

Relatório Analítico dos Investimentos em junho, 2º Trimestre e 1º semestre 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 (junho / 2017)

Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	3.554.085,16	88,87%	0,00%	0,00%	0,00%	-3.554.085,16
DF - Artigo 6º	100,00%	477.656,18	11,94%	0,00%	0,00%	0,00%	-477.656,18
Total Carteira		4.031.741,34					

RENDA FIXA	4.476.839,99	111,04%
------------	--------------	---------

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: junho / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	3.554.085,16	79,39%	0,00%	0,00%
DF - Artigo 6º	477.656,18	10,67%	0,00%	0,00%
Total	4.031.741,34	90,06%	0,00	0,00

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (junho / 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	0,87%	6,15%	2,65%	6,15%	13,27%	30,05%	0,20%	0,178%	0,66%
CDI	0,808%	5,65%	2,54%	5,65%	12,85%	28,75%	-	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,82%	5,70%	2,57%	5,70%	12,90%	28,87%	0,20%	0,015%	0,09%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,81%	5,61%	2,44%	5,61%	12,72%	28,40%	0,20%	0,007%	0,14%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	3.999.183,81	89,33%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	477.656,18	10,67%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	3.554.085,16	79,39%
DISP. FINANCEIRA	477.656,18	10,67%
CDI	445.098,65	9,94%

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%
Mai	3.929.810,48	0,00	0,00	3.965.096,15	35.285,67	0,90%	0,82%	109,29%	0,86%
Junho	3.965.096,15	0,00	0,00	3.999.183,81	34.087,66	0,86%	0,26%	336,30%	0,16%
Acumulado no ano					223.699,64	6,07%	4,13%	146,96%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de junho / 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	3.523.601,22	0,00	0,00	3.554.085,16	30.483,94	0,87%	0,18%	0,87%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	138.180,82	0,00	0,00	139.320,00	1.139,18	0,82%	0,02%	0,82%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	303.314,11	0,00	0,00	305.778,65	2.464,54	0,81%	0,01%	0,81%
Total Renda Fixa					34.087,66	0,86%	0,16%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º 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	3.462.264,49	0,00	0,00	3.554.085,16	91.820,67	2,65%	2,65%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	298.482,73	0,00	0,00	305.778,65	7.295,92	2,44%	2,44%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	135.827,86	0,00	0,00	139.320,00	3.492,14	2,57%	2,57%
Total Renda Fixa					102.608,73	2,63%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre / 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	3.554.085,16	199.952,18	6,12%	6,15%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	289.547,97	0,00	0,00	305.778,65	16.230,68	5,61%	5,61%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	131.803,22	0,00	0,00	139.320,00	7.516,78	5,70%	5,70%
Total Renda Fixa					223.699,64	6,07%	