



Relatório Analítico dos Investimentos em abril 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 (abril / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			24.506,70	0,03%			Artigo 20
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.036.675,91	2,47%	1.339	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	18/08/2018	8.218.244,77	9,97%	100	0,71%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	6.780.947,30	8,22%	717	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	4.938.896,00	5,99%	26	3,46%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	8.009.902,89	9,71%	84	0,61%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.552.832,62	7,95%	720	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	865.459,30	1,05%	32	1,80%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	3.275.818,15	3,97%	627	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	6.331.592,12	7,68%	1.168	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2024	2.760.604,00	3,35%	104	0,75%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	651.086,82	0,79%	193	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.267.493,84	2,75%	769	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	2.354.966,00	2,86%	223	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BANRISUL FOCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+1	Não há	8.202.448,20	9,95%	228	0,70%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL III FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	389.354,68	0,47%	152	0,10%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.782.193,21	3,37%	82	1,77%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	7.859.979,59	9,53%	748	0,13%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	664.070,85	0,81%	608	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BANRISUL PREVIDÊNCIA IPCA 2024 FI RENDA FIXA LP	D+0	15/08/2024	2.530.360,00	3,07%	96	2,27%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+30 a D+2880	Não há	1.624.530,36	1,97%	52	0,45%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE	D+3	Não há	2.112.510,00	2,56%	9.219	0,09%	Artigo 8º, Inciso II

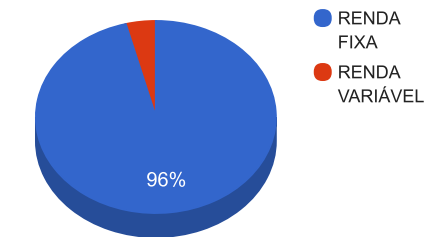
Carteira consolidada de investimentos - base (abril / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se aplica	Não se aplica	1.218.000,00	1,48%		0,76%	Artigo 8º, Inciso VI
		TOTAL -	82.452.473,31				

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

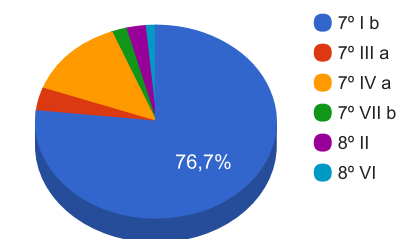
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	63.246.967,92	76,71%	50,00%	60,00%	100,00%	19.205.505,39
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	3.171.547,89	3,85%	0,00%	5,00%	80,00%	62.790.430,76
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	80,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	80,00%	65.961.978,65
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	11.054.410,44	13,41%	10,00%	15,00%	30,00%	13.681.331,55
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	30,00%	24.735.741,99
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	1.624.530,36	1,97%	0,00%	2,00%	5,00%	2.498.093,31
Total Renda Fixa	100,00%	79.097.456,61	95,93%	60,00	90,00	355,00	-

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso II	20,00%	2.112.510,00	2,56%	0,00%	5,00%	10,00%	6.132.737,33
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	4.122.623,67
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	1.218.000,00	1,48%	0,00%	0,00%	5,00%	2.904.623,67
Total Renda Variável	30,00%	3.330.510,00	4,04%	0,00	10,00	60,00	-

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: abril / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	63.246.967,92	76,71%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	3.171.547,89	3,85%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	11.054.410,44	13,41%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	1.624.530,36	1,97%	0,00%	0,00%
Total Renda Fixa	79.097.456,61	95,93%	0,00	0,00

Artigos - Renda Variável	Base: abril / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso II	2.112.510,00	2,56%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso VI	1.218.000,00	1,48%	0,00%	0,00%
Total Renda Variável	3.330.510,00	4,04%	0,00	0,00

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDKA IPCA 2 Anos	0,92%	5,08%	3,95%	7,03%	13,24%	34,55%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,79%	4,16%	3,12%	6,03%	-	-	0,20%	0,312%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,79%	4,15%	3,11%	6,03%	12,75%	-	0,20%	0,309%	1,20%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,76%	4,66%	3,54%	6,53%	12,72%	32,84%	0,20%	0,481%	1,83%
IRF-M 1	0,87%	4,36%	3,04%	6,72%	13,86%	30,56%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,86%	4,30%	3,00%	6,61%	13,65%	30,13%	0,20%	0,157%	0,29%
BANRISUL FOCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,86%	4,30%	2,99%	6,60%	13,61%	29,90%	0,20%	0,161%	0,30%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,86%	4,27%	2,97%	6,56%	13,53%	29,85%	0,10%	0,162%	0,29%
CDI	0,79%	3,84%	2,72%	6,09%	13,45%	29,16%	-	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,79%	3,87%	2,77%	6,12%	13,47%	29,25%	0,20%	0,018%	0,06%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,73%	3,57%	2,53%	5,68%	12,72%	27,15%	1,00%	0,014%	0,09%
IMA-B 5	0,71%	4,83%	3,63%	6,72%	13,17%	33,32%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,70%	4,77%	3,59%	6,62%	12,96%	32,50%	0,20%	0,516%	2,06%
IMA Geral ex-C	0,34%	5,68%	3,84%	7,78%	16,05%	34,07%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,34%	5,73%	3,86%	7,51%	-	-	0,30%	1,053%	-
IMA Geral	0,29%	5,68%	3,80%	7,66%	15,83%	34,03%	-	-	-
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL FI RENDA FIXA LP	0,32%	5,92%	4,10%	7,85%	15,76%	33,42%	0,20%	0,973%	2,89%

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

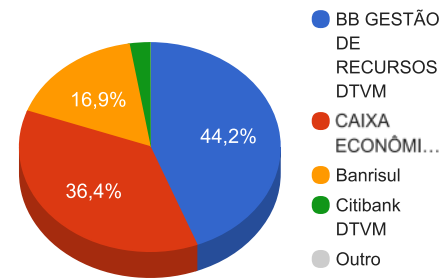
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA	0,14%	1,10%	0,72%	1,59%	4,08%	13,74%	-	-	-
BANRISUL PREVIDÊNCIA IPCA 2024 FI RENDA FIXA LP	0,63%	0,34%	-0,59%	1,83%	4,90%	14,69%	0,15%	0,023%	3,93%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,59%	6,07%	4,61%	8,15%	15,58%	35,74%	0,20%	0,786%	3,50%
IDKA IPCA 20 Anos	-2,49%	10,00%	6,32%	11,99%	26,13%	47,66%	-	-	-
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,43%	9,09%	6,09%	11,14%	22,86%	44,50%	0,20%	3,811%	11,48%
IMA-B	-0,32%	6,55%	4,60%	8,31%	16,59%	36,72%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,79%	1,28%	0,27%	3,05%	5,78%	17,44%	0,20%	0,314%	4,37%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,08%	3,55%	1,75%	5,17%	8,93%	21,23%	0,20%	1,495%	7,01%
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,08%	3,56%	1,76%	5,18%	8,93%	23,15%	0,20%	1,495%	7,00%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,34%	6,47%	4,54%	8,25%	16,41%	34,52%	0,20%	1,894%	5,83%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,34%	6,47%	4,54%	8,17%	16,36%	35,97%	0,20%	1,900%	5,85%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL III FI RENDA FIXA LP	-0,46%	6,51%	4,56%	8,08%	16,43%	34,91%	0,35%	1,895%	5,70%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

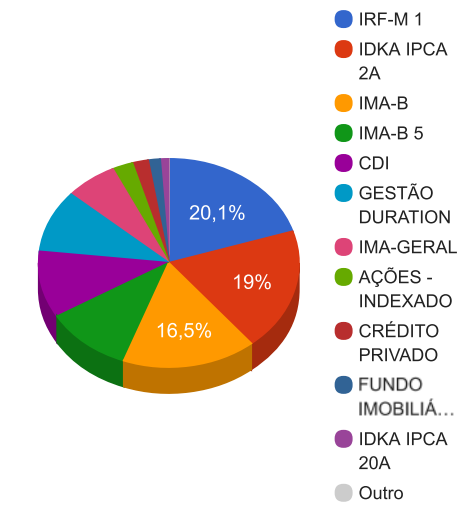
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	0,64%	8,59%	1,13%	0,74%	21,32%	16,32%	-	-	-
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE	0,64%	8,48%	1,07%	0,62%	20,89%	15,79%	0,54%	8,013%	21,26%
IFIX	0,15%	9,17%	5,22%	7,96%	30,95%	45,67%	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	-3,33%	-0,49%	-1,46%	-3,30%	21,27%	35,33%	1,20%	8,214%	23,37%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	36.421.652,56	44,17%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	29.989.447,96	36,37%
Banrisul	13.904.356,09	16,86%
Citibank DTVM	2.112.510,00	2,56%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	24.506,70	0,03%

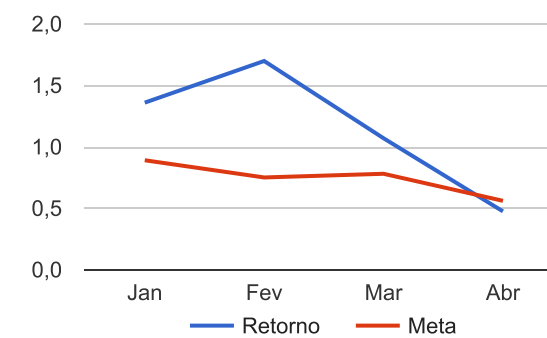
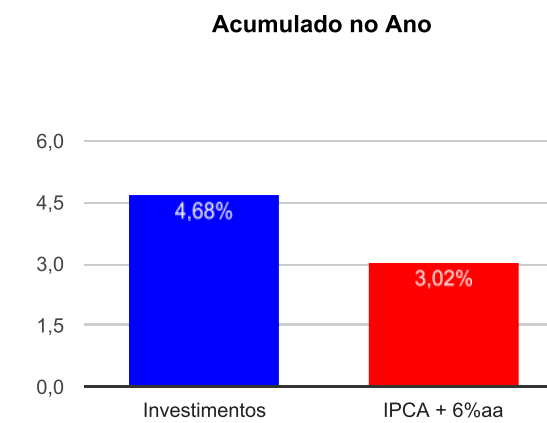


Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	16.570.716,23	20,10%
IDKA IPCA 2A	15.650.278,89	18,98%
IMA-B	13.632.166,67	16,53%
IMA-B 5	8.907.798,62	10,80%
CDI	8.524.050,44	10,34%
GESTÃO DURATION	8.009.902,89	9,71%
IMA-GERAL	5.312.553,21	6,44%
AÇÕES - INDEXADO	2.112.510,00	2,56%
CRÉDITO PRIVADO	1.624.530,36	1,97%
FUNDO IMOBILIÁRIO	1.218.000,00	1,48%
IDKA IPCA 20A	865.459,30	1,05%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	24.506,70	0,03%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	76.016.321,52	6.840.417,77	5.468.959,71	78.439.278,32	1.051.498,74	1,36%	0,89%	152,67%	1,58%
Fevereiro	78.439.278,32	3.635.696,80	3.194.580,78	80.219.431,91	1.339.037,57	1,70%	0,75%	226,34%	1,66%
Março	80.219.431,91	2.646.157,08	2.340.547,66	81.385.852,83	860.811,50	1,07%	0,78%	136,25%	1,20%
Abril	81.385.852,83	1.330.393,50	677.227,00	82.427.966,61	388.947,28	0,47%	0,56%	85,02%	0,95%
Acumulado no ano					3.640.295,09	4,68%	3,02%	155,04%	



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de abril / 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	2.019.261,75	0,00	0,00	2.036.675,91	17.414,16	0,86%	0,16%	0,86%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.277.844,50	0,00	0,00	6.331.592,12	53.747,62	0,86%	0,16%	0,86%
BANRISUL FOCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	8.107.280,47	210.000,00	185.500,00	8.202.448,20	70.667,73	0,85%	0,16%	0,86%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	7.789.066,15	9.120,00	0,00	7.859.979,59	61.793,44	0,79%	0,02%	0,79%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.336.508,00	0,00	0,00	2.354.966,00	18.458,00	0,79%	0,31%	0,79%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.153.881,51	0,00	0,00	8.218.244,77	64.363,26	0,79%	0,31%	0,79%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	645.993,81	0,00	0,00	651.086,82	5.093,01	0,79%	0,31%	0,79%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.729.637,96	0,00	0,00	6.780.947,30	51.309,34	0,76%	0,48%	0,76%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.507.514,16	0,00	0,00	6.552.832,62	45.318,46	0,70%	0,52%	0,70%
BANRISUL PREVIDÊNCIA IPCA 2024 FI RENDA FIXA LP	2.514.500,00	0,00	0,00	2.530.360,00	15.860,00	0,63%	0,02%	0,63%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1.615.013,63	0,00	0,00	1.624.530,36	9.516,73	0,59%	0,79%	0,59%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	223.815,21	926.443,50	491.727,00	664.070,85	5.539,14	0,48%	0,01%	0,73%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.982.772,87	0,00	0,00	8.009.902,89	27.130,02	0,34%	1,05%	0,34%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL FI RENDA FIXA LP	2.773.247,43	0,00	0,00	2.782.193,21	8.945,78	0,32%	0,97%	0,32%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.758.294,00	0,00	0,00	2.760.604,00	2.310,00	0,08%	1,49%	0,08%
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.934.812,00	0,00	0,00	4.938.896,00	4.084,00	0,08%	1,49%	0,08%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.275.254,39	0,00	0,00	2.267.493,84	-7.760,55	-0,34%	1,89%	-0,34%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.287.139,23	0,00	0,00	3.275.818,15	-11.321,08	-0,34%	1,90%	-0,34%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL III FI RENDA FIXA LP	391.160,61	0,00	0,00	389.354,68	-1.805,93	-0,46%	1,90%	-0,46%
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	878.000,15	0,00	0,00	865.459,30	-12.540,85	-1,43%	3,81%	-1,43%
Total Renda Fixa					428.122,28	0,54%	0,65%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE	1.924.855,00	184.830,00	0,00	2.112.510,00	2.825,00	0,13%	8,01%	0,64%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.260.000,00	0,00	0,00	1.218.000,00	-42.000,00	-3,33%	8,21%	-3,33%
Total Renda Variável					-39.175,00	-1,16%	8,09%	