

Relatório Analítico dos Investimentos
em fevereiro de 2017



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

Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	17.702.187,93	73,26%	0,50%	70,00%	100,00%	6.461.053,15
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	80,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	14.497.944,65
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	15,00%	3.624.486,16
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	25,00%	6.040.810,27
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	1.208.162,05
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	1.208.162,05
DF - Artigo 6º	100,00%	11.628,17	0,05%	0,00%	0,00%	0,00%	-11.628,17
Total Carteira		17.713.816,10					

RENDA FIXA	24.174.869,25	136,47%
------------	---------------	---------

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: fevereiro / 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'	17.702.187,93	73,23%	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	11.628,17	0,05%	0,00%	0,00%
Total	17.713.816,10	73,27%	0,00	580,00

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5+	5,058%	7,41%	11,40%	11,75%	35,35%	43,21%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4,97%	7,26%	11,23%	11,54%	34,89%	41,79%	0,20%	2,447%	10,42%
IMA-B	3,849%	5,79%	8,86%	9,92%	26,69%	38,66%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,83%	5,74%	8,78%	9,92%	26,54%	36,41%	0,20%	1,859%	7,37%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	3,78%	5,74%	8,70%	9,99%	26,42%	37,57%	0,20%	1,780%	6,94%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	3,47%	5,28%	8,11%	9,11%	23,72%	36,06%	0,20%	1,626%	6,54%
IMA-B 5	1,492%	2,67%	4,10%	6,47%	13,40%	32,51%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,48%	2,63%	4,05%	6,38%	13,17%	31,63%	0,20%	0,715%	2,39%
IDKA IPCA 2 Anos	1,351%	2,45%	3,77%	6,37%	12,42%	33,17%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,29%	2,37%	3,63%	6,06%	12,84%	31,83%	0,20%	0,596%	2,15%
IRF-M 1	1,007%	2,31%	3,53%	6,86%	14,23%	30,27%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,99%	2,27%	3,47%	6,76%	14,05%	29,83%	0,20%	0,083%	0,30%
CDI	0,864%	1,96%	3,10%	6,43%	13,88%	29,35%	-	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,88%	1,96%	3,09%	6,43%	13,90%	29,43%	0,20%	0,044%	0,05%
IPCA + 6,00% ao ano	0,748%	1,65%	2,47%	4,47%	11,04%	29,84%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-2,09%	-1,21%	-0,52%	1,63%	5,30%	16,98%	0,20%	4,963%	3,93%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	20.414.074,73	84,44%
SANTANDER CACEIS	3.749.166,35	15,51%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	11.628,17	0,05%

Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	10.904.342,50	45,11%
IMA-B 5+	3.607.611,31	14,92%
IMA-B 5	3.121.403,39	12,91%
IRF-M 1	2.573.829,85	10,65%
CDI	1.861.363,52	7,70%
IDKA IPCA 2A	829.404,51	3,43%
DISP. FINANCEIRA	11.628,17	0,05%

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Acumulado no Ano		
							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%
Fevereiro	23.199.845,58	850.340,55	551.348,44	24.163.241,08	664.403,39	2,83%	0,75%	377,77%	1,54%
Acumulado no ano					1.016.636,43	4,41%	1,65%	267,91%	

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

Ativos de Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.436.675,95	0,00	0,00	3.607.611,31	170.935,36	4,97%	2,45%	4,97%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.679.951,86	0,00	0,00	3.820.772,52	140.820,66	3,83%	1,86%	3,83%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	3.213.068,77	0,00	0,00	3.334.403,63	121.334,86	3,78%	1,78%	3,78%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	3.623.280,23	0,00	0,00	3.749.166,35	125.886,12	3,47%	1,63%	3,47%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.075.951,83	0,00	0,00	3.121.403,39	45.451,56	1,48%	0,72%	1,48%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	798.652,70	20.340,55	0,00	829.404,51	10.411,26	1,27%	0,60%	1,29%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.548.488,73	0,00	0,00	2.573.829,85	25.341,12	0,99%	0,08%	0,99%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.292.251,00	0,00	36.348,44	1.265.286,00	9.383,44	0,73%	4,96%	-2,09%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.531.524,51	830.000,00	515.000,00	1.861.363,52	14.839,01	0,63%	0,04%	0,88%
				Total Renda Fixa	664.403,39	2,83%	1,54%	