

Relatório Analítico dos Investimentos em junho, 2º Trimestre e 1º semestre de 2017



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

Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	17.367.091,92	72,61%	0,50%	70,00%	100,00%	6.550.223,10
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	14.350.389,01
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	15,00%	3.587.597,25
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	25,00%	5.979.328,76
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	1.195.865,75
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	1.195.865,75
DF - Artigo 6º	100,00%	2.812,67	0,01%	0,00%	0,00%	0,00%	-2.812,67
Total Carteira		17.369.904,59					

RENTA FIXA	23.920.127,69	137,71%
------------	---------------	---------

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: junho / 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 '	17.367.091,92	72,60%	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	2.812,67	0,01%	0,00%	0,00%
Total	17.369.904,59	72,62%	0,00	580,00

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (junho / 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	0,87%	6,15%	2,65%	6,15%	13,27%	30,05%	0,20%	0,178%	0,66%
CDI	0,808%	5,65%	2,54%	5,65%	12,85%	28,75%	-	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,82%	5,70%	2,57%	5,70%	12,90%	28,87%	0,20%	0,015%	0,09%
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	0,62%	5,73%	1,84%	5,73%	12,10%	30,86%	0,20%	0,733%	2,80%
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	0,51%	5,40%	1,30%	5,40%	11,73%	30,08%	0,20%	0,925%	3,57%
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	0,48%	1,56%	1,95%	1,56%	3,58%	13,28%	0,20%	0,228%	3,93%
IMA-B	0,164%	5,46%	-1,34%	5,46%	13,32%	32,28%	-	-	-
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	0,27%	5,72%	-0,62%	5,72%	13,25%	30,39%	0,20%	1,937%	8,21%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,15%	5,36%	-1,38%	5,36%	13,17%	30,39%	0,20%	2,446%	9,80%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	0,12%	5,27%	-1,37%	5,27%	13,21%	30,77%	0,20%	2,279%	9,37%
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	-0,07%	5,40%	-2,55%	5,40%	14,20%	32,72%	0,20%	3,268%	12,71%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	20.152.359,97	84,25%
SANTANDER CACEIS	3.764.955,05	15,74%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	2.812,67	0,01%

Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	10.891.737,92	45,53%
IMA-B 5+	3.545.092,92	14,82%
IMA-B 5	3.205.457,30	13,40%
IRF-M 1	2.103.685,17	8,79%
CDI	1.929.615,76	8,07%
IDKA IPCA 2A	940.962,95	3,93%
DISP. FINANCEIRA	2.812,67	0,01%

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%
Maiο	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%
Junho	23.906.262,54	171.165,23	240.000,00	23.917.315,02	79.887,25	0,33%	0,26%	130,72%	1,68%
Acumulado no ano					1.247.197,43	5,41%	4,13%	131,00%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de junho / 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	1.913.837,88	0,00	0,00	1.929.615,76	15.777,88	0,82%	0,02%	0,82%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.175.000,88	150.000,00	240.000,00	2.103.685,17	18.684,29	0,80%	0,18%	0,87%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	913.999,25	21.165,23	0,00	940.962,95	5.798,47	0,62%	0,73%	0,62%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.189.130,42	0,00	0,00	3.205.457,30	16.326,88	0,51%	0,93%	0,51%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.294.588,00	0,00	0,00	1.300.763,00	6.175,00	0,48%	0,23%	0,48%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	3.754.828,29	0,00	0,00	3.764.955,05	10.126,76	0,27%	1,94%	0,27%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.801.245,05	0,00	0,00	3.806.938,53	5.693,48	0,15%	2,45%	0,15%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	3.316.006,34	0,00	0,00	3.319.844,34	3.838,00	0,12%	2,28%	0,12%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.547.626,43	0,00	0,00	3.545.092,92	-2.533,51	-0,07%	3,27%	-0,07%
				Total Renda Fixa	79.887,25	0,33%	1,68%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre / 2017

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.572.739,14	320.000,00	850.000,00	2.103.685,17	60.946,03	2,53%	2,65%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.881.248,83	0,00	0,00	1.929.615,76	48.366,93	2,57%	2,57%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.164.394,49	0,00	0,00	3.205.457,30	41.062,81	1,30%	1,30%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.275.882,00	0,00	0,00	1.300.763,00	24.881,00	1,95%	1,95%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	861.763,14	62.936,35	0,00	940.962,95	16.263,46	1,80%	1,84%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	3.788.530,65	0,00	0,00	3.764.955,05	-23.575,60	-0,62%	-0,62%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	3.366.056,20	0,00	0,00	3.319.844,34	-46.211,86	-1,37%	-1,37%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.860.300,68	0,00	0,00	3.806.938,53	-53.362,15	-1,38%	-1,38%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.637.759,96	0,00	0,00	3.545.092,92	-92.667,04	-2,55%	-2,55%
Total Renda Fixa					-24.296,42	-0,10%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre / 2017

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	3.561.178,44	0,00	0,00	3.764.955,05	203.776,61	5,72%	5,72%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.613.372,73	0,00	0,00	3.806.938,53	193.565,80	5,36%	5,36%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.363.512,64	0,00	0,00	3.545.092,92	181.580,28	5,40%	5,40%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	3.153.525,01	0,00	0,00	3.319.844,34	166.319,33	5,27%	5,27%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.041.354,27	0,00	0,00	3.205.457,30	164.103,03	5,40%	5,40%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.478.169,41	1.540.000,00	1.050.000,00	2.103.685,17	135.515,76	5,48%	6,15%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.515.245,37	830.000,00	515.000,00	1.929.615,76	99.370,39	5,44%	5,70%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.280.769,00	0,00	36.348,44	1.300.763,00	56.342,44	4,48%	1,56%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	770.353,27	123.985,89	0,00	940.962,95	46.623,79	5,61%	5,73%
Total Renda Fixa					1.247.197,43	5,41%	