

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



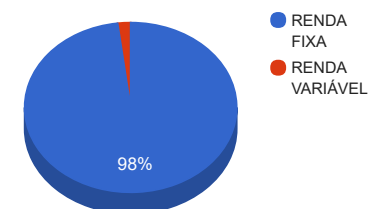
Carteira consolidada de investimentos - base (setembro / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	563.298,83	2,18%	1.221	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.653.747,77	10,28%	771	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	4.723.756,17	18,29%	1.382	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.898.966,94	11,23%	701	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	1.039.201,55	4,02%	283	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.250.359,69	4,84%	259	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	4.929.777,60	19,09%	613	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	1.904.976,14	7,38%	345	0,10%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	4.062.405,48	15,73%	763	0,09%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	D+3	Não há	1.286.312,65	4,98%	359	0,59%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	507.991,98	1,97%	2.876	0,10%	Artigo 8º, Inciso IV
TOTAL -			25.820.794,80				

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

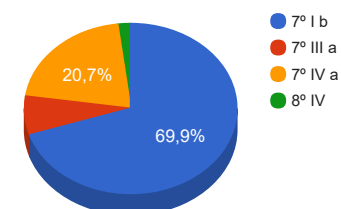
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	18.059.108,55	69,94%	30,00%	40,00%	70,00%	15.447,81
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	1.904.976,14	7,38%	15,00%	30,00%	60,00%	13.587.500,74
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	5.348.718,13	20,71%	5,00%	10,00%	30,00%	2.397.520,31
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	1.291.039,74
Total Renda Fixa	100,00%	25.312.802,82	98,03%	50,00	85,00	165,00	-

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	15,00%	3.873.119,22
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	507.991,98	1,97%	0,00%	5,00%	5,00%	783.047,76
Total Renda Variável	30,00%	507.991,98	1,97%	0,00	15,00	20,00	-

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 "	18.059.108,55	69,94%	30,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	1.904.976,14	7,38%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	5.348.718,13	20,71%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	25.312.802,82	98,03%	50,00	165,00

Artigos - Renda Variável	Base: setembro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	507.991,98	1,97%	0,00%	5,00%
Total Renda Variável	507.991,98	1,97%	0,00	20,00

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
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%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,32%	14,08%	8,56%	5,48%	16,64%	56,75%	0,20%	1,967%	12,79%

IMA-B	1,81%	13,16%	7,30%	5,86%	15,76%	48,59%	-	-	-
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%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,78%	12,94%	7,21%	5,71%	15,46%	47,78%	0,20%	1,328%	9,80%

IMA-B 5	1,01%	10,94%	5,18%	6,58%	13,45%	34,82%	-	-	-
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%	-	-	-
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%

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%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,65%	8,10%	2,27%	4,86%	11,65%	27,28%	0,20%	0,014%	0,11%

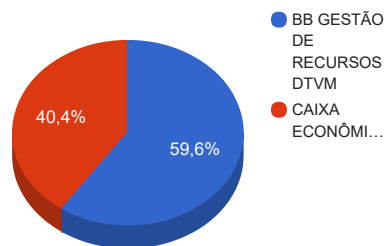
IPCA + 6,00% ao ano	0,62%	6,30%	2,09%	3,77%	8,64%	24,92%	-	-	-
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	0,80%	10,20%	3,98%	5,77%	13,18%	34,46%	0,30%	0,321%	2,53%

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

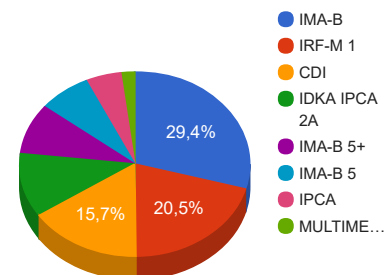
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	0,64%	8,03%	2,25%	4,85%	11,53%	27,29%	-	-	-
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	0,67%	8,17%	2,60%	4,70%	11,64%	30,35%	0,70%	0,143%	0,66%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	15.398.626,54	59,64%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	10.422.168,26	40,36%



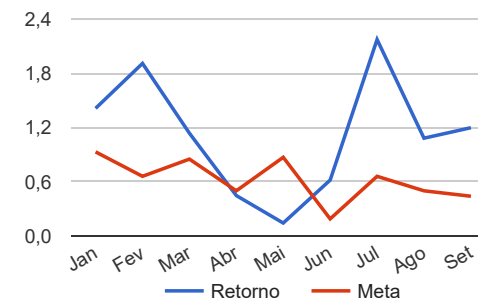
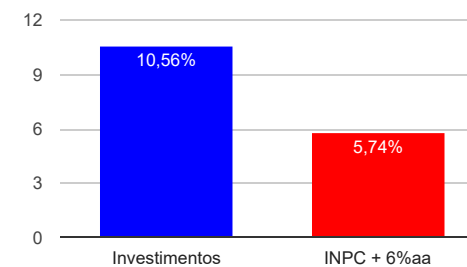
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	7.583.525,37	29,37%
IRF-M 1	5.287.055,00	20,48%
CDI	4.062.405,48	15,73%
IDKA IPCA 2A	2.898.966,94	11,23%
IMA-B 5+	2.289.561,24	8,87%
IMA-B 5	1.904.976,14	7,38%
IPCA	1.286.312,65	4,98%
MULTIMERCADO	507.991,98	1,97%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	21.986.901,12	0,00	102.904,10	22.194.151,45	310.154,43	1,41%	0,93%	151,33%	1,30%
Fevereiro	22.194.151,45	440.574,52	103.986,08	22.960.343,14	429.603,25	1,91%	0,66%	289,75%	0,73%
Março	22.960.343,14	151.334,76	19.393,58	23.354.648,78	262.364,46	1,14%	0,85%	132,89%	0,83%
Abril	23.354.648,78	270.800,00	108.489,19	23.622.166,18	105.206,59	0,45%	0,50%	89,94%	0,75%
Mai	23.622.166,18	265.704,62	104.636,30	23.817.499,38	34.264,88	0,14%	0,87%	16,53%	5,18%
Junho	23.817.499,38	429.913,75	328.827,89	24.066.474,77	147.889,53	0,62%	0,19%	333,69%	0,97%
Julho	24.066.474,77	4.248.943,83	4.089.594,29	24.751.704,14	525.879,83	2,17%	0,66%	330,11%	1,20%
Agosto	24.751.704,14	274.559,69	113.858,85	25.181.729,59	269.324,61	1,08%	0,50%	214,90%	0,91%
Setembro	25.181.729,59	283.612,27	126.264,97	25.642.363,49	303.286,60	1,20%	0,44%	269,92%	0,70%
Acumulado no ano					2.387.974,18	10,56%	5,74%	183,87%	

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(%)
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.221.382,56	0,00	0,00	1.250.359,69	28.977,13	2,37%	2,00%	2,37%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.015.590,34	0,00	0,00	1.039.201,55	23.611,21	2,32%	1,97%	2,32%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.606.828,53	0,00	0,00	2.653.747,77	46.919,24	1,80%	1,35%	1,80%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.843.525,83	0,00	0,00	4.929.777,60	86.251,77	1,78%	1,33%	1,78%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.638.264,90	250.516,26	0,00	1.904.976,14	16.194,98	0,86%	0,65%	0,99%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.874.330,57	0,00	0,00	2.898.966,94	24.636,37	0,86%	0,48%	0,86%
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	1.276.145,14	0,00	0,00	1.286.312,65	10.167,51	0,80%	0,32%	0,80%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.690.237,64	0,00	0,00	4.723.756,17	33.518,53	0,71%	0,07%	0,71%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	702.023,78	2.316,39	145.920,59	563.298,83	4.879,25	0,69%	0,07%	0,71%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.005.506,77	30.779,62	0,00	4.062.405,48	26.119,09	0,65%	0,01%	0,65%
Total Renda Fixa					301.275,08	1,20%	0,72%	

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 JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	504.599,61	0,00	0,00	507.991,98	3.392,37	0,67%	0,14%	0,67%
Total Renda Variável					3.392,37	0,67%	0,14%	

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 (%)
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.574.819,68	37.371,95	12.993,78	4.929.777,60	330.579,75	7,18%	7,21%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.474.387,43	0,00	0,00	2.653.747,77	179.360,34	7,25%	7,25%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.096.115,96	0,00	500.000,00	4.723.756,17	127.640,21	2,66%	2,67%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.778.642,31	0,00	0,00	2.898.966,94	120.324,63	4,33%	4,33%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.701.933,59	274.356,09	0,00	4.062.405,48	86.115,80	2,23%	2,27%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.305.726,72	524.989,22	0,00	1.904.976,14	74.260,20	4,61%	5,16%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	1.202.087,57	0,00	1.250.359,69	48.272,12	4,02%	8,52%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	1.000.000,00	0,00	1.039.201,55	39.201,55	3,92%	8,56%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.936.532,40	6.242,24	1.410.888,28	563.298,83	31.412,47	2,57%	2,67%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.176.446,98	0,00	1.202.124,07	0,00	25.677,09	2,18%	4,83%
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	0,00	1.262.068,72	0,00	1.286.312,65	24.243,93	1,92%	3,98%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.253.020,48	0,00	1.262.068,72	0,00	9.048,24	0,72%	2,23%
Total Renda Fixa					1.096.136,33	4,53%	

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 JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	0,00	500.000,00	0,00	507.991,98	7.991,98	1,60%	2,60%
Total Renda Variável					7.991,98	Microsoft	

VBScript runtime
error '800a000d'

Type mismatch:
'FormatNumber'

/plataforma/relatorios/uRetornoTriRV.asp,
line 143