

Relatório Analítico dos Investimentos em maio de 2016



Carteira consolidada de investimentos - base (maio / 2016)

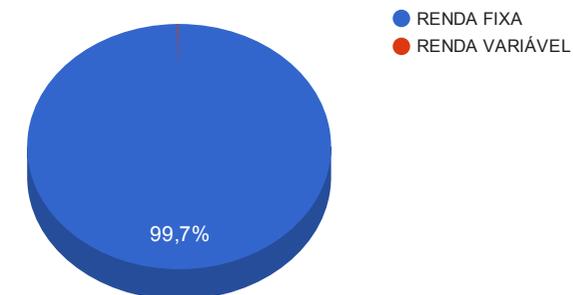
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.710.988,91	7,74%	1.331	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	539,58	0,00%	136	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	17.689.286,26	36,91%	579	0,48%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	13.485.834,04	28,14%	686	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	5.747.715,61	11,99%	3.184	0,11%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	6.422.252,06	13,40%	748	0,14%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	D+3	Não há	723.943,64	1,51%	393	0,36%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIAÇÕES	D+4	Não há	61.576,04	0,13%	258	0,61%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CONSUMO FIAÇÕES	D+4	Não há	79.643,75	0,17%	1.128	0,71%	Artigo 8º, Inciso III
		TOTAL -	47.921.779,89				

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

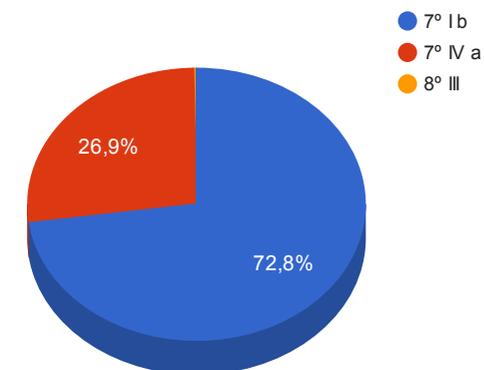
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	100,00%	34.886.648,79	72,80%	13.035.131,10
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	12.893.911,31	26,91%	1.482.622,66
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	40,00%	0,00	0,00%	19.168.711,96
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	15,00%	0,00	0,00%	7.188.266,98
Total Renda Fixa	100,00%	185,00	47.780.560,10	99,71%	

Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	10,00%	141.219,79	0,29%	4.650.958,20
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	2.396.088,99
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	2.396.088,99
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	2.396.088,99
Total Renda Variável	30,00%	25,00	141.219,79	0,29%	

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA + 6,00% ao ano	1,27%	6,54%	3,33%	8,11%	15,85%	33,21%	-	-	-
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	0,84%	8,11%	3,73%	10,12%	14,27%	28,00%	0,30%	0,949%	3,60%
CDI	1,11%	5,50%	3,36%	6,72%	13,98%	27,14%	-	-	-
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,11%	5,53%	3,41%	6,75%	14,12%	27,48%	0,25%	0,012%	0,08%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,10%	5,51%	3,39%	6,73%	14,05%	27,30%	0,20%	0,005%	0,07%
IRF-M 1	1,07%	6,27%	3,43%	7,53%	14,79%	27,53%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,05%	6,26%	3,42%	7,49%	14,65%	27,05%	0,20%	0,084%	0,49%
IMA-B 5	0,80%	7,82%	3,13%	10,11%	16,83%	31,29%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,78%	7,67%	3,07%	9,87%	16,25%	30,33%	0,20%	0,906%	3,51%
IDKA IPCA 2 Anos	0,63%	7,57%	2,45%	9,61%	16,89%	32,04%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,80%	7,47%	3,06%	9,58%	16,70%	31,05%	0,20%	1,279%	3,11%
IMA-B 5+	-0,73%	17,79%	13,27%	19,12%	13,37%	29,77%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,80%	17,46%	13,15%	18,59%	12,51%	27,92%	0,20%	5,104%	13,77%

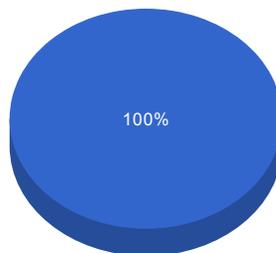
Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (maio / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
SMLL	-4,21%	7,82%	12,62%	2,13%	-11,22%	-26,49%	-	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIAÇÕES	-4,45%	1,21%	4,38%	-0,72%	-7,98%	-22,28%	1,50%	8,804%	19,49%
ICON	-2,46%	5,05%	5,26%	4,01%	-6,19%	8,26%	-	-	-
CAIXA CONSUMO FIAÇÕES	-2,85%	3,13%	4,74%	2,28%	-9,75%	-1,29%	1,60%	9,950%	20,58%

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

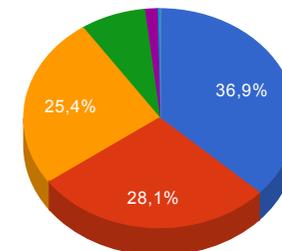
Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	47.921.779,89	100,00%

● CAIXA ECONÔMICA FEDERAL



Sub-segmento	Valor	%
IDKA IPCA 2A	17.689.286,26	36,91%
IMA-B 5	13.485.834,04	28,14%
CDI	12.169.967,67	25,40%
IRF-M 1	3.710.988,91	7,74%
GESTÃO LIVRE	723.943,64	1,51%
AÇÕES - SETORIAIS	141.219,79	0,29%
IMA-B 5+	539,58	0,00%

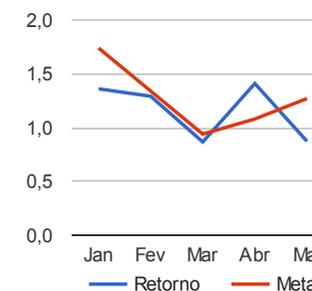
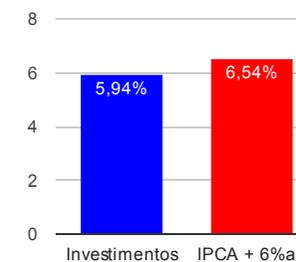
● IDKA IPCA 2A
● IMA-B 5
● CDI
● IRF-M 1
● GESTÃO LIVRE
● AÇÕES - SETORIAIS
● Outro



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%
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%
Acumulado no ano					2.658.667,87	5,94%	6,54%	90,84%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	6.381.751,21	0,00	30.000,00	6.422.252,06	70.500,85	1,10%	0,01%	1,10%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	5.710.820,27	0,00	26.000,00	5.747.715,61	62.895,34	1,10%	0,01%	1,11%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.689.371,88	0,00	15.240,00	3.710.988,91	36.857,03	1,00%	0,08%	1,05%
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	717.892,75	0,00	0,00	723.943,64	6.050,89	0,84%	0,95%	0,84%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	17.037.640,29	920.000,00	411.000,00	17.689.286,26	142.645,97	0,79%	1,28%	0,80%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	12.999.297,08	550.000,00	164.500,00	13.485.834,04	101.036,96	0,75%	0,91%	0,78%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	543,94	0,00	0,00	539,58	-4,36	-0,80%	5,10%	-0,80%
Total Renda Fixa					419.982,68	0,89%	0,75%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA CONSUMO FIAÇÕES	81.978,57	0,00	0,00	79.643,75	-2.334,82	-2,85%	9,95%	-2,85%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FIAÇÕES	64.441,10	0,00	0,00	61.576,04	-2.865,06	-4,45%	8,80%	-4,45%
Total Renda Variável					-5.199,88	-3,55%	9,45%	

