

Relatório Analítico dos Investimentos em maio de 2017



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

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

| Artigos | Resolução % | Carteira \$ | Carteira % | Estratégia de Alocação | | | GAP Superior |
|-----------------------------------|-------------|---------------|------------|------------------------|--------|------------|---------------|
| | | | | Inferior % | Alvo % | Superior % | |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b' | 100,00% | 17.381.830,32 | 72,71% | 0,50% | 70,00% | 100,00% | 6.524.432,22 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a' | 80,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 10,00% | 60,00% | 14.343.757,52 |
| Artigo 7º, Inciso VI | 15,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 15,00% | 3.585.939,38 |
| Artigo 8º, Inciso I | 30,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 25,00% | 5.976.565,64 |
| Artigo 8º, Inciso V | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 5,00% | 1.195.313,13 |
| Artigo 8º, Inciso VI | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 5,00% | 1.195.313,13 |
| DF - Artigo 6º | 100,00% | 40.353,29 | 0,17% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | -40.353,29 |
| Total Carteira | | 17.422.183,61 | | | | | |

| | | |
|------------|---------------|---------|
| RENDA FIXA | 23.946.615,83 | 137,45% |
|------------|---------------|---------|

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

| Artigos | Base: maio / 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' | 17.381.830,32 | 72,59% | 0,00% | 100,00% |
| Artigo 7º, Inciso II | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 15,00% |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a' | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 80,00% |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b' | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 80,00% |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a' | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 30,00% |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'b' | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 30,00% |
| Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a' | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 20,00% |
| Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b' | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 20,00% |
| 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% | 30,00% |
| Artigo 8º, Inciso II | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 20,00% |
| 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% |
| DF - Artigo 6º | 40.353,29 | 0,17% | 0,00% | 0,00% |
| Total | 17.422.183,61 | 72,75% | 0,00 | 580,00 |

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

| | Mês | Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | Taxa adm | VaR - Mês | Volatilidade - 12 meses |
|---|---------|-------|---------|---------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| IRF-M 1 | 0,886% | 6,25% | 2,69% | 6,25% | 13,46% | 30,44% | - | - | - |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 0,90% | 5,24% | 2,91% | 6,48% | 13,48% | 30,10% | 0,20% | 0,955% | 0,65% |
| CDI | 0,808% | 5,65% | 2,54% | 5,65% | 12,85% | 28,75% | - | - | - |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,93% | 4,84% | 2,82% | 6,00% | 13,27% | 29,19% | 0,20% | 0,030% | 0,07% |
| IDKA IPCA 2 Anos | 0,793% | 6,38% | 2,18% | 6,38% | 12,88% | 32,07% | - | - | - |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0,41% | 5,07% | 2,64% | 6,36% | 12,38% | 31,14% | 0,20% | 3,767% | 2,85% |
| IMA-B 5 | 0,525% | 5,47% | 1,32% | 5,47% | 11,91% | 30,87% | - | - | - |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0,08% | 4,86% | 2,17% | 6,30% | 12,18% | 30,41% | 0,20% | 4,893% | 3,58% |
| IPCA + 6,00% ao ano | 0,256% | 4,13% | 1,64% | 4,13% | 9,15% | 25,94% | - | - | - |
| CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 0,84% | 1,08% | 2,32% | 1,78% | 4,23% | 14,27% | 0,20% | 0,060% | 3,92% |
| IMA-B | 0,164% | 5,46% | -1,34% | 5,46% | 13,32% | 32,28% | - | - | - |
| BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA | -0,72% | 5,44% | 0,15% | 8,27% | 14,85% | 29,78% | 0,20% | 10,799% | 8,21% |
| CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP | -0,96% | 5,15% | -0,55% | 8,10% | 15,23% | 30,33% | 0,20% | 12,692% | 9,34% |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | -1,19% | 5,20% | -0,51% | 8,22% | 15,18% | 29,64% | 0,20% | 13,312% | 9,77% |
| IMA-B 5+ | -0,055% | 5,50% | -2,63% | 5,50% | 14,42% | 34,03% | - | - | - |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | -1,67% | 5,47% | -1,66% | 9,38% | 17,23% | 31,89% | 0,20% | 16,974% | 12,71% |
| Não definido | - | - | - | - | - | - | - | - | - |

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

| Administrador | Valor | % |
|----------------------------|---------------|--------|
| CAIXA ECONÔMICA FEDERAL | 20.151.434,25 | 84,15% |
| SANTANDER CACEIS | 3.754.828,29 | 15,68% |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA | 40.353,29 | 0,17% |

| Sub-segmento | Valor | % |
|------------------|---------------|--------|
| IMA-B | 10.872.079,68 | 45,40% |
| IMA-B 5+ | 3.547.626,43 | 14,81% |
| IMA-B 5 | 3.189.130,42 | 13,32% |
| IRF-M 1 | 2.175.000,88 | 9,08% |
| CDI | 1.913.837,88 | 7,99% |
| IDKA IPCA 2A | 913.999,25 | 3,82% |
| DISP. FINANCEIRA | 40.353,29 | 0,17% |

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

| Mês | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (\$) | Retorno (%) | Acumulado no Ano | | |
|------------------|----------------|--------------|------------|---------------|--------------|-------------|------------------|---------|---------|
| | | | | | | | Meta (%) | Gap (%) | VaR (%) |
| Janeiro | 21.777.480,14 | 1.070.132,40 | 0,00 | 23.199.845,58 | 352.233,04 | 1,54% | 0,89% | 172,85% | 2,33% |
| Fevereiro | 23.199.845,58 | 850.340,55 | 551.348,44 | 24.163.241,08 | 664.403,39 | 2,83% | 0,75% | 377,77% | 1,54% |
| Março | 24.163.241,08 | 190.576,59 | 200.000,00 | 24.408.675,09 | 254.857,42 | 1,05% | 0,78% | 134,43% | 1,42% |
| Abril | 24.408.675,09 | 20.784,23 | 390.000,00 | 24.046.147,96 | 6.688,64 | 0,03% | 0,56% | 4,91% | 1,30% |
| Maio | 24.046.147,96 | 190.986,89 | 220.000,00 | 23.906.262,54 | -110.872,31 | -0,46% | 0,82% | -56,12% | 8,98% |
| Acumulado no ano | | | | | 1.167.310,18 | 5,06% | 3,86% | 130,92% | |

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

| Ativos de Renda Fixa | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | VaR - Mês (%) | Instituição(%) |
|---|----------------|------------|------------|------------------|---------------|-------------|---------------|----------------|
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 1.896.166,80 | 0,00 | 0,00 | 1.913.837,88 | 17.671,08 | 0,93% | 0,03% | 0,93% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 2.204.734,33 | 170.000,00 | 220.000,00 | 2.175.000,88 | 20.266,55 | 0,85% | 0,96% | 0,90% |
| CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 1.283.766,00 | 0,00 | 0,00 | 1.294.588,00 | 10.822,00 | 0,84% | 0,06% | 0,84% |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 889.421,12 | 20.986,89 | 0,00 | 913.999,25 | 3.591,24 | 0,39% | 3,77% | 0,41% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 3.186.431,39 | 0,00 | 0,00 | 3.189.130,42 | 2.699,03 | 0,08% | 4,89% | 0,08% |
| BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA | 3.782.186,10 | 0,00 | 0,00 | 3.754.828,29 | -27.357,81 | -0,72% | 10,80% | -0,72% |
| CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP | 3.348.312,90 | 0,00 | 0,00 | 3.316.006,34 | -32.306,56 | -0,96% | 12,69% | -0,96% |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 3.847.133,77 | 0,00 | 0,00 | 3.801.245,05 | -45.888,72 | -1,19% | 13,31% | -1,19% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 3.607.995,55 | 0,00 | 0,00 | 3.547.626,43 | -60.369,12 | -1,67% | 16,97% | -1,67% |
| | | | | Total Renda Fixa | -110.872,31 | -0,46% | 8,98% | |