

Relatório Analítico dos Investimentos em março e 1º Trimestre 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 (março / 2017)

Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	3.462.264,49	88,85%	0,00%	0,00%	0,00%	-3.462.264,49
DF - Artigo 6º	100,00%	436.177,20	11,19%	0,00%	0,00%	0,00%	-436.177,20
Total Carteira		3.898.441,69					

RENDA FIXA	4.332.752,28	111,14%
------------	--------------	---------

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: março / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	3.462.264,49	79,91%	0,00%	0,00%
DF - Artigo 6º	436.177,20	10,07%	0,00%	0,00%
Total	3.898.441,69	89,98%	0,00	0,00

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M 1	1,124%	3,46%	3,46%	6,79%	14,08%	30,52%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,11%	3,41%	3,41%	6,70%	13,92%	30,12%	0,20%	0,130%	0,29%
CDI	1,050%	3,03%	3,03%	6,37%	13,75%	29,37%	-	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,07%	3,05%	3,05%	6,39%	13,77%	29,47%	0,20%	0,030%	0,06%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,05%	3,09%	3,09%	6,39%	13,73%	29,03%	0,20%	0,060%	0,08%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	3.896.575,08	89,93%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	436.177,20	10,07%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	3.462.264,49	79,91%
DISP. FINANCEIRA	436.177,20	10,07%
CDI	434.310,59	10,02%

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%
Acumulado no ano					121.090,91	3,34%	2,44%	136,82%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de março / 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	3.194.763,77	230.000,00	0,00	3.462.264,49	37.500,72	1,09%	0,13%	1,11%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	134.392,13	0,00	0,00	135.827,86	1.435,73	1,07%	0,03%	1,07%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	295.373,65	0,00	0,00	298.482,73	3.109,08	1,05%	0,06%	1,05%
Total Renda Fixa					42.045,53	1,09%	0,12%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º 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	2.864.132,98	490.000,00	0,00	3.462.264,49	108.131,51	3,38%	3,41%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	289.547,97	0,00	0,00	298.482,73	8.934,76	3,09%	3,09%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	131.803,22	0,00	0,00	135.827,86	4.024,64	3,05%	3,05%
Total Renda Fixa					121.090,91	3,34%	