Relatório Analítico dos Investimentos em março e 1º 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 (março / 2016)

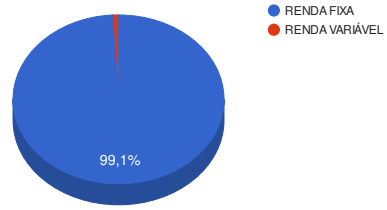
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.205.614,43	1,02%	624	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	27.453.033,13	23,18%	201	2,70%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2016 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2016	323.119,20	0,27%	113	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	4.173.235,23	3,52%	500	0,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2016 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2016	321.378,90	0,27%	133	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.613.803,88	2,21%	666	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	327.197,70	0,28%	45	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.232.881,32	1,04%	84	0,75%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2024	328.544,40	0,28%	17	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2016 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2016	632.803,20	0,53%	154	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.194.990,56	2,70%	1.169	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	44.575.216,50	37,64%	1.319	0,48%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2024	2.193.665,40	1,85%	104	0,67%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.065.871,18	1,74%	330	0,09%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	10.329.175,24	8,72%	139	7,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.497.410,45	2,11%	579	0,24%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2018	1.215.766,00	1,03%	163	0,10%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	12.197.363,36	10,30%	477	0,61%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
POUPANÇA	D+0		471.644,59	0,40%			Artigo 7º, Inciso V, Alínea " a "
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.081.764,59	0,91%	16	5,41%	Artigo 8º, Inciso I
		TOTAL -	**118.434.479,26**				

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

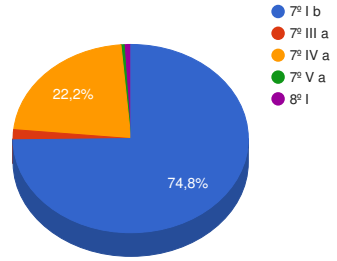
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	100,00%	88.575.483,85	74,79%	29.858.995,41
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	50,00%	2.065.871,18	1,74%	57.151.368,45
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	80,00%	50,00%	0,00	0,00%	59.217.239,63
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	26.239.715,05	22,16%	9.290.628,73
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	30,00%	30,00%	0,00	0,00%	35.530.343,78
Artigo 7º, Inciso V, Alínea " a "	20,00%	5,00%	471.644,59	0,40%	5.450.079,37
Artigo 7º, Inciso V, Alínea " b "	20,00%	5,00%	0,00	0,00%	5.921.723,96
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	5.921.723,96
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	5.921.723,96
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	5.921.723,96
Total Renda Fixa	100,00%	285,00	117.352.714,67	99,09%	

Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	5,00%	1.081.764,59	0,91%	4.839.959,37
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	10,00%	0,00	0,00%	11.843.447,93
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	5.921.723,96
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	5.921.723,96
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	5.921.723,96
Total Renda Variável	30,00%	30,00	1.081.764,59	0,91%	

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



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	5,31%	9,75%	9,75%	15,47%	15,59%	33,54%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5,31%	9,62%	9,62%	14,97%	13,89%	31,25%	0,20%	6,877%	9,79%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	5,23%	9,26%	9,26%	14,76%	14,44%	32,78%	0,20%	6,362%	8,92%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4,06%	6,48%	6,48%	12,01%	9,00%	18,64%	0,20%	6,761%	10,84%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4,06%	6,41%	6,41%	11,93%	-	-	0,20%	6,761%	-
CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,12%	4,39%	4,39%	10,06%	-	-	0,20%	3,873%	-
CAIXA BRASIL 2016 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,91%	0,52%	0,52%	5,29%	-	-	0,20%	0,333%	-
CAIXA BRASIL 2016 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,91%	0,61%	0,61%	5,38%	-	-	0,20%	0,333%	-
CAIXA BRASIL 2016 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,91%	0,46%	0,46%	5,23%	-	-	0,20%	0,333%	-
IRF-M 1+	5,21%	11,31%	11,31%	13,17%	13,09%	25,02%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5,24%	11,16%	11,16%	12,95%	12,99%	24,73%	0,20%	4,348%	6,83%
IRF-M	3,42%	7,95%	7,95%	10,57%	13,32%	25,52%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,38%	7,87%	7,87%	10,46%	12,97%	24,85%	0,20%	2,455%	4,25%
IMA Geral	3,42%	7,28%	7,28%	11,27%	14,24%	28,51%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,34%	7,10%	7,10%	10,88%	13,57%	27,55%	0,20%	3,142%	4,81%
IRF-M 1	1,26%	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%

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

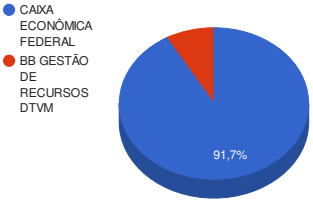
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,21%	3,99%	3,99%	7,67%	14,09%	26,29%	0,10%	0,171%	0,53%
CDI	1,16%	3,25%	3,25%	6,72%	13,73%	26,53%	-	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,17%	3,36%	3,36%	6,75%	13,46%	26,04%	0,20%	0,102%	0,23%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	1,09%	3,04%	3,04%	6,28%	12,77%	24,47%	0,80%	0,000%	0,03%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,05%	2,98%	2,98%	6,23%	12,77%	24,51%	1,00%	0,009%	0,03%
IPCA + 6,00% ao ano	0,94%	4,08%	4,08%	8,58%	15,90%	32,87%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,18%	1,46%	1,46%	5,72%	10,08%	19,34%	0,20%	0,125%	3,99%
IMA-B 5	0,76%	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%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
POUPANÇA	-	-	-	-	-	-	0,00%	0,000%	-

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

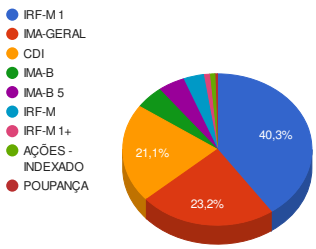
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	16,97%	15,47%	15,47%	11,09%	-2,14%	-0,71%	-	-	-
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	16,58%	14,94%	14,94%	10,66%	-2,65%	-1,21%	0,50%	19,519%	29,49%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	108.568.843,02	91,67%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	9.865.636,24	8,33%

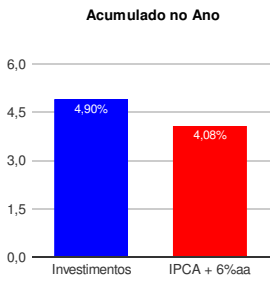


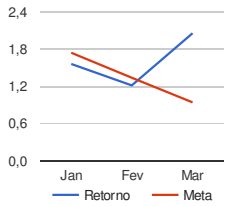
Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	47.770.207,06	40,33%
IMA-GERAL	27.453.033,13	23,18%
CDI	25.023.949,05	21,13%
IMA-B	5.793.695,41	4,89%
IMA-B 5	5.434.068,88	4,59%
IRF-M	4.173.235,23	3,52%
IRF-M 1+	1.232.881,32	1,04%
AÇÕES - INDEXADO	1.081.764,59	0,91%
POUPANÇA	471.644,59	0,40%



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%
Acumulado no ano					5.458.445,12	4,90%	4,08%	120,23%	





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 BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.144.781,78	0,00	0,00	1.205.614,43	60.832,65	5,31%	6,88%	5,31%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.171.483,17	0,00	0,00	1.232.881,32	61.398,15	5,24%	4,35%	5,24%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	1.963.155,36	0,00	0,00	2.065.871,18	102.715,82	5,23%	6,36%	5,23%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.108.131,20	0,00	0,00	2.193.665,40	85.534,20	4,06%	6,76%	4,06%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	315.734,10	0,00	0,00	328.544,40	12.810,30	4,06%	6,76%	4,06%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.036.924,58	0,00	0,00	4.173.235,23	136.310,65	3,38%	2,46%	3,38%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	26.566.301,28	0,00	0,00	27.453.033,13	886.731,85	3,34%	3,14%	3,34%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	44.035.622,42	0,00	0,00	44.575.216,50	539.594,08	1,23%	0,17%	1,23%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.156.692,17	0,00	0,00	3.194.990,56	38.298,39	1,21%	0,17%	1,21%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.201.601,00	0,00	0,00	1.215.766,00	14.165,00	1,18%	0,13%	1,18%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	12.056.638,53	0,00	0,00	12.197.363,36	140.724,83	1,17%	0,10%	1,17%
CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	323.583,00	0,00	0,00	327.197,70	3.614,70	1,12%	3,87%	1,12%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.471.354,80	0,00	0,00	2.497.410,45	26.055,65	1,05%	0,01%	1,05%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	9.867.660,90	1.100.000,00	748.473,75	10.329.175,24	109.988,09	1,00%	0,00%	1,09%
CAIXA BRASIL 2016 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	318.491,40	0,00	0,00	321.378,90	2.887,50	0,91%	0,33%	0,91%
CAIXA BRASIL 2016 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	320.216,70	0,00	0,00	323.119,20	2.902,50	0,91%	0,33%	0,91%
CAIXA BRASIL 2016 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	627.121,80	0,00	0,00	632.803,20	5.681,40	0,91%	0,33%	0,91%
POUPANÇA	468.778,63	0,00	0,00	471.644,59	2.865,96	0,61%	0,00%	0,74%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.117.899,83	1.500.000,00	0,00	2.613.803,88	-4.095,95	-0,16%	1,83%	0,73%
			Total Renda Fixa		2.229.015,77	1,94%	1,33%	

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 BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	927.943,19	0,00	0,00	1.081.764,59	153.821,40	16,58%	19,52%	16,58%
			Total Renda Variável		153.821,40	5,53%	19,52%	

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 IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	25.632.196,62	0,00	0,00	27.453.033,13	1.820.836,51	7,10%	7,10%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	42.860.342,51	0,00	0,00	44.575.216,50	1.714.873,99	4,00%	4,00%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.261.687,94	2.554.000,00	0,00	12.197.363,36	381.675,42	3,23%	3,36%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.868.693,03	0,00	0,00	4.173.235,23	304.542,20	7,87%	7,87%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	7.812.415,36	4.671.852,60	2.431.745,47	10.329.175,24	276.652,75	2,73%	3,04%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	1.890.859,65	0,00	0,00	2.065.871,18	175.011,53	9,26%	9,26%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.060.235,00	0,00	0,00	2.193.665,40	133.430,40	6,48%	6,48%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.109.149,16	0,00	0,00	1.232.881,32	123.732,16	11,16%	11,16%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.072.476,17	0,00	0,00	3.194.990,56	122.514,39	3,99%	3,99%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.099.844,52	0,00	0,00	1.205.614,43	105.769,91	9,62%	9,62%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.734.160,26	692.373,14	0,00	2.497.410,45	70.877,05	2,92%	2,98%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	878.340,65	1.700.000,00	0,00	2.613.803,88	35.463,23	4,05%	5,24%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	308.766,90	0,00	0,00	328.544,40	19.777,50	6,41%	6,41%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.198.226,00	0,00	0,00	1.215.766,00	17.540,00	1,46%	1,46%
CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	313.446,60	0,00	0,00	327.197,70	13.751,10	4,39%	4,39%
POUPANÇA	462.577,22	0,00	0,00	471.644,59	9.067,37	1,96%	-
CAIXA BRASIL 2016 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	629.885,40	0,00	0,00	632.803,20	2.917,80	0,46%	0,46%
CAIXA BRASIL 2016 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	321.165,90	0,00	0,00	323.119,20	1.953,30	0,61%	0,61%
CAIXA BRASIL 2016 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	319.725,90	0,00	0,00	321.378,90	1.653,00	0,52%	0,52%
			Total Renda Fixa		5.332.039,61	4,83%	

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 (%)
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	941.150,87	0,00	0,00	1.081.764,59	140.613,72	14,94%	14,94%
			Total Renda Variável		140.613,72	14,94%	