

Relatório Analítico dos Investimentos em dezembro, 4º Trimestre e ano de 2017



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 (dezembro / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.714.327,11	71,47%	1.412	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	144.904,37	2,79%	748	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	318.250,19	6,12%	424	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
Total para cálculo dos limites da Resolução			4.177.481,67				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			1.019.431,11				Artigo 6º
Total			5.196.912,78				

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

Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	3.714.327,11	88,91%	0,00%	0,00%	0,00%	-3.714.327,11
DF - Artigo 6º	100,00%	1.019.431,11	24,40%	0,00%	0,00%	0,00%	-1.019.431,11
Total Carteira		4.733.758,22					

RENDA FIXA	5.196.912,78	109,78%
------------	--------------	---------

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: dezembro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	3.714.327,11	71,47%	0,00%	0,00%
DF - Artigo 6º	1.019.431,11	19,62%	0,00%	0,00%
Total	4.733.758,22	91,09%	0,00	0,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (dezembro / 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	4.177.481,67	80,38%	0,00%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M 1	0,566%	11,12%	1,82%	4,59%	11,12%	27,47%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,57%	10,93%	1,79%	4,51%	10,93%	27,11%	0,20%	0,031%	0,67%
CDI	0,538%	9,93%	1,76%	4,05%	9,93%	25,31%	-	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,55%	9,91%	1,75%	4,08%	9,91%	25,34%	0,20%	0,016%	0,17%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,52%	9,94%	1,74%	4,01%	9,94%	25,33%	0,20%	0,021%	0,13%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	4.177.481,67	80,38%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	1.019.431,11	19,62%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	3.714.327,11	71,47%
DISP. FINANCEIRA	1.019.431,11	19,62%
CDI	463.154,56	8,91%

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	3.285.484,17	260.000,00	0,00	3.589.267,06	43.782,89	1,23%	0,89%	138,45%	0,26%
Fevereiro	3.589.267,06	0,00	0,00	3.624.529,55	35.262,49	0,98%	0,75%	131,26%	0,08%
Março	3.624.529,55	230.000,00	0,00	3.896.575,08	42.045,53	1,09%	0,78%	139,03%	0,12%
Abril	3.896.575,08	0,00	0,00	3.929.810,48	33.235,40	0,85%	0,56%	152,95%	0,14%
Mai	3.929.810,48	0,00	0,00	3.965.096,15	35.285,67	0,90%	0,82%	109,29%	0,86%
Junho	3.965.096,15	0,00	0,00	3.999.183,81	34.087,66	0,86%	0,26%	336,30%	0,16%
Julho	3.999.183,81	0,00	0,00	4.039.838,68	40.654,87	1,02%	0,73%	139,65%	0,18%
Agosto	4.039.838,68	0,00	0,00	4.075.363,14	35.524,46	0,88%	0,72%	121,42%	0,07%
Setembro	4.075.363,14	0,00	0,00	4.104.186,32	28.823,18	0,71%	0,62%	113,29%	0,07%
Outubro	4.104.186,32	0,00	0,00	4.129.699,49	25.513,17	0,62%	0,91%	68,40%	0,08%
Novembro	4.129.699,49	0,00	0,00	4.154.026,21	24.326,72	0,59%	0,74%	79,60%	0,04%
Dezembro	4.154.026,21	0,00	0,00	4.177.481,67	23.455,46	0,56%	0,91%	62,35%	0,03%
Acumulado no ano					401.997,50	10,79%	9,04%	119,37%	

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.693.355,15	0,00	0,00	3.714.327,11	20.971,96	0,57%	0,03%	0,57%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	316.521,46	0,00	0,00	318.250,19	1.728,73	0,55%	0,02%	0,55%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	144.149,60	0,00	0,00	144.904,37	754,77	0,52%	0,02%	0,52%
Total Renda Fixa					23.455,46	0,56%	0,03%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre / 2017

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.648.987,11	0,00	0,00	3.714.327,11	65.340,00	1,79%	1,79%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	312.776,07	0,00	0,00	318.250,19	5.474,12	1,75%	1,75%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	142.423,14	0,00	0,00	144.904,37	2.481,23	1,74%	1,74%
Total Renda Fixa					73.295,35	1,79%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no Ano de 2017

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.864.132,98	490.000,00	0,00	3.714.327,11	360.194,13	10,91%	10,93%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	289.547,97	0,00	0,00	318.250,19	28.702,22	9,91%	9,91%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	131.803,22	0,00	0,00	144.904,37	13.101,15	9,94%	9,94%
Total Renda Fixa					401.997,50	10,79%	