

Relatório Analítico dos Investimentos em julho 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 (julho / 2017)

Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	3.591.145,70	88,89%	0,00%	0,00%	0,00%	-3.591.145,70
DF - Artigo 6º	100,00%	644.907,45	15,96%	0,00%	0,00%	0,00%	-644.907,45
Total Carteira		4.236.053,15					

RENDA FIXA	4.684.746,13	110,59%
------------	--------------	---------

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: julho / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	3.591.145,70	76,66%	0,00%	0,00%
DF - Artigo 6º	644.907,45	13,77%	0,00%	0,00%
Total	4.236.053,15	90,42%	0,00	0,00

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M 1	1,049%	7,36%	2,87%	5,99%	13,48%	30,14%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,04%	7,25%	2,84%	5,92%	13,28%	29,76%	0,20%	0,199%	0,66%
CDI	0,797%	6,49%	2,55%	5,35%	12,51%	28,27%	-	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,82%	6,47%	2,49%	5,31%	12,41%	27,90%	0,20%	0,029%	0,15%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,79%	6,53%	2,56%	5,40%	12,54%	28,36%	0,20%	0,017%	0,10%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	4.039.838,68	86,23%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	644.907,45	13,77%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	3.591.145,70	76,66%
DISP. FINANCEIRA	644.907,45	13,77%
CDI	448.692,98	9,58%

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%
Julho	3.999.183,81	0,00	0,00	4.039.838,68	40.654,87	1,02%	0,73%	139,65%	0,18%
Acumulado no ano					264.354,51	7,14%	4,89%	146,23%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de julho / 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	3.554.085,16	0,00	0,00	3.591.145,70	37.060,54	1,04%	0,20%	1,04%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	305.778,65	0,00	0,00	308.278,68	2.500,03	0,82%	0,03%	0,82%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	139.320,00	0,00	0,00	140.414,30	1.094,30	0,79%	0,02%	0,79%
Total Renda Fixa					40.654,87	1,02%	0,18%	