

Relatório Analítico dos Investimentos em outubro de 2016



Carteira consolidada de investimentos - base (outubro / 2016)

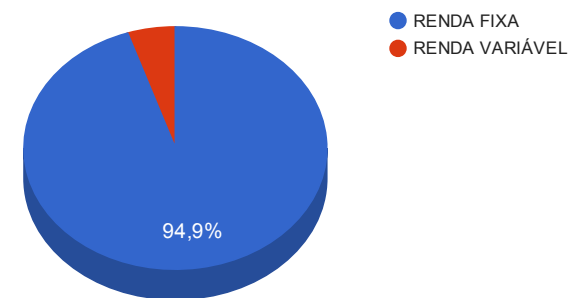
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			23.736,52	0,05%			Artigo 20
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.423.488,63	8,51%	641	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.572.610,37	4,95%	1.330	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	13.167.073,40	25,34%	197	2,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	618.386,61	1,19%	733	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	11.079.199,83	21,32%	738	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1901	Não há	5.210.253,36	10,03%			Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.418.775,77	8,50%	344	0,18%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
GBX PRIME I FIDC	D+1201	29 dias	7.792.351,19	15,00%			Artigo 7º, Inciso VI
CAIXA CONSUMO FIAÇÕES	D+4	Não há	94.179,37	0,18%	1.066	0,71%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIAÇÕES	D+4	Não há	79.770,15	0,15%	371	0,60%	Artigo 8º, Inciso III
W7 FIP	Não se aplica	Não se aplica	2.482.256,72	4,78%	20	2,93%	Artigo 8º, Inciso V
		TOTAL -	51.962.081,92				

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

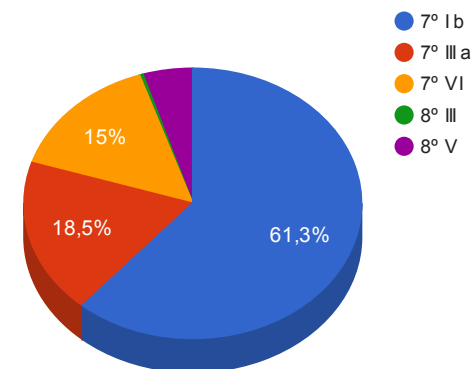
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	100,00%	31.860.758,84	61,32%	20.101.323,08
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	40,00%	9.629.029,13	18,53%	11.155.803,64
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	15,00%	7.792.351,19	15,00%	1.961,10
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	0,00	0,00%	15.588.624,58
Total Renda Fixa	100,00%	185,00	49.282.139,16	94,84%	

Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	10,00%	173.949,52	0,33%	5.022.258,67
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	2.482.256,72	4,78%	115.847,38
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	2.598.104,10
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	2.598.104,10
Total Renda Variável	30,00%	25,00	2.656.206,24	5,11%	

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M 1	0,94%	12,18%	3,36%	6,69%	14,72%	28,94%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,94%	12,10%	3,33%	6,60%	14,59%	28,51%	0,20%	0,171%	0,35%
IPCA + 7,00% ao ano	0,80%	11,89%	2,53%	6,04%	15,39%	35,66%	-	-	-
GBX PRIME I FIDC	0,76%	12,05%	2,75%	6,44%	15,25%	32,16%	0,15%	-	-
IMA-B 5+	0,73%	28,98%	3,30%	8,70%	32,20%	35,92%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,70%	28,53%	3,22%	8,54%	31,37%	34,60%	0,20%	3,091%	9,77%
IMA-B	0,64%	22,78%	3,13%	7,65%	25,94%	33,95%	-	-	-
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	0,84%	22,16%	3,35%	7,86%	25,16%	33,00%	0,20%	2,261%	6,22%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,65%	22,51%	3,09%	7,53%	25,56%	31,59%	0,20%	2,279%	6,81%
IMA-B 5	0,46%	13,44%	2,99%	6,05%	16,48%	32,40%	-	-	-
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,52%	12,95%	3,05%	6,17%	15,37%	-	1,00%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,46%	13,20%	2,95%	5,95%	16,15%	31,42%	0,20%	0,735%	2,53%
IDKA IPCA 2 Anos	0,41%	13,11%	3,23%	5,80%	15,48%	32,92%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,43%	12,90%	3,00%	5,89%	15,70%	31,80%	0,20%	0,673%	2,42%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

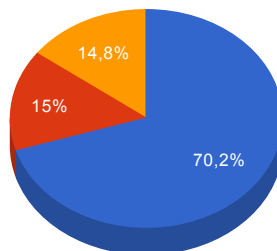
Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (outubro / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
SMLL	7,01%	44,67%	7,29%	28,53%	34,32%	3,56%	-	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIAÇÕES	7,40%	31,12%	6,75%	23,79%	29,61%	3,43%	1,50%	4,881%	18,90%
ICON	0,42%	25,42%	3,03%	16,46%	19,34%	13,33%	-	-	-
CAIXA CONSUMO FIAÇÕES	1,72%	21,96%	3,30%	14,88%	15,20%	3,28%	1,60%	6,301%	19,16%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
W7 FIP	-	-	-	-	-	-	1,50%	0,000%	28,24%

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

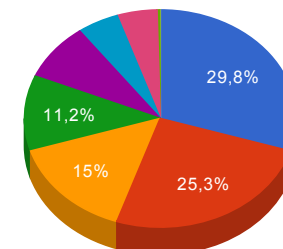
Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	36.453.484,13	70,15%
CM Capital Markets DTVM	7.792.351,19	15,00%
Santander Securities Services	7.692.510,08	14,80%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	23.736,52	0,05%

- CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
- CM Capital Markets DTVM
- Santander Securities Services
- Outro



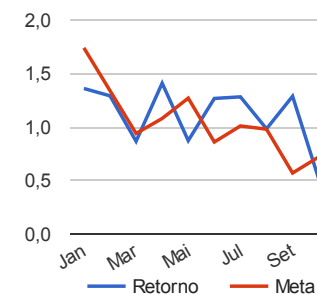
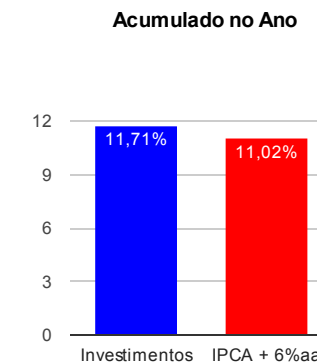
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	15.497.975,60	29,83%
IMA-B 5+	13.167.073,40	25,34%
FIDC - ABERTO	7.792.351,19	15,00%
IMA-B 5	5.828.639,97	11,22%
IDKA IPCA 2A	4.423.488,63	8,51%
IRF-M 1	2.572.610,37	4,95%
FIP	2.482.256,72	4,78%
AÇÕES - SETORIAIS	173.949,52	0,33%
CVS	23.736,52	0,05%

- IMA-B
- IMA-B 5+
- FIDC - ABERTO
- IMA-B 5
- IDKA IPCA 2A
- IRF-M 1
- FIP
- 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%
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%
Outubro	51.063.293,64	7.330.000,00	6.721.525,71	51.938.345,40	266.577,47	0,52%	0,72%	71,19%	2,08%
Acumulado no ano					5.292.933,47	11,71%	11,02%	106,28%	



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	7.085.633,80	0,00	2.737.525,71	4.418.775,77	70.667,68	1,00%	2,26%	0,84%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.957.281,36	0,00	1.419.000,00	2.572.610,37	34.329,01	0,87%	0,17%	0,94%
GBX PRIME I FIDC	7.733.741,94	0,00	0,00	7.792.351,19	58.609,25	0,76%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.007.953,50	0,00	0,00	11.079.199,83	71.246,33	0,65%	2,28%	0,65%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.166.674,92	0,00	553.000,00	618.386,61	4.711,69	0,40%	0,74%	0,46%
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	5.189.782,77	0,00	0,00	5.210.253,36	20.470,59	0,39%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.411.308,55	0,00	2.012.000,00	4.423.488,63	24.180,08	0,38%	0,67%	0,43%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.857.797,02	7.330.000,00	0,00	13.167.073,40	-20.723,62	-0,16%	3,09%	0,70%
Total Renda Fixa					263.491,01	0,54%	2,20%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIAÇÕES	74.274,46	0,00	0,00	79.770,15	5.495,69	7,40%	4,88%	7,40%
CAIXA CONSUMO FIAÇÕES	92.583,39	0,00	0,00	94.179,37	1.595,98	1,72%	6,30%	1,72%
W7 FIP	2.486.261,93	0,00	0,00	2.482.256,72	-4.005,21	-0,16%	0,00%	-0,16%
Total Renda Variável					3.086,46	0,12%	0,37%	

