

Relatório Analítico dos Investimentos em julho de 2016



Carteira consolidada de investimentos - base (julho / 2016)

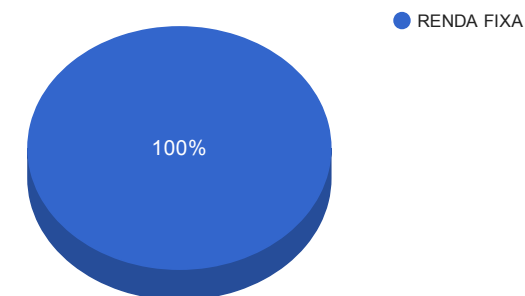
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.201.936,82	3,99%	604	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.369.197,91	7,87%	570	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	4.715.491,45	15,66%	1.170	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.378.125,26	17,85%	707	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	6.047.611,56	20,08%	1.325	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2016	1.099.672,00	3,65%	85	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	943.320,09	3,13%	90	0,09%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.721.556,41	5,72%	748	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.387.105,84	4,61%	1.347	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	4.306.769,78	14,30%	382	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IPCA XIII FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	01/08/2016	950.464,19	3,16%	49	0,87%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
		TOTAL -	30.121.251,31				

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

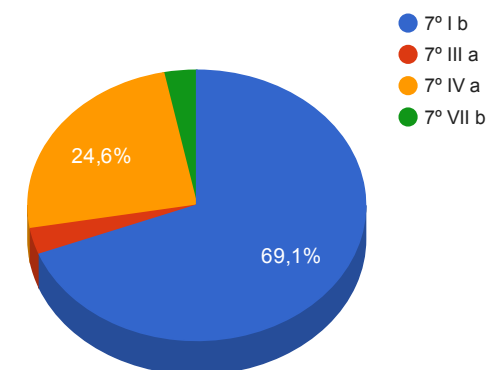
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	90,00%	20.812.035,00	69,09%	6.297.091,18
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	40,00%	943.320,09	3,13%	11.105.180,43
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	7.415.432,03	24,62%	1.620.943,36
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.506.062,57
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.506.062,57
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	950.464,19	3,16%	555.598,38
Total Renda Fixa	100,00%	175,00	30.121.251,31	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%	903.637,54
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.506.062,57
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	2,00%	0,00	0,00%	602.425,03
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 (julho / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	2,51%	19,06%	4,38%	16,82%	20,53%	34,07%	-	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,50%	18,87%	4,33%	16,73%	20,16%	33,25%	0,20%	1,912%	9,57%
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,15%	5,36%	4,00%	3,73%	9,47%	-	0,20%	0,086%	4,25%
IMA-B 5	1,21%	10,15%	2,97%	6,97%	16,28%	31,52%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,19%	9,96%	2,91%	6,84%	15,77%	30,58%	0,20%	0,670%	3,40%
Selic	1,11%	7,91%	3,42%	6,78%	14,03%	27,87%	-	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,13%	7,93%	3,47%	6,80%	14,06%	28,07%	0,20%	0,015%	0,02%
CDI	1,11%	7,90%	3,41%	6,78%	14,01%	27,78%	-	-	-
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,12%	7,91%	3,46%	6,78%	14,05%	28,03%	0,20%	0,007%	0,02%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,11%	7,91%	3,41%	6,79%	14,05%	27,92%	0,20%	0,009%	0,06%
IRF-M 1	1,04%	8,53%	3,22%	6,78%	14,68%	27,91%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,03%	8,49%	3,17%	6,75%	14,55%	27,44%	0,20%	0,110%	0,47%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,03%	8,44%	3,13%	6,71%	14,41%	27,14%	0,10%	0,111%	0,49%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1,01%	8,47%	3,17%	6,71%	14,48%	27,45%	0,20%	0,110%	0,76%
IDKA IPCA 2 Anos	0,91%	9,56%	2,49%	5,59%	15,90%	31,44%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,11%	9,61%	2,80%	6,55%	16,02%	30,88%	0,20%	0,697%	3,03%
IPCA	0,52%	4,96%	1,66%	3,64%	8,74%	19,13%	-	-	-

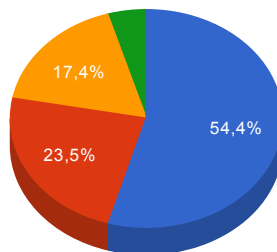
Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (julho / 2016)

	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	0,93%	8,70%	3,29%	7,22%	14,83%	32,55%	0,20%	0,028%	0,21%

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

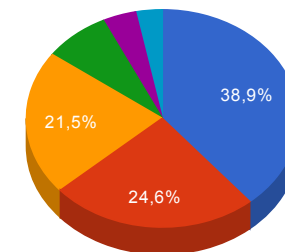
Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	16.399.366,24	54,44%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	7.084.689,36	23,52%
BANCO BRADESCO	5.250.089,87	17,43%
BANCO SANTANDER	1.387.105,84	4,61%

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



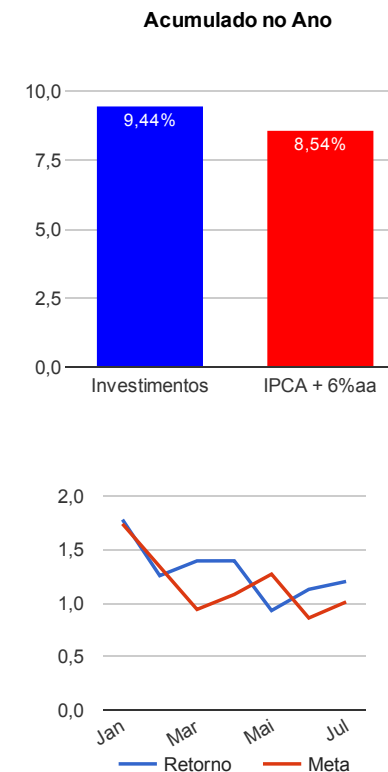
Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	11.706.423,10	38,86%
CDI	7.415.432,03	24,62%
IMA-B 5	6.477.797,26	21,51%
IMA-B	2.369.197,91	7,87%
IDKA IPCA 2A	1.201.936,82	3,99%
CRÉDITO PRIVADO	950.464,19	3,16%

- 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%
Julho	29.462.895,49	542.186,05	241.509,67	30.121.251,31	357.679,44	1,20%	1,01%	119,07%	0,35%
Acumulado no ano					2.515.105,02	9,44%	8,54%	110,58%	



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de julho / 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	2.311.351,61	0,00	0,00	2.369.197,91	57.846,30	2,50%	1,91%	2,50%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.314.832,34	0,00	0,00	5.378.125,26	63.292,92	1,19%	0,67%	1,19%
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.087.118,00	0,00	0,00	1.099.672,00	12.554,00	1,15%	0,09%	1,15%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	4.258.461,77	0,00	0,00	4.306.769,78	48.308,01	1,13%	0,01%	1,13%
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.371.728,70	0,00	0,00	1.387.105,84	15.377,14	1,12%	0,01%	1,12%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.702.675,02	0,00	0,00	1.721.556,41	18.881,39	1,11%	0,01%	1,11%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.188.788,78	0,00	0,00	1.201.936,82	13.148,04	1,11%	0,70%	1,11%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.124.019,54	95.187,04	235.009,67	6.047.611,56	63.414,65	1,02%	0,11%	1,03%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	933.861,29	0,00	0,00	943.320,09	9.458,80	1,01%	0,11%	1,01%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.228.361,92	446.999,01	6.500,00	4.715.491,45	46.630,52	1,00%	0,11%	1,03%
CAIXA BRASIL IPCA XIII FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	941.696,52	0,00	0,00	950.464,19	8.767,67	0,93%	0,03%	0,93%
Total Renda Fixa					357.679,44	1,20%	0,35%	