

Relatório Analítico dos Investimentos em setembro e 3º Trimestre de 2016



Carteira consolidada de investimentos - base (setembro / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			92.391,00	0,18%			Artigo 20
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	11.007.953,50	21,52%	728	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.166.674,92	2,28%	733	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.411.308,55	12,53%	639	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.857.797,02	11,45%	179	0,90%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.957.281,36	7,74%	1.331	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1901	Não há	5.189.782,77	10,15%	9	11,86%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.085.633,80	13,85%	341	0,30%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
GBX PRIME I FIDC	D+1201	29 dias	7.733.741,94	15,12%		2,87%	Artigo 7º, Inciso VI
CAIXA CONSUMO FIAÇÕES	D+4	Não há	92.583,39	0,18%	1.052	0,71%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIAÇÕES	D+4	Não há	74.274,46	0,15%	346	0,61%	Artigo 8º, Inciso III
W7 FIP	Não se aplica	Não se aplica	2.486.261,93	4,86%	20	2,93%	Artigo 8º, Inciso V
TOTAL -			51.155.684,64				

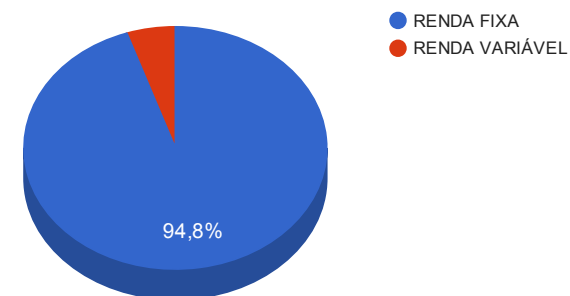
Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (setembro / 2016)

Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	100,00%	28.401.015,35	55,52%	22.754.669,29
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	40,00%	12.275.416,57	24,00%	8.186.857,29
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	15,00%	7.733.741,94	15,12%	-60.389,24
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	0,00	0,00%	15.346.705,39
Total Renda Fixa	100,00%	185,00	48.410.173,86	94,63%	

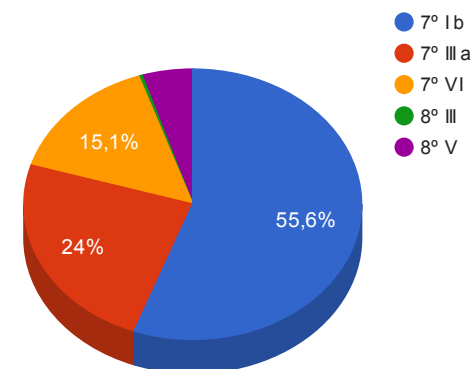
Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	10,00%	166.857,85	0,33%	4.948.710,61
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	2.486.261,93	4,86%	71.522,30
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	2.557.784,23
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	2.557.784,23
Total Renda Variável	30,00%	25,00	2.653.119,78	5,19%	

⚠️ **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 (setembro / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5+	1,67%	28,05%	5,98%	13,71%	34,70%	38,62%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,66%	27,64%	5,93%	13,48%	33,84%	36,94%	0,20%	3,135%	10,13%
IMA-B	1,57%	22,00%	5,04%	11,16%	28,36%	35,87%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,58%	21,72%	4,97%	11,04%	27,66%	33,42%	0,20%	2,300%	7,11%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	1,51%	21,14%	4,94%	10,88%	27,24%	34,68%	0,20%	2,172%	6,44%
IDKA IPCA 2 Anos	1,50%	12,64%	3,74%	7,11%	18,43%	33,53%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,33%	12,42%	3,70%	7,14%	18,28%	32,52%	0,20%	0,545%	2,55%
IMA-B 5	1,41%	12,92%	3,76%	7,19%	18,83%	33,03%	-	-	-
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1,45%	12,36%	3,85%	7,37%	17,21%	-	1,00%	0,974%	2,88%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,40%	12,68%	3,70%	7,08%	18,43%	32,08%	0,20%	0,778%	2,72%
IRF-M 1	1,19%	11,14%	3,46%	6,82%	15,14%	28,83%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,17%	11,05%	3,42%	6,78%	14,99%	28,37%	0,20%	0,075%	0,40%
IPCA + 7,00% ao ano	0,65%	11,00%	2,82%	6,41%	16,07%	35,98%	-	-	-
GBX PRIME I FIDC	0,85%	11,21%	3,07%	6,67%	15,78%	32,39%	0,15%	-	-
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

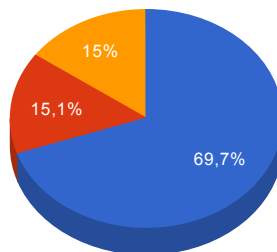
Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (setembro / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
ICON	2,16%	24,90%	12,94%	16,75%	17,06%	19,58%	-	-	-
CAIXA CONSUMO FIAÇÕES	2,07%	19,89%	10,87%	13,70%	8,01%	8,25%	1,60%	7,698%	19,95%
SMLL	0,09%	35,19%	14,90%	26,78%	32,37%	-4,76%	-	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIAÇÕES	0,22%	22,08%	12,65%	18,74%	23,35%	-4,06%	1,50%	8,965%	19,20%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
W7 FIP	-	-	-	-	-	-	1,50%	0,000%	28,18%

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

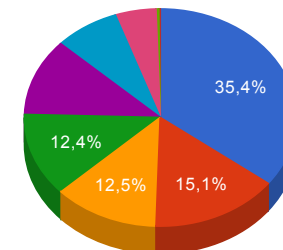
Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	35.653.507,00	69,70%
CM Capital Markets DTVM	7.733.741,94	15,12%
Santander Securities Services	7.676.044,70	15,01%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	92.391,00	0,18%

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



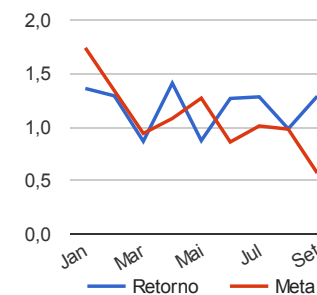
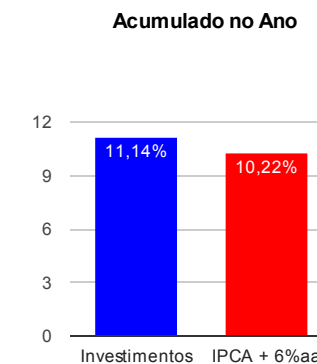
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	18.093.587,30	35,37%
FIDC - ABERTO	7.733.741,94	15,12%
IDKA IPCA 2A	6.411.308,55	12,53%
IMA-B 5	6.356.457,69	12,43%
IMA-B 5+	5.857.797,02	11,45%
IRF-M 1	3.957.281,36	7,74%
FIP	2.486.261,93	4,86%
AÇÕES - SETORIAIS	166.857,85	0,33%
CVS	92.391,00	0,18%

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



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%
Setembro	49.759.986,45	11.412.998,00	10.759.000,00	51.063.293,64	649.309,19	1,29%	0,57%	227,09%	1,62%
Acumulado no ano					5.026.356,00	11,14%	10,22%	108,98%	



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de setembro / 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	5.532.551,43	230.000,00	0,00	5.857.797,02	95.245,59	1,65%	3,13%	1,66%
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	5.115.606,51	0,00	0,00	5.189.782,77	74.176,26	1,45%	0,97%	1,45%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	10.852.998,00	0,00	11.007.953,50	154.955,50	1,43%	2,30%	1,58%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.150.583,09	0,00	0,00	1.166.674,92	16.091,83	1,40%	0,78%	1,40%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.327.088,90	0,00	0,00	6.411.308,55	84.219,65	1,33%	0,55%	1,33%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.921.444,83	0,00	10.000,00	3.957.281,36	45.836,53	1,17%	0,08%	1,17%
GBX PRIME I FIDC	7.668.602,37	0,00	0,00	7.733.741,94	65.139,57	0,85%	-	-
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	17.388.819,25	330.000,00	10.749.000,00	7.085.633,80	115.814,55	0,65%	2,17%	1,51%
Total Renda Fixa					651.479,48	1,36%	1,69%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA CONSUMO FIAÇÕES	90.706,78	0,00	0,00	92.583,39	1.876,61	2,07%	7,70%	2,07%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIAÇÕES	74.113,65	0,00	0,00	74.274,46	160,81	0,22%	8,97%	0,22%
W7 FIP	2.490.469,64	0,00	0,00	2.486.261,93	-4.207,71	-0,17%	0,00%	-0,17%
Total Renda Variável					-2.170,29	-0,08%	0,52%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre / 2016

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	8.130.043,34	9.317.573,54	10.749.000,00	7.085.633,80	387.016,92	3,28%	4,94%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.955.726,39	0,00	5.909.440,85	6.411.308,55	365.023,01	3,71%	3,70%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.758.617,74	1.550.000,00	6.607.725,38	3.957.281,36	256.389,00	3,32%	3,42%
GBX PRIME I FIDC	7.503.475,98	0,00	0,00	7.733.741,94	230.265,96	3,07%	3,07%
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	4.997.594,84	0,00	0,00	5.189.782,77	192.187,93	3,85%	3,85%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	10.852.998,00	0,00	11.007.953,50	154.955,50	1,43%	4,97%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.147.598,31	0,00	2.068.832,21	1.166.674,92	87.908,82	3,71%	3,70%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	553,48	5.774.521,03	0,00	5.857.797,02	82.722,51	4,81%	5,93%
Total Renda Fixa					1.756.469,65	0,61%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre / 2016

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA CONSUMO FIAÇÕES	83.509,11	0,00	0,00	92.583,39	9.074,28	10,87%	10,87%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIAÇÕES	65.934,99	0,00	0,00	74.274,46	8.339,47	12,65%	12,65%
W7 FIP	2.499.652,00	0,00	0,00	2.486.261,93	-13.390,07	-0,54%	-
Total Renda Variável					4.023,68	0,15%	

