

Relatório Analítico dos Inv emoutu



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

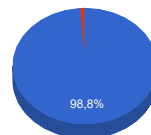
Carteira consolidada de investimentos - base (outubro / 2017)

| Produto / Fundo | Disponibilidade Resgate | Carência | Saldo | Particip. S/ Total | Qtde. Cotistas | % S/ PL Fundo | |
|-------------------------------------------------------------|-------------------------|----------------|----------------------|--------------------|----------------|---------------|-----|
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | D+0 | Não há | 3.592.452,17 | 21,05% | 1.377 | 0,02% | Art |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP | D+1 | Não há | 3.049.151,06 | 17,87% | 347 | 0,15% | Art |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | D+0 | Não há | 6.694.220,38 | 39,22% | 715 | 0,11% | Art |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+0 | Não há | 2.703,36 | 0,02% | 639 | 0,00% | Art |
| BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | D+0 | Não há | 1.081.983,53 | 6,34% | 545 | 0,01% | Art |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | D+0 | Não há | 2.392.869,32 | 14,02% | 604 | 0,06% | Art |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | D+0 | Não há | 52.332,32 | 0,31% | 764 | 0,00% | Art |
| WESTERN ASSET DIVIDEND YIELD FI AÇÕES | D+4 | Não há | 200.577,30 | 1,18% | 12 | 0,51% | Ar |
| | | TOTAL - | 17.066.289,44 | | | | |

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 7º, Inciso I, Alínea " b " | 100,00% | 0,00 | 0,00% | 30,00% | 50,00% | 70,00% | 11.946.402,61 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a " | 60,00% | 0,00 | 0,00% | 15,00% | 20,00% | 60,00% | 10.239.773,66 |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " | 40,00% | 16.865.712,14 | 98,82% | 5,00% | 5,00% | 30,00% | -11.745.825,31 |
| Artigo 7º, Inciso VI | 0,00% | 0,00 | 0,00% | 5,00% | 10,00% | 15,00% | 2.559.943,42 |
| Total Renda Fixa | 100,00% | 16.865.712,14 | 98,82% | 55,00 | 85,00 | 175,00 | - |

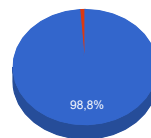
Distribuição por Segmento



! 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% | 200.577,30 | 1,18% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | -200.577,30 |
| Artigo 8º, Inciso III | 10,00% | 0,00 | 0,00% | 5,00% | 10,00% | 15,00% | 2.559.943,42 |
| Artigo 8º, Inciso IV | 0,00% | 0,00 | 0,00% | 2,00% | 5,00% | 5,00% | 853.314,47 |
| Total Renda Variável | 30,00% | 200.577,30 | 1,18% | 7,00 | 15,00 | 20,00 | - |

Distribuição por Artigo / Re



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

| Artigos - Renda Fixa | Base: outubro / 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 " | 16.865.712,14 | 98,82% | 5,00% | 30,00% |
| Artigo 7º, Inciso VI | 0,00 | 0,00% | 5,00% | 15,00% |
| Total Renda Fixa | 16.865.712,14 | 98,82% | 55,00 | 175,00 |

| Artigos - Renda Variável | Base: outubro / 2017 | | Lin Inferi |
|------------------------------------|----------------------|--------------|------------|
| | Carteira (\$) | Carteira (%) | |
| Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a " | 200.577,30 | 1,18% | 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 | 200.577,30 | 1,18% | 7, |

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 | 12.731.874,19 | 74,60% | 0,00% |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM | 3.051.854,42 | 17,88% | 0,00% |
| BRDESCO ASSET MANAGEMENT | 1.081.983,53 | 6,34% | 0,00% |
| WESTERN ASSET | 200.577,30 | 1,18% | 0,00% |

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

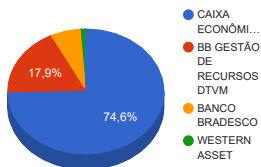
| | Mês | Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | Taxa adm | VaR - Mês |
|-------------------------------------------------------------|-------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|-----------|
| IDKA IPCA 2 Anos | 0,80% | 12,02% | 2,70% | 6,61% | 14,10% | 31,77% | - | - |
| 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% |
| Selic | 0,64% | 8,73% | 2,10% | 4,71% | 11,10% | 26,74% | - | - |
| BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 0,65% | 9,16% | 2,32% | 4,98% | 11,62% | 27,50% | 0,20% | 0,012% |
| CDI | 0,64% | 8,72% | 2,10% | 4,70% | 11,08% | 26,70% | - | - |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,65% | 8,76% | 2,09% | 4,71% | 11,12% | 26,74% | 0,20% | 0,022% |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,56% | 7,86% | 1,83% | 4,15% | 10,07% | 24,57% | 1,00% | 0,010% |
| IRF-M 1 | 0,62% | 9,81% | 2,28% | 5,22% | 12,29% | 28,83% | - | - |
| 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% |
| 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% |
| 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% |

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

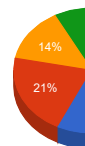
| | Mês | Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | Taxa adm | VaR - Mês |
|---------------------------------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|-----------|
| IDIV | 0,29% | 27,92% | 13,84% | 11,16% | 23,99% | 82,58% | - | - |
| WESTERN ASSET DIVIDEND YIELD FI AÇÕES | -0,90% | 21,47% | 10,41% | 9,52% | 10,28% | 45,41% | 2,00% | 7,966% |

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

| Administrador | Valor | % |
|----------------------------|---------------|--------|
| CAIXA ECONÔMICA FEDERAL | 12.731.874,19 | 74,60% |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM | 3.051.854,42 | 17,88% |
| BANCO BRADESCO | 1.081.983,53 | 6,34% |
| WESTERN ASSET | 200.577,30 | 1,18% |



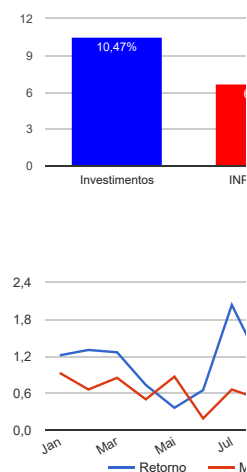
| Sub-segmento | Valor | % |
|-------------------|--------------|--------|
| IMA-B 5 | 9.743.371,44 | 57,09% |
| IRF-M 1 | 3.592.452,17 | 21,05% |
| IDKA IPCA 2A | 2.392.869,32 | 14,02% |
| CDI | 1.137.019,21 | 6,66% |
| AÇÕES - SETORIAIS | 200.577,30 | 1,18% |



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% |
| Acumulado no ano | | | | | 1.800.546,49 | 10,47% | 6,65% | 157,50% | |

Acumulado no An



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 - |
|-------------------------------------------------------------|---------------|------------|--------------|-------------------------|------------------|--------------|----------|
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 2.375.192,46 | 0,00 | 0,00 | 2.392.869,32 | 17.676,86 | 0,74% | 0 |
| BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 1.074.995,74 | 0,00 | 0,00 | 1.081.983,53 | 6.987,79 | 0,65% | 0 |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 3.570.323,19 | 0,00 | 0,00 | 3.592.452,17 | 22.128,98 | 0,62% | 0 |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 2.688,33 | 0,00 | 0,00 | 2.703,36 | 15,03 | 0,56% | 0 |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 6.663.468,93 | 0,00 | 0,00 | 6.694.220,38 | 30.751,45 | 0,46% | 0 |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP | 3.035.244,68 | 0,00 | 0,00 | 3.049.151,06 | 13.906,38 | 0,46% | 0 |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 1.650.017,44 | 0,00 | 1.600.000,00 | 52.332,32 | 2.314,88 | 0,14% | 0 |
| | | | | Total Renda Fixa | 93.781,37 | 0,51% | 0 |

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

| Ativos de Renda Variável | Sado Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | VaR - |
|---------------------------------------|---------------|------------|----------|-----------------------------|------------------|---------------|-------|
| WESTERN ASSET DIVIDEND YIELD FI AÇÕES | 202.392,83 | 0,00 | 0,00 | 200.577,30 | -1.815,53 | -0,90% | 7 |
| | | | | Total Renda Variável | -1.815,53 | -0,90% | 7 |