



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

Carteira consolidada de investimentos - base (março / 2016)

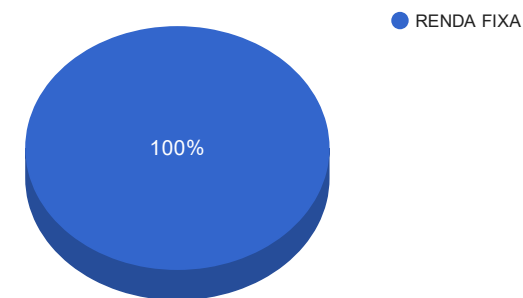
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	398.910,81	7,11%	721	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	764.032,96	13,62%	564	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	51.305,44	0,91%	1.169	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.547.522,34	63,26%	1.319	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	44.271,97	0,79%	139	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	801.732,50	14,30%	133	0,21%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
<b>TOTAL -</b>			<b>5.607.776,02</b>				

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

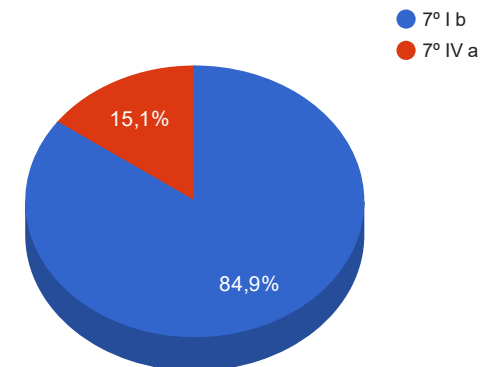
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	100,00%	4.761.771,55	84,91%	846.004,47
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	30,00%	0,00	0,00%	1.682.332,81
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	846.004,47	15,09%	836.328,34
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	10,00%	0,00	0,00%	560.777,60
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	280.388,80
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>175,00</b>	<b>5.607.776,02</b>	<b>100,00%</b>	

Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	10,00%	0,00	0,00%	560.777,60
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	0,00	0,00%	841.166,40
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>25,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	

**Distribuição por Segmento**



**Distribuição por Artigo / Resolução**



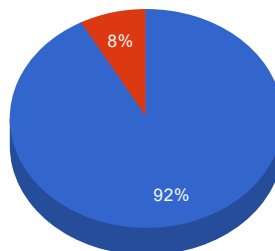
Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (março / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
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%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,21%	3,99%	3,99%	7,67%	14,09%	26,29%	0,10%	0,171%	0,53%
CDI	1,16%	3,25%	3,25%	6,72%	13,73%	26,53%	-	-	-
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,17%	3,34%	3,34%	6,71%	13,38%	25,99%	0,20%	0,075%	0,22%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	1,09%	3,04%	3,04%	6,28%	12,77%	24,47%	0,80%	0,000%	0,03%
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%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,53%	4,93%	4,93%	10,39%	16,25%	31,02%	0,20%	1,837%	3,20%

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

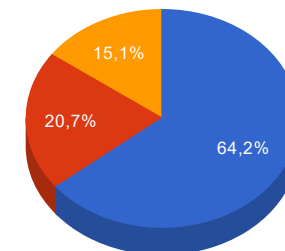
Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	5.157.559,77	91,97%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	450.216,25	8,03%

- CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
- BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM



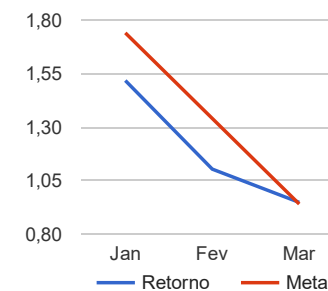
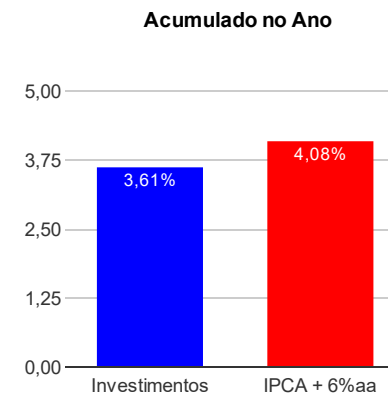
Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	3.598.827,78	64,18%
IDKA IPCA 2A	1.162.943,77	20,74%
CDI	846.004,47	15,09%

- IRF-M 1
- IDKA IPCA 2A
- CDI



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	4.816.787,08	384.185,92	56.737,62	5.222.284,79	78.049,41	1,52%	1,74%	87,23%	0,30%
Fevereiro	5.222.284,79	1.813.738,11	1.701.511,56	5.393.358,65	58.847,31	1,10%	1,34%	82,06%	0,33%
Março	5.393.358,65	1.102.073,32	940.302,88	5.607.776,02	52.646,93	0,95%	0,94%	100,59%	0,50%
Acumulado no ano					189.543,65	3,61%	4,08%	88,51%	



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 ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	792.496,64	0,00	0,00	801.732,50	9.235,86	1,17%	0,07%	1,17%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.768.479,41	134.564,30	400.000,00	3.547.522,34	44.478,63	1,14%	0,17%	1,23%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	759.345,01	0,00	0,00	764.032,96	4.687,95	0,62%	1,84%	0,62%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	35.406,75	548.258,54	540.302,88	44.271,97	909,56	0,16%	0,00%	1,09%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	400.000,00	0,00	398.910,81	-1.089,19	-0,27%	1,84%	0,53%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	37.630,84	19.250,48	0,00	51.305,44	-5.575,88	-9,80%	0,17%	1,21%
Total Renda Fixa					52.646,93	0,95%	0,50%	

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 IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.978.323,76	940.729,85	1.525.000,00	3.547.522,34	153.468,73	3,61%	4,00%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	775.832,20	0,00	0,00	801.732,50	25.900,30	3,34%	3,34%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	750.000,00	0,00	764.032,96	14.032,96	1,87%	4,92%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	31.517,34	1.054.111,92	1.043.543,61	44.271,97	2.186,32	1,05%	3,04%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	400.000,00	0,00	398.910,81	-1.089,19	-0,27%	4,93%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	31.113,78	155.155,58	130.008,45	51.305,44	-4.955,47	-8,27%	3,99%
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>189.543,65</b>	<b>3,61%</b>	