

Relatório Analítico dos Investimentos em maio 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 (maio / 2017)

Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	3.523.601,22	88,87%	0,00%	0,00%	0,00%	-3.523.601,22
DF - Artigo 6º	100,00%	540.828,99	13,64%	0,00%	0,00%	0,00%	-540.828,99
Total Carteira		4.064.430,21					

RENDA FIXA	4.505.925,14	110,86%
------------	--------------	---------

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: maio / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	3.523.601,22	78,20%	0,00%	0,00%
DF - Artigo 6º	540.828,99	12,00%	0,00%	0,00%
Total	4.064.430,21	90,20%	0,00	0,00

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M 1	0,886%	6,25%	2,69%	6,25%	13,46%	30,44%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,90%	5,24%	2,91%	6,48%	13,48%	30,10%	0,20%	0,955%	0,65%
CDI	0,808%	5,65%	2,54%	5,65%	12,85%	28,75%	-	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,93%	4,84%	2,82%	6,00%	13,27%	29,19%	0,20%	0,030%	0,07%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,84%	4,75%	2,69%	5,91%	13,10%	28,65%	0,20%	0,161%	0,14%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	3.965.096,15	88,00%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	540.828,99	12,00%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	3.523.601,22	78,20%
DISP. FINANCEIRA	540.828,99	12,00%
CDI	441.494,93	9,80%

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%
Maio	3.929.810,48	0,00	0,00	3.965.096,15	35.285,67	0,90%	0,82%	109,29%	0,86%
Acumulado no ano					189.611,98	5,16%	3,86%	133,65%	

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	136.904,96	0,00	0,00	138.180,82	1.275,86	0,93%	0,03%	0,93%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.492.123,13	0,00	0,00	3.523.601,22	31.478,09	0,90%	0,96%	0,90%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	300.782,39	0,00	0,00	303.314,11	2.531,72	0,84%	0,16%	0,84%
Total Renda Fixa					35.285,67	0,90%	0,86%	