

Relatório Analítico dos Investimentos em outubro de 2016



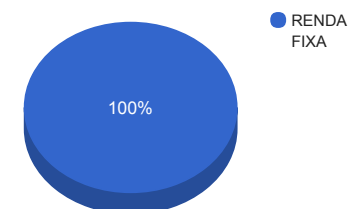
Carteira consolidada de investimentos - base (outubro / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.842.372,83	8,98%	738	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	4.500.455,49	14,22%	620	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.267.088,20	7,16%	641	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.034.889,63	3,27%	208	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	4.040.120,06	12,76%	1.330	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.797.751,01	8,84%	1.170	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.565.256,23	20,74%	733	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRAPRESIRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.039.277,33	9,60%	87	0,36%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRAPRESIRF-M 1 FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	2.390.408,71	7,55%	399	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	746.613,61	2,36%	751	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.434.494,83	4,53%	1.329	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
		TOTAL -	31.658.727,93				

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

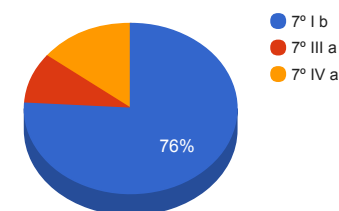
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	90,00%	24.047.933,45	75,96%	4.444.921,69
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	40,00%	3.039.277,33	9,60%	9.624.213,84
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	4.571.517,15	14,44%	4.926.101,23
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.582.936,40
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.582.936,40
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.582.936,40
Total Renda Fixa	100,00%	175,00	31.658.727,93	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%	949.761,84
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.582.936,40
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	2,00%	0,00	0,00%	633.174,56
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 (outubro / 2016)

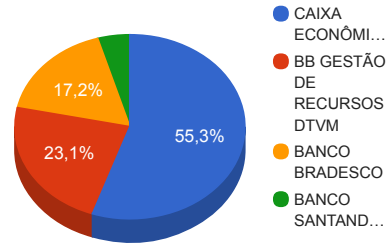
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Selic	1,05%	11,59%	3,41%	6,95%	14,08%	28,69%	-	-	-
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,17%	11,74%	3,53%	7,13%	14,23%	28,98%	0,20%	0,040%	0,04%
CDI	1,05%	11,58%	3,41%	6,94%	14,06%	28,63%	-	-	-
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,05%	11,59%	3,42%	6,99%	14,10%	28,82%	0,20%	0,005%	0,02%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,05%	11,58%	3,40%	6,92%	14,05%	28,73%	0,20%	0,008%	0,04%
IRF-M 1	0,94%	12,18%	3,36%	6,69%	14,72%	28,94%	-	-	-
BRDESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,96%	12,09%	3,34%	6,61%	14,54%	28,54%	0,20%	0,182%	0,38%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,94%	12,10%	3,33%	6,60%	14,59%	28,51%	0,20%	0,171%	0,35%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,94%	12,02%	3,30%	6,54%	14,50%	28,20%	0,10%	0,177%	0,35%
IMA Geral	0,90%	18,76%	3,50%	7,58%	21,23%	31,01%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,99%	18,63%	3,64%	7,60%	21,07%	30,17%	0,20%	1,147%	3,38%
IMA-B	0,64%	22,78%	3,13%	7,65%	25,94%	33,95%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,65%	22,51%	3,09%	7,53%	25,56%	31,59%	0,20%	2,279%	6,81%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,62%	22,56%	3,11%	7,57%	25,65%	33,14%	0,20%	2,279%	6,78%
IMA-B 5	0,46%	13,44%	2,99%	6,05%	16,48%	32,40%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,46%	13,20%	2,95%	5,95%	16,15%	31,42%	0,20%	0,735%	2,53%
IDKA IPCA 2 Anos	0,41%	13,11%	3,23%	5,80%	15,48%	32,92%	-	-	-

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

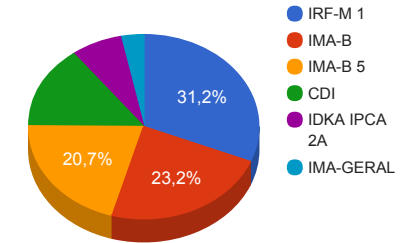
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,43%	12,90%	3,00%	5,89%	15,70%	31,80%	0,20%	0,673%	2,42%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	17.496.340,56	55,27%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	7.298.206,50	23,05%
BANCO BRADESCO	5.429.686,04	17,15%
BANCO SANTANDER	1.434.494,83	4,53%



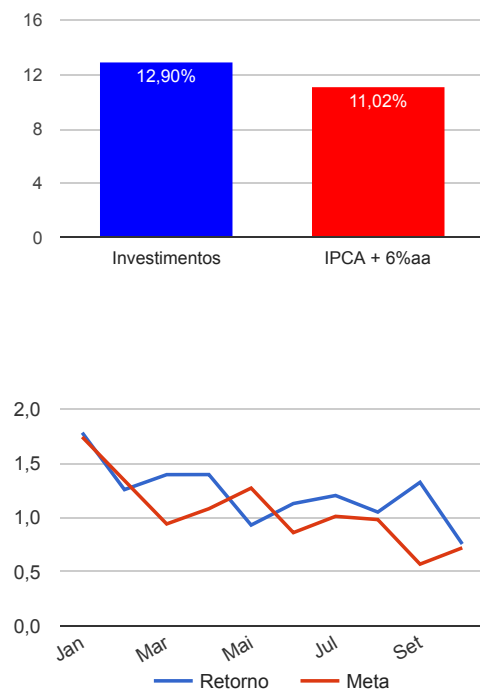
Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	9.877.148,40	31,20%
IMA-B	7.342.828,32	23,19%
IMA-B 5	6.565.256,23	20,74%
CDI	4.571.517,15	14,44%
IDKA IPCA 2A	2.267.088,20	7,16%
IMA-GERAL	1.034.889,63	3,27%



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%
Setembro	30.673.122,15	454.189,61	248.981,71	31.286.874,13	408.544,08	1,32%	0,57%	233,29%	0,78%
Outubro	31.286.874,13	385.054,11	250.609,76	31.658.727,93	237.409,45	0,76%	0,72%	104,26%	0,83%
Acumulado no ano					3.479.525,56	12,90%	11,02%	117,09%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.362.681,88	0,00	0,00	2.390.408,71	27.726,83	1,17%	0,04%	1,17%
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.419.531,04	0,00	0,00	1.434.494,83	14.963,79	1,05%	0,01%	1,05%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	738.863,33	0,00	0,00	746.613,61	7.750,28	1,05%	0,01%	1,05%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.024.747,37	0,00	0,00	1.034.889,63	10.142,26	0,99%	1,15%	0,99%
BRDESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	3.010.497,11	0,00	0,00	3.039.277,33	28.780,22	0,96%	0,18%	0,96%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.773.309,32	0,00	1.700,00	2.797.751,01	26.141,69	0,94%	0,18%	0,94%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.245.970,15	3.450,00	248.909,76	4.040.120,06	39.609,67	0,93%	0,17%	0,94%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.472.578,45	0,00	0,00	4.500.455,49	27.877,04	0,62%	2,28%	0,62%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.445.821,39	381.604,11	0,00	2.842.372,83	14.947,33	0,53%	2,28%	0,65%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.535.459,78	0,00	0,00	6.565.256,23	29.796,45	0,46%	0,74%	0,46%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.257.414,31	0,00	0,00	2.267.088,20	9.673,89	0,43%	0,67%	0,43%
Total Renda Fixa					237.409,45	0,76%	0,83%	