

Relatório Analítico dos Inv em ju



Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

Carteira consolidada de investimentos - base (julho / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.513.728,73	17,87%	1.367	0,03%	Art
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.717.236,11	34,15%	703	0,11%	Art
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.331.723,11	11,86%	594	0,06%	Art
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	2.968.587,81	15,09%	329	0,16%	Art
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	2.894.721,20	14,72%	766	0,05%	Art
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.654,77	0,01%	620	0,00%	Art
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.057.415,51	5,38%	493	0,01%	Art
WESTERN ASSET DIVIDEND YIELD FI AÇÕES	D+4	Não há	181.659,35	0,92%	6	0,51%	
		TOTAL -	19.667.726,59				

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

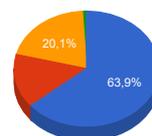
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	12.562.687,95	63,87%	30,00%	50,00%	70,00%	1.204.720,66
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	2.968.587,81	15,09%	15,00%	20,00%	60,00%	8.832.048,14
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	3.954.791,48	20,11%	5,00%	5,00%	30,00%	1.945.526,50
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	2.950.158,99
Total Renda Fixa	100,00%	19.486.067,24	99,08%	55,00	85,00	175,00	-

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	181.659,35	0,92%	5,00%	10,00%	15,00%	2.768.499,64
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	983.386,33
Total Renda Variável	30,00%	181.659,35	0,92%	7,00	15,00	20,00	-

Distribuição por Artigo / Re



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: julho / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	12.562.687,95	63,87%	30,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	2.968.587,81	15,09%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	3.954.791,48	20,11%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	0,00	0,00%	5,00%	15,00%
Total Renda Fixa	19.486.067,24	99,08%	55,00	175,00

Artigos - Renda Variável	Base: julho / 2017		Lin Inferi
	Carteira (\$)	Carteira (%)	
Artigo 8º, Inciso III	181.659,35	0,92%	5,0
Artigo 8º, Inciso IV	0,00	0,00%	2,0
Total Renda Variável	181.659,35	0,92%	7,

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

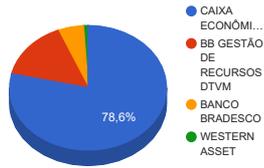
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês
IMA-B 5	2,85%	8,47%	3,47%	7,23%	13,72%	32,24%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2,85%	8,41%	3,47%	7,19%	13,59%	31,63%	0,20%	1,221%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,82%	8,37%	3,44%	7,15%	13,53%	31,44%	0,20%	1,220%
IDKA IPCA 2 Anos	2,53%	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%
IRF-M 1	1,05%	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%
Selic	0,80%	6,50%	2,56%	5,35%	12,52%	28,31%	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,81%	6,68%	2,60%	5,53%	12,94%	28,82%	0,20%	0,008%
CDI	0,80%	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%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,71%	5,92%	2,28%	4,86%	11,57%	26,18%	1,00%	0,009%

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

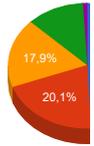
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês
IDIV	4,82%	12,37%	-2,35%	3,49%	27,11%	42,43%	-	-
WESTERN ASSET DIVIDEND YIELD FI AÇÕES	1,92%	10,01%	-0,81%	2,37%	5,77%	20,43%	2,00%	3,486%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	15.457.409,15	78,59%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	2.971.242,58	15,11%
BANCO BRADESCO	1.057.415,51	5,38%
WESTERN ASSET	181.659,35	0,92%



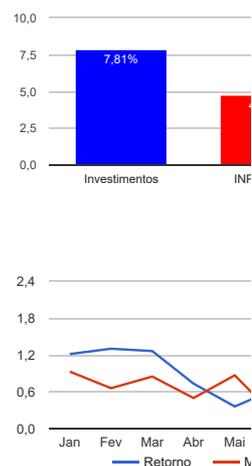
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5	9.685.823,92	49,25%
CDI	3.954.791,48	20,11%
IRF-M 1	3.513.728,73	17,87%
IDKA IPCA 2A	2.331.723,11	11,86%
AÇÕES - SETORIAIS	181.659,35	0,92%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	14.438.742,95	1.200.000,00	0,00	15.828.937,80	190.194,85	1,22%	0,93%	130,47%	0,95%
Fevereiro	15.828.937,80	0,00	0,00	16.035.218,12	206.280,32	1,30%	0,66%	198,03%	0,55%
Março	16.035.218,12	0,00	0,00	16.238.113,88	202.895,76	1,27%	0,85%	148,00%	0,60%
Abril	16.238.113,88	2.800.000,00	200.000,00	18.976.529,08	138.415,20	0,73%	0,50%	147,72%	0,45%
Mai	18.976.529,08	1.350.000,00	1.250.000,00	19.145.651,97	69.122,89	0,36%	0,87%	41,56%	3,29%
Junho	19.145.651,97	0,00	0,00	19.270.159,20	124.507,23	0,65%	0,19%	350,96%	0,64%
Julho	19.270.159,20	1.200.000,00	1.195.000,00	19.667.726,59	392.567,39	2,04%	0,66%	309,72%	0,78%
Acumulado no ano					1.323.983,64	7,81%	4,75%	164,43%	

Acumulado no An



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 -
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2.886.333,54	0,00	0,00	2.968.587,81	82.254,27	2,85%	1
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.977.064,27	0,00	445.000,00	6.717.236,11	185.171,84	2,65%	1
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.276.796,47	0,00	0,00	2.331.723,11	54.926,64	2,41%	0
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.625.718,60	600.000,00	750.000,00	3.513.728,73	38.010,13	0,90%	0
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.048.926,42	0,00	0,00	1.057.415,51	8.489,09	0,81%	0
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.635,97	0,00	0,00	2.654,77	18,80	0,71%	0
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.274.444,15	600.000,00	0,00	2.894.721,20	20.277,05	0,71%	0
				Total Renda Fixa	389.147,82	2,04%	0

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR -
WESTERN ASSET DIVIDEND YIELD FI AÇÕES	178.239,78	0,00	0,00	181.659,35	3.419,57	1,92%	3
				Total Renda Variável	3.419,57	1,92%	3