

Relatório Analítico dos Investimentos em junho, 2º Trimestre e 1º semestre de 2016



Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2016)

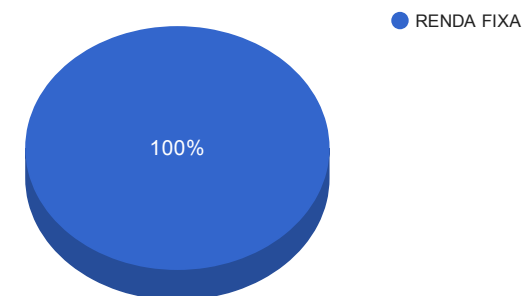
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	6.124.019,54	20,79%	1.331	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.314.832,34	18,04%	701	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.188.788,78	4,03%	602	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	4.228.361,92	14,35%	1.175	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.311.351,61	7,84%	560	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2016	1.087.118,00	3,69%	85	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	933.861,29	3,17%	91	0,08%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.702.675,02	5,78%	747	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER CORPORATE FIC REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.371.728,70	4,66%	1.366	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	4.258.461,77	14,45%	381	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IPCA XIII FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	01/08/2016	941.696,52	3,20%	49	0,87%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
TOTAL -			29.462.895,49				

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

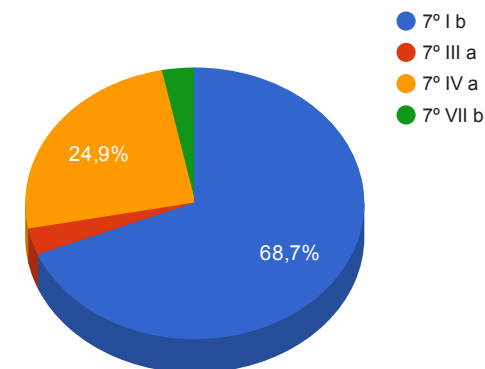
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	90,00%	20.254.472,19	68,75%	6.262.133,75
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	40,00%	933.861,29	3,17%	10.851.296,91
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	7.332.865,49	24,89%	1.506.003,16
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.473.144,77
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.473.144,77
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	941.696,52	3,20%	531.448,25
Total Renda Fixa	100,00%	175,00	29.462.895,49	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%	883.886,86
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.473.144,77
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	2,00%	0,00	0,00%	589.257,91
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 (junho / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	1,93%	16,15%	5,83%	16,15%	16,73%	32,26%	-	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,90%	15,96%	5,76%	15,96%	16,24%	31,43%	0,20%	2,296%	9,75%
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,34%	4,16%	3,53%	4,16%	-	-	0,20%	0,145%	-
Selic	1,16%	6,73%	3,36%	6,73%	14,11%	27,66%	-	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,18%	6,72%	3,38%	6,72%	14,11%	27,85%	0,20%	0,013%	0,02%
CDI	1,16%	6,72%	3,36%	6,72%	14,09%	27,57%	-	-	-
SANTANDER CORPORATE FIC REFERENCIADO DI	1,18%	6,71%	3,39%	6,71%	14,14%	27,81%	0,20%	0,005%	0,02%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,16%	6,73%	3,36%	6,73%	14,15%	27,71%	0,20%	0,007%	0,07%
IRF-M 1	1,08%	7,42%	3,25%	7,42%	14,96%	27,79%	-	-	-
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1,06%	7,38%	3,22%	7,38%	14,78%	27,34%	0,20%	0,114%	0,77%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,06%	7,38%	3,25%	7,38%	14,82%	27,31%	0,20%	0,120%	0,49%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,03%	7,34%	3,22%	7,34%	14,66%	27,00%	0,10%	0,117%	0,51%
IMA-B 5	0,94%	8,84%	3,31%	8,84%	16,94%	31,07%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,92%	8,66%	3,26%	8,66%	16,43%	30,14%	0,20%	1,106%	3,51%
IDKA IPCA 2 Anos	0,93%	8,58%	3,25%	8,58%	17,00%	31,47%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,88%	8,41%	3,32%	8,41%	16,74%	30,55%	0,20%	1,115%	3,11%
IPCA	0,35%	4,42%	1,75%	4,42%	8,84%	18,53%	-	-	-

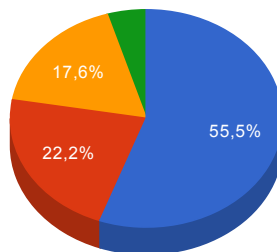
Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (junho / 2016)

	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	1,22%	7,70%	3,30%	7,70%	15,13%	32,45%	0,20%	0,041%	0,22%

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

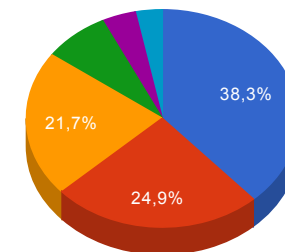
Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	16.359.130,20	55,52%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	6.539.713,53	22,20%
BANCO BRADESCO	5.192.323,06	17,62%
BANCO SANTANDER	1.371.728,70	4,66%

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



Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	11.286.242,75	38,31%
CDI	7.332.865,49	24,89%
IMA-B 5	6.401.950,34	21,73%
IMA-B	2.311.351,61	7,84%
IDKA IPCA 2A	1.188.788,78	4,03%
CRÉDITO PRIVADO	941.696,52	3,20%

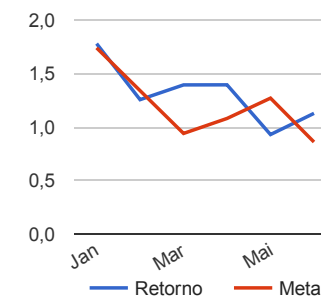
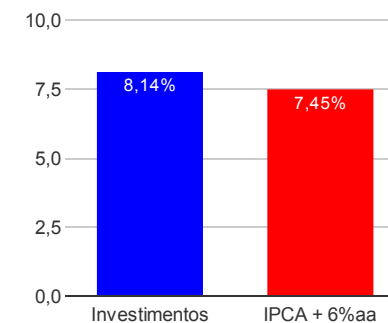
- IRF-M 1
- CDI
- IMA-B 5
- IMA-B
- IDKA IPCA 2A
- CRÉDITO PRIVADO



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%
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%
Abril	27.593.914,58	385.152,67	240.788,77	28.125.050,42	386.771,94	1,39%	1,08%	129,55%	0,67%
Mai	28.125.050,42	431.708,14	243.515,75	28.576.455,94	263.213,13	0,93%	1,27%	73,17%	0,56%
Junho	28.576.455,94	795.050,04	237.153,44	29.462.895,49	328.542,95	1,13%	0,86%	130,86%	0,48%
Acumulado no ano					2.157.425,58	8,14%	7,45%	109,24%	
Acumulado no 2º Trimestre					978.528,02	3,49%	3,24%	107,66%	

Acumulado no Ano



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de junho / 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	2.268.162,25	0,00	0,00	2.311.351,61	43.189,36	1,90%	2,30%	1,90%
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.072.731,00	0,00	0,00	1.087.118,00	14.387,00	1,34%	0,15%	1,34%
CAIXA BRASIL IPCA XIII FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	930.307,40	0,00	0,00	941.696,52	11.389,12	1,22%	0,04%	1,22%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	4.208.819,73	0,00	0,00	4.258.461,77	49.642,04	1,18%	0,01%	1,18%
SANTANDER CORPORATE FIC REFERENCIADO DI	1.355.751,25	0,00	0,00	1.371.728,70	15.977,45	1,18%	0,01%	1,18%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.683.228,47	0,00	0,00	1.702.675,02	19.446,55	1,16%	0,01%	1,16%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	924.091,13	0,00	0,00	933.861,29	9.770,16	1,06%	0,11%	1,06%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.014.751,51	278.573,51	234.153,44	6.124.019,54	64.847,96	1,03%	0,12%	1,06%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.673.684,64	516.476,53	3.000,00	4.228.361,92	41.200,75	0,98%	0,12%	1,03%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.266.482,02	0,00	0,00	5.314.832,34	48.350,32	0,92%	1,11%	0,92%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.178.446,54	0,00	0,00	1.188.788,78	10.342,24	0,88%	1,11%	0,88%
Total Renda Fixa					328.542,95	1,13%	0,48%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre / 2016

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.884.983,03	744.338,32	699.447,83	6.124.019,54	194.146,02	3,18%	3,25%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.147.270,72	0,00	0,00	5.314.832,34	167.561,62	3,26%	3,26%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	4.119.156,63	0,00	0,00	4.258.461,77	139.305,14	3,38%	3,38%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.185.557,50	0,00	0,00	2.311.351,61	125.794,11	5,76%	5,76%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.259.762,79	867.572,53	15.700,00	4.228.361,92	116.726,60	3,13%	3,22%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.647.288,45	0,00	0,00	1.702.675,02	55.386,57	3,36%	3,36%
SANTANDER CORPORATE FIC REFERENCIADO DI	1.326.708,39	0,00	0,00	1.371.728,70	45.020,31	3,39%	3,39%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.150.541,27	0,00	0,00	1.188.788,78	38.247,51	3,32%	3,32%
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.050.003,00	0,00	0,00	1.087.118,00	37.115,00	3,53%	3,53%
CAIXA BRASIL IPCA XIII FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	911.642,67	0,00	0,00	941.696,52	30.053,85	3,30%	3,30%
BRDESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	904.688,60	0,00	0,00	933.861,29	29.172,69	3,22%	3,22%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.311,53	0,00	6.310,13	0,00	-1,40	-0,02%	5,97%
				Total Renda Fixa	978.528,02	3,49%	

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.557.115,52	1.452.964,03	1.311.538,07	6.124.019,54	425.478,06	7,25%	7,38%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.891.185,83	0,00	0,00	5.314.832,34	423.646,51	8,66%	8,66%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.993.167,63	0,00	0,00	2.311.351,61	318.183,98	15,96%	15,96%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	3.990.430,74	0,00	0,00	4.258.461,77	268.031,03	6,72%	6,72%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.230.572,17	1.791.972,53	24.500,00	4.228.361,92	230.317,22	7,11%	7,34%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.595.377,06	0,00	0,00	1.702.675,02	107.297,96	6,73%	6,73%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.096.536,90	0,00	0,00	1.188.788,78	92.251,88	8,41%	8,41%
SANTANDER CORPORATE FIC REFERENCIADO DI	1.285.480,28	0,00	0,00	1.371.728,70	86.248,42	6,71%	6,71%
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.043.724,00	0,00	29.693,68	1.087.118,00	73.087,68	7,13%	4,16%
CAIXA BRASIL IPCA XIII FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	874.360,36	0,00	0,00	941.696,52	67.336,16	7,70%	7,70%
BRDESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	869.687,49	0,00	0,00	933.861,29	64.173,80	7,38%	7,38%
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%	19,48%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	6.306,59	6.310,13	0,00	3,54	0,06%	14,26%
Total Renda Fixa					2.157.425,58	8,14%	