

Relatório Analítico dos Investimentos em fevereiro 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 (fevereiro / 2017)

Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	3.194.763,77	88,14%	0,00%	0,00%	0,00%	-3.194.763,77
DF - Artigo 6º	100,00%	563.282,38	15,54%	0,00%	0,00%	0,00%	-563.282,38
Total Carteira		3.758.046,15					

RENDA FIXA	4.187.811,93	111,44%
------------	--------------	---------

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: fevereiro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	3.194.763,77	76,29%	0,00%	0,00%
DF - Artigo 6º	563.282,38	13,45%	0,00%	0,00%
Total	3.758.046,15	89,74%	0,00	0,00

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M 1	1,007%	2,31%	3,53%	6,86%	14,23%	30,27%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,99%	2,27%	3,47%	6,76%	14,05%	29,83%	0,20%	0,083%	0,30%
CDI	0,864%	1,96%	3,10%	6,43%	13,88%	29,35%	-	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,90%	2,01%	3,14%	6,44%	13,86%	28,91%	0,20%	0,049%	0,09%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,88%	1,96%	3,09%	6,43%	13,90%	29,43%	0,20%	0,044%	0,05%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	3.624.529,55	86,55%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	563.282,38	13,45%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	3.194.763,77	76,29%
DISP. FINANCEIRA	563.282,38	13,45%
CDI	429.765,78	10,26%

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%
Acumulado no ano					79.045,38	2,23%	1,65%	135,36%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de fevereiro / 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	3.163.309,09	0,00	0,00	3.194.763,77	31.454,68	0,99%	0,08%	0,99%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	292.738,71	0,00	0,00	295.373,65	2.634,94	0,90%	0,05%	0,90%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	133.219,26	0,00	0,00	134.392,13	1.172,87	0,88%	0,04%	0,88%
Total Renda Fixa					35.262,49	0,98%	0,08%	