

Relatório Analítico dos Investimentos em outubro de 2017



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

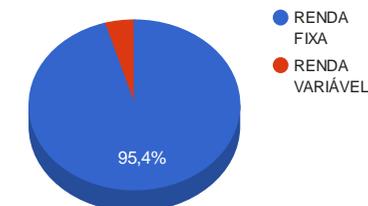
Carteira consolidada de investimentos - base (outubro / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			10.208,67	0,06%			Artigo 20
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	41.299,48	0,22%	312	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CATÂNIA FI RENDA FIXA LP	D+30 ou D+2521	Não há	2.648.447,34	14,38%	10	3,32%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	219.559,42	1,19%	1.223	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	3.827.690,65	20,78%	610	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	9.035,36	0,05%	639	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	442.669,17	2,40%	255	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
AUSTRO IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+4 ou D+1473	Não há	4.402.187,19	23,90%	27	3,33%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	D+1009	Não há	1.783.547,27	9,68%			Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	853.093,95	4,63%	114	0,11%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	509.553,39	2,77%	70	0,65%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	D+90 ou D+150 a D+450	18 meses	699.652,59	3,80%	14	6,28%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BRS PARTICIPAÇÕES FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+1	4 anos	845.914,03	4,59%	34	0,90%	Artigo 8º, Inciso III
RHODES FIC RENDA FIXA LP	D+30 a D+1008	Não há	2.123.523,17	11,53%	6	3,75%	Desenquadrado - RF
		TOTAL -	18.416.381,68				

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

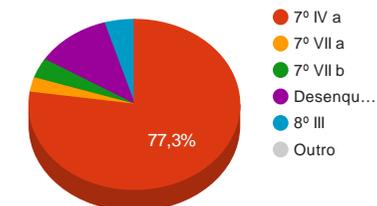
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 20	100,00%	10.208,67	0,06%	0,00%	0,00%	0,00%	-10.208,67
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	0,00	0,00%	30,00%	45,00%	70,00%	12.891.467,18
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	0,00	0,00%	15,00%	20,00%	60,00%	11.049.829,01
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	14.227.529,83	77,25%	5,00%	5,00%	30,00%	-8.702.615,33
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	15,00%	2.762.457,25
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	509.553,39	2,77%	0,00%	0,00%	0,00%	-509.553,39
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	699.652,59	3,80%	0,00%	5,00%	5,00%	221.166,49
Desenquadrado - RF	0,00%	2.123.523,17	11,53%	0,00%	0,00%	0,00%	-2.123.523,17
Total Renda Fixa	100,00%	17.570.467,65	95,41%	50,00	85,00	180,00	-

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	845.914,03	4,59%	5,00%	10,00%	15,00%	1.916.543,22
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	920.819,08
Total Renda Variável	30,00%	845.914,03	4,59%	7,00	15,00	20,00	-

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: outubro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 20	10.208,67	0,06%	0,00%	0,00%
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 "	14.227.529,83	77,25%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	509.553,39	2,77%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	699.652,59	3,80%	0,00%	5,00%
Desenquadrado - RF	2.123.523,17	11,53%	0,00%	0,00%
Total Renda Fixa	17.570.467,65	95,41%	50,00	180,00

Artigos - Renda Variável	Base: outubro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso III	845.914,03	4,59%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Total Renda Variável	845.914,03	4,59%	7,00	20,00

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	Volatilidade - 12 meses
IPCA + 7,00% ao ano	0,99%	8,11%	2,52%	4,63%	9,86%	26,77%	-	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-0,64%	-45,11%	3,46%	-46,70%	-43,80%	-79,00%	0,00%	2,219%	-
IMA-S	0,66%	8,95%	2,14%	4,89%	11,29%	26,80%	-	-	-
CATÂNIA FI RENDA FIXA LP	0,24%	-1,63%	0,30%	-0,21%	-2,63%	-0,60%	0,90%	0,716%	2,26%
CDI	0,64%	8,72%	2,10%	4,70%	11,08%	26,70%	-	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,56%	7,86%	1,83%	4,15%	10,07%	24,57%	1,00%	0,010%	0,12%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	0,30%	3,99%	1,00%	2,07%	5,09%	-21,22%	1,00%	0,032%	0,29%
IRF-M 1	0,62%	9,81%	2,28%	5,22%	12,29%	28,83%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,61%	9,60%	2,21%	5,11%	12,01%	28,25%	0,10%	0,077%	0,68%
IRF-M	0,10%	13,68%	2,66%	6,77%	16,15%	42,35%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,00%	13,35%	2,46%	6,56%	15,72%	41,83%	0,20%	1,123%	4,86%
IMA-B 5+	-1,01%	13,46%	2,74%	5,58%	15,27%	52,38%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,03%	13,20%	2,67%	5,53%	14,99%	51,06%	0,20%	2,529%	12,65%
IMA-B	-0,38%	12,73%	2,78%	5,80%	14,59%	44,31%	-	-	-
RHODES FIC RENDA FIXA LP	0,25%	0,87%	0,75%	-0,12%	0,80%	6,32%	0,30%	0,430%	3,03%
AUSTRO IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	-0,06%	6,18%	1,41%	3,78%	7,65%	26,89%	0,30%	0,963%	3,47%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,40%	12,49%	2,71%	5,65%	14,29%	43,59%	0,20%	1,821%	9,76%

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

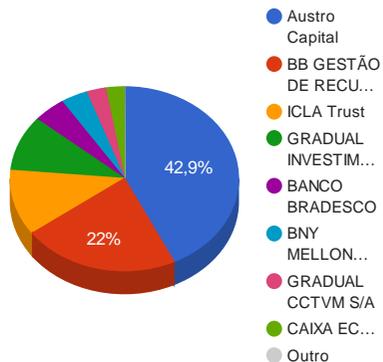
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	-0,42%	12,20%	2,70%	5,45%	14,07%	43,21%	0,20%	1,829%	9,76%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	-	-100,00%	-	-100,00%	-100,00%	-100,00%	0,00%	-	-
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

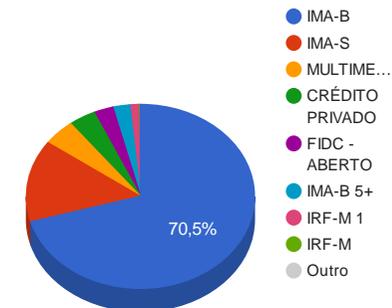
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA	0,42%	2,21%	0,77%	1,09%	2,70%	10,79%	-	-	-
BRS PARTICIPAÇÕES FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-0,29%	-2,00%	-0,69%	-1,31%	-7,70%	21,08%	1,50%	0,204%	5,54%

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

Administrador	Valor	%
Austro Capital	7.896.548,56	42,88%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	4.056.285,43	22,03%
ICLA Trust	2.123.523,17	11,53%
GRADUAL INVESTIMENTOS	1.783.547,27	9,68%
BANCO BRADESCO	853.093,95	4,63%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	699.652,59	3,80%
GRADUAL CCTVM S/A	509.553,39	2,77%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	483.968,65	2,63%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	10.208,67	0,06%

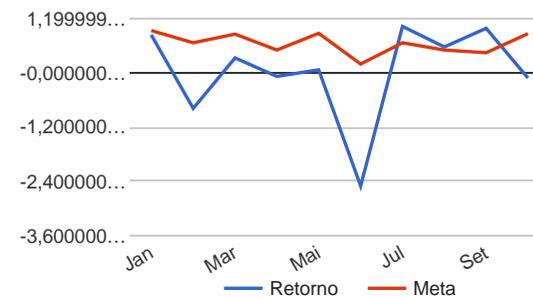
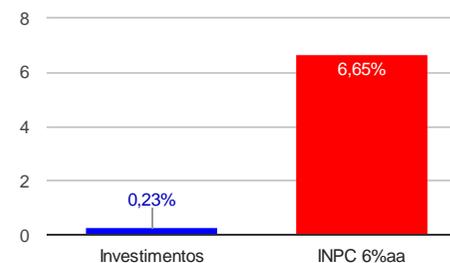


Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	12.990.042,23	70,54%
IMA-S	2.648.447,34	14,38%
MULTIMERCADO	845.914,03	4,59%
CRÉDITO PRIVADO	699.652,59	3,80%
FIDC - ABERTO	509.553,39	2,77%
IMA-B 5+	442.669,17	2,40%
IRF-M 1	219.559,42	1,19%
IRF-M	41.299,48	0,22%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	10.208,67	0,06%
CDI	9.035,36	0,05%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Acumulado no Ano



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 - Mês (%)	Instituição(%)
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.220,04	18.200,00	18.479,96	9.035,36	95,28	0,35%	0,01%	0,56%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	697.544,16	0,00	0,00	699.652,59	2.108,43	0,30%	0,03%	0,30%
RHODES FIC RENDA FIXA LP	2.118.329,35	0,00	0,00	2.123.523,17	5.193,82	0,25%	0,43%	0,25%
CATÂNIA FI RENDA FIXA LP	2.642.197,70	0,00	0,00	2.648.447,34	6.249,64	0,24%	0,72%	0,24%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	24.330,30	195.000,00	0,00	219.559,42	229,12	0,10%	0,08%	0,61%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	41.300,46	0,00	0,00	41.299,48	-0,98	0,00%	1,12%	-0,00%
AUSTRO IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	4.404.730,12	0,00	0,00	4.402.187,19	-2.542,93	-0,06%	0,96%	-0,06%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	1.787.640,34	0,00	0,00	1.783.547,27	-4.093,07	-0,23%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.868.159,94	0,00	25.000,00	3.827.690,65	-15.469,29	-0,40%	1,82%	-0,40%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	856.656,04	0,00	0,00	853.093,95	-3.562,09	-0,42%	1,83%	-0,42%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	512.827,22	0,00	0,00	509.553,39	-3.273,83	-0,64%	2,22%	-0,64%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	447.260,14	0,00	0,00	442.669,17	-4.590,97	-1,03%	2,53%	-1,03%
Total Renda Fixa					-19.656,87	-0,11%	1,14%	

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 - Mês (%)	Instituição(%)
BRS PARTICIPAÇÕES FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	848.339,39	0,00	0,00	845.914,03	-2.425,36	-0,29%	0,20%	-0,29%
Total Renda Variável					-2.425,36	-0,29%	0,20%	

