

## Relatório Analítico dos Investimentos em março e 1º Trimestre de 2017



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

Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	17.885.488,06	73,28%	0,50%	70,00%	100,00%	6.523.187,03
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	14.645.205,05
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	15,00%	3.661.301,26
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	25,00%	6.102.168,77
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	1.220.433,75
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	1.220.433,75
DF - Artigo 6º	100,00%	25.191,72	0,10%	0,00%	0,00%	0,00%	-25.191,72
Total Carteira		17.910.679,78					

RENDA FIXA	24.433.866,81	136,42%
------------	---------------	---------

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: março / 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 '	17.885.488,06	73,20%	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	25.191,72	0,10%	0,00%	0,00%
Total	17 910 679,78	73,30%	0,00	580,00

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDKA IPCA 2 Anos	1,621%	4,11%	4,11%	6,49%	14,06%	33,81%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,42%	3,82%	3,82%	6,15%	13,74%	32,33%	0,20%	0,660%	1,88%
IMA-B 5	1,391%	4,09%	4,09%	6,45%	14,11%	32,99%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,38%	4,05%	4,05%	6,36%	13,89%	32,16%	0,20%	0,760%	2,16%
IRF-M 1	1,124%	3,46%	3,46%	6,79%	14,08%	30,52%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,11%	3,41%	3,41%	6,70%	13,92%	30,12%	0,20%	0,130%	0,29%
CDI	1,050%	3,03%	3,03%	6,37%	13,75%	29,37%	-	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,07%	3,05%	3,05%	6,39%	13,77%	29,47%	0,20%	0,030%	0,06%
IMA-B	1,045%	6,89%	6,89%	9,36%	21,56%	40,51%	-	-	-
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	1,05%	6,38%	6,38%	8,64%	19,80%	37,66%	0,20%	1,780%	5,52%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,03%	6,83%	6,83%	9,33%	21,40%	38,26%	0,20%	2,050%	6,15%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	0,95%	6,74%	6,74%	9,38%	21,28%	38,79%	0,20%	1,980%	5,84%
IMA-B 5+	0,875%	8,35%	8,35%	10,88%	26,07%	45,95%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,84%	8,15%	8,15%	10,63%	25,55%	44,50%	0,20%	2,720%	8,47%
IPCA + 6,00% ao ano	0,785%	2,44%	2,44%	4,69%	10,87%	28,50%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,84%	-0,38%	-0,38%	1,67%	4,94%	15,52%	0,20%	0,140%	3,92%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	20.620.144,44	84,39%
SANTANDER CACEIS	3.788.530,65	15,51%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	25.191,72	0,10%

Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	11.014.887,53	45,08%
IMA-B 5+	3.637.759,96	14,89%
IMA-B 5	3.164.394,49	12,95%
IRF-M 1	2.572.739,14	10,53%
CDI	1.881.248,83	7,70%
IDKA IPCA 2A	861.763,14	3,53%
DISP. FINANCEIRA	25.191,72	0,10%

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%
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%
Março	24.163.241,08	190.576,59	200.000,00	24.408.675,09	254.857,42	1,05%	0,78%	134,43%	1,42%
Acumulado no ano					1.271.493,85	5,51%	2,44%	225,56%	

Acumulado no Ano

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	829.404,51	20.576,59	0,00	861.763,14	11.782,04	1,39%	0,66%	1,42%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.121.403,39	0,00	0,00	3.164.394,49	42.991,10	1,38%	0,76%	1,38%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.861.363,52	0,00	0,00	1.881.248,83	19.885,31	1,07%	0,03%	1,07%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.573.829,85	170.000,00	200.000,00	2.572.739,14	28.909,29	1,05%	0,13%	1,11%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	3.749.166,35	0,00	0,00	3.788.530,65	39.364,30	1,05%	1,78%	1,05%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.820.772,52	0,00	0,00	3.860.300,68	39.528,16	1,03%	2,05%	1,03%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	3.334.403,63	0,00	0,00	3.366.056,20	31.652,57	0,95%	1,98%	0,95%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.265.286,00	0,00	0,00	1.275.882,00	10.596,00	0,84%	0,14%	0,84%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.607.611,31	0,00	0,00	3.637.759,96	30.148,65	0,84%	2,72%	0,84%
				Total Renda Fixa	254.857,42	1,05%	1,42%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre / 2017

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.363.512,64	0,00	0,00	3.637.759,96	274.247,32	8,15%	8,15%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.613.372,73	0,00	0,00	3.860.300,68	246.927,95	6,83%	6,83%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	3.561.178,44	0,00	0,00	3.788.530,65	227.352,21	6,38%	6,38%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	3.153.525,01	0,00	0,00	3.366.056,20	212.531,19	6,74%	6,74%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.041.354,27	0,00	0,00	3.164.394,49	123.040,22	4,05%	4,05%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.478.169,41	1.220.000,00	200.000,00	2.572.739,14	74.569,73	2,88%	3,41%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.515.245,37	830.000,00	515.000,00	1.881.248,83	51.003,46	2,80%	3,05%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.280.769,00	0,00	36.348,44	1.275.882,00	31.461,44	2,48%	-0,38%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	770.353,27	61.049,54	0,00	861.763,14	30.360,33	3,74%	3,82%
Total Renda Fixa					1.271.493,85	5,51%	