

Relatório Analítico dos Investimentos em dezembro, 4º Trimestre e ano de 2016



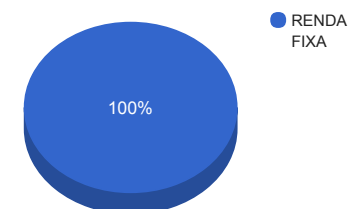
Carteira consolidada de investimentos - base (dezembro / 2016)

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	4.691.391,60	14,24%	1.340	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.055.096,97	3,20%	198	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.680.875,98	20,28%	713	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.890.031,47	8,77%	721	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	4.572.330,06	13,88%	603	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.308.036,09	7,01%	620	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.959.558,46	8,99%	1.183	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRANCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.106.589,03	9,43%	86	0,34%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRANCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	2.444.243,79	7,42%	411	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.465.979,99	4,45%	1.321	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	762.803,14	2,32%	758	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
		TOTAL -	32.936.936,58				

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

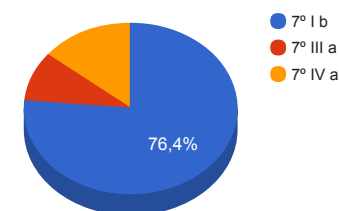
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	90,00%	25.157.320,63	76,38%	4.485.922,29
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	40,00%	3.106.589,03	9,43%	10.068.185,60
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	4.673.026,92	14,19%	5.208.054,05
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.646.846,83
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.646.846,83
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.646.846,83
Total Renda Fixa	100,00%	175,00	32.936.936,58	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%	988.108,10
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.646.846,83
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	2,00%	0,00	0,00%	658.738,73
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 (dezembro / 2016)

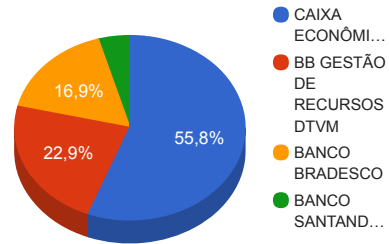
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	2,91%	24,81%	2,30%	7,46%	24,81%	35,90%	-	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,89%	24,52%	2,23%	7,37%	24,52%	35,13%	0,20%	3,579%	7,34%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,88%	24,56%	2,33%	7,42%	24,56%	33,62%	0,20%	3,583%	7,33%
IMA Geral	1,88%	21,00%	2,80%	7,20%	21,00%	32,27%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,91%	20,94%	2,96%	7,39%	20,94%	31,47%	0,20%	1,784%	3,65%
IMA-B 5	1,39%	15,48%	2,27%	6,11%	15,48%	33,33%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,38%	15,19%	2,23%	6,01%	15,19%	32,31%	0,20%	1,325%	2,60%
IDKA IPCA 2 Anos	1,28%	15,21%	2,28%	6,11%	15,21%	34,09%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,23%	14,94%	2,24%	6,02%	14,94%	32,76%	0,20%	1,023%	2,42%
IRF-M 1	1,20%	14,72%	3,22%	6,79%	14,72%	29,64%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,18%	14,58%	3,18%	6,71%	14,58%	29,20%	0,20%	0,098%	0,35%
BRADERCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1,17%	14,57%	3,19%	6,70%	14,57%	29,27%	0,20%	0,101%	0,35%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,17%	14,48%	3,16%	6,66%	14,48%	28,89%	0,10%	0,100%	0,35%
Selic	1,12%	14,02%	3,24%	6,83%	14,02%	29,15%	-	-	-
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,12%	14,25%	3,45%	7,06%	14,25%	29,51%	0,20%	0,006%	0,05%
CDI	1,12%	14,00%	3,24%	6,82%	14,00%	29,09%	-	-	-
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,13%	14,04%	3,27%	6,87%	14,04%	29,29%	0,20%	0,005%	0,02%

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

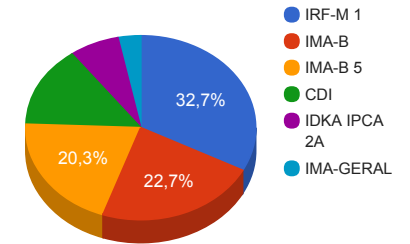
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,11%	14,00%	3,24%	6,81%	14,00%	29,18%	0,20%	0,016%	0,04%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	18.388.235,25	55,83%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	7.531.888,52	22,87%
BANCO BRADESCO	5.550.832,82	16,85%
BANCO SANTANDER	1.465.979,99	4,45%



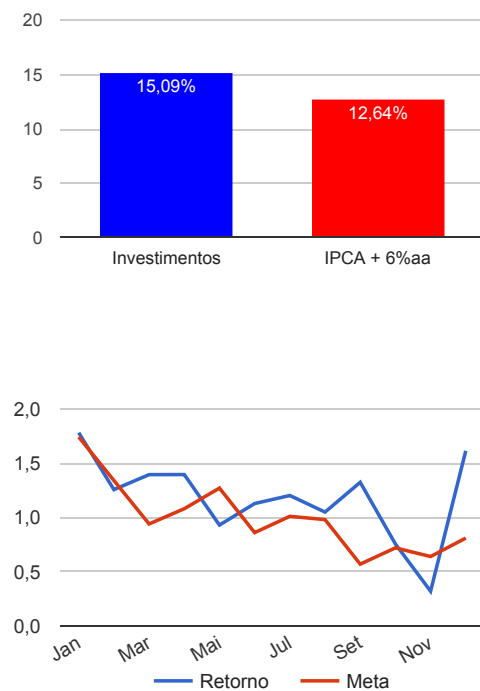
Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	10.757.539,09	32,66%
IMA-B	7.462.361,53	22,66%
IMA-B 5	6.680.875,98	20,28%
CDI	4.673.026,92	14,19%
IDKA IPCA 2A	2.308.036,09	7,01%
IMA-GERAL	1.055.096,97	3,20%



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%
Novembro	31.658.727,93	503.614,75	245.209,60	32.019.551,63	102.418,55	0,32%	0,64%	49,80%	1,63%
Dezembro	32.019.551,63	694.586,02	299.981,94	32.936.936,58	522.780,87	1,61%	0,81%	198,74%	1,24%
Acumulado no ano					4.104.724,98	15,09%	12,64%	119,38%	

Acumulado no Ano



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de dezembro / 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	4.443.888,59	0,00	0,00	4.572.330,06	128.441,47	2,89%	3,58%	2,89%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.809.247,42	0,00	0,00	2.890.031,47	80.784,05	2,88%	3,58%	2,88%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.035.296,70	0,00	0,00	1.055.096,97	19.800,27	1,91%	1,78%	1,91%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.590.047,84	0,00	0,00	6.680.875,98	90.828,14	1,38%	1,32%	1,38%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.280.028,38	0,00	0,00	2.308.036,09	28.007,71	1,23%	1,02%	1,23%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	3.070.529,09	0,00	0,00	3.106.589,03	36.059,94	1,17%	0,10%	1,17%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.892.518,60	33.147,38	0,00	2.959.558,46	33.892,48	1,16%	0,10%	1,17%
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.449.667,22	0,00	0,00	1.465.979,99	16.312,77	1,13%	0,01%	1,13%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.417.237,08	0,00	0,00	2.444.243,79	27.006,71	1,12%	0,01%	1,12%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	754.449,27	0,00	0,00	762.803,14	8.353,87	1,11%	0,02%	1,11%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.276.641,44	661.438,64	299.981,94	4.691.391,60	53.293,46	1,08%	0,10%	1,18%
				Total Renda Fixa	522.780,87	1,61%	1,24%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º 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	6.535.459,78	0,00	0,00	6.680.875,98	145.416,20	2,23%	2,23%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.245.970,15	1.102.709,52	794.101,30	4.691.391,60	136.813,23	3,02%	3,18%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.472.578,45	0,00	0,00	4.572.330,06	99.751,61	2,23%	2,23%
BRDESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	3.010.497,11	0,00	0,00	3.106.589,03	96.091,92	3,19%	3,19%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.773.309,32	98.941,25	1.700,00	2.959.558,46	89.007,89	3,15%	3,16%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.362.681,88	0,00	0,00	2.444.243,79	81.561,91	3,45%	3,45%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.445.821,39	381.604,11	0,00	2.890.031,47	62.605,97	2,21%	2,33%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.257.414,31	0,00	0,00	2.308.036,09	50.621,78	2,24%	2,24%
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.419.531,04	0,00	0,00	1.465.979,99	46.448,95	3,27%	3,27%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.024.747,37	0,00	0,00	1.055.096,97	30.349,60	2,96%	2,96%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	738.863,33	0,00	0,00	762.803,14	23.939,81	3,24%	3,24%
Total Renda Fixa					862.608,87	2,71%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no Ano de 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	1.000.000,00	0,00	6.680.875,98	789.690,15	15,17%	15,19%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.557.115,52	4.213.887,20	5.797.420,64	4.691.391,60	717.809,52	13,54%	14,58%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.993.167,63	2.000.000,00	0,00	4.572.330,06	579.162,43	24,39%	24,52%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	3.990.430,74	0,00	2.000.000,00	2.444.243,79	453.813,05	13,67%	14,25%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.230.572,17	2.344.296,77	2.045.700,00	2.959.558,46	430.389,52	13,65%	14,48%
BRDESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	869.687,49	2.000.000,00	0,00	3.106.589,03	236.901,54	14,48%	14,57%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.096.536,90	1.000.000,00	0,00	2.308.036,09	211.499,19	14,89%	14,94%
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.285.480,28	0,00	0,00	1.465.979,99	180.499,71	14,04%	14,04%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.595.377,06	0,00	1.000.000,00	762.803,14	167.426,08	13,24%	14,00%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	2.778.559,95	0,00	2.890.031,47	111.471,52	4,30%	24,56%
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.043.724,00	0,00	1.136.805,68	0,00	93.081,68	9,10%	-
CAIXA BRASIL IPCA XIII FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	874.360,36	0,00	950.871,10	0,00	76.510,74	8,75%	-
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	1.000.000,00	0,00	1.055.096,97	55.096,97	5,51%	20,94%
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%	29,55%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	6.306,59	6.310,13	0,00	3,54	0,06%	23,26%
Total Renda Fixa					4.104.724,98	15,09%	