

Relatório Analítico dos Investimentos
em setembro e 3º Trimestre 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 (setembro / 2017)

Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	18.122.126,22	73,74%	0,50%	70,00%	100,00%	6.454.958,18
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	80,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	14.746.250,64
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	15,00%	3.686.562,66
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	25,00%	6.144.271,10
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	1.228.854,22
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	1.228.854,22
DF - Artigo 6º	100,00%	32.701,01	0,13%	0,00%	0,00%	0,00%	-32.701,01
Total Carteira		18.154.827,23					

RENDA FIXA	24.609.785,41	135,56%
------------	---------------	---------

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: setembro / 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'	18.122.126,22	73,64%	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	32.701,01	0,13%	0,00%	0,00%
Total	18 154 827,23	73,77%	0,00	580,00

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5+	2,399%	14,62%	8,64%	5,79%	17,29%	57,99%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,37%	14,38%	8,52%	5,75%	16,99%	56,58%	0,20%	2,004%	12,71%
IMA-B	1,811%	13,16%	7,30%	5,86%	15,76%	48,59%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,80%	12,99%	7,25%	5,77%	15,63%	47,62%	0,20%	1,346%	9,79%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1,79%	12,71%	7,07%	5,60%	15,50%	46,97%	0,20%	1,312%	9,37%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	1,67%	12,49%	6,40%	5,74%	14,88%	45,16%	0,20%	1,201%	8,15%
IMA-B 5	1,007%	10,94%	5,18%	6,58%	13,45%	34,82%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,99%	10,80%	5,13%	6,49%	13,27%	34,14%	0,20%	0,646%	3,63%
IDKA IPCA 2 Anos	0,911%	11,13%	4,46%	6,74%	13,66%	34,61%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,89%	10,30%	4,32%	6,24%	12,77%	33,38%	0,20%	0,491%	2,83%
IRF-M 1	0,745%	9,14%	2,72%	5,49%	12,65%	29,70%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,71%	8,98%	2,67%	5,39%	12,45%	29,31%	0,20%	0,071%	0,67%
CDI	0,638%	8,03%	2,25%	4,85%	11,53%	27,29%	-	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,63%	8,06%	2,23%	4,86%	11,56%	27,32%	0,20%	0,017%	0,12%
IPCA + 6,00% ao ano	0,624%	6,30%	2,09%	3,77%	8,64%	24,92%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,50%	0,57%	-0,98%	0,95%	2,64%	12,00%	0,20%	0,237%	3,95%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	20.571.061,57	83,59%
SANTANDER CACEIS	4.006.022,83	16,28%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	32.701,01	0,13%

Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	11.643.335,92	47,31%
IMA-B 5+	3.847.071,54	15,63%
IMA-B 5	3.369.907,58	13,69%
IRF-M 1	1.768.794,37	7,19%
CDI	1.612.496,29	6,55%
IDKA IPCA 2A	1.047.438,70	4,26%
DISP. FINANCEIRA	32.701,01	0,13%

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%
Setembro	24.666.578,30	21.685,59	475.000,00	24.577.084,40	363.820,51	1,47%	0,62%	236,27%	1,05%
Acumulado no ano					2.629.948,63	11,51%	6,30%	182,48%	

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

Ativos de Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.757.915,51	0,00	0,00	3.847.071,54	89.156,03	2,37%	2,00%	2,37%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.010.704,18	0,00	0,00	4.082.891,20	72.187,02	1,80%	1,35%	1,80%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	3.491.889,63	0,00	0,00	3.554.421,89	62.532,26	1,79%	1,31%	1,79%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	3.940.275,35	0,00	0,00	4.006.022,83	65.747,48	1,67%	1,20%	1,67%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.336.812,01	0,00	0,00	3.369.907,58	33.095,57	0,99%	0,65%	0,99%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.016.543,33	21.685,59	0,00	1.047.438,70	9.209,78	0,89%	0,49%	0,89%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.870.602,51	0,00	115.000,00	1.768.794,37	13.191,86	0,71%	0,07%	0,71%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.960.167,78	0,00	360.000,00	1.612.496,29	12.328,51	0,63%	0,02%	0,63%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.281.668,00	0,00	0,00	1.288.040,00	6.372,00	0,50%	0,24%	0,50%
				Total Renda Fixa	363.820,51	1,47%	1,05%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre / 2017

Ativos de Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.545.092,92	0,00	0,00	3.847.071,54	301.978,62	8,52%	8,52%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.806.938,53	0,00	0,00	4.082.891,20	275.952,67	7,25%	7,25%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	3.764.955,05	0,00	0,00	4.006.022,83	241.067,78	6,40%	6,40%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	3.319.844,34	0,00	0,00	3.554.421,89	234.577,55	7,07%	7,07%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.205.457,30	0,00	0,00	3.369.907,58	164.450,28	5,13%	5,13%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.103.685,17	335.000,00	726.000,00	1.768.794,37	56.109,20	2,58%	2,67%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.929.615,76	0,00	360.000,00	1.612.496,29	42.880,53	2,22%	2,23%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	940.962,95	64.549,03	0,00	1.047.438,70	41.926,72	4,30%	4,32%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.300.763,00	0,00	36.530,85	1.288.040,00	23.807,85	1,84%	-0,98%
Total Renda Fixa					1.382.751,20	5,79%	