

Relatório Analítico dos Investimentos em janeiro 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 (janeiro / 2017)

Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	3.163.309,09	88,13%	0,00%	0,00%	0,00%	-3.163.309,09
DF - Artigo 6º	100,00%	349.360,05	9,73%	0,00%	0,00%	0,00%	-349.360,05
Total Carteira		3.512.669,14					

RENDA FIXA	3.938.627,11	112,13%
------------	--------------	---------

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: janeiro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	3.163.309,09	80,32%	0,00%	0,00%
DF - Artigo 6º	349.360,05	8,87%	0,00%	0,00%
Total	3.512.669,14	89,19%	0,00	0,00

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M 1	1,289%	1,29%	3,58%	7,06%	14,32%	29,93%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,26%	1,26%	3,50%	6,95%	14,17%	29,47%	0,20%	0,288%	0,31%
CDI	1,085%	1,08%	3,28%	6,80%	14,03%	29,29%	-	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,10%	1,10%	3,27%	6,75%	13,98%	28,81%	0,20%	0,052%	0,09%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,07%	1,07%	3,27%	6,77%	14,03%	29,36%	0,20%	0,035%	0,05%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	3.589.267,06	91,13%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	349.360,05	8,87%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	3.163.309,09	80,32%
CDI	425.957,97	10,81%
DISP. FINANCEIRA	349.360,05	8,87%

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%
Acumulado no ano					43.782,89	1,23%	0,89%	138,45%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de janeiro / 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	2.864.132,98	260.000,00	0,00	3.163.309,09	39.176,11	1,25%	0,29%	1,26%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	289.547,97	0,00	0,00	292.738,71	3.190,74	1,10%	0,05%	1,10%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	131.803,22	0,00	0,00	133.219,26	1.416,04	1,07%	0,03%	1,07%
Total Renda Fixa					43.782,89	1,23%	0,26%	