

Relatório Analítico dos Investimentos em agosto de 2017



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

Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior	RENDAS FIXAS	24.696.635,87	137,49%
				Inferior %	Alvo %	Superior %				
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	17.932.852,89	72,70%	0,50%	70,00%	100,00%	6.733.725,41			
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	80,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	14.799.946,98			
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	15,00%	3.699.986,75			
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	25,00%	6.166.644,58			
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	1.233.328,92			
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	1.233.328,92			
DF - Artigo 6º	100,00%	30.057,57	0,12%	0,00%	0,00%	0,00%	-30.057,57			
Total Carteira		17.962.910,46								

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: agosto / 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'	17.932.852,89	72,61%	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	30.057,57	0,12%	0,00%	0,00%
Total	17.962.910,46	72,73%	0,00	580,00

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5+	1,363%	11,93%	6,04%	4,21%	16,45%	51,77%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,33%	11,73%	5,93%	4,17%	16,18%	50,38%	0,20%	2,644%	12,76%
IMA-B	1,343%	11,14%	5,57%	5,06%	15,49%	44,95%	-	-	-
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1,36%	10,73%	5,30%	4,72%	15,18%	43,25%	0,20%	1,756%	9,40%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,33%	11,00%	5,51%	4,97%	15,39%	43,43%	0,20%	1,813%	9,83%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	1,20%	10,65%	4,94%	5,10%	14,67%	41,56%	0,20%	1,441%	8,18%
IMA-B 5	1,255%	9,83%	4,68%	6,98%	13,91%	34,53%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,24%	9,71%	4,63%	6,90%	13,72%	33,75%	0,20%	0,717%	3,64%
IDKA IPCA 2 Anos	0,966%	10,12%	4,34%	7,49%	14,33%	34,57%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,96%	9,32%	4,05%	6,79%	13,26%	33,40%	0,20%	0,491%	2,83%
IRF-M 1	0,901%	8,33%	2,86%	5,88%	13,15%	29,98%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,89%	8,21%	2,82%	5,81%	12,96%	29,61%	0,20%	0,081%	0,67%
CDI	0,801%	7,34%	2,43%	5,28%	12,05%	27,88%	-	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,79%	7,38%	2,42%	5,31%	12,08%	27,93%	0,20%	0,007%	0,11%
IPCA + 6,00% ao ano	0,724%	5,65%	1,72%	3,93%	8,58%	25,42%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,86%	0,07%	-1,00%	1,29%	2,94%	12,43%	0,20%	4,371%	3,94%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	20.726.302,95	83,92%
SANTANDER CACEIS	3.940.275,35	15,95%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	30.057,57	0,12%

Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	11.442.869,16	46,33%
IMA-B 5+	3.757.915,51	15,22%
IMA-B 5	3.336.812,01	13,51%
CDI	1.960.167,78	7,94%
IRF-M 1	1.870.602,51	7,57%
IDKA IPCA 2A	1.016.543,33	4,12%
DISP. FINANCEIRA	30.057,57	0,12%

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%
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%
Agosto	24.714.795,82	21.482,42	362.530,85	24.666.578,30	292.830,91	1,18%	0,72%	163,60%	1,53%
Acumulado no ano					2.266.128,12	9,88%	5,65%	175,09%	

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

Ativos de Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	3.445.129,49	0,00	0,00	3.491.889,63	46.760,14	1,36%	1,76%	1,36%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.708.581,89	0,00	0,00	3.757.915,51	49.333,62	1,33%	2,64%	1,33%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.958.183,53	0,00	0,00	4.010.704,18	52.520,65	1,33%	1,81%	1,33%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.295.953,87	0,00	0,00	3.336.812,01	40.858,14	1,24%	0,72%	1,24%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	3.893.400,99	0,00	0,00	3.940.275,35	46.874,36	1,20%	1,44%	1,20%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	985.419,15	21.482,42	0,00	1.016.543,33	9.641,76	0,96%	0,49%	0,96%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.305.919,00	0,00	36.530,85	1.281.668,00	12.279,85	0,94%	4,37%	-1,86%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.177.435,88	0,00	326.000,00	1.870.602,51	19.166,63	0,88%	0,08%	0,89%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.944.772,02	0,00	0,00	1.960.167,78	15.395,76	0,79%	0,01%	0,79%
				Total Renda Fixa	292.830,91	1,18%	1,53%	