

Relatório Analítico dos Investimentos em junho, 2º Trimestre e 1º semestre de 2016



Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2016)

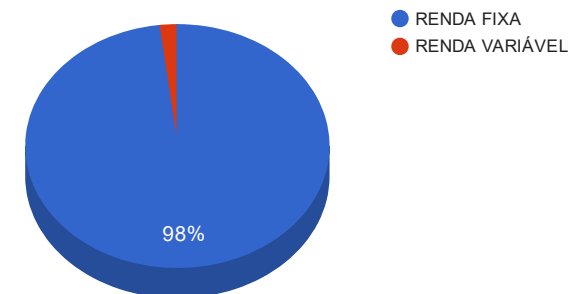
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.339.402,66	25,72%	701	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	4.497.388,46	21,66%	1.331	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.702.214,29	8,20%	602	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	2.583.094,95	12,44%	288	0,15%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	3.626.718,56	17,47%	747	0,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.354,66	0,01%	573	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRANCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	2.307.139,16	11,11%	381	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IPCA XIII FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	01/08/2016	293.668,35	1,41%	49	0,27%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
SCHRODER IBRX-100 FI AÇÕES	D+4	Não há	251.914,14	1,21%	7	5,25%	Artigo 8º, Inciso I
WESTERN ASSET DIVIDEND YIELD FI AÇÕES	D+4	Não há	155.340,93	0,75%	3	0,44%	Artigo 8º, Inciso III
		TOTAL -	20.759.236,16				

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

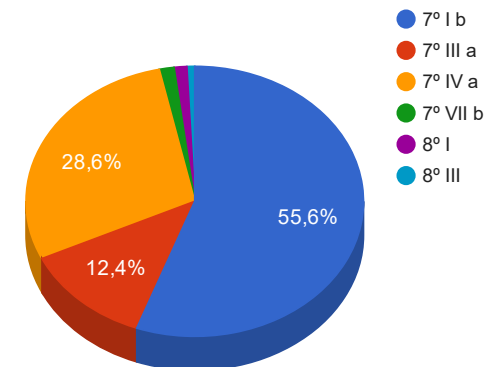
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	75,00%	11.539.005,41	55,58%	4.030.421,71
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	25,00%	2.583.094,95	12,44%	2.606.714,09
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	5.936.212,38	28,60%	291.558,47
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	293.668,35	1,41%	744.293,46
Total Renda Fixa	100,00%	135,00	20.351.981,09	98,04%	

Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	3,00%	251.914,14	1,21%	370.862,94
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	3,00%	155.340,93	0,75%	467.436,15
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.037.961,81
Total Renda Variável	30,00%	11,00	407.255,07	1,96%	

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Selic	1,16%	6,73%	3,36%	6,73%	14,11%	27,66%	-	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,18%	6,72%	3,38%	6,72%	14,11%	27,85%	0,20%	0,013%	0,02%
CDI	1,16%	6,72%	3,36%	6,72%	14,09%	27,57%	-	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,17%	6,27%	3,20%	6,27%	13,15%	25,58%	1,00%	0,106%	0,08%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,16%	6,73%	3,36%	6,73%	14,15%	27,71%	0,20%	0,007%	0,07%
IRF-M 1	1,08%	7,42%	3,25%	7,42%	14,96%	27,79%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,06%	7,38%	3,25%	7,38%	14,82%	27,31%	0,20%	0,120%	0,49%
IMA-B 5	0,94%	8,84%	3,31%	8,84%	16,94%	31,07%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,92%	8,66%	3,26%	8,66%	16,43%	30,14%	0,20%	1,106%	3,51%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,91%	8,75%	3,28%	8,75%	16,54%	30,11%	0,20%	1,106%	3,52%
IDKA IPCA 2 Anos	0,93%	8,58%	3,25%	8,58%	17,00%	31,47%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,88%	8,41%	3,32%	8,41%	16,74%	30,55%	0,20%	1,115%	3,11%
IPCA	0,35%	4,42%	1,75%	4,42%	8,84%	18,53%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XIII FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,22%	7,70%	3,30%	7,70%	15,13%	32,45%	0,20%	0,041%	0,22%

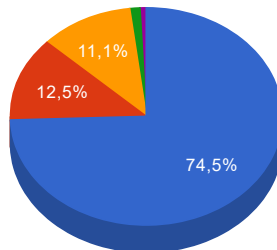
Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (junho / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDIV	7,69%	25,88%	6,70%	25,88%	-4,03%	-25,77%	-	-	-
WESTERN ASSET DIVIDEND YIELD FI AÇÕES	4,33%	15,30%	2,39%	15,30%	0,58%	-3,65%	2,00%	9,330%	21,18%
IBX	6,48%	17,74%	3,35%	17,74%	-3,08%	-2,66%	-	-	-
SCHRODER IBRX-100 FI AÇÕES	4,70%	8,47%	-0,82%	8,47%	-5,25%	-7,61%	1,50%	12,021%	24,78%

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

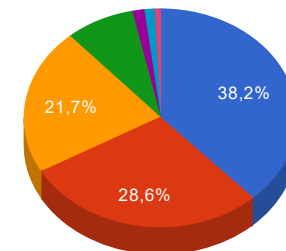
Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	15.459.392,32	74,47%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	2.585.449,61	12,45%
BANCO BRADESCO	2.307.139,16	11,11%
BNY Mellon Serviços Financeiros	251.914,14	1,21%
WESTERN ASSET	155.340,93	0,75%

- CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
- BB GESTÃO DE RECURSO...
- BANCO BRADESCO
- BNY Mellon Serviços Financeiros
- WESTERN ASSET



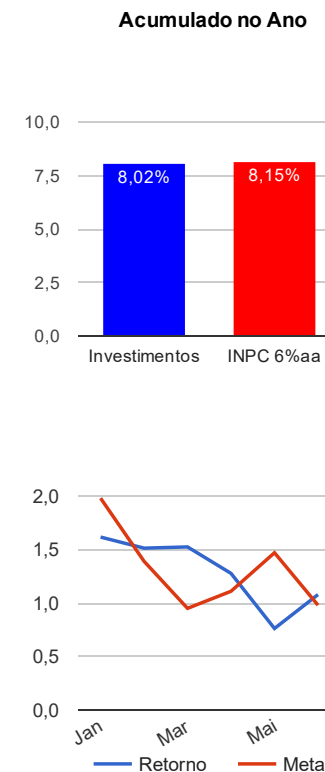
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5	7.922.497,61	38,16%
CDI	5.936.212,38	28,60%
IRF-M 1	4.497.388,46	21,66%
IDKA IPCA 2A	1.702.214,29	8,20%
CRÉDITO PRIVADO	293.668,35	1,41%
AÇÕES - INDEXADO	251.914,14	1,21%
AÇÕES - SETORIAIS	155.340,93	0,75%

- IMA-B 5
- CDI
- IRF-M 1
- IDKA IPCA 2A
- CRÉDITO PRIVADO
- AÇÕES - INDEXADO
- AÇÕES - SETORIAIS



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	17.509.380,50	725.616,75	132.732,06	18.394.888,45	292.623,26	1,62%	1,98%	81,62%	1,30%
Fevereiro	18.394.888,45	3.633.813,60	2.176.922,53	20.152.126,44	300.346,92	1,51%	1,39%	108,50%	1,29%
Março	20.152.126,44	8.782.593,97	8.272.494,51	20.977.177,57	314.951,67	1,52%	0,95%	160,07%	1,12%
Abril	20.977.177,57	1.000.000,00	1.702.000,00	20.543.047,81	267.870,24	1,28%	1,11%	115,41%	0,86%
Mai	20.543.047,81	190.000,00	541.860,00	20.347.700,32	156.512,51	0,76%	1,47%	51,77%	0,71%
Junho	20.347.700,32	190.000,00	0,00	20.759.236,16	221.535,84	1,08%	0,98%	109,80%	0,76%
Acumulado no ano					1.553.840,44	8,02%	8,15%	98,49%	



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IPCA XIII FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	290.116,65	0,00	0,00	293.668,35	3.551,70	1,22%	0,04%	1,22%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.280.244,21	0,00	0,00	2.307.139,16	26.894,95	1,18%	0,01%	1,18%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.327,42	0,00	0,00	2.354,66	27,24	1,17%	0,11%	1,17%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	3.397.072,36	190.000,00	0,00	3.626.718,56	39.646,20	1,11%	0,01%	1,16%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.450.392,54	0,00	0,00	4.497.388,46	46.995,92	1,06%	0,12%	1,06%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.290.828,79	0,00	0,00	5.339.402,66	48.573,87	0,92%	1,11%	0,92%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2.559.821,32	0,00	0,00	2.583.094,95	23.273,63	0,91%	1,11%	0,91%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.687.405,35	0,00	0,00	1.702.214,29	14.808,94	0,88%	1,11%	0,88%
Total Renda Fixa					203.772,45	1,01%	0,55%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
SCHRODER IBRX-100 FI AÇÕES	240.597,93	0,00	0,00	251.914,14	11.316,21	4,70%	12,02%	4,70%
WESTERN ASSET DIVIDEND YIELD FI AÇÕES	148.893,75	0,00	0,00	155.340,93	6.447,18	4,33%	9,33%	4,33%
Total Renda Variável					17.763,39	4,56%	10,99%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre / 2016

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.887.509,03	1.000.000,00	702.000,00	5.339.402,66	153.893,63	2,82%	3,26%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.355.874,50	0,00	0,00	4.497.388,46	141.513,96	3,25%	3,25%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.659.518,06	380.000,00	1.540.000,00	3.626.718,56	127.200,50	3,18%	3,36%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2.501.033,77	0,00	0,00	2.583.094,95	82.061,18	3,28%	3,28%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.231.666,76	0,00	0,00	2.307.139,16	75.472,40	3,38%	3,38%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.647.448,08	0,00	0,00	1.702.214,29	54.766,21	3,32%	3,32%
CAIXA BRASIL IPCA XIII FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	284.296,05	0,00	0,00	293.668,35	9.372,30	3,30%	3,30%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.114,26	0,00	1.860,00	2.354,66	100,40	2,97%	3,20%
				Total Renda Fixa	644.380,58	3,21%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre / 2016

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
WESTERN ASSET DIVIDEND YIELD FI AÇÕES	151.711,57	0,00	0,00	155.340,93	3.629,36	2,39%	2,39%
SCHRODER IBRX-100 FI AÇÕES	254.005,49	0,00	0,00	251.914,14	-2.091,35	-0,82%	-0,82%
Total Renda Variável					1.538,01	0,38%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre / 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	5.152.641,10	0,00	5.443.037,21	0,00	290.396,11	5,64%	12,62%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.499.252,71	1.725.616,75	0,00	4.497.388,46	272.519,00	7,11%	7,38%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.385.056,38	3.580.000,00	1.540.000,00	3.626.718,56	201.662,18	6,11%	6,73%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.170.994,88	4.881.760,78	902.000,00	5.339.402,66	188.647,00	7,04%	8,66%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.965.345,60	200.000,00	0,00	2.307.139,16	141.793,56	6,65%	6,72%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	1.724.576,85	0,00	1.838.235,74	0,00	113.658,89	6,59%	15,44%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,00	2.476.914,73	0,00	2.583.094,95	106.180,22	4,29%	8,75%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.097.564,09	0,00	2.176.922,53	0,00	79.358,44	3,78%	15,68%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	738.433,58	0,00	791.221,56	0,00	52.787,98	7,15%	15,96%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	1.657.732,06	0,00	1.702.214,29	44.482,23	3,63%	8,41%
CAIXA BRASIL IPCA XIII FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	272.669,55	0,00	0,00	293.668,35	20.998,80	7,70%	7,70%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.995,31	0,00	1.860,00	2.354,66	219,35	6,04%	6,27%
				Total Renda Fixa	1.512.703,76	7,98%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
WESTERN ASSET DIVIDEND YIELD FI AÇÕES	134.723,32	0,00	0,00	155.340,93	20.617,61	15,30%	15,30%
SCHRODER IBRX-100 FI AÇÕES	232.236,52	0,00	0,00	251.914,14	19.677,62	8,47%	8,47%
SAFRA CARTEIRA INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	131.890,61	0,00	132.732,06	0,00	841,45	0,64%	7,34%
				Total Renda Variável	41.136,68	12,32%	