

Relatório Analítico dos Investimentos em agosto de 2016



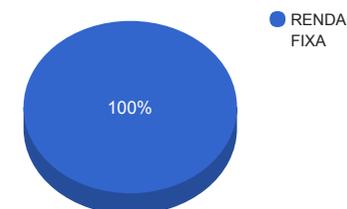
Carteira consolidada de investimentos - base (agosto / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	4.403.713,70	14,36%	601	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.227.760,66	7,26%	631	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.008.805,26	3,29%	207	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.407.699,18	7,85%	716	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.445.316,90	21,01%	731	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.985.270,81	12,99%	1.336	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.747.033,32	8,96%	1.176	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRABESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.975.722,31	9,70%	88	0,31%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	730.794,74	2,38%	763	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.403.979,19	4,58%	1.335	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRABESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	2.337.026,08	7,62%	384	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
		TOTAL -	30.673.122,15				

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

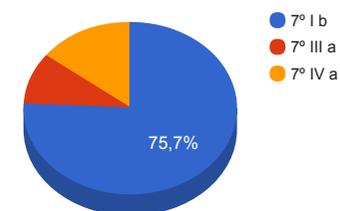
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	90,00%	23.225.599,83	75,72%	4.380.210,11
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	40,00%	2.975.722,31	9,70%	9.293.526,55
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	4.471.800,01	14,58%	4.730.136,64
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.533.656,11
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.533.656,11
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.533.656,11
Total Renda Fixa	100,00%	175,00	30.673.122,15	100,00%	

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	3,00%	0,00	0,00%	920.193,66
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.533.656,11
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	2,00%	0,00	0,00%	613.462,44
Total Renda Variável	30,00%	10,00	0,00	0,00%	

Distribuição por Artigo / Resolução



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

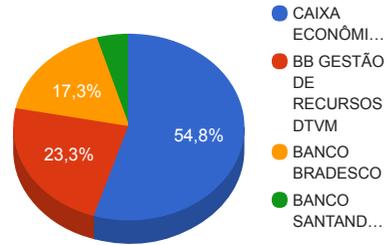
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDKA IPCA 2 Anos	1,29%	10,97%	3,16%	5,69%	17,70%	31,48%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,22%	10,94%	3,23%	6,39%	17,78%	30,85%	0,20%	0,732%	2,94%
Selic	1,22%	9,22%	3,53%	7,01%	14,15%	28,31%	-	-	-
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,22%	9,24%	3,57%	7,04%	14,18%	28,51%	0,20%	0,007%	0,02%
CDI	1,21%	9,21%	3,52%	7,00%	14,13%	28,23%	-	-	-
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,22%	9,22%	3,56%	7,03%	14,16%	28,47%	0,20%	0,003%	0,02%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,21%	9,21%	3,51%	7,02%	14,14%	28,35%	0,20%	0,008%	0,06%
IRF-M 1	1,19%	9,83%	3,35%	6,89%	14,87%	28,36%	-	-	-
BRDESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1,18%	9,75%	3,28%	6,84%	14,59%	27,89%	0,20%	0,055%	0,75%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,17%	9,76%	3,30%	6,83%	14,74%	27,89%	0,20%	0,051%	0,45%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,16%	9,70%	3,26%	6,78%	14,60%	27,58%	0,10%	0,051%	0,47%
IMA-B 5	1,09%	11,35%	3,27%	6,50%	18,11%	31,19%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,07%	11,13%	3,21%	6,38%	17,61%	30,24%	0,20%	0,801%	3,29%
IMA Geral	1,03%	15,92%	4,57%	11,75%	19,78%	27,84%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,02%	15,64%	4,49%	11,57%	19,16%	26,88%	0,20%	0,925%	4,52%
IMA-B	0,89%	20,11%	5,41%	15,26%	25,51%	29,04%	-	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,89%	19,92%	5,38%	15,20%	25,07%	28,34%	0,20%	1,899%	9,26%

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

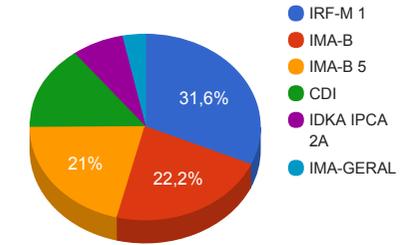
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,83%	19,82%	5,32%	15,12%	24,30%	26,87%	0,20%	1,871%	9,20%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	16.805.647,55	54,79%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	7.150.747,02	23,31%
BANCO BRADESCO	5.312.748,39	17,32%
BANCO SANTANDER	1.403.979,19	4,58%



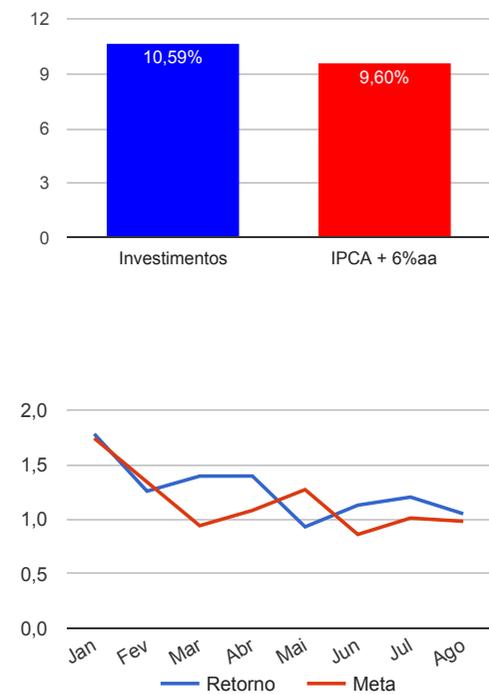
Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	9.708.026,44	31,65%
IMA-B	6.811.412,88	22,21%
IMA-B 5	6.445.316,90	21,01%
CDI	4.471.800,01	14,58%
IDKA IPCA 2A	2.227.760,66	7,26%
IMA-GERAL	1.008.805,26	3,29%



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	28.125.050,44	386.771,96	1,39%	1,08%	129,55%	0,67%
Mai	28.125.050,44	431.708,14	243.515,75	28.576.455,94	263.213,11	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%
Agosto	30.121.251,31	10.512.176,82	10.278.772,99	30.673.122,15	318.467,01	1,05%	0,98%	107,54%	0,69%
Acumulado no ano					2.833.572,03	10,59%	9,60%	110,35%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.387.105,84	0,00	0,00	1.403.979,19	16.873,35	1,22%	0,00%	1,22%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.201.936,82	1.000.000,00	0,00	2.227.760,66	25.823,84	1,17%	0,73%	1,22%
BRASESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	943.320,09	2.000.000,00	0,00	2.975.722,31	32.402,22	1,10%	0,05%	1,18%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.378.125,26	1.000.000,00	0,00	6.445.316,90	67.191,64	1,05%	0,80%	1,07%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	1.000.000,00	0,00	1.008.805,26	8.805,26	0,88%	0,93%	1,02%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.369.197,91	2.000.000,00	0,00	4.403.713,70	34.515,79	0,79%	1,90%	0,89%
BRASESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	4.306.769,78	0,00	2.000.000,00	2.337.026,08	30.256,30	0,70%	0,01%	1,22%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.715.491,45	6.383,98	2.007.500,00	2.747.033,32	32.657,89	0,69%	0,05%	1,16%
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.099.672,00	0,00	1.107.112,00	0,00	7.440,00	0,68%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.047.611,56	1.108.837,00	3.213.289,89	3.985.270,81	42.112,14	0,59%	0,05%	1,17%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.721.556,41	0,00	1.000.000,00	730.794,74	9.238,33	0,54%	0,01%	1,21%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	2.396.955,84	0,00	2.407.699,18	10.743,34	0,45%	1,87%	0,83%
CAIXA BRASIL IPCA XIII FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	950.464,19	0,00	950.871,10	0,00	406,91	0,04%	-	-
Total Renda Fixa					318.467,01	1,05%	0,69%	