

# Relatório Analítico dos Investimentos em agosto 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 (agosto / 2017)

Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	3.623.094,85	88,90%	0,00%	0,00%	0,00%	-3.623.094,85
DF - Artigo 6º	100,00%	805.902,49	19,77%	0,00%	0,00%	0,00%	-805.902,49
Total Carteira		4.428.997,34					

RENDA FIXA	4.881.265,63	110,21%
------------	--------------	---------

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: agosto / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	3.623.094,85	74,22%	0,00%	0,00%
DF - Artigo 6º	805.902,49	16,51%	0,00%	0,00%
Total	4.428.997,34	90,73%	0,00	0,00

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M 1	0,901%	8,33%	2,86%	5,88%	13,15%	29,98%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,89%	8,21%	2,82%	5,81%	12,96%	29,61%	0,20%	0,081%	0,67%
CDI	0,801%	7,34%	2,43%	5,28%	12,05%	27,88%	-	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,80%	7,32%	2,45%	5,20%	11,97%	27,62%	0,20%	0,019%	0,15%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,79%	7,38%	2,42%	5,31%	12,08%	27,93%	0,20%	0,007%	0,11%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	4.075.363,14	83,49%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	805.902,49	16,51%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	3.623.094,85	74,22%
DISP. FINANCEIRA	805.902,49	16,51%
CDI	452.268,29	9,27%

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%
Agosto	4.039.838,68	0,00	0,00	4.075.363,14	35.524,46	0,88%	0,72%	121,42%	0,07%
Acumulado no ano					299.878,97	8,09%	5,65%	143,24%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de agosto / 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	3.591.145,70	0,00	0,00	3.623.094,85	31.949,15	0,89%	0,08%	0,89%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	308.278,68	0,00	0,00	310.742,41	2.463,73	0,80%	0,02%	0,80%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	140.414,30	0,00	0,00	141.525,88	1.111,58	0,79%	0,01%	0,79%
Total Renda Fixa					35.524,46	0,88%	0,07%	