

Relatório Analítico dos Investimentos em março e 1º Trimestre de 2016



Carteira consolidada de investimentos - base (março / 2016)

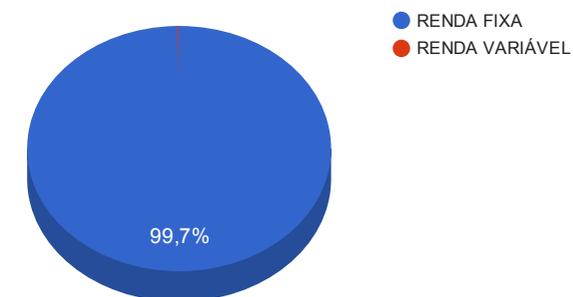
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	12.813.670,90	27,55%	666	0,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	516,63	0,00%	122	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.663.048,31	7,87%	1.319	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	16.531.262,77	35,54%	564	0,49%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	7.007.465,19	15,06%	752	0,16%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	D+3	Não há	706.373,15	1,52%	409	0,34%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	5.649.723,34	12,15%	2.829	0,12%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIAÇÕES	D+4	Não há	62.553,64	0,13%	249	0,62%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CONSUMO FIAÇÕES	D+4	Não há	81.431,16	0,18%	1.174	0,63%	Artigo 8º, Inciso III
		TOTAL -	46.516.045,09				

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

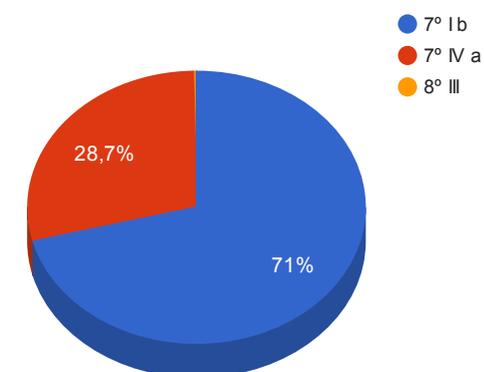
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	100,00%	33.008.498,61	70,96%	13.507.546,48
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	13.363.561,68	28,73%	591.251,85
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	40,00%	0,00	0,00%	18.606.418,04
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	15,00%	0,00	0,00%	6.977.406,76
Total Renda Fixa	100,00%	185,00	46.372.060,29	99,69%	

Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	10,00%	143.984,80	0,31%	4.507.619,71
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	2.325.802,25
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	2.325.802,25
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	2.325.802,25
Total Renda Variável	30,00%	25,00	143.984,80	0,31%	

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+	8,30%	12,62%	12,62%	18,46%	15,77%	35,93%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8,34%	12,47%	12,47%	17,93%	15,09%	34,46%	0,20%	10,098%	13,64%
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%
CDI	1,16%	3,25%	3,25%	6,72%	13,73%	26,53%	-	-	-
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,18%	3,25%	3,25%	6,73%	13,86%	26,86%	0,25%	0,041%	0,09%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,18%	3,25%	3,25%	6,72%	13,80%	26,69%	0,20%	0,036%	0,07%
IPCA + 6,00% ao ano	0,94%	4,08%	4,08%	8,58%	15,90%	32,87%	-	-	-
CAIXA PA TRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	1,22%	5,48%	5,48%	10,56%	13,87%	29,32%	0,30%	1,791%	3,55%
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%
IDKA IPCA 2 Anos	0,15%	5,16%	5,16%	10,57%	17,31%	32,68%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,62%	4,92%	4,92%	10,39%	16,35%	31,45%	0,20%	1,836%	3,11%

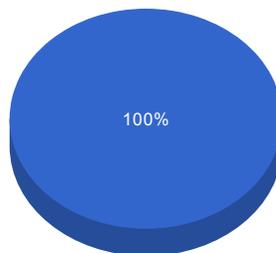
Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (março / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
SMLL	11,39%	6,64%	6,64%	4,41%	-11,68%	-27,24%	-	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIAÇÕES	6,04%	2,82%	2,82%	3,88%	-6,48%	-20,11%	1,50%	7,654%	17,65%
ICON	7,19%	6,98%	6,98%	0,26%	-1,84%	14,21%	-	-	-
CAIXA CONSUMO FIAÇÕES	7,09%	5,45%	5,45%	-5,00%	-5,12%	7,21%	1,60%	9,006%	19,23%

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

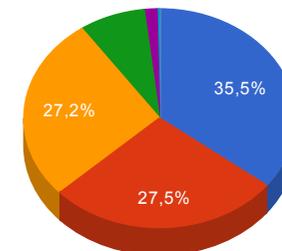
Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	46.516.045,09	100,00%

● CAIXA ECONÔMICA FEDERAL



Sub-segmento	Valor	%
IDKA IPCA 2A	16.531.262,77	35,54%
IMA-B 5	12.813.670,90	27,55%
CDI	12.657.188,53	27,21%
IRF-M 1	3.663.048,31	7,87%
GESTÃO LIVRE	706.373,15	1,52%
AÇÕES - SETORIAIS	143.984,80	0,31%
IMA-B 5+	516,63	0,00%

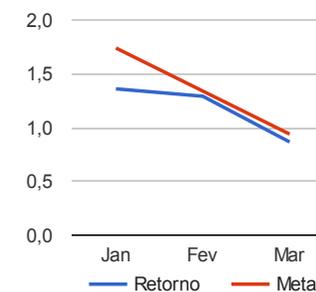
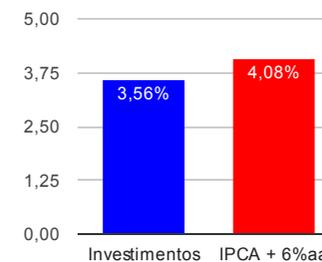
● IDKA IPCA 2A
● IMA-B 5
● CDI
● IRF-M 1
● GESTÃO LIVRE
● AÇÕES - SETORIAIS
● Outro



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%
Acumulado no ano					1.588.100,50	3,56%	4,08%	87,28%	

Acumulado no Ano



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 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	476,87	0,00	0,00	516,63	39,76	8,34%	10,10%	8,34%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.643.250,35	0,00	24.700,00	3.663.048,31	44.497,96	1,22%	0,17%	1,23%
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	697.883,32	0,00	0,00	706.373,15	8.489,83	1,22%	1,79%	1,22%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	5.623.214,93	0,00	40.000,00	5.649.723,34	66.508,41	1,18%	0,04%	1,18%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	6.925.863,03	0,00	0,00	7.007.465,19	81.602,16	1,18%	0,04%	1,18%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	12.361.492,55	364.000,00	0,00	12.813.670,90	88.178,35	0,69%	1,83%	0,73%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	16.429.830,24	0,00	0,00	16.531.262,77	101.432,53	0,62%	1,84%	0,62%
Total Renda Fixa					390.749,00	0,85%	1,21%	

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 CONSUMO FIAÇÕES	76.037,99	0,00	0,00	81.431,16	5.393,17	7,09%	9,01%	7,09%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIAÇÕES	58.990,10	0,00	0,00	62.553,64	3.563,54	6,04%	7,65%	6,04%
Total Renda Variável					8.956,71	6,63%	8,42%	

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-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.796.050,54	5.550.276,95	1.000,00	12.813.670,90	468.343,41	3,90%	5,24%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	16.864.285,61	660.000,00	16.531.262,77	326.977,16	1,96%	4,92%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	6.008.761,09	793.834,14	0,00	7.007.465,19	204.869,96	3,14%	3,25%
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%	9,62%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	5.510.416,49	0,00	40.000,00	5.649.723,34	179.306,85	3,25%	3,25%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.555.779,03	0,00	34.700,00	3.663.048,31	141.969,28	4,00%	4,00%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	4.961.770,44	0,00	4.999.194,50	0,00	37.424,06	0,75%	9,26%
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	669.650,64	0,00	0,00	706.373,15	36.722,51	5,48%	5,48%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	459,35	0,00	0,00	516,63	57,28	12,47%	12,47%
				Total Renda Fixa	1.582.178,79	3,56%	

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 CONSUMO FIAÇÕES	77.223,53	0,00	0,00	81.431,16	4.207,63	5,45%	5,45%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIAÇÕES	60.839,56	0,00	0,00	62.553,64	1.714,08	2,82%	2,82%
Total Renda Variável					5.921,71	4,29%	

