

Relatório Analítico dos Investimentos em julho de 2017



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

Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	18.018.975,31	72,91%	0,50%	70,00%	100,00%	6.695.820,51
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	14.828.877,49
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	15,00%	3.707.219,37
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	25,00%	6.178.698,96
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	1.235.739,79
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	1.235.739,79
DF - Artigo 6º	100,00%	21.285,16	0,09%	0,00%	0,00%	0,00%	-21.285,16
Total Carteira		18.040.260,47					

RENTA FIXA	24.736.080,98	137,12%
------------	---------------	---------

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: julho / 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 '	18.018.975,31	72,84%	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	21.285,16	0,09%	0,00%	0,00%
Total	18 040 260,47	72,93%	0,00	580,00

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5+	4,674%	10,43%	2,76%	8,01%	15,89%	42,86%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4,61%	10,26%	2,79%	7,91%	15,61%	41,52%	0,20%	2,937%	12,75%
IMA-B	3,998%	9,67%	2,93%	7,66%	14,97%	38,57%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,97%	9,54%	2,89%	7,56%	14,82%	36,75%	0,20%	2,253%	9,84%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	3,77%	9,25%	2,89%	7,22%	14,74%	37,15%	0,20%	2,150%	9,41%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	3,41%	9,33%	2,94%	7,46%	14,51%	35,72%	0,20%	1,815%	8,20%
IMA-B 5	2,846%	8,47%	3,47%	7,23%	13,72%	32,24%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,82%	8,37%	3,44%	7,15%	13,53%	31,44%	0,20%	1,220%	3,64%
IDKA IPCA 2 Anos	2,527%	9,07%	3,80%	7,90%	14,69%	32,93%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,41%	8,28%	3,48%	7,14%	13,54%	31,73%	0,20%	0,943%	2,85%
IRF-M 1	1,049%	7,36%	2,87%	5,99%	13,48%	30,14%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,04%	7,25%	2,84%	5,92%	13,28%	29,76%	0,20%	0,199%	0,66%
CDI	0,797%	6,49%	2,55%	5,35%	12,51%	28,27%	-	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,79%	6,53%	2,56%	5,40%	12,54%	28,36%	0,20%	0,017%	0,10%
IPCA + 6,00% ao ano	0,728%	4,89%	1,82%	3,96%	8,85%	25,40%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,40%	1,96%	1,73%	1,06%	3,10%	12,36%	0,20%	0,100%	3,93%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	20.821.394,83	84,17%
SANTANDER CACEIS	3.893.400,99	15,74%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	21.285,16	0,09%

Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	11.296.714,01	45,67%
IMA-B 5+	3.708.581,89	14,99%
IMA-B 5	3.295.953,87	13,32%
IRF-M 1	2.177.435,88	8,80%
CDI	1.944.772,02	7,86%
IDKA IPCA 2A	985.419,15	3,98%
DISP. FINANCEIRA	21.285,16	0,09%

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%
Julho	23.917.315,02	356.381,02	285.000,00	24.714.795,82	726.099,78	3,03%	0,73%	415,82%	1,61%
Acumulado no ano					1.973.297,21	8,60%	4,89%	175,98%	

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.545.092,92	0,00	0,00	3.708.581,89	163.488,97	4,61%	2,94%	4,61%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.806.938,53	0,00	0,00	3.958.183,53	151.245,00	3,97%	2,25%	3,97%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	3.319.844,34	0,00	0,00	3.445.129,49	125.285,15	3,77%	2,15%	3,77%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	3.764.955,05	0,00	0,00	3.893.400,99	128.445,94	3,41%	1,81%	3,41%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.205.457,30	0,00	0,00	3.295.953,87	90.496,57	2,82%	1,22%	2,82%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	940.962,95	21.381,02	0,00	985.419,15	23.075,18	2,40%	0,94%	2,41%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.103.685,17	335.000,00	285.000,00	2.177.435,88	23.750,71	0,97%	0,20%	1,04%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.929.615,76	0,00	0,00	1.944.772,02	15.156,26	0,79%	0,02%	0,79%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.300.763,00	0,00	0,00	1.305.919,00	5.156,00	0,40%	0,10%	0,40%
Total Renda Fixa					726.099,78	3,03%	1,61%	