

Relatório Analítico dos Investimentos em outubro de 2017



Carteira consolidada de investimentos - base (outubro / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2018	1.299.196,00	5,40%	163	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.247.941,94	5,19%	764	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '

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

Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	17.936.342,84	74,66%	0,50%	70,00%	100,00%	6.087.567,33
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	14.414.346,10
Artigo 7º, Inciso VI	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	15,00%	3.603.586,53
Artigo 8º, Inciso I	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	25,00%	6.005.977,54
Artigo 8º, Inciso V	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	1.201.195,51
Artigo 8º, Inciso VI	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	1.201.195,51
DF - Artigo 6º	100,00%	13.677,87	0,06%	0,00%	0,00%	0,00%	-13.677,87
Total Carteira		17.950.020,71					

RENDA FIXA	24.037.588,04	133,91%
------------	---------------	---------

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: outubro / 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 '	17.936.342,84	74,62%	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	13.677,87	0,06%	0,00%	0,00%
Total	17.950.020,71	74,67%	0,00	580,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (outubro / 2017)

Artigo 14º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR)

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	20.033.277,85	83,34%	0,01%
BANCO DO NORDESTE DO BRASIL	3.990.632,32	16,60%	0,05%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA + 6,00% ao ano	0,909%	7,27%	2,27%	4,13%	8,84%	24,42%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,87%	1,44%	-0,51%	1,20%	2,91%	11,66%	0,20%	0,093%	3,94%
IDKA IPCA 2 Anos	0,801%	12,02%	2,70%	6,61%	14,10%	31,77%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,74%	11,12%	2,62%	6,19%	13,13%	30,89%	0,20%	0,586%	2,81%
CDI	0,643%	8,72%	2,10%	4,70%	11,08%	26,70%	-	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,65%	8,76%	2,09%	4,71%	11,12%	26,74%	0,20%	0,022%	0,12%
IRF-M 1	0,620%	9,81%	2,28%	5,22%	12,29%	28,83%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,62%	9,66%	2,24%	5,14%	12,09%	28,45%	0,20%	0,091%	0,67%
IMA-B 5	0,484%	11,48%	2,77%	6,34%	13,48%	32,18%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,46%	11,31%	2,72%	6,25%	13,27%	31,57%	0,20%	0,898%	3,64%
IMA-B 5+	-1,011%	13,46%	2,74%	5,58%	15,27%	52,38%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,03%	13,20%	2,67%	5,53%	14,99%	51,06%	0,20%	2,529%	12,65%
IMA-B	-0,382%	12,73%	2,78%	5,80%	14,59%	44,31%	-	-	-
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	-0,38%	12,06%	2,50%	5,51%	13,86%	41,18%	0,20%	1,693%	8,13%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-0,39%	12,27%	2,77%	5,74%	14,09%	42,80%	0,20%	1,745%	9,32%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,41%	12,53%	2,73%	5,69%	14,41%	43,66%	0,20%	1,825%	9,75%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	20.033.277,85	83,34%
SANTANDER CACEIS	3.990.632,32	16,60%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	13.677,87	0,06%

Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	11.597.109,86	48,25%
IMA-B 5+	3.807.582,70	15,84%
IMA-B 5	3.385.459,47	14,08%
IRF-M 1	1.609.431,64	6,70%
CDI	1.247.941,94	5,19%
IDKA IPCA 2A	1.077.188,56	4,48%
DISP. FINANCEIRA	13.677,87	0,06%

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%
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%
Outubro	24.577.084,40	21.877,45	545.000,00	24.023.910,17	-30.051,68	-0,12%	0,91%	-13,45%	1,41%
Acumulado no ano					2.599.896,95	11,37%	7,27%	156,36%	

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.288.040,00	0,00	0,00	1.299.196,00	11.156,00	0,87%	0,09%	0,87%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.047.438,70	21.877,45	0,00	1.077.188,56	7.872,41	0,74%	0,59%	0,74%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.612.496,29	0,00	375.000,00	1.247.941,94	10.445,65	0,65%	0,02%	0,65%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.768.794,37	0,00	170.000,00	1.609.431,64	10.637,27	0,60%	0,09%	0,62%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.369.907,58	0,00	0,00	3.385.459,47	15.551,89	0,46%	0,90%	0,46%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	4.006.022,83	0,00	0,00	3.990.632,32	-15.390,51	-0,38%	1,69%	-0,38%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	3.554.421,89	0,00	0,00	3.540.429,39	-13.992,50	-0,39%	1,74%	-0,39%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.082.891,20	0,00	0,00	4.066.048,15	-16.843,05	-0,41%	1,83%	-0,41%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.847.071,54	0,00	0,00	3.807.582,70	-39.488,84	-1,03%	2,53%	-1,03%
				Total Renda Fixa	-30.051,68	-0,12%	1,41%	