

Relatório Analítico dos Investimentos em janeiro de 2017



Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (janeiro / 2017)

Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	17.163.001,30	73,98%	0,50%	70,00%	100,00%	6.036.844,28
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	13.919.907,35
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	15,00%	3.479.976,84
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	25,00%	5.799.961,40
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	1.159.992,28
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	1.159.992,28
DF - Artigo 6º	100,00%	32.096,82	0,14%	0,00%	0,00%	0,00%	-32.096,82
Total Carteira		17.195.098,12					

RENDA FIXA	23.231.942,40	135,11%
------------	---------------	---------

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: janeiro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00%	0,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	17.163.001,30	73,88%	0,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso II	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00%	0,00%	80,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	0,00	0,00%	0,00%	80,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00%	0,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00%	0,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 7º, Inciso VI	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso I	0,00	0,00%	0,00%	30,00%
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
DF - Artigo 6º	32.096,82	0,14%	0,00%	0,00%
Total	17 195 098,12	74,01%	0,00	580,00

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5+	2,237%	2,24%	3,87%	7,30%	32,37%	36,55%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,18%	2,18%	3,79%	7,13%	31,98%	35,25%	0,20%	4,406%	10,58%
IMA-B	1,867%	1,87%	3,55%	6,79%	24,76%	34,25%	-	-	-
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1,89%	1,89%	3,54%	7,01%	24,43%	33,34%	0,20%	3,190%	7,00%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,84%	1,84%	3,55%	6,75%	24,64%	32,05%	0,20%	3,342%	7,48%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	1,74%	1,74%	3,38%	6,57%	22,25%	32,09%	0,20%	2,957%	6,65%
IRF-M 1	1,289%	1,29%	3,58%	7,06%	14,32%	29,93%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,26%	1,26%	3,50%	6,95%	14,17%	29,47%	0,20%	0,288%	0,31%
IMA-B 5	1,156%	1,16%	2,97%	6,05%	13,45%	32,16%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,14%	1,14%	2,92%	5,95%	13,21%	31,19%	0,20%	1,254%	2,49%
IDKA IPCA 2 Anos	1,087%	1,09%	2,97%	6,30%	12,25%	32,94%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,06%	1,06%	2,89%	5,98%	12,92%	31,70%	0,20%	1,042%	2,26%
CDI	1,085%	1,08%	3,28%	6,80%	14,03%	29,29%	-	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,07%	1,07%	3,27%	6,77%	14,03%	29,36%	0,20%	0,035%	0,05%
IPCA + 6,00% ao ano	0,892%	0,89%	2,37%	4,70%	11,70%	30,99%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,90%	0,90%	2,36%	2,03%	6,26%	17,79%	0,20%	0,053%	3,91%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	19.576.565,35	84,27%
SANTANDER CACEIS	3.623.280,23	15,60%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	32.096,82	0,14%

Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	10.516.300,86	45,27%
IMA-B 5+	3.436.675,95	14,79%
IMA-B 5	3.075.951,83	13,24%
IRF-M 1	2.548.488,73	10,97%
CDI	1.531.524,51	6,59%
IDKA IPCA 2A	798.652,70	3,44%
DISP. FINANCEIRA	32.096,82	0,14%

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	21.777.480,14	1.070.132,40	0,00	23.199.845,58	352.233,04	1,54%	0,89%	172,85%	2,33%
Acumulado no ano					352.233,04	1,54%	0,89%	172,85%	

Acumulado no Ano

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.363.512,64	0,00	0,00	3.436.675,95	73.163,31	2,18%	4,41%	2,18%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	3.153.525,01	0,00	0,00	3.213.068,77	59.543,76	1,89%	3,19%	1,89%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.613.372,73	0,00	0,00	3.679.951,86	66.579,13	1,84%	3,34%	1,84%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	3.561.178,44	0,00	0,00	3.623.280,23	62.101,79	1,74%	2,96%	1,74%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.041.354,27	0,00	0,00	3.075.951,83	34.597,56	1,14%	1,25%	1,14%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.515.245,37	0,00	0,00	1.531.524,51	16.279,14	1,07%	0,03%	1,07%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	770.353,27	20.132,40	0,00	798.652,70	8.167,03	1,03%	1,04%	1,06%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.280.769,00	0,00	0,00	1.292.251,00	11.482,00	0,90%	0,05%	0,90%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.478.169,41	1.050.000,00	0,00	2.548.488,73	20.319,32	0,80%	0,29%	1,26%
				Total Renda Fixa	352.233,04	1,54%	2,33%	