

Relatório Analítico dos Investimentos em dezembro, 4º Trimestre e ano 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 (dezembro / 2017)

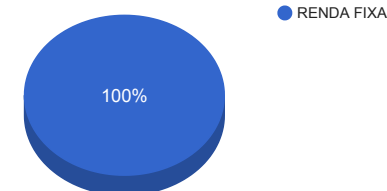
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BNB RPPS PREVIDÊNCIA FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B	D+1	Não há	2.288.825,98	3,26%	56	1,80%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	591.411,24	0,84%	189	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	6.503.995,61	9,27%	1.412	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	44.870.355,76	63,97%	1.226	0,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	4.915.797,34	7,01%	748	0,09%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	1.681.037,35	2,40%	114	0,25%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.980,37	0,00%	632	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	9.224.840,15	13,15%	3.148	0,85%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	64.160,96	0,09%	757	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
Total			70.142.404,76				

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

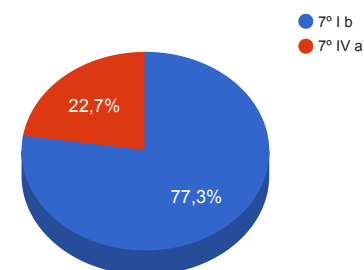
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	54.254.588,59	77,35%	50,00%	70,00%	100,00%	15.887.816,17
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	42.085.442,86
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	42.085.442,86
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	15.887.816,17	22,65%	0,00%	0,00%	30,00%	5.154.905,26
Artigo 7º, Inciso VI	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	15,00%	10.521.360,71
Artigo 8º, Inciso I	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	25,00%	17.535.601,19
Artigo 8º, Inciso V	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	3.507.120,24
Artigo 8º, Inciso VI	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	3.507.120,24
Total Carteira		70.142.404,76					

RENDA FIXA	70.142.404,76	100,00%
------------	---------------	---------

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: dezembro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	54.254.588,59	77,35%	0,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	15.887.816,17	22,65%	0,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	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%
Artigo 8º, Inciso I	0,00	0,00%	0,00%	25,00%
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
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 Fixa	70.142.404,76	100,00%	0,00	475,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (dezembro / 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
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	44.936.497,09	64,06%	0,00%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	13.692.241,54	19,52%	0,00%
BANCO DO NORDESTE DO BRASIL	11.513.666,13	16,41%	0,13%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M 1+	1,46%	16,67%	1,30%	7,07%	16,67%	51,25%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,38%	16,15%	1,09%	6,75%	16,15%	50,47%	0,20%	1,101%	5,97%

IMA-B	0,83%	12,79%	-0,32%	6,96%	12,79%	40,78%	-	-	-
BNB RPPS PREVIDÊNCIA FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B	0,76%	12,11%	-0,34%	6,04%	12,11%	37,57%	0,20%	1,348%	7,62%

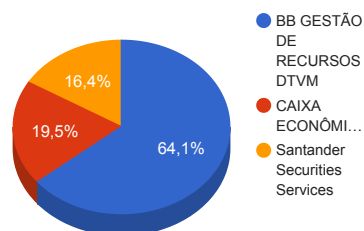
IRF-M 1	0,57%	11,12%	1,82%	4,59%	11,12%	27,47%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,57%	10,93%	1,79%	4,51%	10,93%	27,11%	0,20%	0,031%	0,67%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,56%	10,86%	1,77%	4,48%	10,86%	26,92%	0,10%	0,040%	0,68%

CDI	0,54%	9,93%	1,76%	4,05%	9,93%	25,31%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,58%	10,08%	1,83%	4,14%	10,08%	25,36%	0,20%	0,068%	0,13%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,52%	9,94%	1,74%	4,01%	9,94%	25,33%	0,20%	0,021%	0,13%
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	0,51%	9,70%	1,68%	3,94%	9,70%	24,11%	0,50%	0,025%	0,24%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,45%	8,87%	1,49%	3,51%	8,87%	23,14%	1,00%	0,010%	0,12%

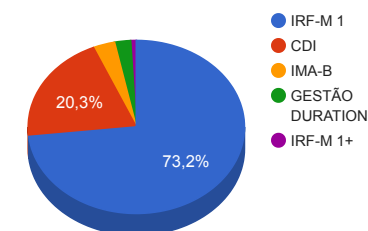
IPCA	0,44%	2,95%	1,14%	1,74%	2,95%	9,42%	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,80%	11,22%	1,49%	5,54%	11,22%	-	0,002	0,423%	4,29%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	44.936.497,09	64,06%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	13.692.241,54	19,52%
Santander Securities Services	11.513.666,13	16,41%



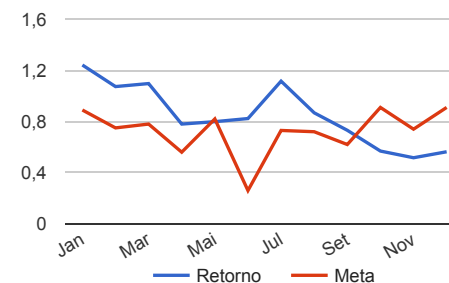
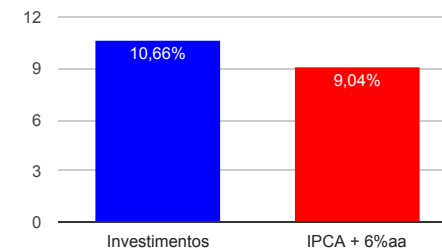
Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	51.374.351,37	73,24%
CDI	14.206.778,82	20,25%
IMA-B	2.288.825,98	3,26%
GESTÃO DURATION	1.681.037,35	2,40%
IRF-M 1+	591.411,24	0,84%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	57.633.174,85	0,00	233.782,97	58.115.238,99	715.847,11	1,24%	0,89%	139,26%	0,37%
Fevereiro	58.115.238,99	1.153.317,10	233.351,97	59.668.820,81	633.616,69	1,07%	0,75%	143,40%	0,17%
Março	59.668.820,81	678.308,31	255.954,32	60.750.280,14	659.105,34	1,10%	0,78%	139,80%	0,22%
Abril	60.750.280,14	1.572.259,26	1.000.911,12	61.799.880,49	478.252,21	0,78%	0,56%	139,85%	0,22%
Mai	61.799.880,49	738.526,00	250.964,88	62.784.947,32	497.505,71	0,80%	0,82%	97,22%	1,34%
Junho	62.784.947,32	735.988,95	289.886,74	63.751.531,55	520.482,02	0,82%	0,26%	322,00%	0,23%
Julho	63.751.531,55	1.365.690,15	1.058.666,75	64.773.286,34	714.731,39	1,12%	0,73%	153,28%	0,25%
Agosto	64.773.286,34	1.631.351,12	1.174.212,38	65.796.641,04	566.215,96	0,87%	0,72%	119,85%	0,13%
Setembro	65.796.641,04	1.637.815,82	1.105.073,37	66.814.451,70	485.068,21	0,73%	0,62%	117,15%	0,12%
Outubro	66.814.451,70	826.820,67	448.735,31	67.574.737,71	382.200,65	0,57%	0,91%	62,59%	0,15%
Novembro	67.574.737,71	1.638.758,20	1.093.416,35	68.471.879,24	351.799,68	0,52%	0,74%	69,79%	0,13%
Dezembro	68.471.879,24	3.971.198,68	2.693.551,42	70.142.404,76	392.878,26	0,56%	0,91%	62,20%	0,10%
Acumulado no ano					6.397.703,23	10,66%	9,04%	117,91%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	583.334,05	0,00	0,00	591.411,24	8.077,19	1,38%	1,10%	1,38%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1.667.773,17	0,00	0,00	1.681.037,35	13.264,18	0,80%	0,42%	0,80%
BNB RPPS PREVIDÊNCIA FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B	2.271.519,22	0,00	0,00	2.288.825,98	17.306,76	0,76%	1,35%	0,76%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	63.789,13	0,00	0,00	64.160,96	371,83	0,58%	0,07%	0,58%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.467.272,51	0,00	0,00	6.503.995,61	36.723,10	0,57%	0,03%	0,57%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	42.527.034,03	2.262.471,98	162.657,23	44.870.355,76	243.506,98	0,54%	0,04%	0,56%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.890.192,16	0,00	0,00	4.915.797,34	25.605,18	0,52%	0,02%	0,52%
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	9.178.417,39	0,00	0,00	9.224.840,15	46.422,76	0,51%	0,02%	0,51%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	822.547,58	1.708.726,70	2.530.894,19	1.980,37	1.600,28	0,06%	0,01%	0,45%
Total Renda Fixa					392.878,26	0,56%	0,10%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre / 2017

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	41.911.283,16	3.079.168,87	868.890,87	44.870.355,76	748.794,60	1,75%	1,77%
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	9.072.455,63	0,00	0,00	9.224.840,15	152.384,52	1,68%	1,68%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.389.581,58	0,00	0,00	6.503.995,61	114.414,03	1,79%	1,79%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.831.623,07	0,00	0,00	4.915.797,34	84.174,27	1,74%	1,74%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1.656.380,30	0,00	0,00	1.681.037,35	24.657,05	1,49%	1,49%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	585.017,52	0,00	0,00	591.411,24	6.393,72	1,09%	1,09%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.464,73	3.357.608,68	3.366.812,21	1.980,37	2.719,17	0,16%	1,49%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	63.006,65	0,00	0,00	64.160,96	1.154,31	1,83%	1,83%
BNB RPPS PREVIDÊNCIA FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B	2.296.639,06	0,00	0,00	2.288.825,98	-7.813,08	-0,34%	-0,34%
Total Renda Fixa					1.126.878,59	1,66%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no Ano de 2017

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	34.768.925,85	10.958.350,46	4.844.765,90	44.870.355,76	3.987.845,35	10,65%	10,86%
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	8.409.354,81	0,00	0,00	9.224.840,15	815.485,34	9,70%	9,70%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.862.979,37	0,00	0,00	6.503.995,61	641.016,24	10,93%	10,93%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.471.348,36	0,00	0,00	4.915.797,34	444.448,98	9,94%	9,94%
BNB RPPS PREVIDÊNCIA FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B	2.041.611,30	0,00	0,00	2.288.825,98	247.214,68	12,11%	12,11%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1.511.487,99	0,00	0,00	1.681.037,35	169.549,36	11,22%	11,22%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	509.181,56	0,00	0,00	591.411,24	82.229,68	16,15%	16,15%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	58.285,61	0,00	0,00	64.160,96	5.875,35	10,08%	10,08%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	4.991.683,80	4.993.741,68	1.980,37	4.038,25	0,32%	8,87%
Total Renda Fixa					6.397.703,23	10,66%	