

Relatório Analítico dos Investimentos em julho de 2016

Carteira consolidada de investimentos - base (julho / 2016)

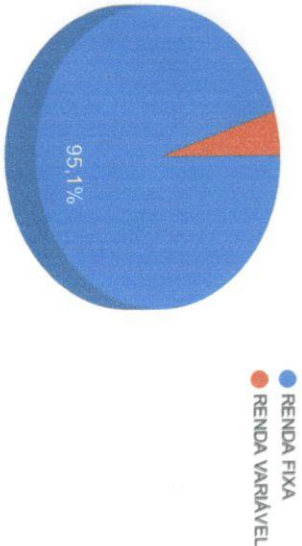
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO
TÍTULOS PÚBLICOS							
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	4.203.561,42	11,36%			Artigo 7º, Inciso I, Alínea "a"
		Não há	1.060.961,84	2,87%	33	1,48%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	143.248,04	0,39%	199	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.620.669,25	7,08%	1.325	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"
CAIXA BRASIL 2016 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2016	4.443.544,00	12,01%	103	0,56%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	886.595,07	2,40%	193	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.584.965,08	9,69%	604	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"
CAIXA BRASIL 2016 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2016	2.761.360,00	7,46%	154	0,58%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.140.628,52	11,19%	707	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	752.425,13	2,03%	652	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.932.221,92	10,63%	1.170	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	98.205,12	0,27%	54	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea "a"
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	130.594,13	0,35%	90	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea "a"
CAIXA PATRIMÔNIO INDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	D+3	Não há	2.374.581,60	6,42%	388	1,20%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea "a"
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	2.642.587,58	7,14%	382	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea "a"
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.417.313,98	3,83%	748	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea "a"
SANTANDER PETROBRÁS PLUS FIC AÇÕES	D+4	Não há	506.795,08	1,37%	1.950	1,48%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA BRASIL IPCA VII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+0	22/11/2016	366.225,40	0,99%	20	0,37%	Artigo 8º, Inciso IV
CAIXA BRASIL IPCA V FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+0	08/11/2016	932.761,00	2,52%	23	0,98%	Artigo 8º, Inciso IV
TOTAL -			36.999.244,16				

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

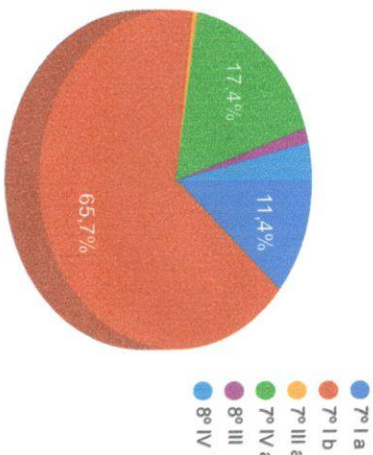
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	15,00%	4.203.561,42	11,36%	1.346.325,20
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	85,00%	24.326.618,85	65,75%	7.122.738,69
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	40,00%	228.799,25	0,62%	14.570.898,41
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	6.434.483,16	17,39%	4.665.290,09
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.849.962,21
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.849.962,21
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.849.962,21
Total Renda Fixa	100,00%	185,00	35.193.462,68	95,12%	

Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.849.962,21
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	5,00%	506.795,08	1,37%	1.343.167,13
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	1.298.986,40	3,51%	550.975,81
Total Renda Variável	30,00%	15,00	1.805.781,48	4,88%	

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Retorno dos Investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (julho / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	2,51%	19,06%	4,38%	16,82%	20,53%	34,07%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,48%	18,83%	4,31%	16,75%	19,10%	31,74%	0,20%	1,888%	9,57%
CAIXA BRASIL 2016 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,15%	5,37%	4,00%	3,74%	9,52%	-	0,20%	0,086%	4,22%
CAIXA BRASIL 2016 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,15%	5,21%	4,00%	3,59%	-	-	0,20%	0,086%	-
IMA Geral	1,66%	14,74%	3,94%	12,48%	17,19%	29,87%	-	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	1,68%	14,75%	4,05%	12,54%	16,83%	29,10%	0,25%	1,068%	4,97%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,64%	14,47%	3,83%	12,26%	16,49%	28,73%	0,20%	0,931%	4,72%
IMA-B 5	1,21%	10,15%	2,97%	6,97%	16,28%	31,52%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,19%	9,96%	2,91%	6,84%	15,77%	30,58%	0,20%	0,670%	3,40%
Selic	1,11%	7,91%	3,42%	6,78%	14,03%	27,87%	-	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,13%	7,93%	3,47%	6,80%	14,06%	28,07%	0,20%	0,015%	0,02%
CDI	1,11%	7,90%	3,41%	6,78%	14,01%	27,78%	-	-	-
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	1,25%	10,39%	2,97%	7,55%	14,10%	28,29%	0,30%	0,727%	3,47%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,11%	7,91%	3,41%	6,79%	14,05%	27,92%	0,20%	0,009%	0,06%
IRFAM 1	1,04%	8,53%	3,22%	6,78%	14,68%	27,91%	-	-	-
SANTANDER IRFAM 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1,06%	8,33%	3,19%	6,63%	14,27%	26,91%	0,40%	0,165%	0,50%
CAIXA BRASIL IRFAM 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,03%	8,49%	3,17%	6,75%	14,55%	27,44%	0,20%	0,110%	0,47%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,03%	8,44%	3,13%	6,71%	14,41%	27,14%	0,10%	0,111%	0,49%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1,01%	8,47%	3,17%	6,71%	14,48%	27,45%	0,20%	0,110%	0,76%
IDKA IPCA 2 Anos	0,91%	9,56%	2,49%	5,59%	15,90%	31,44%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,13%	8,58%	3,79%	6,65%	15,79%	-	0,20%	0,118%	1,27%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,11%	9,61%	2,80%	6,55%	16,02%	30,88%	0,20%	0,697%	3,03%

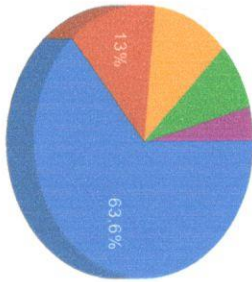
Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (julho / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
PETROBRAS ON - PETR3	21,72%	63,48%	5,58%	102,16%	20,98%	-22,12%	-	-	-
SANTANDER PETROBRÁS PLUS FIC AÇÕES	21,41%	62,73%	4,69%	100,50%	20,08%	-24,72%	3,00%	20,532%	67,34%
IPCA + 6,00% ao ano	1,01%	8,54%	3,17%	6,68%	15,21%	33,82%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA VII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	0,85%	8,95%	3,24%	7,22%	15,35%	33,37%	0,20%	0,039%	0,42%
CAIXA BRASIL IPCA V FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	0,83%	9,22%	3,27%	7,70%	15,41%	33,23%	0,20%	0,005%	0,34%

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

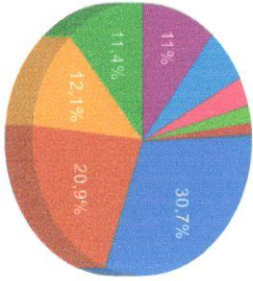
Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	23.537.722,00	63,62%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTM	4.818.816,99	13,02%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	4.203.561,42	11,36%
BANCO BRADESCO	2.871.386,83	7,76%
BANCO SANTANDER	1.567.756,92	4,24%

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



Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5	11.345.532,52	30,66%
IRF-M 1	7.744.447,14	20,93%
IDKA IPCA 2A	4.471.560,15	12,09%
TÍTULOS PÚBLICOS	4.203.561,42	11,36%
CDI	4.059.901,56	10,97%
GESTÃO LIVRE	2.374.581,60	6,42%
MULTIMERCADO	1.298.986,40	3,51%
IMA-B	752.425,13	2,03%
AÇÕES - SETORIAIS	506.795,08	1,37%
IMA-GERAL	241.453,16	0,65%

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



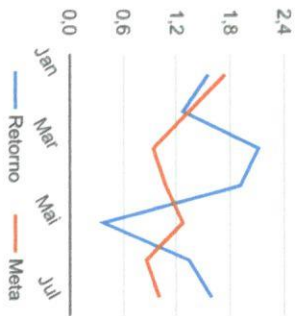
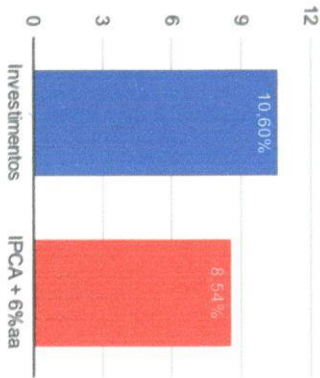
Carteira de Títulos Públicos - base (julho / 2016)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde.	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	GAP (Atual - Pago)
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	11/08/2004	500	1.487,344824	2.996,746079	743.672,41	1.498.373,04	754.700,63
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	02/12/2004	270	1.494,58526	2.996,746079	403.538,02	809.121,44	405.583,42
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	02/03/2009	630	1.104,73659	3.009,630068	695.984,05	1.896.066,94	1.200.082,89

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%
Março	33.326.255,10	734.958,21	690.000,00	34.077.050,51	705.837,20	2,12%	0,94%	224,49%	1,40%
Abril	34.077.050,51	938.403,18	490.000,00	35.185.926,08	660.472,39	1,91%	1,08%	177,73%	1,08%
Mai	35.185.926,08	781.358,91	480.000,00	35.621.696,87	134.411,88	0,38%	1,27%	29,81%	0,77%
Junho	35.621.696,87	669.598,14	500.000,00	36.270.548,44	479.253,43	1,34%	0,86%	155,38%	0,85%
Julho	36.270.548,44	649.837,10	500.000,00	36.999.244,16	578.858,62	1,59%	1,01%	157,48%	0,63%
Acumulado no ano					3.478.303,75	10,60%	8,54%	124,18%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
TÍTULOS PÚBLICOS	4.076.940,85	0,00	0,00	4.203.561,42	126.620,57	3,11%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	734.205,78	0,00	0,00	752.425,13	18.219,35	2,48%	1,89%	2,48%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	96.585,17	0,00	0,00	98.205,12	1.619,95	1,68%	1,07%	1,68%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	140.932,42	0,00	0,00	143.248,04	2.315,62	1,64%	0,93%	1,64%
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	2.345.273,93	0,00	0,00	2.374.581,60	29.307,67	1,25%	0,73%	1,25%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.091.899,19	0,00	0,00	4.140.628,52	48.729,33	1,19%	0,67%	1,19%
CAIXA BRASIL 2016 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.392.812,00	0,00	0,00	4.443.544,00	50.732,00	1,15%	0,09%	1,15%
CAIXA BRASIL 2016 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.729.845,00	0,00	0,00	2.761.360,00	31.515,00	1,15%	0,09%	1,15%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.612.946,30	0,00	0,00	2.642.587,58	29.641,28	1,13%	0,01%	1,13%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	876.689,83	0,00	0,00	886.595,07	9.925,24	1,13%	0,12%	1,13%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.401.789,40	0,00	0,00	1.417.313,98	15.544,58	1,11%	0,01%	1,11%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.545.748,98	0,00	0,00	3.584.965,08	39.216,10	1,11%	0,70%	1,11%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1.049.859,43	0,00	0,00	1.060.961,84	11.102,41	1,06%	0,16%	1,06%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.892.213,38	0,00	0,00	3.932.221,92	40.008,54	1,03%	0,11%	1,03%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	129.284,64	0,00	0,00	130.594,13	1.309,49	1,01%	0,11%	1,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.447.879,15	649.837,10	500.000,00	2.620.669,25	22.953,00	0,74%	0,11%	1,03%
Total Renda Fixa					478.760,13	1,38%	0,33%	

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

Ativos de Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
SANTANDER PETROBRAS PLUS FIC AÇÕES	417.437,09	0,00	0,00	506.795,08	89.357,99	21,41%	20,53%	21,41%
CAIXA BRASIL IPCA VII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	363.135,40	0,00	0,00	366.225,40	3.090,00	0,85%	0,04%	0,85%
CAIXA BRASIL IPCA V FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	925.110,50	0,00	0,00	932.761,00	7.650,50	0,83%	0,00%	0,83%
Total Renda Variável					100.098,49	5,39%	5,77%	