

Relatório Analítico dos Investimentos em agosto 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 (agosto / 2017)

Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	90.365.164,18	98,31%	30,00%	35,00%	70,00%	-26.022.979,99
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	0,00	0,00%	15,00%	20,00%	60,00%	55.150.443,59
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	1.552.241,80	1,69%	5,00%	5,00%	30,00%	26.022.979,99
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	13.787.610,90
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	4.595.870,30
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	4.595.870,30
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	13.787.610,90
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	4.595.870,30
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	4.595.870,30
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	4.595.870,30
Total Carteira		91.917.405,98					

RENDA FIXA	91.917.405,98	100,00%
RENDA VARIÁVEL	0,00	0,00%

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: agosto / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	90.365.164,18	98,31%	30,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	1.552.241,80	1,69%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	0,00	0,00%	5,00%	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 III	0,00	0,00%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Total	91.917.405,98	100,00%	66,00	215,00

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+	1,36%	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	1,34%	11,14%	5,57%	5,06%	15,49%	44,95%	-	-	-
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%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,32%	10,97%	5,49%	4,92%	15,22%	44,11%	0,20%	1,808%	9,85%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,99%	9,56%	4,09%	6,64%	13,51%	33,62%	0,20%	0,547%	3,58%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-2,05%	2,14%	0,14%	2,99%	5,74%	17,74%	0,20%	4,288%	4,41%
IMA-B 5	1,25%	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%
IMA Geral	1,07%	10,21%	4,28%	5,86%	15,03%	37,79%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,03%	10,12%	4,20%	5,85%	15,17%	37,24%	0,20%	0,879%	4,78%
IRF-M	1,06%	11,91%	4,79%	7,25%	18,00%	40,09%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,04%	11,73%	4,73%	7,08%	17,74%	39,52%	0,20%	0,975%	4,87%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,01%	11,75%	4,73%	7,05%	17,80%	39,40%	0,20%	0,989%	4,89%
IDKA IPCA 2 Anos	0,97%	10,12%	4,34%	7,49%	14,33%	34,57%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,98%	9,35%	4,08%	6,76%	13,28%	33,34%	0,20%	0,487%	2,90%
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%

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
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,68%	7,94%	2,91%	5,84%	11,82%	29,95%	0,20%	0,287%	1,90%
IRF-M 1	0,90%	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%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,88%	8,17%	2,83%	5,78%	12,88%	29,36%	0,10%	0,081%	0,68%
CDI	0,80%	7,34%	2,43%	5,28%	12,05%	27,88%	-	-	-
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,72%	6,76%	2,21%	4,84%	11,14%	25,78%	0,80%	0,000%	0,10%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,70%	6,67%	2,16%	4,76%	11,07%	25,76%	1,00%	0,003%	0,10%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	48.941.941,30	53,25%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	42.975.464,68	46,75%

Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	26.509.902,52	28,84%
IRF-M 1	25.415.474,55	27,65%
IDKA IPCA 2A	19.681.135,11	21,41%
IRF-M	8.246.171,85	8,97%
IMA-B 5	7.709.960,09	8,39%
IMA-B 5+	2.633.273,85	2,86%
CDI	1.552.241,80	1,69%
IMA-GERAL	169.246,21	0,18%

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Acumulado no Ano

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de agosto / 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	2.598.704,44	0,00	0,00	2.633.273,85	34.569,41	1,33%	2,64%	1,33%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.721.382,77	0,00	0,00	9.850.374,59	128.991,82	1,33%	1,81%	1,33%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.325.035,30	0,00	0,00	14.514.497,26	189.461,96	1,32%	1,81%	1,32%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.048.000,67	0,00	0,00	7.135.370,86	87.370,19	1,24%	0,72%	1,24%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	452.477,23	0,00	0,00	457.170,17	4.692,94	1,04%	0,98%	1,04%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	167.524,69	0,00	0,00	169.246,21	1.721,52	1,03%	0,88%	1,03%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.711.349,62	0,00	0,00	7.789.001,68	77.652,06	1,01%	0,99%	1,01%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.447.574,12	0,00	0,00	10.550.411,39	102.837,27	0,98%	0,49%	0,98%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.184.242,26	0,00	60.483,66	2.145.030,67	21.272,07	0,97%	0,55%	0,99%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.462.482,75	0,00	0,00	8.544.059,37	81.576,62	0,96%	0,49%	0,96%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.091.527,46	0,00	0,00	12.199.101,48	107.574,02	0,89%	0,08%	0,89%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.101.411,62	0,00	0,00	13.216.373,07	114.961,45	0,88%	0,08%	0,88%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	586.589,80	0,00	15.948,41	574.589,23	3.947,84	0,67%	4,29%	-2,05%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	599.253,78	0,00	16.610,03	586.664,35	4.020,60	0,67%	0,29%	0,68%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.145.580,01	1.039.132,18	691.347,04	1.505.317,77	11.952,62	0,55%	0,00%	0,70%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	13.727,67	154.482,13	121.752,14	46.924,03	466,37	0,28%	0,00%	0,72%
Total Renda Fixa					973.068,76	1,07%	0,87%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	0,00	200.000,00	212.349,27	0,00	12.349,27	6,17%	5,15%	6,95%
Total Renda Variável					12.349,27	-100,00%	0,00%	

