

Relatório Analítico dos Investimentos em abril de 2017



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

Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	3.492.123,13	88,86%	0,00%	0,00%	0,00%	-3.492.123,13
DF - Artigo 6º	100,00%	467.849,73	11,91%	0,00%	0,00%	0,00%	-467.849,73
Total Carteira		3.959.972,86					

RENDA FIXA	4.397.660,21	111,05%
------------	--------------	---------

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: abril / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	3.492.123,13	79,41%	0,00%	0,00%
DF - Artigo 6º	467.849,73	10,64%	0,00%	0,00%
Total	3.959.972,86	90,05%	0,00	0,00

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M 1	0,874%	4,36%	3,04%	6,72%	13,86%	30,56%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,86%	4,30%	3,00%	6,61%	13,65%	30,13%	0,20%	0,157%	0,29%
CDI	0,785%	3,84%	2,72%	6,09%	13,45%	29,16%	-	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,79%	3,87%	2,77%	6,12%	13,47%	29,25%	0,20%	0,018%	0,06%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,77%	3,88%	2,75%	6,10%	13,37%	28,86%	0,20%	0,048%	0,08%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	3.929.810,48	89,36%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	467.849,73	10,64%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	3.492.123,13	79,41%
DISP. FINANCEIRA	467.849,73	10,64%
CDI	437.687,35	9,95%

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%
Acumulado no ano					154.326,31	4,23%	3,02%	140,13%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de abril / 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	3.462.264,49	0,00	0,00	3.492.123,13	29.858,64	0,86%	0,16%	0,86%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	135.827,86	0,00	0,00	136.904,96	1.077,10	0,79%	0,02%	0,79%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	298.482,73	0,00	0,00	300.782,39	2.299,66	0,77%	0,05%	0,77%
Total Renda Fixa					33.235,40	0,85%	0,14%	