

Relatório Analítico dos Investimentos em janeiro de 2018



Carteira consolidada de investimentos - base (janeiro / 2018)

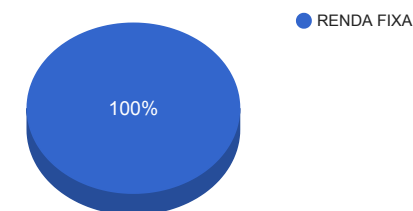
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.139.683,29	4,08%	197	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.881.993,69	10,33%	203	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	846.141,86	3,03%	707	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.716.490,21	16,90%	625	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BANRISUL PREVIDÊNCIA IPCA 2024 FI RENDA FIXA LP	D+0	15/08/2024	1.315.400,00	4,71%	96	1,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.450.139,12	5,20%	734	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2024	397.742,70	1,43%	17	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2024	2.213.388,00	7,93%	104	0,56%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	647.452,08	2,32%	1.418	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BANRISUL SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES LP	D+0	Não há	448.943,05	1,61%	871	0,26%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-GERAL LP	D+0	Não há	2.009.639,39	7,20%	95	1,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA RS TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.202.419,12	4,31%	124	0,43%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	D+0	Não há	1.897.404,90	6,80%	310	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-GERAL LP	D+0	Não há	1.750.237,07	6,27%	72	1,11%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	4.993.011,51	17,89%	756	0,12%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
		TOTAL -	27.910.085,99				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (janeiro / 2018)

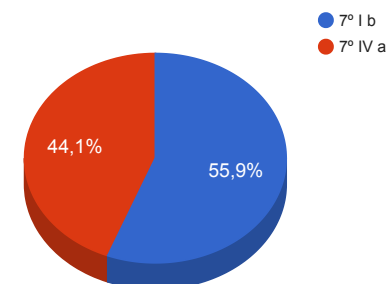
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	15.608.430,95	55,92%	0,00%	51,00%	100,00%	12.301.655,04
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	21,00%	60,00%	16.746.051,59
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	12.301.655,04	44,08%	0,00%	28,00%	40,00%	-1.137.620,64
Total Carteira		27.910.085,99					

RENTA FIXA	27.910.085,99	100,00%
------------	---------------	---------

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: janeiro / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	15.608.430,95	55,92%	0,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	12.301.655,04	44,08%	0,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso V, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	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, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	30,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	27.910.085,99	100,00%	0,00	315,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (janeiro / 2018)

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	17.392.854,97	62,32%	0,00%
BANRISUL CORRETORA	5.524.219,51	19,79%	0,05%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	4.993.011,51	17,89%	0,00%

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (janeiro / 2018)

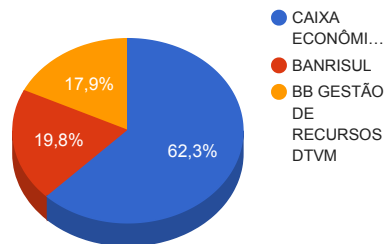
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	3,40%	3,40%	3,46%	6,35%	14,49%	42,84%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,37%	3,37%	3,39%	6,21%	14,24%	42,39%	0,20%	1,795%	9,09%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	3,30%	3,30%	3,39%	6,25%	13,92%	41,75%	0,20%	1,806%	8,69%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3,05%	3,05%	2,77%	3,21%	8,77%	26,90%	0,20%	1,550%	7,93%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3,05%	3,05%	2,77%	3,20%	8,77%	26,80%	0,20%	1,550%	7,92%
IMA Geral	1,76%	1,76%	2,66%	5,28%	12,77%	36,16%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,68%	1,68%	2,54%	5,03%	12,50%	35,78%	0,20%	0,845%	4,39%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-GERAL LP	1,66%	1,66%	2,57%	5,15%	12,85%	34,89%	0,20%	0,843%	4,29%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-GERAL...	1,63%	1,63%	2,56%	5,13%	13,14%	35,17%	0,20%	0,825%	4,29%
IRF-M 1+	1,55%	1,55%	2,94%	5,81%	15,40%	47,98%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,66%	1,66%	2,98%	5,59%	14,97%	47,80%	0,20%	1,178%	5,89%
IMA-B 5	1,33%	1,33%	2,33%	5,17%	12,77%	27,94%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,31%	1,31%	2,28%	5,06%	12,57%	27,44%	0,20%	0,609%	3,43%
IDKA IPCA 2 Anos	0,77%	0,77%	2,20%	4,96%	13,25%	27,12%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,95%	0,95%	2,06%	4,74%	12,22%	26,72%	0,20%	0,448%	2,62%
IRF-M 1	0,59%	0,59%	1,79%	4,11%	10,35%	26,16%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,57%	0,57%	1,74%	4,02%	10,18%	25,79%	0,20%	0,097%	0,65%

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (janeiro / 2018)

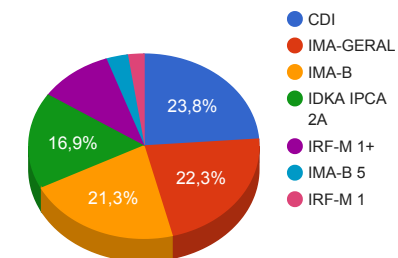
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	0,58%	0,58%	1,70%	3,83%	9,38%	24,73%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,57%	0,57%	1,73%	3,90%	9,51%	24,76%	0,20%	0,021%	0,13%
IPCA	0,29%	0,29%	1,01%	1,79%	2,86%	8,36%	-	-	-
BANRISUL PREVIDÊNCIA IPCA 2024 FI RENDA FIXA LP	1,08%	1,08%	2,65%	2,16%	3,36%	9,88%	0,15%	0,237%	4,00%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA RS TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,57%	0,57%	1,66%	3,79%	9,26%	24,55%	0,20%	0,020%	0,17%
BANRISUL SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES LP	0,53%	0,53%	1,56%	3,58%	8,93%	23,48%	0,50%	0,002%	0,12%

Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (janeiro / 2018)

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	17.392.854,97	62,32%
BANRISUL	5.524.219,51	19,79%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	4.993.011,51	17,89%



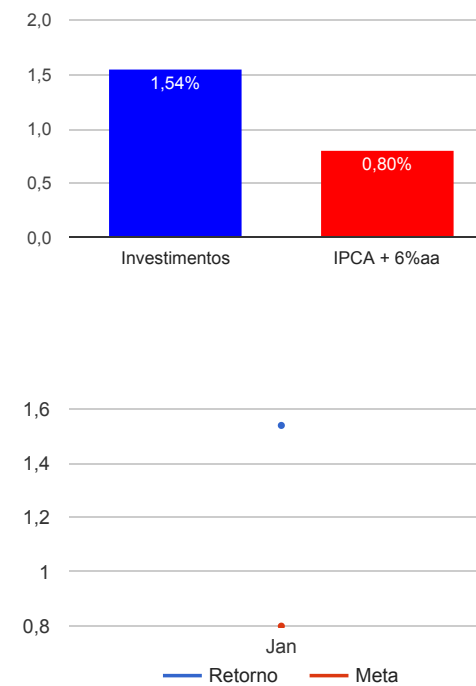
Sub-segmento	Valor	%
CDI	6.644.373,68	23,81%
IMA-GERAL	6.214.959,75	22,27%
IMA-B	5.958.674,72	21,35%
IDKA IPCA 2A	4.716.490,21	16,90%
IRF-M 1+	2.881.993,69	10,33%
IMA-B 5	846.141,86	3,03%
IRF-M 1	647.452,08	2,32%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	27.542.174,73	42.350,15	98.268,30	27.910.085,99	423.829,41	1,54%	0,80%	192,00%	0,74%
Acumulado no ano					423.829,41	1,54%	0,80%	192,00%	

Acumulado no Ano



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de janeiro / 2018

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.402.806,65	0,00	0,00	1.450.139,12	47.332,47	3,37%	1,80%	3,37%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1.836.739,97	0,00	0,00	1.897.404,90	60.664,93	3,30%	1,81%	3,30%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.147.898,00	0,00	0,00	2.213.388,00	65.490,00	3,05%	1,55%	3,05%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	385.975,50	0,00	0,00	397.742,70	11.767,20	3,05%	1,55%	3,05%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.123.827,07	0,00	3.030,52	1.139.683,29	18.886,74	1,68%	0,84%	1,68%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.835.034,47	0,00	0,00	2.881.993,69	46.959,22	1,66%	1,18%	1,66%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	1.815.540,89	0,00	95.237,78	1.750.237,07	29.933,96	1,65%	0,84%	1,66%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA REFERENCIADO...	1.977.390,57	0,00	0,00	2.009.639,39	32.248,82	1,63%	0,82%	1,63%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	835.223,39	0,00	0,00	846.141,86	10.918,47	1,31%	0,61%	1,31%
BANRISUL PREVIDÊNCIA IPCA 2024 FI RENDA FIXA LP	1.301.350,00	0,00	0,00	1.315.400,00	14.050,00	1,08%	0,24%	1,08%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.671.938,47	0,00	0,00	4.716.490,21	44.551,74	0,95%	0,45%	0,95%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	4.964.661,09	0,00	0,00	4.993.011,51	28.350,42	0,57%	0,02%	0,57%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	643.783,41	0,00	0,00	647.452,08	3.668,67	0,57%	0,10%	0,57%
CAIXA RS TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.195.606,26	0,00	0,00	1.202.419,12	6.812,86	0,57%	0,02%	0,57%
BANRISUL SOBERANO FI RENDA FIXA SIMPLES LP	404.398,99	42.350,15	0,00	448.943,05	2.193,91	0,49%	0,00%	0,53%
Total Renda Fixa					423.829,41	1,54%	0,74%	