

Relatório Analítico dos Investimentos em setembro e 3º Trimestre de 2016



Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

Carteira consolidada de investimentos - base (setembro / 2016)

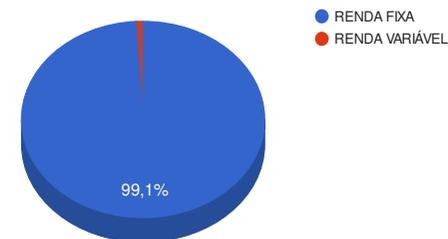
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	47.595.443,42	34,23%	1.331	0,47%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.409.647,33	2,45%	1.171	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	4.611.979,19	3,32%	596	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	30.108.783,24	21,65%	207	2,45%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.338.710,93	0,96%	728	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	343.100,70	0,25%	45	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2024	2.356.183,80	1,69%	104	0,67%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2024	352.852,20	0,25%	17	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.388.252,41	1,00%	108	0,36%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.798.799,35	2,01%	733	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.290.549,68	1,65%	341	0,10%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.661.888,45	1,91%	587	0,24%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	23.752.382,43	17,08%	179	7,49%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2018	1.254.929,00	0,90%	164	0,10%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	13.039.053,01	9,38%	463	0,60%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
POUPANÇA CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	D+0	Não há	491.068,01	0,35%			Artigo 7º, Inciso V, Alínea " a "
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FIAÇÕES	D+4	Não há	1.261.184,50	0,91%	16	4,91%	Artigo 8º, Inciso I
TOTAL -			139.054.807,65				

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

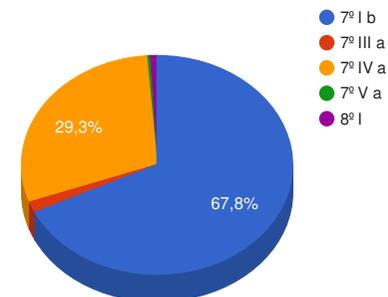
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alinea " b "	100,00%	100,00%	94.303.752,57	67,82%	44.751.055,08
Artigo 7º, Inciso III, Alinea " a "	80,00%	50,00%	2.290.549,68	1,65%	67.236.854,15
Artigo 7º, Inciso IV, Alinea " a "	30,00%	30,00%	40.708.252,89	29,27%	1.008.189,41
Artigo 7º, Inciso V, Alinea " a "	20,00%	5,00%	491.068,01	0,35%	6.461.672,37
Artigo 7º, Inciso III, Alinea " b "	80,00%	50,00%	0,00	0,00%	69.527.403,83
Artigo 7º, Inciso IV, Alinea " b "	30,00%	30,00%	0,00	0,00%	41.716.442,30
Artigo 7º, Inciso V, Alinea " b "	20,00%	5,00%	0,00	0,00%	6.952.740,38
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	6.952.740,38
Artigo 7º, Inciso VII, Alinea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	6.952.740,38
Artigo 7º, Inciso VII, Alinea " b "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	6.952.740,38
Total Renda Fixa	100,00%	285,00	137.793.623,15	99,09%	

Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	5,00%	1.261.184,50	0,91%	5.691.555,88
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	10,00%	0,00	0,00%	13.905.480,77
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	6.952.740,38
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	6.952.740,38
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	6.952.740,38
Total Renda Variável	30,00%	30,00	1.261.184,50	0,91%	

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M 1+	2,33%	25,23%	4,73%	12,51%	27,33%	32,01%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,31%	25,16%	4,76%	12,60%	27,19%	31,76%	0,20%	2,034%	5,59%
IRF-M	1,96%	19,30%	4,31%	10,51%	22,20%	30,67%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,96%	19,21%	4,32%	10,51%	22,07%	30,02%	0,20%	1,397%	3,48%
IMA-B	1,57%	22,00%	5,04%	11,16%	28,36%	35,87%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,58%	21,72%	4,97%	11,04%	27,66%	33,42%	0,20%	2,300%	7,11%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	1,51%	21,14%	4,94%	10,88%	27,24%	34,68%	0,20%	2,172%	6,44%
CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,46%	9,46%	1,47%	4,86%	15,41%	-	0,20%	1,260%	6,57%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,12%	14,36%	1,98%	7,41%	20,31%	19,41%	0,20%	2,215%	8,68%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,12%	14,28%	1,97%	7,40%	20,22%	-	0,20%	2,215%	8,70%
IMA Geral	1,53%	17,70%	4,28%	9,71%	22,07%	31,71%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,58%	17,46%	4,31%	9,67%	21,60%	30,66%	0,20%	1,247%	3,56%
IMA-B 5	1,41%	12,92%	3,76%	7,19%	18,83%	33,03%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,40%	12,68%	3,70%	7,08%	18,43%	32,08%	0,20%	0,778%	2,72%
IRF-M 1	1,19%	11,14%	3,46%	6,82%	15,14%	28,83%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,17%	11,05%	3,42%	6,78%	14,99%	28,37%	0,20%	0,075%	0,40%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,16%	10,97%	3,39%	6,72%	14,91%	28,05%	0,10%	0,076%	0,39%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	1,11%	10,42%	3,47%	6,94%	14,13%	28,50%	-	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,10%	10,50%	3,43%	6,90%	14,12%	27,99%	0,20%	0,016%	0,14%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,04%	9,76%	3,29%	6,59%	13,23%	26,53%	1,00%	0,016%	0,08%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	1,04%	9,73%	3,25%	6,49%	13,18%	26,36%	0,80%	0,000%	0,00%
IPCA + 6,00% ao ano	0,57%	10,22%	2,57%	5,90%	14,98%	33,45%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,80%	4,73%	-0,07%	3,22%	9,12%	19,82%	0,20%	0,063%	3,94%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
POUPANÇA CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	-	-	-	-	-	-	0,00%	-	-

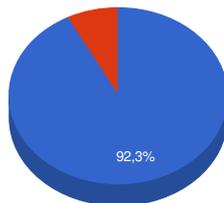
Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (setembro / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	0,80%	34,64%	13,28%	16,61%	29,53%	7,86%	-	-	-
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FIAÇÕES	0,98%	34,00%	13,12%	16,59%	29,01%	7,32%	0,50%	11,140%	31,23%

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

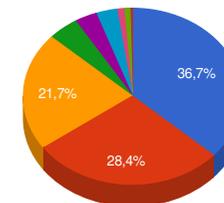
Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	128.371.292,68	92,32%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	10.683.514,97	7,68%

- CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
- BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM



Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	51.005.090,75	36,68%
CDI	39.453.323,89	28,37%
IMA-GERAL	30.108.783,24	21,65%
IMA-B	6.338.296,61	4,56%
IRF-M	4.611.979,19	3,32%
IMA-B 5	4.396.829,05	3,16%
IRF-M 1+	1.388.252,41	1,00%
AÇÕES - INDEXADO	1.261.184,50	0,91%
POUPANÇA	491.068,01	0,35%

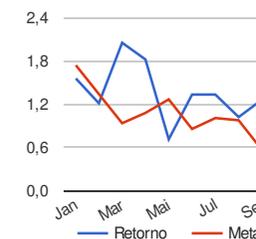
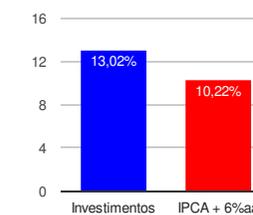
- IRF-M 1
- CDI
- IMA-GERAL
- IMA-B
- IRF-M
- IMA-B 5
- IRF-M 1+
- AÇÕES - INDEXADO
- POUPANÇA



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	105.789.553,87	4.316.373,14	751.163,93	111.059.627,62	1.704.864,54	1,56%	1,74%	89,63%	0,81%
Fevereiro	111.059.627,62	2.701.852,60	932.107,79	114.200.115,84	1.370.743,41	1,21%	1,34%	90,38%	1,02%
Março	114.200.115,84	2.600.000,00	748.473,75	118.434.479,26	2.382.837,17	2,05%	0,94%	217,92%	1,50%
Abril	118.434.479,26	3.605.519,00	1.781.782,60	122.447.738,14	2.189.522,48	1,82%	1,08%	169,15%	1,07%
Mai	122.447.738,14	4.846.743,74	3.055.821,84	125.130.648,46	891.988,42	0,72%	1,27%	56,51%	0,87%
Junho	125.130.648,46	4.998.169,44	3.529.264,48	128.288.924,77	1.689.371,35	1,33%	0,86%	154,85%	0,66%
Julho	128.288.924,77	2.614.000,00	647.586,78	131.995.163,16	1.739.825,17	1,34%	1,01%	132,34%	0,47%
Agosto	131.995.163,16	4.812.657,00	2.932.473,50	135.246.932,84	1.371.586,18	1,02%	0,98%	105,02%	0,56%
Setembro	135.246.932,84	5.638.002,33	3.569.200,61	139.054.807,65	1.739.073,09	1,27%	0,57%	223,31%	0,59%
Acumulado no ano					15.079.811,81	13,02%	10,22%	127,39%	
Acumulado no 3º Trimestre					4.850.484,44	3,67%	2,57%	142,64%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.356.863,26	0,00	0,00	1.388.252,41	31.389,15	2,31%	2,03%	2,31%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.523.438,80	0,00	0,00	4.611.979,19	88.540,39	1,96%	1,40%	1,96%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.317.844,89	0,00	0,00	1.338.710,93	20.866,04	1,58%	2,30%	1,58%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	29.640.377,62	0,00	0,00	30.108.783,24	468.405,62	1,58%	1,25%	1,58%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	2.256.539,22	0,00	0,00	2.290.549,68	34.010,46	1,51%	2,17%	1,51%
CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	338.156,40	0,00	0,00	343.100,70	4.944,30	1,46%	1,26%	1,46%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.760.195,83	0,00	0,00	2.798.799,35	38.603,52	1,40%	0,78%	1,40%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	47.044.440,29	0,00	0,00	47.595.443,42	551.003,13	1,17%	0,08%	1,17%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.370.595,23	0,00	0,00	3.409.647,33	39.052,10	1,16%	0,08%	1,16%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.329.979,40	0,00	0,00	2.356.183,80	26.204,40	1,12%	2,21%	1,12%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	348.930,00	0,00	0,00	352.852,20	3.922,20	1,12%	2,21%	1,12%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	12.897.406,68	0,00	0,00	13.039.053,01	141.646,33	1,10%	0,02%	1,10%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.634.448,82	0,00	0,00	2.661.888,45	27.439,63	1,04%	0,02%	1,04%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	21.445.817,02	5.638.002,33	3.569.200,61	23.752.382,43	237.763,69	0,88%	0,00%	1,04%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.245.017,00	0,00	0,00	1.254.929,00	9.912,00	0,80%	0,06%	0,80%
POUPANÇA CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	487.995,35	0,00	0,00	491.068,01	3.072,66	0,63%	-	0,66%
				Total Renda Fixa	1.726.775,62	1,27%	0,49%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FIAÇÕES	1.248.887,03	0,00	0,00	1.261.184,50	12.297,47	0,98%	11,14%	0,98%
				Total Renda Variável	12.297,47	0,98%	11,14%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º 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	46.023.379,31	0,00	0,00	47.595.443,42	1.572.064,11	3,42%	3,42%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	28.865.885,91	0,00	0,00	30.108.783,24	1.242.897,33	4,31%	4,31%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	15.845.277,66	13.064.659,33	5.802.497,29	23.752.382,43	644.942,73	2,88%	3,25%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	12.606.990,26	0,00	0,00	13.039.053,01	432.062,75	3,43%	3,43%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.421.196,48	0,00	0,00	4.611.979,19	190.782,71	4,32%	4,32%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.297.952,93	0,00	0,00	3.409.647,33	111.694,40	3,39%	3,39%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	2.182.819,57	0,00	0,00	2.290.549,68	107.730,11	4,94%	4,94%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.698.892,32	0,00	0,00	2.798.799,35	99.907,03	3,70%	3,70%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.577.166,07	0,00	0,00	2.661.888,45	84.722,38	3,29%	3,29%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.275.335,08	0,00	0,00	1.338.710,93	63.375,85	4,97%	4,97%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.325.177,93	0,00	0,00	1.388.252,41	63.074,48	4,76%	4,76%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.310.400,80	0,00	0,00	2.356.183,80	45.783,00	1,98%	1,98%
CAIXA BRASIL 2016 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	655.162,80	0,00	667.204,20	0,00	12.041,40	1,84%	-
POUPANÇA CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	481.092,41	0,00	0,00	491.068,01	9.975,60	2,07%	-
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	346.021,80	0,00	0,00	352.852,20	6.830,40	1,97%	1,97%
CAIXA BRASIL 2016 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	334.541,70	0,00	340.695,60	0,00	6.153,90	1,84%	-
CAIXA BRASIL 2016 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	332.741,40	0,00	338.863,80	0,00	6.122,40	1,84%	-
CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	338.137,20	0,00	0,00	343.100,70	4.963,50	1,47%	1,47%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.255.808,00	0,00	0,00	1.254.929,00	-879,00	-0,07%	-0,07%
Total Renda Fixa					4.704.245,08	3,59%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre / 2016

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FIAÇÕES	1.114.945,14	0,00	0,00	1.261.184,50	146.239,36	13,12%	13,12%
				Total Renda Variável	146.239,36	13,12%	

