

Relatório Analítico dos Investimentos em março e 1º Trimestre de 2016

Carteira consolidada de investimentos - base (março / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	6.910.945,50	22,56%	1.319	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.590.417,96	5,19%	1.169	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	346.503,22	1,13%	564	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.955.682,39	16,18%	666	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	4.629.365,78	15,11%	721	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	D+0	Não há	3.039.321,23	9,92%	330	0,14%	Artigo 7º, Inciso III
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	52.389,38	0,17%	579	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	3.913.155,61	12,77%	752	0,09%	Artigo 7º, Inciso IV
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	1.516.781,26	4,95%	843	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	Não se aplica	Não se aplica	26.764,99	0,09%	98	0,02%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IPCA XIV FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	01/08/2016	758.446,00	2,48%	31	0,78%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	18/04/2018	350.105,10	1,14%	100	0,18%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	D+4	Não há	436.107,63	1,42%	89	0,56%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	53.745,88	0,18%	1.191	0,17%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	53.358,79	0,17%	132	0,40%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	58.183,08	0,19%	249	0,58%	Artigo 8º, Inciso III
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	D+4	Não há	499.445,09	1,63%	85	0,50%	Artigo 8º, Inciso III
BB PIPE FIC AÇÕES	D+4	03/06/2018	374.496,49	1,22%	48	0,45%	Artigo 8º, Inciso III
BB CONSUMO FIC AÇÕES	D+4	Não há	149.890,01	0,49%	2.455	0,20%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA BRASIL IPCA VII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+0	22/11/2016	879.186,50	2,87%	20	0,93%	Artigo 8º, Inciso IV
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se aplica	Não se aplica	40.611,50	0,13%		0,03%	Artigo 8º, Inciso VI
Total			30.634.903,39				

Enquadramentos na Resolução 3.922 / 4.392 / 4.604 e Política de Investimentos - base (março / 2016)

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '	100,00%	80,00%	18.432.914,85	60,17%	6.075.007,86
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '	80,00%	50,00%	0,00	0,00%	15.317.451,70
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b ' '	80,00%	10,00%	0,00	0,00%	3.063.490,34
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' '	30,00%	30,00%	0,00	0,00%	9.190.471,02
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b ' '	30,00%	10,00%	0,00	0,00%	3.063.490,34
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.531.745,17
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a ' '	5,00%	5,00%	26.764,99	0,09%	1.504.980,18
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b ' '	5,00%	5,00%	1.108.551,10	3,62%	423.194,07
Total Renda Fixa	100,00%	195,00	19.568.230,94	63,88%	

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	10,00%	436.107,63	1,42%	2.627.382,71
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	1.189.119,34	3,88%	3.406.116,17
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	879.186,50	2,87%	652.558,67
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.531.745,17
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	40.611,50	0,13%	1.491.133,67
Total	30,00%	40,00	2.545.024,97	8,31%	

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	5,311%	9,75%	9,75%	15,47%	15,59%	33,54%	-	-	-
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	5,23%	9,26%	9,26%	14,76%	14,44%	32,78%	0,20%	6,362%	8,92%
IRF-M 1	1,257%	4,04%	4,04%	7,79%	14,41%	27,15%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,23%	4,00%	4,00%	7,70%	14,21%	26,64%	0,20%	0,168%	0,52%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,21%	3,99%	3,99%	7,67%	14,09%	26,29%	0,10%	0,171%	0,53%
CDI	1,161%	3,25%	3,25%	6,72%	13,73%	26,53%	-	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,18%	3,25%	3,25%	6,72%	13,80%	26,69%	0,20%	0,036%	0,07%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,11%	3,16%	3,16%	6,66%	13,82%	26,87%	0,20%	0,015%	0,05%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1,05%	2,98%	2,98%	6,23%	12,77%	24,51%	1,00%	0,009%	0,03%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	-1,31%	-1,64%	-1,64%	-1,28%	-6,90%	-22,58%	0,25%	0,935%	-
IPCA + 6,00% ao ano	0,942%	4,08%	4,08%	8,58%	15,90%	32,87%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	2,40%	7,45%	7,45%	13,42%	-	-	0,20%	1,277%	-
IMA-B 5	0,758%	5,35%	5,35%	10,86%	16,55%	31,87%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,73%	5,24%	5,24%	10,60%	16,05%	30,95%	0,20%	1,835%	3,51%
IPCA	0,420%	2,62%	2,62%	5,51%	9,39%	18,28%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XIV FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,34%	4,26%	4,26%	8,22%	15,84%	32,48%	0,20%	0,057%	0,25%
IDKA IPCA 2 Anos	0,153%	5,16%	5,16%	10,57%	17,31%	32,68%	-	-	-

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (março / 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	0,62%	4,92%	4,92%	10,39%	16,35%	31,45%	0,20%	1,836%	3,11%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,53%	4,93%	4,93%	10,39%	16,25%	31,02%	0,20%	1,837%	3,20%

Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (março / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDIV	20,60%	17,98%	17,98%	11,69%	-8,75%	-27,78%	-	-	-
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	14,33%	9,66%	9,66%	4,73%	-14,17%	-28,83%	1,50%	15,066%	25,56%
Ibovespa	16,97%	15,47%	15,47%	11,09%	-2,14%	-0,71%	-	-	-
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	14,88%	13,22%	13,22%	11,96%	-13,19%	-26,28%	2,00%	13,540%	22,74%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	11,85%	11,50%	11,50%	7,55%	-3,23%	2,16%	1,00%	14,630%	21,91%
BB PIPE FIC AÇÕES	8,20%	12,36%	12,36%	8,42%	4,18%	17,61%	1,20%	8,288%	14,13%
BB CONSUMO FIC AÇÕES	7,02%	6,70%	6,70%	-0,40%	-3,06%	11,88%	1,00%	10,225%	19,23%
IBX-50	16,41%	15,03%	15,03%	9,34%	-2,86%	-0,61%	-	-	-
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	11,10%	7,50%	7,50%	1,92%	-8,51%	-8,42%	0,70%	14,807%	23,75%
SMLL	11,39%	6,64%	6,64%	4,41%	-11,68%	-27,24%	-	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	6,04%	2,82%	2,82%	3,88%	-6,48%	-20,11%	1,50%	7,654%	17,65%
IFIX	9,11%	5,39%	5,39%	6,07%	10,24%	11,15%	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	10,81%	2,50%	2,50%	3,79%	-1,68%	-56,61%	1,20%	-	37,77%
IPCA + 6,00% ao ano	0,94%	4,08%	4,08%	8,58%	15,90%	32,87%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA VII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1,32%	4,62%	4,62%	9,02%	16,47%	33,57%	0,20%	0,220%	0,46%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	21.795.352,43	71,15%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	8.812.785,97	28,77%
FINAXIS CORRETORA	26.764,99	0,09%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	8.501.363,46	27,75%
CDI	5.482.326,25	17,90%
IDKA IPCA 2A	4.975.869,00	16,24%
IMA-B 5	4.955.682,39	16,18%
IMA-B	3.039.321,23	9,92%
AÇÕES - INDEXADO	499.445,09	1,63%
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	436.107,63	1,42%
AÇÕES - LIVRES	374.496,49	1,22%
CRÉDITO PRIVADO	350.105,10	1,14%
AÇÕES - SETORIAIS	203.248,80	0,66%
AÇÕES - SMALL / MID CAPS	58.183,08	0,19%
AÇÕES - DIVIDENDOS	53.745,88	0,18%
FUNDO IMOBILIÁRIO	40.611,50	0,13%
FIDC	26.764,99	0,09%

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Acumulado no Ano

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	29.427.425,26	540.876,47	592.000,00	29.812.425,58	436.123,85	1,48%	1,98%	74,83%	1,45%
Fevereiro	29.812.425,58	5.922.476,97	6.544.063,24	29.633.078,26	442.238,95	1,48%	1,39%	106,38%	1,39%
Março	29.633.078,26	1.045.504,73	603.000,00	30.634.903,39	559.320,40	1,86%	0,95%	195,30%	1,97%
Acumulado no ano					1.437.683,20	4,90%	4,39%	111,75%	

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	2.888.205,14	0,00	0,00	3.039.321,23	151.116,09	5,23%	6,36%	5,23%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	341.883,90	0,00	0,00	350.105,10	8.221,20	2,40%	1,28%	2,40%
CAIXA BRASIL IPCA XIV FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	748.452,40	0,00	0,00	758.446,00	9.993,60	1,34%	0,06%	1,34%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.571.353,59	0,00	0,00	1.590.417,96	19.064,37	1,21%	0,17%	1,21%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	3.867.586,79	0,00	0,00	3.913.155,61	45.568,82	1,18%	0,04%	1,18%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.742.553,73	643.325,33	560.000,00	6.910.945,50	85.066,44	1,15%	0,17%	1,23%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1.542.942,93	0,00	43.000,00	1.516.781,26	16.838,33	1,09%	0,02%	1,11%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.919.537,59	0,00	0,00	4.955.682,39	36.144,80	0,73%	1,83%	0,73%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.605.142,22	0,00	0,00	4.629.365,78	24.223,56	0,53%	1,84%	0,53%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,00	52.363,87	0,00	52.389,38	25,51	0,05%	0,01%	1,05%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	349.815,53	0,00	346.503,22	-3.312,31	-0,95%	1,84%	0,62%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	27.120,55	0,00	0,00	26.764,99	-355,56	-1,31%	0,94%	-1,31%
Total Renda Fixa					392.594,85	1,42%	1,41%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	46.448,33	0,00	0,00	53.358,79	6.910,46	14,88%	13,54%	14,88%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	47.009,98	0,00	0,00	53.745,88	6.735,90	14,33%	15,07%	14,33%
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	446.534,11	0,00	0,00	499.445,09	52.910,98	11,85%	14,63%	11,85%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	392.543,58	0,00	0,00	436.107,63	43.564,05	11,10%	14,81%	11,10%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	37.000,00	0,00	0,00	40.611,50	3.611,50	9,76%	-	9,76%
BB PIPE FIC AÇÕES	346.127,68	0,00	0,00	374.496,49	28.368,81	8,20%	8,29%	8,20%
BB CONSUMO FIC AÇÕES	140.061,72	0,00	0,00	149.890,01	9.828,29	7,02%	10,22%	7,02%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	54.868,52	0,00	0,00	58.183,08	3.314,56	6,04%	7,65%	6,04%
CAIXA BRASIL IPCA VII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	867.705,50	0,00	0,00	879.186,50	11.481,00	1,32%	0,22%	1,32%
				Total Renda Variável	166.725,55	7,01%	8,21%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º 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	6.670.616,71	643.325,33	669.409,50	6.910.945,50	266.412,96	3,91%	4,00%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	2.781.843,30	0,00	0,00	3.039.321,23	257.477,93	9,26%	9,26%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.709.129,32	0,00	0,00	4.955.682,39	246.553,07	5,24%	5,24%
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	4.607.840,96	0,00	4.750.799,31	0,00	142.958,35	3,10%	7,12%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	3.250.254,82	540.876,47	0,00	3.913.155,61	122.024,32	3,22%	3,25%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	2.371.259,33	0,00	912.597,60	1.516.781,26	58.119,53	3,05%	3,16%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.316.884,04	0,00	1.364.256,83	0,00	47.372,79	3,60%	9,50%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	278.600,88	1.322.465,81	42.000,00	1.590.417,96	31.351,27	3,22%	3,99%
CAIXA BRASIL IPCA XIV FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	727.456,00	0,00	0,00	758.446,00	30.990,00	4,26%	4,26%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	4.600.011,16	0,00	4.629.365,78	29.354,62	0,64%	4,93%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	325.844,40	0,00	0,00	350.105,10	24.260,70	7,45%	7,45%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,00	52.363,87	0,00	52.389,38	25,51	0,05%	2,98%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	27.211,63	0,00	0,00	26.764,99	-446,64	-1,64%	-1,64%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	349.815,53	0,00	346.503,22	-3.312,31	-0,95%	4,92%
Total Renda Fixa					1.253.142,10	4,64%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB GOVERNANÇA IS FI AÇÕES	447.914,53	0,00	0,00	499.445,09	51.530,56	11,50%	11,50%
BB PIPE FIC AÇÕES	333.309,71	0,00	0,00	374.496,49	41.186,78	12,36%	12,36%
CAIXA BRASIL IPCA VII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	840.352,00	0,00	0,00	879.186,50	38.834,50	4,62%	4,62%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	405.700,27	0,00	0,00	436.107,63	30.407,36	7,50%	7,50%
BB CONSUMO FIC AÇÕES	140.478,90	0,00	0,00	149.890,01	9.411,11	6,70%	6,70%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	47.127,77	0,00	0,00	53.358,79	6.231,02	13,22%	13,22%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	49.011,93	0,00	0,00	53.745,88	4.733,95	9,66%	9,66%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	56.588,76	0,00	0,00	58.183,08	1.594,32	2,82%	2,82%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	40.000,00	0,00	0,00	40.611,50	611,50	1,53%	2,50%
Total Renda Variável					184.541,10	7,82%	