

# Relatório Analítico dos Investimentos em setembro e 3º Trimestre 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 (setembro / 2017)

Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	3.648.987,11	88,91%	0,00%	0,00%	0,00%	-3.648.987,11
DF - Artigo 6º	100,00%	609.137,20	14,84%	0,00%	0,00%	0,00%	-609.137,20
Total Carteira		4.258.124,31					

RENDA FIXA	4.713.323,52	110,69%
------------	--------------	---------

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: setembro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	3.648.987,11	77,42%	0,00%	0,00%
DF - Artigo 6º	609.137,20	12,92%	0,00%	0,00%
Total	4.258.124,31	90,34%	0,00	0,00

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M 1	0,745%	9,14%	2,72%	5,49%	12,65%	29,70%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,71%	8,98%	2,67%	5,39%	12,45%	29,31%	0,20%	0,071%	0,67%
CDI	0,638%	8,03%	2,25%	4,85%	11,53%	27,29%	-	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,65%	8,02%	2,29%	4,79%	11,48%	27,22%	0,20%	0,030%	0,16%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,63%	8,06%	2,23%	4,86%	11,56%	27,32%	0,20%	0,017%	0,12%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	4.104.186,32	87,08%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	609.137,20	12,92%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	3.648.987,11	77,42%
DISP. FINANCEIRA	609.137,20	12,92%
CDI	455.199,21	9,66%

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%
Setembro	4.075.363,14	0,00	0,00	4.104.186,32	28.823,18	0,71%	0,62%	113,29%	0,07%
Acumulado no ano					328.702,15	8,85%	6,30%	140,38%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de setembro / 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	3.623.094,85	0,00	0,00	3.648.987,11	25.892,26	0,71%	0,07%	0,71%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	310.742,41	0,00	0,00	312.776,07	2.033,66	0,65%	0,03%	0,65%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	141.525,88	0,00	0,00	142.423,14	897,26	0,63%	0,02%	0,63%
Total Renda Fixa					28.823,18	0,71%	0,07%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º 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	3.554.085,16	0,00	0,00	3.648.987,11	94.901,95	2,67%	2,67%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	305.778,65	0,00	0,00	312.776,07	6.997,42	2,29%	2,29%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	139.320,00	0,00	0,00	142.423,14	3.103,14	2,23%	2,23%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>105.002,51</b>	<b>2,63%</b>	