

Relatório Analítico dos Investimentos em agosto de 2016



Carteira consolidada de investimentos - base (agosto / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			355.167,47	0,71%			Artigo 20
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.150.583,09	2,30%	731	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.327.088,90	12,63%	631	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.921.444,83	7,82%	1.336	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.532.551,43	11,04%	176	0,78%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1901	Não há	5.115.606,51	10,21%	9	11,86%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	17.388.819,25	34,70%	340	0,74%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
GBX PRIME I FIDC	D+1201	29 dias	7.668.602,37	15,30%		2,87%	Artigo 7º, Inciso VI
CAIXA CONSUMO FIAÇÕES	D+4	Não há	90.706,78	0,18%	1.050	0,72%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIAÇÕES	D+4	Não há	74.113,65	0,15%	333	0,62%	Artigo 8º, Inciso III
W7 FIP	Não se aplica	Não se aplica	2.490.469,64	4,97%	20	2,93%	Artigo 8º, Inciso V
TOTAL -			50.115.153,92				

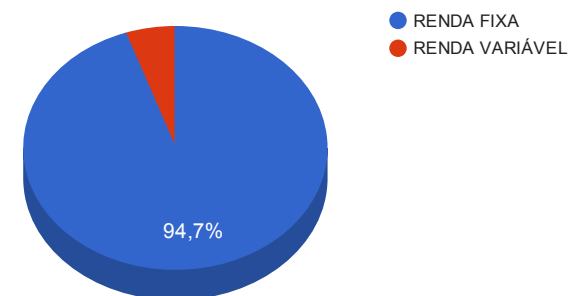
Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (agosto / 2016)

Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	100,00%	16.931.668,25	33,79%	33.183.485,67
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	40,00%	22.504.425,76	44,91%	-2.458.364,19
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	15,00%	7.668.602,37	15,30%	-151.329,28
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	0,00	0,00%	15.034.546,18
Total Renda Fixa	100,00%	185,00	47.104.696,38	93,99%	

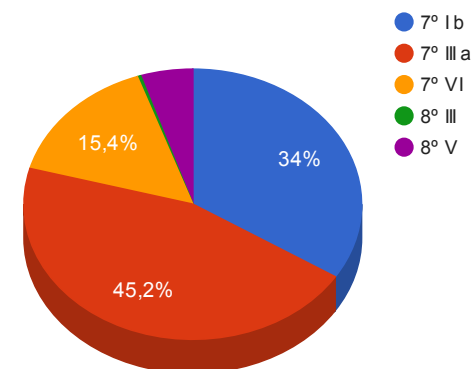
Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	10,00%	164.820,43	0,33%	4.846.694,96
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	2.490.469,64	4,97%	15.288,06
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	2.505.757,70
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	2.505.757,70
Total Renda Variável	30,00%	25,00	2.655.290,07	5,30%	

⚠️ **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 (agosto / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDKA IPCA 2 Anos	1,29%	10,97%	3,16%	5,69%	17,70%	31,48%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,22%	10,94%	3,23%	6,39%	17,78%	30,85%	0,20%	0,732%	2,94%
IRF-M 1	1,19%	9,83%	3,35%	6,89%	14,87%	28,36%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,17%	9,76%	3,30%	6,83%	14,74%	27,89%	0,20%	0,051%	0,45%
IMA-B 5	1,09%	11,35%	3,27%	6,50%	18,11%	31,19%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,07%	11,13%	3,21%	6,38%	17,61%	30,24%	0,20%	0,801%	3,29%
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1,05%	10,76%	3,26%	6,71%	15,89%	-	1,00%	0,798%	3,85%
IPCA + 7,00% ao ano	1,06%	10,29%	3,13%	6,81%	16,60%	36,69%	-	-	-
GBX PRIME I FIDC	1,12%	10,27%	3,46%	7,16%	15,87%	-	0,15%	0,390%	0,79%
IMA-B	0,89%	20,11%	5,41%	15,26%	25,51%	29,04%	-	-	-
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	0,97%	19,34%	5,35%	14,94%	24,37%	28,43%	0,20%	1,795%	8,44%
IMA-B 5+	0,87%	25,95%	6,93%	21,12%	30,33%	28,94%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,82%	25,55%	6,88%	20,93%	29,43%	27,40%	0,20%	2,523%	13,15%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

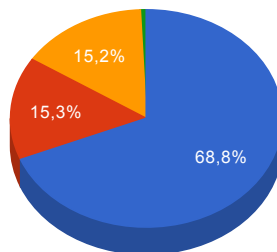
Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (agosto / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
ICON	0,43%	22,25%	16,37%	22,50%	14,80%	9,72%	-	-	-
CAIXA CONSUMO FIAÇÕES	-0,51%	17,46%	13,89%	19,29%	7,03%	-0,04%	1,60%	4,721%	19,87%
SMLL	0,18%	35,07%	25,27%	41,09%	28,67%	-13,77%	-	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIAÇÕES	-0,82%	21,82%	20,36%	25,64%	23,24%	-10,90%	1,50%	6,420%	19,31%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
W7 FIP	-	-	-	-	-	-	1,50%	0,047%	28,18%

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

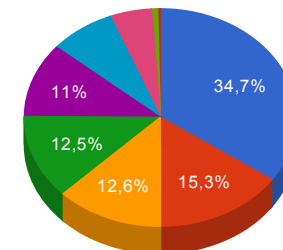
Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	34.485.307,93	68,81%
CM Capital Markets DTVM	7.668.602,37	15,30%
Santander Securities Services	7.606.076,15	15,18%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	355.167,47	0,71%

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



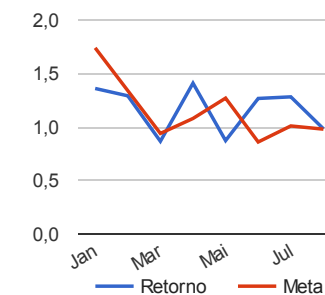
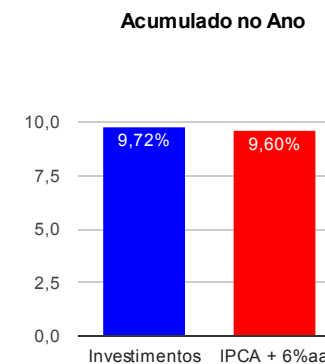
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	17.388.819,25	34,70%
FIDC - ABERTO	7.668.602,37	15,30%
IDKA IPCA 2A	6.327.088,90	12,63%
IMA-B 5	6.266.189,60	12,50%
IMA-B 5+	5.532.551,43	11,04%
IRF-M 1	3.921.444,83	7,82%
FIP	2.490.469,64	4,97%
CVS	355.167,47	0,71%
AÇÕES - SETORIAIS	164.820,43	0,33%

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



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%
Julho	47.142.706,18	2.435.020,52	796.000,00	49.407.150,96	625.424,26	1,28%	1,01%	127,03%	0,69%
Agosto	49.407.150,96	13.647.074,05	13.779.998,44	49.759.986,45	485.759,88	0,98%	0,98%	100,78%	1,19%
Acumulado no ano					4.377.046,81	9,72%	9,60%	101,31%	



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	12.087.957,09	0,00	5.909.440,85	6.327.088,90	148.572,66	1,23%	0,73%	1,22%
GBX PRIME I FIDC	7.583.896,15	0,00	0,00	7.668.602,37	84.706,22	1,12%	0,39%	1,12%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.616.495,00	0,00	5.801.725,38	3.921.444,83	106.675,21	1,11%	0,05%	1,17%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.185.082,21	0,00	2.068.832,21	1.150.583,09	34.333,09	1,08%	0,80%	1,07%
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	5.062.266,24	0,00	0,00	5.115.606,51	53.340,27	1,05%	0,80%	1,05%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	9.209.292,46	8.102.553,02	0,00	17.388.819,25	76.973,77	0,44%	1,79%	0,97%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	571,98	5.544.521,03	0,00	5.532.551,43	-12.541,58	-0,23%	2,52%	0,82%
Total Renda Fixa					492.059,64	1,05%	1,23%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
W7 FIP	2.495.693,48	0,00	0,00	2.490.469,64	-5.223,84	-0,21%	0,05%	-0,21%
CAIXA CONSUMO FIAÇÕES	91.172,81	0,00	0,00	90.706,78	-466,03	-0,51%	4,72%	-0,51%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIAÇÕES	74.723,54	0,00	0,00	74.113,65	-609,89	-0,82%	6,42%	-0,82%
Total Renda Variável					-6.299,76	-0,24%	0,38%	

