

Relatório Analítico dos Investimentos em abril de 2017



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

Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	17.517.902,26	72,85%	0,50%	70,00%	100,00%	6.528.245,70
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	14.427.688,78
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	15,00%	3.606.922,19
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	25,00%	6.011.536,99
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	1.202.307,40
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	1.202.307,40
DF - Artigo 6º	100,00%	27.374,09	0,11%	0,00%	0,00%	0,00%	-27.374,09
Total Carteira		17.545.276,35					

RENTA FIXA	24.073.522,05	137,21%
------------	---------------	---------

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: abril / 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 '	17.517.902,26	72,77%	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	27.374,09	0,11%	0,00%	0,00%
Total	17.545.276,35	72,88%	0,00	580,00

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDKA IPCA 2 Anos	0,924%	5,08%	3,95%	7,03%	13,24%	34,55%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,79%	4,64%	3,54%	6,53%	12,81%	33,04%	0,20%	0,465%	1,76%
IRF-M 1	0,874%	4,36%	3,04%	6,72%	13,86%	30,56%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,86%	4,30%	3,00%	6,61%	13,65%	30,13%	0,20%	0,157%	0,29%
CDI	0,785%	3,84%	2,72%	6,09%	13,45%	29,16%	-	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,79%	3,87%	2,77%	6,12%	13,47%	29,25%	0,20%	0,018%	0,06%
IMA-B 5	0,710%	4,83%	3,63%	6,72%	13,17%	33,32%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,70%	4,77%	3,59%	6,62%	12,96%	32,50%	0,20%	0,516%	2,06%
IPCA + 6,00% ao ano	0,558%	3,02%	2,11%	4,52%	10,30%	27,71%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,62%	0,23%	-0,66%	1,68%	4,64%	14,59%	0,20%	0,027%	3,93%
IMA-B 5+	-0,816%	7,46%	5,11%	9,18%	18,67%	39,79%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,82%	7,27%	4,99%	8,96%	18,27%	38,38%	0,20%	2,560%	7,99%
IMA-B	-0,322%	6,55%	4,60%	8,31%	16,59%	36,72%	-	-	-
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	-0,17%	6,21%	4,39%	7,91%	15,56%	34,01%	0,20%	1,610%	5,24%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,34%	6,47%	4,54%	8,25%	16,41%	34,52%	0,20%	1,894%	5,83%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-0,53%	6,18%	4,21%	7,90%	16,38%	34,80%	0,20%	1,855%	5,57%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	20.263.961,86	84,18%
SANTANDER CACEIS	3.782.186,10	15,71%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	27.374,09	0,11%

Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	10.977.632,77	45,60%
IMA-B 5+	3.607.995,55	14,99%
IMA-B 5	3.186.431,39	13,24%
IRF-M 1	2.204.734,33	9,16%
CDI	1.896.166,80	7,88%
IDKA IPCA 2A	889.421,12	3,69%
DISP. FINANCEIRA	27.374,09	0,11%

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%
Abril	24.408.675,09	20.784,23	390.000,00	24.046.147,96	6.688,64	0,03%	0,56%	4,91%	1,30%
Acumulado no ano					1.278.182,49	5,54%	3,02%	183,79%	

Acumulado no Ano

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de abril / 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	2.572.739,14	0,00	390.000,00	2.204.734,33	21.995,19	0,85%	0,16%	0,86%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.881.248,83	0,00	0,00	1.896.166,80	14.917,97	0,79%	0,02%	0,79%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	861.763,14	20.784,23	0,00	889.421,12	6.873,75	0,78%	0,46%	0,79%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.164.394,49	0,00	0,00	3.186.431,39	22.036,90	0,70%	0,52%	0,70%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.275.882,00	0,00	0,00	1.283.766,00	7.884,00	0,62%	0,03%	0,62%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	3.788.530,65	0,00	0,00	3.782.186,10	-6.344,55	-0,17%	1,61%	-0,17%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.860.300,68	0,00	0,00	3.847.133,77	-13.166,91	-0,34%	1,89%	-0,34%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	3.366.056,20	0,00	0,00	3.348.312,90	-17.743,30	-0,53%	1,85%	-0,53%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.637.759,96	0,00	0,00	3.607.995,55	-29.764,41	-0,82%	2,56%	-0,82%
				Total Renda Fixa	6.688,64	0,03%	1,30%	