	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alinea " b "	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alinea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>46.191.426,40</b>	<b>100,00%</b>	<b>36,00</b>	<b>190,00</b>

Artigos - Renda Variável	Base: abril / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I, Alinea " a "	0,00	0,00%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alinea " a "	0,00	0,00%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00%	7,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alinea " a "	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alinea " b "	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>15,00</b>	<b>40,00</b>

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (abril / 2018)

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	22.063.564,89	47,77%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	19.158.502,17	41,48%	0,00%
SICREDI	2.720.839,92	5,89%	0,01%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	2.248.519,42	4,87%	0,00%

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (abril / 2018)

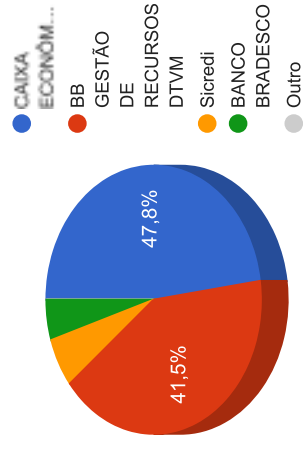
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDKA IPCA 2 Anos	0,82%	3,86%	3,07%	5,34%	12,30%	27,17%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,78%	3,87%	2,89%	5,02%	11,52%	25,80%	0,20%	0,320%	2,65%
CDI	0,52%	2,11%	1,52%	3,25%	8,10%	22,64%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,52%	2,11%	1,53%	3,28%	8,19%	22,87%	0,20%	0,018%	0,11%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	0,50%	2,05%	1,47%	3,15%	8,04%	22,33%	0,15%	0,001%	0,10%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,50%	2,05%	1,47%	3,18%	7,97%	22,40%	0,20%	0,008%	0,14%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,45%	1,84%	1,32%	2,83%	7,23%	20,66%	0,80%	0,000%	0,09%
IRF-M 1	0,51%	2,32%	1,71%	3,53%	8,94%	24,04%	-	-	-
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,50%	2,26%	1,67%	3,45%	8,77%	23,56%	0,20%	0,069%	0,65%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,49%	2,25%	1,67%	3,44%	8,76%	23,60%	0,20%	0,067%	0,63%
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA REFERENCIADO	0,48%	2,28%	1,68%	3,49%	8,87%	23,63%	0,20%	0,065%	0,64%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,48%	2,24%	1,65%	3,42%	8,71%	23,41%	0,10%	0,068%	0,64%
IRF-M	0,47%	4,25%	2,92%	5,64%	12,79%	32,67%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,43%	4,18%	2,86%	5,52%	12,49%	32,10%	0,20%	0,827%	4,41%
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M LP	0,41%	4,29%	2,93%	5,67%	12,56%	32,01%	0,20%	0,830%	4,62%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,36%	4,26%	2,85%	5,59%	12,51%	32,17%	0,20%	0,862%	4,43%
IRF-M 1+	0,45%	4,97%	3,37%	6,41%	14,19%	36,11%	-	-	-

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (abril / 2018)

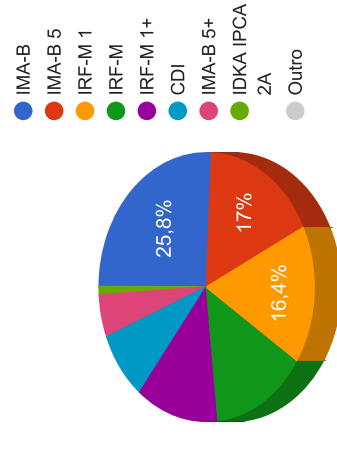
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,31%	5,00%	3,29%	6,36%	13,85%	35,53%	0,20%	1,179%	5,77%
IMA-B 5	0,42%	3,97%	2,60%	4,99%	11,65%	26,36%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,41%	3,89%	2,55%	4,89%	11,44%	25,88%	0,20%	0,481%	3,46%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,40%	3,89%	2,54%	4,88%	11,47%	25,92%	0,20%	0,481%	3,47%
IMA-B 5+	-0,63%	5,27%	0,31%	4,61%	10,45%	31,07%	-	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,64%	5,15%	0,22%	4,42%	9,96%	30,14%	0,20%	2,122%	11,78%
IMA-B	-0,14%	4,79%	1,34%	4,85%	10,93%	29,34%	-	-	-
SICREDI INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA REFERENCIADO LP	-0,10%	4,86%	1,38%	4,85%	10,60%	28,87%	0,20%	1,386%	8,86%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,15%	4,71%	1,28%	4,74%	10,66%	28,76%	0,20%	1,342%	8,97%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,16%	4,72%	1,30%	4,74%	10,70%	28,86%	0,20%	1,346%	8,97%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (abril / 2018)

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	22.063.564,89	47,77%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	19.158.502,17	41,48%
Sicredi	2.720.839,92	5,89%
BANCO BRADESCO	2.248.519,42	4,87%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	0,23	0,00%



Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	11.906.747,12	25,78%
IMA-B 5	7.830.467,72	16,95%
IRF-M 1	7.578.566,95	16,41%
IRF-M	6.524.676,89	14,13%
IRF-M 1+	5.725.756,53	12,40%
CDI	3.824.762,06	8,28%
IMA-B 5+	2.346.041,12	5,08%
IDKA IPCA 2A	454.408,01	0,98%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	0,23	0,00%

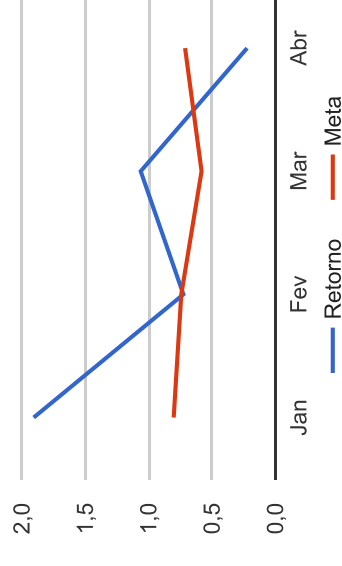
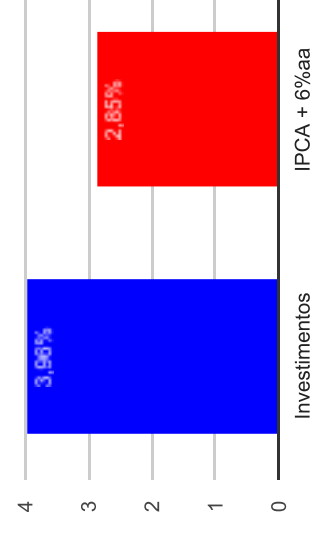




Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	43.157.734,08	612.495,64	339.537,37	44.257.831,25	827.138,90	1,90%	0,80%	237,63%	1,03%
Fevereiro	44.257.831,25	1.180.147,60	1.708.951,54	44.049.201,32	320.174,01	0,72%	0,74%	97,97%	1,06%
Março	44.049.201,32	3.868.344,94	2.507.765,53	45.891.189,66	481.408,93	1,06%	0,58%	183,67%	0,92%
Abril	45.891.189,66	1.340.507,30	1.141.988,80	46.191.426,40	101.718,24	0,22%	0,71%	31,18%	0,82%
Acumulado no ano					1.730.440,08	3,96%	2,85%	138,67%	

**Acumulado no Ano**



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de abril / 2018

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	450.875,79	0,00	0,00	454.408,01	3.532,22	0,78%	0,32%	0,78%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	522.544,78	0,00	0,00	525.249,44	2.704,66	0,52%	0,02%	0,52%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	1.063.808,17	0,00	0,00	1.069.135,53	5.327,36	0,50%	0,00%	0,50%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.463.476,68	0,00	0,00	1.470.734,37	7.257,69	0,50%	0,01%	0,50%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.173.572,98	0,00	0,00	1.179.383,89	5.810,91	0,50%	0,07%	0,50%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.130.728,72	0,00	0,00	2.141.124,94	10.396,22	0,49%	0,07%	0,49%
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA REFERENCIADO	188.100,89	0,00	0,00	189.008,85	907,96	0,48%	0,06%	0,48%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.049.612,65	0,00	0,00	4.069.049,27	19.436,62	0,48%	0,07%	0,48%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.418.864,55	0,00	0,00	4.437.761,68	18.897,13	0,43%	0,83%	0,43%
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M LP	590.038,34	0,00	0,00	592.432,82	2.394,48	0,41%	0,83%	0,41%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.430.301,83	0,00	0,00	5.452.309,96	22.008,13	0,41%	0,48%	0,41%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2.368.570,73	0,00	0,00	2.378.157,76	9.587,03	0,40%	0,48%	0,40%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.489.186,52	0,00	0,00	1.494.482,39	5.295,87	0,36%	0,86%	0,36%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.708.289,10	0,00	0,00	5.725.756,53	17.467,43	0,31%	1,18%	0,31%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	558.002,87	1.340.507,30	1.141.988,80	759.642,72	3.121,35	0,16%	0,00%	0,45%
SICREDI INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA REFERENCIADO LP	1.941.293,07	0,00	0,00	1.939.398,25	-1.894,82	-0,10%	1,39%	-0,10%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.410.378,49	0,00	0,00	5.402.242,90	-8.135,59	-0,15%	1,34%	-0,15%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.572.440,05	0,00	0,00	4.565.105,97	-7.334,08	-0,16%	1,35%	-0,16%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.361.103,45	0,00	0,00	2.346.041,12	-15.062,33	-0,64%	2,12%	-0,64%
			Total Renda Fixa		101.718,24	0,22%	0,82%	