

Relatório Analítico dos Investimentos em maio de 2017



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

Acumulado no Ano

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	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%
Mai	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	Sado 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%	