

Relatório Analítico dos Inv em novem



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

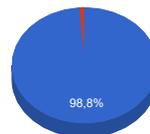
Carteira consolidada de investimentos - base (novembro / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.700.199,30	43,25%	713	0,10%	Art
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.716,35	0,02%	644	0,00%	Art
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.088.011,88	7,02%	545	0,01%	Art
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.398.330,98	15,48%	613	0,06%	Art
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	52.622,48	0,34%	758	0,00%	Art
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.005.941,46	12,95%	1.401	0,01%	Art
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	3.051.840,95	19,70%	352	0,15%	Art
WESTERN ASSET DIVIDEND YIELD FI AÇÕES	D+4	Não há	192.372,96	1,24%	11	0,51%	Ar
		TOTAL -	15.492.036,36				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	0,00	0,00%	30,00%	50,00%	70,00%	10.844.425,45
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	15,00%	20,00%	60,00%	9.295.221,82
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	15.299.663,40	98,76%	5,00%	5,00%	30,00%	-10.652.052,49
Artigo 7º, Inciso VI	0,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	2.323.805,45
Total Renda Fixa	100,00%	15.299.663,40	98,76%	55,00	85,00	175,00	-

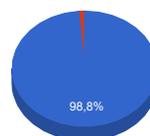
Distribuição por Segmento



⚠ 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 II, Alínea " a "	20,00%	192.372,96	1,24%	0,00%	0,00%	0,00%	-192.372,96
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	2.323.805,45
Artigo 8º, Inciso IV	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	774.601,82
Total Renda Variável	30,00%	192.372,96	1,24%	7,00	15,00	20,00	-

Distribuição por Artigo / Re



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: novembro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	0,00	0,00%	30,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	15.299.663,40	98,76%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	0,00	0,00%	5,00%	15,00%
Total Renda Fixa	15.299.663,40	98,76%	55,00	175,00

Artigos - Renda Variável	Base: novembro / 2017		Lin Inferi
	Carteira (\$)	Carteira (%)	
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	192.372,96	1,24%	0,0
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00%	5,0
Artigo 8º, Inciso IV	0,00	0,00%	2,0
Total Renda Variável	192.372,96	1,24%	7,

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (novembro / 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	11.157.094,22	72,02%	0,00%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	3.054.557,30	19,72%	0,00%
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	1.088.011,88	7,02%	0,00%
WESTERN ASSET	192.372,96	1,24%	0,00%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês
IRF-M 1	0,62%	10,49%	2,00%	4,92%	11,82%	28,26%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,59%	10,31%	1,94%	4,82%	11,61%	27,86%	0,20%	0,042%
Selic	0,57%	9,35%	1,86%	4,34%	10,58%	26,13%	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,56%	9,77%	1,89%	4,59%	11,00%	26,88%	0,20%	0,001%
CDI	0,57%	9,34%	1,86%	4,33%	10,56%	26,09%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,55%	9,37%	1,85%	4,32%	10,58%	26,11%	0,20%	0,019%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,48%	8,38%	1,60%	3,80%	9,52%	23,92%	1,00%	0,004%
IDKA IPCA 2 Anos	0,26%	12,31%	1,98%	6,41%	13,75%	31,84%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,23%	11,37%	1,87%	6,00%	12,74%	30,53%	0,20%	0,505%
IMA-B 5	0,10%	11,59%	1,60%	6,36%	13,15%	31,60%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,09%	11,41%	1,55%	6,25%	12,95%	30,96%	0,20%	0,890%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,09%	11,45%	1,54%	6,27%	12,97%	31,14%	0,20%	0,895%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês
IDIV	-6,67%	19,39%	-0,67%	10,02%	18,34%	84,42%	-	-
WESTERN ASSET DIVIDEND YIELD FI AÇÕES	-4,09%	16,50%	0,03%	9,06%	15,62%	39,71%	2,00%	9,667%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	11.157.094,22	72,02%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	3.054.557,30	19,72%
BANCO BRADESCO	1.088.011,88	7,02%
WESTERN ASSET	192.372,96	1,24%



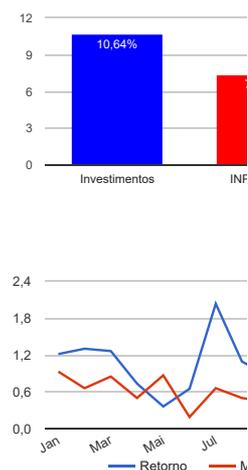
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5	9.752.040,25	62,95%
IDKA IPCA 2A	2.398.330,98	15,48%
IRF-M 1	2.005.941,46	12,95%
CDI	1.143.350,71	7,38%
AÇÕES - SETORIAIS	192.372,96	1,24%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	14.438.742,95	1.200.000,00	0,00	15.828.937,80	190.194,85	1,22%	0,93%	130,47%	0,95%
Fevereiro	15.828.937,80	0,00	0,00	16.035.218,12	206.280,32	1,30%	0,66%	198,03%	0,55%
Março	16.035.218,12	0,00	0,00	16.238.113,88	202.895,76	1,27%	0,85%	148,00%	0,60%
Abril	16.238.113,88	2.800.000,00	200.000,00	18.976.529,08	138.415,20	0,73%	0,50%	147,72%	0,45%
Mai	18.976.529,08	1.350.000,00	1.250.000,00	19.145.651,97	69.122,89	0,36%	0,87%	41,56%	3,29%
Junho	19.145.651,97	0,00	0,00	19.270.159,20	124.507,23	0,65%	0,19%	350,96%	0,64%
Julho	19.270.159,20	1.200.000,00	1.195.000,00	19.667.726,59	392.567,39	2,04%	0,66%	309,72%	0,78%
Agosto	19.667.726,59	800.000,00	1.078.000,00	19.604.795,42	215.068,83	1,09%	0,50%	217,37%	0,47%
Setembro	19.604.795,42	0,00	1.200.000,00	18.574.323,60	169.528,18	0,86%	0,44%	195,01%	0,49%
Outubro	18.574.323,60	0,00	1.600.000,00	17.066.289,44	91.965,84	0,50%	0,86%	57,67%	0,71%
Novembro	17.066.289,44	0,00	1.600.000,00	15.492.036,36	25.746,92	0,15%	0,64%	23,57%	0,76%
Acumulado no ano					1.826.293,41	10,64%	7,33%	145,11%	

Acumulado no An



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR -
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.081.983,53	0,00	0,00	1.088.011,88	6.028,35	0,56%	0
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	52.332,32	0,00	0,00	52.622,48	290,16	0,55%	0
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.703,36	0,00	0,00	2.716,35	12,99	0,48%	0
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.592.452,17	0,00	1.600.000,00	2.005.941,46	13.489,29	0,38%	0
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.392.869,32	0,00	0,00	2.398.330,98	5.461,66	0,23%	0
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.694.220,38	0,00	0,00	6.700.199,30	5.978,92	0,09%	0
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.049.151,06	0,00	0,00	3.051.840,95	2.689,89	0,09%	0
				Total Renda Fixa	33.951,26	0,20%	0

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR -
WESTERN ASSET DIVIDEND YIELD FI AÇÕES	200.577,30	0,00	0,00	192.372,96	-8.204,34	-4,09%	9
				Total Renda Variável	-8.204,34	-4,09%	9