

Relatório Analítico dos Investimentos em abril de 2016



Carteira consolidada de investimentos - base (abril / 2016)

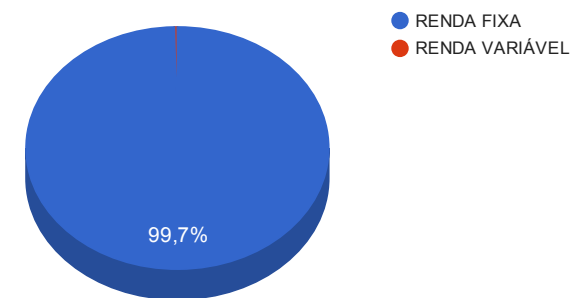
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	12.999.297,08	27,85%	672	0,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	543,94	0,00%	129	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.689.371,88	7,90%	1.326	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	17.037.640,29	36,50%	567	0,48%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	6.381.751,21	13,67%	749	0,14%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	D+3	Não há	717.892,75	1,54%	403	0,35%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	5.710.820,27	12,23%	3.008	0,11%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIAÇÕES	D+4	Não há	64.441,10	0,14%	258	0,61%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CONSUMO FIAÇÕES	D+4	Não há	81.978,57	0,18%	1.162	0,62%	Artigo 8º, Inciso III
TOTAL -			46.683.737,09				

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

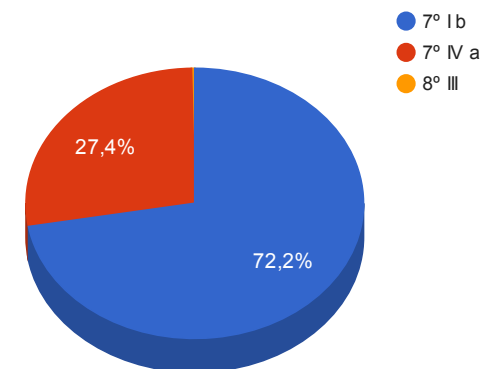
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	100,00%	33.726.853,19	72,25%	12.956.883,90
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	12.810.464,23	27,44%	1.194.656,90
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	40,00%	0,00	0,00%	18.673.494,84
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	15,00%	0,00	0,00%	7.002.560,56
Total Renda Fixa	100,00%	185,00	46.537.317,42	99,69%	

Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	10,00%	146.419,67	0,31%	4.521.954,04
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	2.334.186,85
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	2.334.186,85
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	2.334.186,85
Total Renda Variável	30,00%	25,00	146.419,67	0,31%	

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5+	5,37%	18,66%	17,25%	21,62%	17,80%	38,82%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5,29%	18,41%	17,16%	21,03%	17,01%	37,15%	0,20%	5,468%	13,77%
IDKA IPCA 2 Anos	1,66%	6,90%	3,03%	9,15%	18,82%	33,12%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,62%	6,62%	3,65%	9,26%	17,94%	31,77%	0,20%	1,222%	3,10%
IMA-B 5	1,54%	6,97%	3,88%	9,83%	17,80%	32,16%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,53%	6,84%	3,82%	9,63%	17,30%	31,22%	0,20%	1,247%	3,52%
IPCA + 6,00% ao ano	1,08%	5,20%	3,40%	8,33%	15,78%	32,79%	-	-	-
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	1,63%	7,20%	4,45%	9,82%	14,80%	29,63%	0,30%	1,214%	3,59%
IRF-M 1	1,07%	5,15%	3,45%	7,53%	14,67%	27,38%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,11%	5,15%	3,47%	7,49%	14,50%	26,91%	0,20%	0,173%	0,50%
CDI	1,05%	4,34%	3,25%	6,67%	13,85%	26,83%	-	-	-
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,08%	4,37%	3,29%	6,70%	13,99%	27,17%	0,25%	0,033%	0,09%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,07%	4,35%	3,27%	6,67%	13,91%	26,96%	0,20%	0,022%	0,07%

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

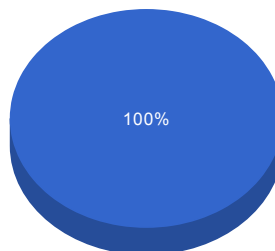
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
SMLL	5,56%	12,56%	23,06%	4,51%	-9,52%	-22,45%	-	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIAÇÕES	3,02%	5,92%	11,98%	4,70%	-6,06%	-17,73%	1,50%	10,974%	18,56%

ICON	0,67%	7,70%	13,05%	2,48%	-6,12%	13,29%	-	-	-
CAIXA CONSUMO FIAÇÕES	0,67%	6,16%	11,95%	0,28%	-9,26%	6,78%	1,60%	9,453%	19,51%

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

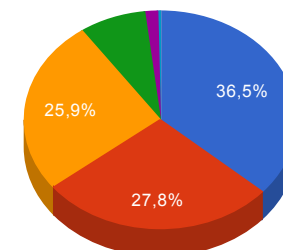
Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	46.683.737,09	100,00%

● CAIXA
ECONÔMICA
FEDERAL



Sub-segmento	Valor	%
IDKA IPCA 2A	17.037.640,29	36,50%
IMA-B 5	12.999.297,08	27,85%
CDI	12.092.571,48	25,90%
IRF-M 1	3.689.371,88	7,90%
GESTÃO LIVRE	717.892,75	1,54%
AÇÕES - SETORIAIS	146.419,67	0,31%
IMA-B 5+	543,94	0,00%

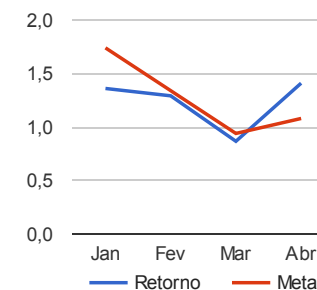
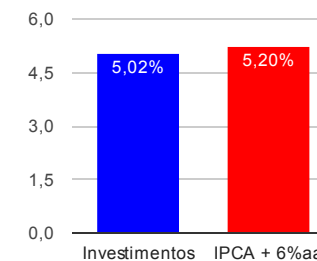
● IDKA IPCA
2A
● IMA-B 5
● CDI
● IRF-M 1
● GESTÃO
LIVRE
● AÇÕES -
SETORIAIS
● Outro



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%
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%
Acumulado no ano					2.243.885,07	5,02%	5,20%	96,55%	

Acumulado no Ano



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de abril / 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	516,63	0,00	0,00	543,94	27,31	5,29%	5,47%	5,29%
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	706.373,15	0,00	0,00	717.892,75	11.519,60	1,63%	1,21%	1,63%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	16.531.262,77	236.000,00	0,00	17.037.640,29	270.377,52	1,61%	1,22%	1,62%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	12.813.670,90	0,00	10.000,00	12.999.297,08	195.626,18	1,53%	1,25%	1,53%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.663.048,31	0,00	14.092,57	3.689.371,88	40.416,14	1,10%	0,17%	1,11%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	5.649.723,34	0,00	0,00	5.710.820,27	61.096,93	1,08%	0,03%	1,08%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	7.007.465,19	0,00	700.000,00	6.381.751,21	74.286,02	1,06%	0,02%	1,07%
Total Renda Fixa					653.349,70	1,41%	0,84%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIAÇÕES	62.553,64	0,00	0,00	64.441,10	1.887,46	3,02%	10,97%	3,02%
CAIXA CONSUMO FIAÇÕES	81.431,16	0,00	0,00	81.978,57	547,41	0,67%	9,45%	0,67%
Total Renda Variável					2.434,87	1,69%	10,12%	

