

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
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			1.555.877,06	3,19%			Artigo 20
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	11.955.726,39	24,55%	602	0,31%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.147.598,31	6,46%	701	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	553,48	0,00%	136	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	8.758.617,74	17,99%	1.331	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1901	Não há	4.997.594,84	10,26%	9	12,14%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.130.043,34	16,69%	330	0,37%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
GBX PRIME I FIDC	D+1201	29 dias	7.503.475,98	15,41%	33	2,87%	Artigo 7º, Inciso VI
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIAÇÕES	D+4	Não há	65.934,99	0,14%	256	0,64%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CONSUMO FIAÇÕES	D+4	Não há	83.509,11	0,17%	1.097	0,71%	Artigo 8º, Inciso III
W7 FIP	Não se aplica	Não se aplica	2.499.652,00	5,13%	20	2,93%	Artigo 8º, Inciso V
		TOTAL -	48.698.583,24				

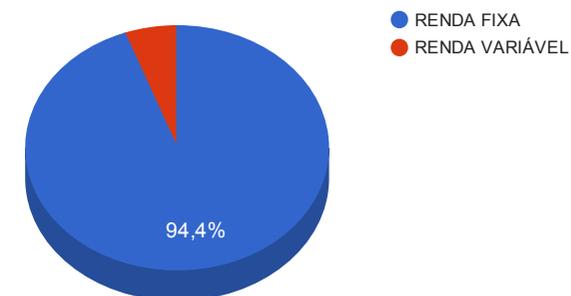
Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (junho / 2016)

Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	100,00%	23.862.495,92	49,00%	24.836.087,32
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	40,00%	13.127.638,18	26,96%	6.351.795,12
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	0,00	0,00%	14.609.574,97
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	15,00%	7.503.475,98	15,41%	-198.688,49
Total Renda Fixa	100,00%	185,00	44.493.610,08	91,37%	

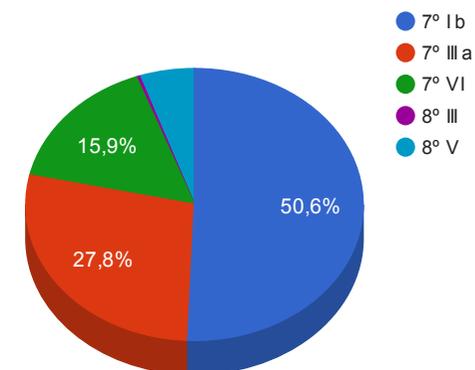
Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	10,00%	149.444,10	0,31%	4.720.414,22
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	2.499.652,00	5,13%	-64.722,84
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	2.434.929,16
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	2.434.929,16
Total Renda Variável	30,00%	25,00	2.649.096,10	5,44%	

⚠ **Atenção!! - Valores em desacordo com Artigo 7º, Inciso VII, § 5º**

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
IMA-B 5+	2,57%	20,82%	7,29%	20,82%	17,14%	33,97%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,58%	20,49%	7,13%	20,49%	16,21%	32,22%	0,20%	3,176%	13,77%
IMA-B	1,93%	16,15%	5,83%	16,15%	16,73%	32,26%	-	-	-
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	1,90%	15,44%	5,66%	15,44%	15,52%	31,10%	0,20%	2,079%	8,93%
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%
IPCA + 7,00% ao ano	0,94%	7,95%	3,49%	7,95%	16,46%	35,74%	-	-	-
GBX PRIME I FIDC	1,23%	7,90%	3,50%	7,90%	15,97%	-	0,15%	0,156%	0,75%
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%
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,88%	8,20%	3,40%	8,20%	-	-	1,00%	1,092%	-
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%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

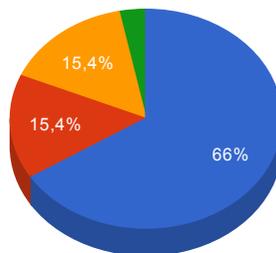
Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (junho / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
SMLL	9,12%	17,65%	10,33%	17,65%	-1,97%	-21,93%	-	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIAÇÕES	7,08%	8,38%	5,41%	8,38%	-1,39%	-18,81%	1,50%	9,600%	19,49%
ICON	5,27%	10,59%	3,37%	10,59%	-3,13%	9,05%	-	-	-
CAIXA CONSUMO FIAÇÕES	4,85%	8,14%	2,55%	8,14%	-7,59%	-1,59%	1,60%	10,408%	20,58%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
W7 FIP	-	-	-	-	-	-	1,50%	3,090%	28,18%

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

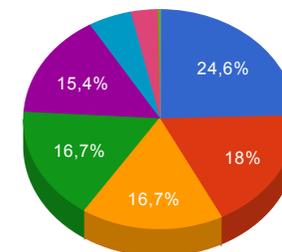
Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	32.141.983,36	66,00%
CM Capital Markets DTVM	7.503.475,98	15,41%
Santander Securities Services	7.497.246,84	15,40%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	1.555.877,06	3,19%

- CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
- CM Capital Markets DTVM
- Santander Securities Services
- DISPONIBILIDADE FINANCEIRA



Sub-segmento	Valor	%
IDKA IPCA 2A	11.955.726,39	24,55%
IRF-M 1	8.758.617,74	17,99%
IMA-B 5	8.145.193,15	16,73%
IMA-B	8.130.043,34	16,69%
FIDC - ABERTO	7.503.475,98	15,41%
FIP	2.499.652,00	5,13%
CVS	1.555.877,06	3,19%
AÇÕES - SETORIAIS	149.444,10	0,31%
IMA-B 5+	553,48	0,00%

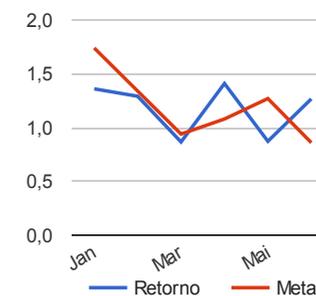
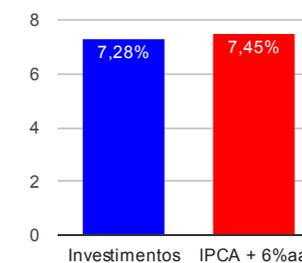
- IDKA IPCA 2A
- IRF-M 1
- IMA-B 5
- IMA-B
- FIDC - ABERTO
- FIP
- CVS
- AÇÕES - SETORIAIS
- Outro



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	44.370.457,26	21.950.562,56	21.915.209,37	45.009.933,37	604.122,92	1,36%	1,74%	78,21%	1,17%
Fevereiro	45.009.933,37	893.834,14	671.000,00	45.817.039,38	584.271,87	1,29%	1,34%	96,09%	0,95%
Março	45.817.039,38	364.000,00	64.700,00	46.516.045,09	399.705,71	0,87%	0,94%	91,99%	1,23%
Abril	46.516.045,09	236.000,00	724.092,57	46.683.737,09	655.784,57	1,41%	1,08%	130,98%	0,86%
Mai	46.683.737,09	1.470.000,00	646.740,00	47.921.779,89	414.782,80	0,87%	1,27%	68,72%	0,78%
Junho	47.921.779,89	44.448.992,03	45.835.260,54	47.142.706,18	607.194,80	1,27%	0,86%	147,03%	1,07%
Acumulado no ano					3.265.862,67	7,28%	7,45%	97,66%	

Acumulado no Ano



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 IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	539,58	0,00	0,00	553,48	13,90	2,58%	3,18%	2,58%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	13.485.834,04	48.000,00	10.542.755,43	3.147.598,31	156.519,70	1,16%	1,11%	0,92%
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	723.943,64	0,00	732.181,33	0,00	8.237,69	1,14%	1,22%	0,85%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	17.689.286,26	0,00	5.913.712,79	11.955.726,39	180.152,92	1,02%	1,11%	0,88%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.710.988,91	12.959.246,06	8.011.150,00	8.758.617,74	99.532,77	0,60%	0,12%	1,06%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	0,00	16.441.745,97	8.402.000,00	8.130.043,34	90.297,37	0,55%	2,08%	1,90%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	5.747.715,61	0,00	5.777.824,71	0,00	30.109,10	0,52%	0,02%	1,16%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	6.422.252,06	0,00	6.455.636,28	0,00	33.384,22	0,52%	0,01%	1,16%
GBX PRIME I FIDC	0,00	7.500.000,00	0,00	7.503.475,98	3.475,98	0,05%	0,16%	1,23%
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,00	5.000.000,00	0,00	4.997.594,84	-2.405,16	-0,05%	1,09%	0,88%
Total Renda Fixa					599.318,49	1,25%	0,93%	

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(%)
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIAÇÕES	61.576,04	0,00	0,00	65.934,99	4.358,95	7,08%	9,60%	7,08%
CAIXA CONSUMO FIAÇÕES	79.643,75	0,00	0,00	83.509,11	3.865,36	4,85%	10,41%	4,85%
W7 FIP	0,00	2.500.000,00	0,00	2.499.652,00	-348,00	-0,01%	3,09%	-0,43%
Total Renda Variável					7.876,31	0,30%	3,48%	

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 IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	16.531.262,77	1.156.000,00	6.324.712,79	11.955.726,39	593.176,41	3,46%	3,32%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	12.813.670,90	598.000,00	10.717.255,43	3.147.598,31	453.182,84	3,47%	3,26%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	7.007.465,19	0,00	7.185.636,28	0,00	178.171,09	2,71%	3,36%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.663.048,31	12.959.246,06	8.040.482,57	8.758.617,74	176.805,94	2,72%	3,25%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	5.649.723,34	0,00	5.803.824,71	0,00	154.101,37	2,73%	3,39%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	0,00	16.441.745,97	8.402.000,00	8.130.043,34	90.297,37	0,55%	5,66%
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	706.373,15	0,00	732.181,33	0,00	25.808,18	3,65%	3,36%
GBX PRIME I FIDC	0,00	7.500.000,00	0,00	7.503.475,98	3.475,98	0,05%	3,50%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	516,63	0,00	0,00	553,48	36,85	7,13%	7,13%
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,00	5.000.000,00	0,00	4.997.594,84	-2.405,16	-0,05%	3,40%
				Total Renda Fixa	1.672.650,87	3,59%	

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 (%)
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIAÇÕES	62.553,64	0,00	0,00	65.934,99	3.381,35	5,41%	5,41%
CAIXA CONSUMO FIAÇÕES	81.431,16	0,00	0,00	83.509,11	2.077,95	2,55%	2,55%
W7 FIP	0,00	2.500.000,00	0,00	2.499.652,00	-348,00	-0,01%	-
Total Renda Variável					5.111,30	-1,63%	

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-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.796.050,54	6.148.276,95	10.718.255,43	3.147.598,31	921.526,25	7,50%	8,66%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	18.020.285,61	6.984.712,79	11.955.726,39	920.153,57	5,49%	8,41%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	6.008.761,09	793.834,14	7.185.636,28	0,00	383.041,05	5,93%	6,73%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	5.510.416,49	0,00	5.843.824,71	0,00	333.408,22	6,07%	6,75%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.555.779,03	12.959.246,06	8.075.182,57	8.758.617,74	318.775,22	6,83%	7,38%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	16.729.506,59	0,00	16.916.014,87	0,00	186.508,28	1,11%	15,96%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	4.961.770,44	16.441.745,97	13.401.194,50	8.130.043,34	127.721,43	1,31%	15,44%
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	669.650,64	0,00	732.181,33	0,00	62.530,69	9,34%	9,02%
GBX PRIME I FIDC	0,00	7.500.000,00	0,00	7.503.475,98	3.475,98	0,05%	7,90%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	459,35	0,00	0,00	553,48	94,13	20,49%	20,49%
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,00	5.000.000,00	0,00	4.997.594,84	-2.405,16	-0,05%	8,20%
Total Renda Fixa					3.254.829,66	7,28%	

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 (%)
CAIXA CONSUMO FIAÇÕES	77.223,53	0,00	0,00	83.509,11	6.285,58	8,14%	8,14%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIAÇÕES	60.839,56	0,00	0,00	65.934,99	5.095,43	8,38%	8,38%
W7 FIP	0,00	2.500.000,00	0,00	2.499.652,00	-348,00	-0,01%	-
Total Renda Variável					11.033,01	2,59%	

