

Relatório Analítico dos Investimentos em março e 1º Trimestre de 2016



Carteira consolidada de investimentos - base (março / 2016)

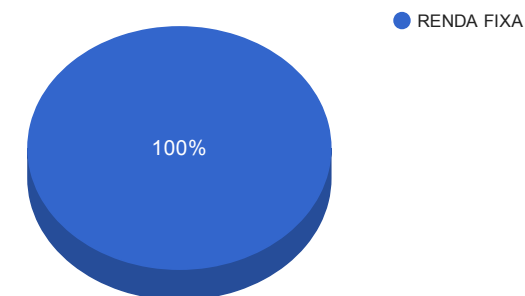
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.259.762,79	11,81%	1.169	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2016	1.050.003,00	3,81%	85	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.185.557,50	7,92%	539	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.311,53	0,02%	93	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.150.541,27	4,17%	564	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.884.983,03	21,33%	1.319	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.147.270,72	18,65%	666	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	904.688,60	3,28%	88	0,09%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
SANTANDER CORPORATE FIC REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.326.708,39	4,81%	1.420	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO PREMIUM FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	4.119.156,63	14,93%	388	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.647.288,45	5,97%	752	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IPCA XIII FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	01/08/2016	911.642,67	3,30%	49	0,87%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
TOTAL -			27.593.914,58				

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

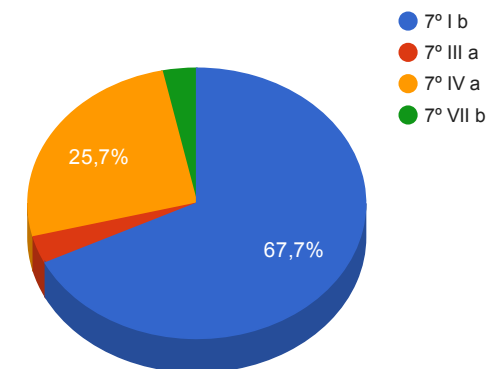
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	90,00%	18.684.429,84	67,71%	6.150.093,28
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	40,00%	904.688,60	3,28%	10.132.877,23
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	7.093.153,47	25,71%	1.185.020,90
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.379.695,73
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.379.695,73
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	911.642,67	3,30%	468.053,06
Total Renda Fixa	100,00%	175,00	27.593.914,58	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%	827.817,44
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.379.695,73
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	2,00%	0,00	0,00%	551.878,29
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 (março / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	5,31%	9,75%	9,75%	15,47%	15,59%	33,54%	-	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5,33%	9,65%	9,65%	15,22%	15,24%	32,68%	0,20%	6,878%	9,71%
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,91%	0,60%	0,60%	5,38%	-	-	0,20%	0,333%	-
IRF-M	3,42%	7,95%	7,95%	10,57%	13,32%	25,52%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,40%	7,82%	7,82%	10,36%	12,70%	24,61%	0,20%	2,462%	4,15%
IRF-M 1	1,26%	4,04%	4,04%	7,79%	14,41%	27,15%	-	-	-
BRDESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1,27%	4,02%	4,02%	7,93%	14,27%	26,69%	0,20%	0,157%	0,79%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,23%	4,00%	4,00%	7,70%	14,21%	26,64%	0,20%	0,168%	0,52%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,21%	3,99%	3,99%	7,67%	14,09%	26,29%	0,10%	0,171%	0,53%
Selic	1,16%	3,26%	3,26%	6,73%	13,74%	26,64%	-	-	-
BRDESCO PREMIUM FI REFERENCIADO DI	1,15%	3,23%	3,23%	6,69%	13,76%	26,83%	0,20%	0,007%	0,03%
CDI	1,16%	3,25%	3,25%	6,72%	13,73%	26,53%	-	-	-
CAIXA BRASIL FI REFERENCIADO DI LP	1,18%	3,25%	3,25%	6,72%	13,80%	26,69%	0,20%	0,036%	0,07%
SANTANDER CORPORATE FIC REFERENCIADO DI	1,14%	3,21%	3,21%	6,69%	13,77%	26,76%	0,20%	0,010%	0,03%
IMA-B 5	0,76%	5,35%	5,35%	10,86%	16,55%	31,87%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,73%	5,24%	5,24%	10,60%	16,05%	30,95%	0,20%	1,835%	3,51%
IPCA	0,42%	2,62%	2,62%	5,51%	9,39%	18,28%	-	-	-

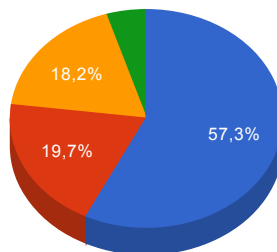
Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (março / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL IPCA XIII FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,34%	4,26%	4,26%	8,22%	15,84%	32,48%	0,20%	0,057%	0,25%
IDKA IPCA 2 Anos	0,15%	5,16%	5,16%	10,57%	17,31%	32,68%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,62%	4,92%	4,92%	10,39%	16,35%	31,45%	0,20%	1,836%	3,11%

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

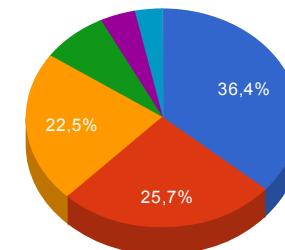
Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	15.798.040,67	57,25%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	5.445.320,29	19,73%
BANCO BRADESCO	5.023.845,23	18,21%
BANCO SANTANDER	1.326.708,39	4,81%

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



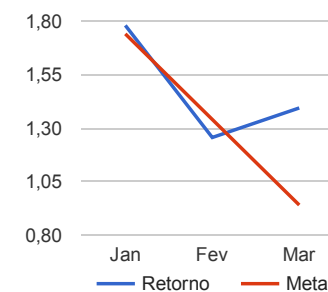
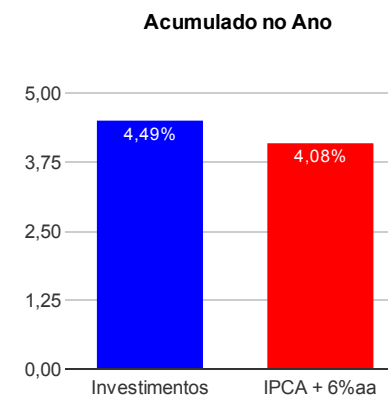
Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	10.049.434,42	36,42%
CDI	7.093.153,47	25,71%
IMA-B 5	6.197.273,72	22,46%
IMA-B	2.185.557,50	7,92%
IDKA IPCA 2A	1.150.541,27	4,17%
CRÉDITO PRIVADO	911.642,67	3,30%
IRF-M	6.311,53	0,02%

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



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%
Fevereiro	26.546.247,99	404.290,46	239.479,60	27.046.486,18	335.427,33	1,26%	1,34%	93,42%	0,83%
Março	27.046.486,18	380.512,11	212.378,29	27.593.914,58	379.294,58	1,39%	0,94%	147,92%	1,04%
Acumulado no ano					1.178.897,56	4,49%	4,08%	110,19%	



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.074.977,40	0,00	0,00	2.185.557,50	110.580,10	5,33%	6,88%	5,33%
CAIXA BRASIL IPCA XIII FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	899.616,71	0,00	0,00	911.642,67	12.025,96	1,34%	0,06%	1,34%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	893.368,22	0,00	0,00	904.688,60	11.320,38	1,27%	0,16%	1,27%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.888.765,33	133.305,52	209.878,29	5.884.983,03	72.790,47	1,21%	0,17%	1,23%
CAIXA BRASIL FI REFERENCIADO DI LP	1.628.105,72	0,00	0,00	1.647.288,45	19.182,73	1,18%	0,04%	1,18%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.983.693,77	240.900,00	2.500,00	3.259.762,79	37.669,02	1,17%	0,17%	1,21%
BRADESCO PREMIUM FI REFERENCIADO DI	4.072.420,48	0,00	0,00	4.119.156,63	46.736,15	1,15%	0,01%	1,15%
SANTANDER CORPORATE FIC REFERENCIADO DI	1.311.756,22	0,00	0,00	1.326.708,39	14.952,17	1,14%	0,01%	1,14%
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.040.572,00	0,00	0,00	1.050.003,00	9.431,00	0,91%	0,33%	0,91%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.109.728,55	0,00	0,00	5.147.270,72	37.542,17	0,73%	1,83%	0,73%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.143.481,78	0,00	0,00	1.150.541,27	7.059,49	0,62%	1,84%	0,62%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	6.306,59	0,00	6.311,53	4,94	0,08%	2,46%	3,40%
Total Renda Fixa					379.294,58	1,39%	1,04%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre / 2016

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	4.891.185,83	0,00	0,00	5.147.270,72	256.084,89	5,24%	5,24%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.557.115,52	708.625,71	612.090,24	5.884.983,03	231.332,04	3,94%	4,00%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.993.167,63	0,00	0,00	2.185.557,50	192.389,87	9,65%	9,65%
BRDESCO PREMIUM FI REFERENCIADO DI	3.990.430,74	0,00	0,00	4.119.156,63	128.725,89	3,23%	3,23%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.230.572,17	924.400,00	8.800,00	3.259.762,79	113.590,62	3,85%	3,99%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.096.536,90	0,00	0,00	1.150.541,27	54.004,37	4,92%	4,92%
CAIXA BRASIL FI REFERENCIADO DI LP	1.595.377,06	0,00	0,00	1.647.288,45	51.911,39	3,25%	3,25%
SANTANDER CORPORATE FIC REFERENCIADO DI	1.285.480,28	0,00	0,00	1.326.708,39	41.228,11	3,21%	3,21%
CAIXA BRASIL IPCA XIII FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	874.360,36	0,00	0,00	911.642,67	37.282,31	4,26%	4,26%
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.043.724,00	0,00	29.693,68	1.050.003,00	35.972,68	3,47%	0,60%
BRDESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	869.687,49	0,00	0,00	904.688,60	35.001,11	4,02%	4,02%
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%	11,16%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	6.306,59	0,00	6.311,53	4,94	0,08%	7,82%
Total Renda Fixa					1.178.897,56	4,49%	

