

Relatório Analítico dos Investimentos em outubro de 2017



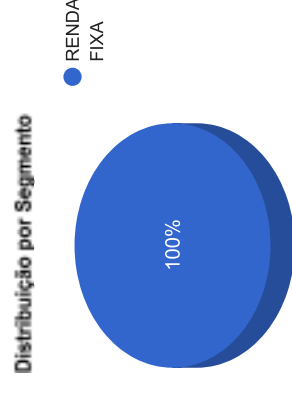
Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

Carteira consolidada de investimentos - base (outubro / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			88,04	0,00%			Artigo 20
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	2.267.407,03	5,29%	347	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	2.246.838,28	5,24%	274	0,17%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	5.157.996,66	12,04%	610	0,10%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	560.621,44	1,31%	50	0,67%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.140.010,56	2,66%	193	0,16%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	936.075,18	2,18%	437	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.036.442,79	2,42%	260	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	944.181,93	2,20%	231	0,25%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.383.232,30	12,56%	203	0,36%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SICREDI INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	1.849.721,83	4,32%	67	1,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.934.510,82	9,18%	1.223	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	13.638,90	0,03%	756	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.198.087,29	12,13%	715	0,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	432.706,97	1,01%	604	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	4.205.417,76	9,82%	699	0,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	987,38	0,00%	764	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.415.408,76	3,30%	312	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.580.548,36	3,69%	1.377	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+1	Não há	182.626,35	0,43%	45	0,15%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.358.570,26	10,17%	780	0,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TOTAL -			42.845.118,89				

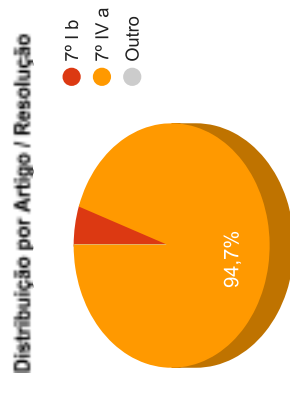
Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (outubro / 2017)

Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 20	100,00%	88,04	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-88,04
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	2.267.407,03	5,29%	30,00%	35,00%	85,00%	34.150.944,03
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	10,00%	20,00%	60,00%	25.707.071,33
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	40.577.623,82	94,71%	5,00%	5,00%	30,00%	-27.724.088,15
Artigo 7º, Inciso VI	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	15,00%	6.426.767,83
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	2.142.255,94
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	2.142.255,94
Total Renda Fixa	100,00%	42.845.118,89	100,00%	45,00	75,00	200,00	-



⚠ 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 III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	15,00%	6.426.767,83
Artigo 8º, Inciso IV	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	2.142.255,94
Artigo 8º, Inciso V	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	2.142.255,94
Artigo 8º, Inciso VI	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	2.142.255,94
Total Renda Variável	30,00%	0,00	0,00%	0,00	25,00	30,00	-



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: outubro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 20	88,04	0,00%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	2.267.407,03	5,29%	30,00%	85,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	10,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40.577.623,82	94,71%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	0,00	0,00%	0,00%	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%
Total Renda Fixa	42.845.118,89	100,00%	45,00	200,00

Artigos - Renda Variável	Base: outubro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Total Renda Variável	0,00	0,00%	0,00	30,00

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	20.249.798,43	47,26%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	17.825.809,45	41,61%	0,00%
SICREDI	2.592.969,62	6,05%	0,01%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	2.176.453,35	5,08%	0,00%

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

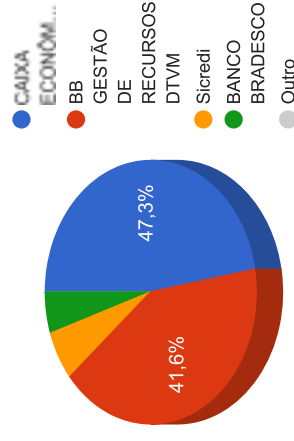
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDKA IPCA 2 Anos	0,80%	12,02%	2,70%	6,61%	14,10%	31,77%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,74%	11,12%	2,62%	6,19%	13,13%	30,89%	0,20%	0,586%	2,81%
CDI	0,64%	8,72%	2,10%	4,70%	11,08%	26,70%	-	-	-
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 BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,65%	8,76%	2,09%	4,71%	11,12%	26,74%	0,20%	0,022%	0,12%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	0,64%	8,72%	2,08%	4,74%	11,03%	26,32%	0,15%	0,009%	0,11%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,63%	8,70%	2,10%	4,64%	11,03%	26,63%	0,20%	0,029%	0,17%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,58%	7,99%	1,89%	4,27%	10,19%	24,64%	0,80%	0,007%	0,11%
IRF-M 1	0,62%	9,81%	2,28%	5,22%	12,29%	28,63%	-	-	-
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,63%	9,71%	2,26%	5,19%	12,11%	28,80%	0,20%	0,091%	0,67%
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%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,60%	9,63%	2,21%	5,13%	12,05%	28,29%	0,20%	0,079%	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%
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%
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)

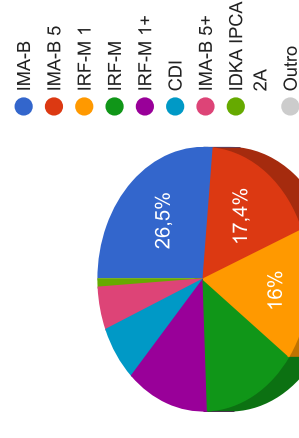
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,08%	13,44%	2,59%	6,60%	15,82%	41,81%	0,20%	1,104%	4,83%
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	0,02%	13,35%	2,53%	6,51%	15,67%	40,78%	0,20%	1,131%	5,04%
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%	-	-	-
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%
IMA-B	-0,38%	12,73%	2,78%	5,80%	14,59%	44,31%	-	-	-
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%
SICREDI INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	-0,45%	12,35%	2,67%	5,49%	14,21%	42,67%	0,20%	1,855%	9,65%
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%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	20.249.798,43	47,26%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	17.825.809,45	41,61%
Sicredi	2.592.969,62	6,05%
BANCO BRADESCO	2.176.453,35	5,08%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	88,04	0,00%



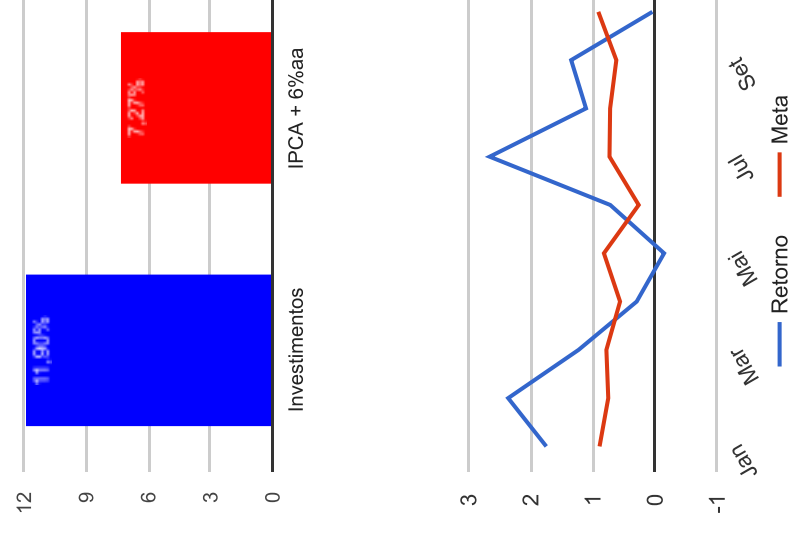
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	11.366.288,75	26,53%
IMA-B 5	7.465.494,32	17,42%
IRF-M 1	6.837.696,09	15,96%
IRF-M	6.181.447,96	14,43%
IRF-M 1+	5.383.232,30	12,56%
CDI	2.931.326,18	6,84%
IMA-B 5+	2.246.838,28	5,24%
IDKA IPCA ZA	432.706,97	1,01%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	88,04	0,00%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	34.254.926,64	1.000.000,00	123.000,00	35.745.731,88	613.805,24	1,75%	0,89%	195,88%	1,91%
Fevereiro	35.745.731,88	1.102.901,49	444.194,63	37.263.875,75	859.437,01	2,36%	0,75%	315,43%	1,08%
Março	37.263.875,75	804.878,86	540.058,37	37.989.249,45	460.553,21	1,23%	0,78%	156,42%	1,28%
Abril	37.989.249,45	1.097.343,87	484.930,04	38.714.490,86	112.827,58	0,29%	0,56%	52,41%	1,12%
Mai	38.714.490,86	1.102.701,79	1.014.643,08	38.744.847,34	-57.702,23	-0,15%	0,82%	-18,10%	7,38%
Junho	38.744.847,34	1.004.940,36	733.596,32	39.296.196,56	280.005,18	0,72%	0,26%	280,74%	1,43%
Julho	39.296.196,56	1.097.985,94	542.755,52	40.910.901,55	1.059.474,57	2,66%	0,73%	365,23%	1,30%
Agosto	40.910.901,55	1.297.099,76	944.545,32	41.720.573,64	457.117,65	1,11%	0,72%	152,96%	1,06%
Setembro	41.720.573,64	787.565,61	694.707,85	42.376.626,80	563.195,40	1,35%	0,62%	215,76%	0,90%
Outubro	42.376.626,80	1.429.414,82	977.865,00	42.845.030,85	16.854,23	0,04%	0,91%	4,33%	1,14%
Acumulado no ano					4.365.567,84	11,90%	7,27%	163,71%	

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 IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	429.510,43	0,00	0,00	432.706,97	3.196,54	0,74%	0,59%	0,74%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12.851,93	695,78	0,00	13.638,90	91,19	0,67%	0,03%	0,68%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	980,96	0,00	0,00	987,38	6,42	0,65%	0,02%	0,65%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	1.029.803,19	0,00	0,00	1.036.442,79	6.639,60	0,64%	0,01%	0,64%
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	181.479,47	0,00	0,00	182.626,35	1.146,88	0,63%	0,09%	0,63%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	930.230,93	0,00	0,00	936.075,18	5.844,25	0,63%	0,03%	0,63%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.570.812,42	0,00	0,00	1.580.548,36	9.735,94	0,62%	0,09%	0,62%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.910.689,43	0,00	0,00	3.934.510,82	23.821,39	0,61%	0,08%	0,61%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.133.258,32	0,00	0,00	1.140.010,56	6.752,24	0,60%	0,08%	0,60%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.174.208,70	0,00	0,00	5.198.087,29	23.878,59	0,46%	0,90%	0,46%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2.257.065,98	0,00	0,00	2.267.407,03	10.341,05	0,46%	0,90%	0,46%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	988.091,33	928.719,04	977.865,00	944.181,93	5.236,56	0,27%	0,01%	0,58%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.202.179,89	0,00	0,00	4.205.417,76	3.237,87	0,08%	1,10%	0,08%
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	560.537,29	0,00	0,00	560.621,44	84,15	0,02%	1,13%	0,02%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.415.442,40	0,00	0,00	1.415.408,76	-33,64	0,00%	1,12%	-0,00%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.394.353,50	0,00	0,00	5.383.232,30	-11.121,20	-0,21%	1,48%	-0,21%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.178.852,96	0,00	0,00	5.157.996,66	-20.856,30	-0,40%	1,82%	-0,40%
SICREDI INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	1.858.076,21	0,00	0,00	1.849.721,83	-8.354,38	-0,45%	1,86%	-0,45%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.878.836,28	500.000,00	0,00	4.358.570,26	-20.266,02	-0,46%	1,83%	-0,41%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.269.365,18	0,00	0,00	2.246.838,28	-22.526,90	-0,99%	2,51%	-0,99%
				Total Renda Fixa	16.854,23	0,04%	1,14%	