

Relatório Analítico dos Investimentos em fevereiro de 2016



Carteira consolidada de investimentos - base (fevereiro / 2016)

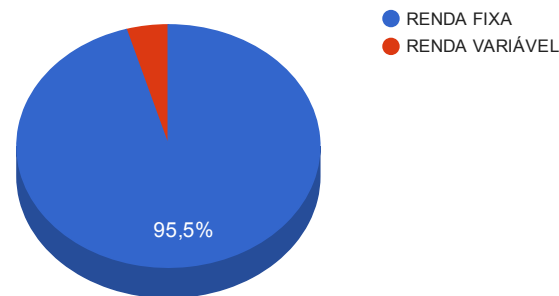
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
TÍTULOS PÚBLICOS			3.596.571,32	10,79%			Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA BRASIL 2016 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2016	2.613.007,50	7,84%	153	0,58%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.005.577,21	3,02%	36	1,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.933.989,39	11,80%	654	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.666.865,43	5,00%	1.306	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	129.705,11	0,39%	203	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	659.046,71	1,98%	623	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2016 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2016	4.204.724,00	12,62%	103	0,56%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.410.613,74	10,23%	544	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	839.776,30	2,52%	193	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.475.269,80	10,43%	1.164	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRABESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	123.678,74	0,37%	89	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRABESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	88.696,85	0,27%	57	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.340.378,38	4,02%	758	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRABESCO PREMIUM FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	2.498.793,36	7,50%	387	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	D+3	Não há	2.241.836,29	6,73%	408	1,12%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER PETROBRÁS PLUS FIC AÇÕES	D+4	Não há	268.814,27	0,81%	2.004	1,44%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA BRASIL IPCA V FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+0	08/11/2016	881.828,50	2,65%	23	0,98%	Artigo 8º, Inciso IV
CAIXA BRASIL IPCA VII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+0	22/11/2016	347.082,20	1,04%	20	0,37%	Artigo 8º, Inciso IV
		TOTAL -	33.326.255,10				

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

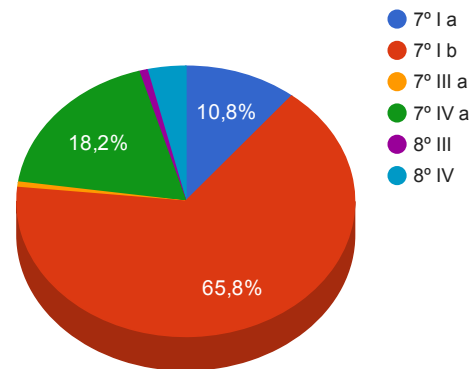
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	15,00%	3.596.571,32	10,79%	1.402.366,95
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	85,00%	21.938.575,19	65,83%	6.388.741,65
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	40,00%	212.375,59	0,64%	13.118.126,45
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	6.081.008,03	18,25%	3.916.868,50
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.666.312,76
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.666.312,76
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.666.312,76
Total Renda Fixa	100,00%	185,00	31.828.530,13	95,51%	

Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.666.312,76
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	5,00%	268.814,27	0,81%	1.397.498,49
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	1.228.910,70	3,69%	437.402,06
Total Renda Variável	30,00%	15,00	1.497.724,97	4,49%	

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	2,26%	4,22%	5,80%	8,90%	9,45%	27,71%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,27%	4,09%	5,61%	7,98%	7,80%	25,48%	0,20%	3,096%	9,10%
CAIXA BRASIL 2016 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,84%	-0,30%	1,37%	6,01%	-	-	0,20%	4,867%	-
CAIXA BRASIL 2016 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,98%	-0,44%	1,22%	-	-	-	0,20%	5,104%	-

IMA Geral	1,69%	3,74%	4,79%	7,19%	10,52%	25,12%	-	-	-
BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	1,64%	3,64%	4,62%	6,95%	10,18%	24,13%	0,25%	1,564%	4,86%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,64%	3,64%	4,72%	6,80%	9,98%	24,22%	0,20%	1,557%	4,59%

IMA-B 5	1,54%	4,55%	6,77%	10,89%	16,86%	32,06%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,51%	4,47%	6,60%	10,56%	16,32%	31,08%	0,20%	1,440%	3,36%

IDKA IPCA 2 Anos	1,20%	5,00%	6,99%	11,37%	18,46%	33,63%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,37%	4,28%	6,33%	10,71%	16,83%	31,71%	0,20%	1,371%	2,93%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,02%	2,84%	4,62%	9,32%	-	-	0,20%	0,576%	-

IRF-M 1	1,09%	2,75%	3,97%	7,47%	14,04%	26,55%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,10%	2,74%	3,94%	7,40%	13,84%	26,05%	0,20%	0,179%	0,54%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,10%	2,74%	3,93%	7,33%	13,72%	25,72%	0,10%	0,180%	0,56%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1,07%	2,68%	3,85%	7,24%	13,60%	25,42%	0,40%	0,177%	0,55%
BRASESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1,06%	2,72%	3,91%	7,26%	13,91%	26,00%	0,20%	0,183%	0,81%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Selic	1,00%	2,07%	3,26%	6,67%	13,61%	26,14%	-	-	-
BRDESCO PREMIUM FI REFERENCIADO DI	0,99%	2,05%	3,24%	6,67%	13,65%	26,36%	0,20%	0,006%	0,03%
CDI	1,00%	2,07%	3,25%	6,67%	13,59%	26,03%	-	-	-
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	1,54%	4,22%	6,16%	8,66%	13,63%	28,26%	0,30%	1,186%	3,41%
CAIXA BRASIL FI REFERENCIADO DI LP	0,99%	2,05%	3,23%	6,66%	13,63%	26,17%	0,20%	0,008%	0,07%

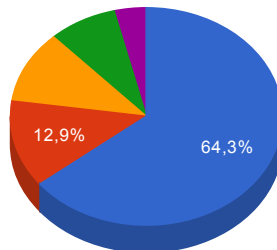
Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (fevereiro / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
PETROBRAS PN - PETR4	6,20%	-23,28%	-32,99%	-44,07%	-46,29%	-59,75%	-	-	-
SANTANDER PETROBRÁS PLUS FIC AÇÕES	6,35%	-13,69%	-21,32%	-30,38%	-22,98%	-43,49%	3,00%	45,916%	63,84%
IPCA + 6,00% ao ano	1,34%	3,11%	4,63%	8,67%	16,92%	33,42%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA V FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1,82%	3,26%	4,84%	7,91%	17,29%	33,10%	0,20%	0,131%	0,33%
CAIXA BRASIL IPCA VII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1,62%	3,26%	4,91%	8,49%	17,29%	33,22%	0,20%	0,199%	0,49%

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

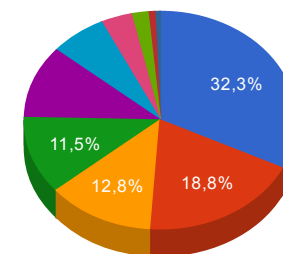
Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	21.429.077,25	64,30%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	4.315.046,10	12,95%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	3.596.571,32	10,79%
BANCO BRADESCO	2.711.168,95	8,14%
BANCO SANTANDER	1.274.391,48	3,82%

- CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
- BB GESTÃO DE RECURSO...
- TESOURO NACIONAL (TÍTULOS P...
- BANCO BRADESCO
- BANCO SANTANDER



Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5	10.751.720,89	32,26%
IRF-M 1	6.271.391,18	18,82%
IDKA 2A	4.250.390,04	12,75%
CDI	3.839.171,74	11,52%
TÍTULOS PÚBLICOS	3.596.571,32	10,79%
GESTÃO LIVRE	2.241.836,29	6,73%
MULTIMERCADO	1.228.910,70	3,69%
IMA-B	659.046,71	1,98%
AÇÕES - SETORIAIS	268.814,27	0,81%
IMA-GERAL	218.401,96	0,66%

- IMA-B 5
- IRF-M 1
- IDKA 2A
- CDI
- TÍTULOS PÚBLICOS
- GESTÃO LIVRE
- MULTIMER...
- IMA-B
- AÇÕES - SETORIAIS
- IMA-GERAL

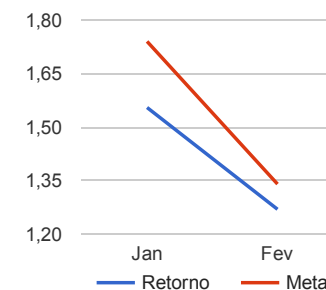
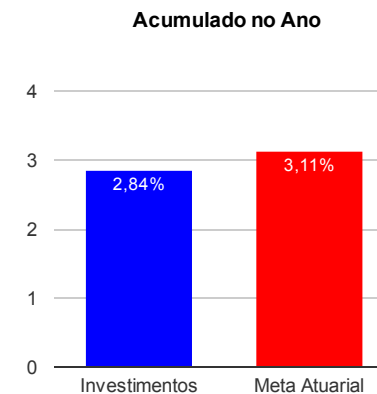


Carteira de Títulos Públicos - base (fevereiro / 2016)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde.	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	GAP (Atual - Pago)
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/8/2024	11/8/2004	500	1.487,344824	2.672,087235	743.672,41	1.336.043,62	592.371,21
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/8/2024	2/12/2004	270	1.494,58526	2.672,087235	403.538,02	721.463,55	317.925,53
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/5/2045	2/3/2009	630	1.104,73659	2.442,958968	695.984,05	1.539.064,15	843.080,10

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	30.803.950,98	4.171.192,91	2.700.000,00	32.776.920,78	501.776,89	1,55%	1,74%	89,38%	1,13%
Fevereiro	32.776.920,78	1.338.931,86	1.207.290,88	33.326.255,10	417.693,34	1,27%	1,34%	94,42%	2,13%
Acumulado no ano					919.470,23	2,84%	3,11%	91,52%	



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	644.447,96	0,00	0,00	659.046,71	14.598,75	2,27%	3,10%	2,27%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	87.261,89	0,00	0,00	88.696,85	1.434,96	1,64%	1,56%	1,64%
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	2.207.813,73	0,00	0,00	2.241.836,29	34.022,56	1,54%	1,19%	1,54%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.875.366,42	0,00	0,00	3.933.989,39	58.622,97	1,51%	1,44%	1,51%
TÍTULOS PÚBLICOS	3.547.283,16	0,00	0,00	3.596.571,32	49.288,16	1,39%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.364.453,75	0,00	0,00	3.410.613,74	46.159,99	1,37%	1,37%	1,37%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	994.979,73	0,00	0,00	1.005.577,21	10.597,48	1,07%	0,18%	1,07%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	122.382,28	0,00	0,00	123.678,74	1.296,46	1,06%	0,18%	1,06%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.935.989,37	503.535,63	0,00	3.475.269,80	35.744,80	1,04%	0,18%	1,10%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	855.544,33	0,00	24.384,79	839.776,30	8.616,76	1,01%	0,58%	1,02%
BRADESCO PREMIUM FI REFERENCIADO DI	2.474.218,02	0,00	0,00	2.498.793,36	24.575,34	0,99%	0,01%	0,99%
CAIXA BRASIL 2016 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.283.464,00	0,00	119.705,44	4.204.724,00	40.965,44	0,96%	4,87%	-1,84%
CAIXA BRASIL 2016 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.665.740,00	0,00	78.200,65	2.613.007,50	25.468,15	0,96%	5,10%	-1,98%
CAIXA BRASIL FI REFERENCIADO DI LP	1.130.729,61	197.906,09	0,00	1.340.378,38	11.742,68	0,88%	0,01%	0,99%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.399.392,92	637.490,14	385.000,00	1.666.865,43	14.982,37	0,74%	0,18%	1,10%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	727.450,67	0,00	600.000,00	129.705,11	2.254,44	0,31%	1,56%	1,64%
Total Renda Fixa					380.371,31	1,21%	1,80%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
SANTANDER PETROBRÁS PLUS FIC AÇÕES	252.765,64	0,00	0,00	268.814,27	16.048,63	6,35%	45,92%	6,35%
CAIXA BRASIL IPCA V FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	866.076,50	0,00	0,00	881.828,50	15.752,00	1,82%	0,13%	1,82%
CAIXA BRASIL IPCA VII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	341.560,80	0,00	0,00	347.082,20	5.521,40	1,62%	0,20%	1,62%
Total Renda Variável					37.322,03	2,34%	8,36%	

