

Relatório Analítico dos Investimentos em janeiro de 2016



Carteira consolidada de investimentos - base (janeiro / 2016)

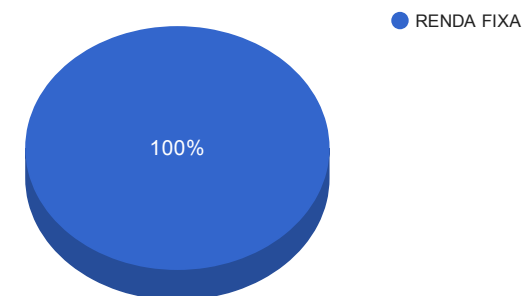
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.128.005,65	4,25%	507	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2016	1.060.128,00	3,99%	85	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.867.842,35	10,80%	1.158	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.033.585,09	18,96%	641	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.713.135,24	21,52%	1.287	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.029.607,64	7,65%	544	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	884.003,52	3,33%	84	0,10%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.612.088,86	6,07%	753	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO PREMIUM FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	4.032.368,70	15,19%	388	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER CORPORATE FIC REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.299.004,75	4,89%	1.362	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IPCA XIII FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	01/08/2016	886.478,19	3,34%	49	0,87%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
TOTAL -			26.546.247,99				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (janeiro / 2016)

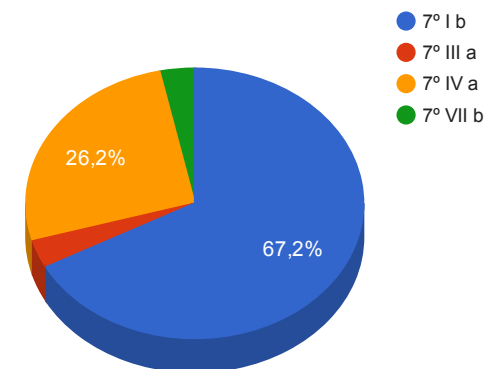
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	90,00%	17.832.303,97	67,17%	6.059.319,22
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	40,00%	884.003,52	3,33%	9.734.495,68
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	6.943.462,31	26,16%	1.020.412,09
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.327.312,40
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.327.312,40
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	886.478,19	3,34%	440.834,21
Total Renda Fixa	100,00%	175,00	26.546.247,99	100,00%	

Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	3,00%	0,00	0,00%	796.387,44
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.327.312,40
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	2,00%	0,00	0,00%	530.924,96
Total Renda Variável	30,00%	10,00	0,00	0,00%	

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (janeiro / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDKA IPCA 2 Anos	3,76%	3,76%	5,94%	9,76%	18,43%	36,00%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,87%	2,87%	5,42%	8,88%	16,63%	33,70%	0,20%	1,673%	2,93%
IMA-B 5	2,97%	2,97%	5,73%	8,70%	16,49%	33,78%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,91%	2,91%	5,59%	8,36%	15,89%	32,79%	0,20%	1,694%	3,34%
IMA-B	1,91%	1,91%	4,53%	3,17%	7,61%	30,43%	-	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,83%	1,83%	4,39%	2,94%	7,23%	29,48%	0,20%	2,118%	9,08%
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,57%	1,57%	4,25%	5,53%	-	-	0,20%	0,499%	-
IRF-M 1	1,64%	1,64%	3,94%	7,40%	13,65%	26,52%	-	-	-
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1,65%	1,65%	3,87%	7,28%	13,47%	25,99%	0,20%	0,336%	0,81%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,62%	1,62%	3,87%	7,21%	13,28%	25,64%	0,10%	0,343%	0,57%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,62%	1,62%	3,89%	7,30%	13,40%	26,01%	0,20%	0,346%	0,55%
IPCA	1,27%	1,27%	3,27%	4,91%	10,71%	18,61%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XIII FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,39%	1,39%	4,14%	7,10%	16,35%	29,97%	0,20%	0,032%	0,27%
Selic	1,06%	1,06%	3,31%	6,78%	13,40%	25,88%	-	-	-
BRADESCO PREMIUM FI REFERENCIADO DI	1,05%	1,05%	3,30%	6,79%	13,48%	26,11%	0,20%	0,005%	0,04%
CDI	1,05%	1,05%	3,31%	6,78%	13,38%	25,75%	-	-	-
SANTANDER CORPORATE FIC REFERENCIADO DI	1,05%	1,05%	3,32%	6,80%	13,50%	26,05%	0,20%	0,006%	0,04%

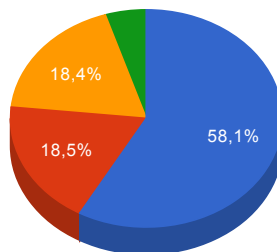
Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (janeiro / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL FI REFERENCIADO DI LP	1,05%	1,05%	3,29%	6,80%	13,45%	25,91%	0,20%	0,014%	0,08%

Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (janeiro / 2016)

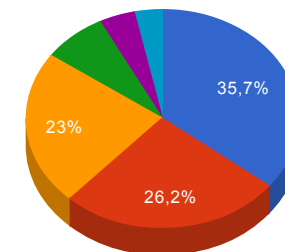
Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	15.433.421,03	58,14%
BANCO BRADESCO	4.916.372,22	18,52%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	4.897.449,99	18,45%
BANCO SANTANDER	1.299.004,75	4,89%

- CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
- BANCO BRADESCO
- BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM
- BANCO SANTANDER



Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	9.464.981,11	35,65%
CDI	6.943.462,31	26,16%
IMA-B 5	6.093.713,09	22,96%
IMA-B	2.029.607,64	7,65%
IDKA IPCA 2A	1.128.005,65	4,25%
CRÉDITO PRIVADO	886.478,19	3,34%

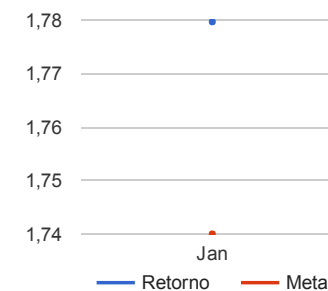
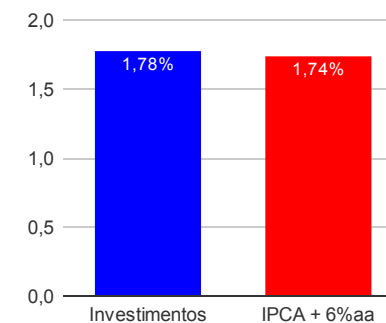
- IRF-M 1
- CDI
- IMA-B 5
- IMA-B
- IDKA IPCA 2A
- CRÉDITO PRIVADO



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	25.552.981,25	854.529,73	325.438,64	26.546.247,99	464.175,65	1,78%	1,74%	102,31%	0,70%
Acumulado no ano					464.175,65	1,78%	1,74%	102,31%	

Acumulado no Ano



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de janeiro / 2016

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	4.891.185,83	0,00	0,00	5.033.585,09	142.399,26	2,91%	1,69%	2,91%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.096.536,90	0,00	0,00	1.128.005,65	31.468,75	2,87%	1,67%	2,87%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.993.167,63	0,00	0,00	2.029.607,64	36.440,01	1,83%	2,12%	1,83%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	869.687,49	0,00	0,00	884.003,52	14.316,03	1,65%	0,34%	1,65%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.557.115,52	261.029,73	198.726,03	5.713.135,24	93.716,02	1,61%	0,35%	1,62%
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.043.724,00	0,00	0,00	1.060.128,00	16.404,00	1,57%	0,50%	1,57%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.230.572,17	593.500,00	0,00	2.867.842,35	43.770,18	1,55%	0,34%	1,62%
CAIXA BRASIL IPCA XIII FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	874.360,36	0,00	0,00	886.478,19	12.117,83	1,39%	0,03%	1,39%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	125.343,27	0,00	126.712,61	0,00	1.369,34	1,09%	2,85%	3,49%
SANTANDER CORPORATE FIC REFERENCIADO DI	1.285.480,28	0,00	0,00	1.299.004,75	13.524,47	1,05%	0,01%	1,05%
BRADESCO PREMIUM FI REFERENCIADO DI	3.990.430,74	0,00	0,00	4.032.368,70	41.937,96	1,05%	0,00%	1,05%
CAIXA BRASIL FI REFERENCIADO DI LP	1.595.377,06	0,00	0,00	1.612.088,86	16.711,80	1,05%	0,01%	1,05%
Total Renda Fixa					464.175,65	1,78%	0,70%	

