



Relatório Analítico dos Investimentos em abril de 2016

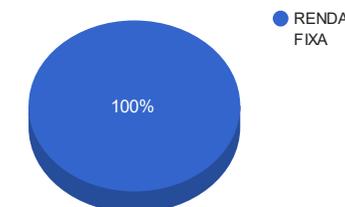
Carteira consolidada de investimentos - base (abril / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			56.315,56	0,16%			Artigo 20
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.413.704,80	4,00%	625	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	15.525.374,35	43,89%	1.326	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.372.417,73	6,71%	1.174	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.089.366,53	3,08%	194	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	5.112.089,89	14,45%	36	7,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.407.356,68	3,98%	672	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	1.321.967,06	3,74%	2.130	0,16%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	429.369,53	1,21%	143	0,29%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.042.305,25	5,77%	475	0,10%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	4.599.695,99	13,00%	844	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
		TOTAL -	35.369.963,37				

Enquadramentos na Resolução 3.922 / 4.392 / 4.604 e Política de Investimentos - base (abril / 2016)

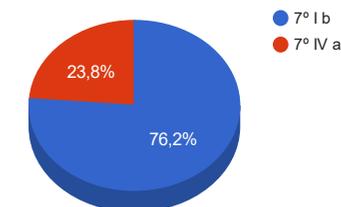
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	0,00%	26.920.309,98	76,11%	-26.920.309,98
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	0,00%	8.393.337,83	23,73%	-8.393.337,83
Total Renda Fixa	100,00%	0,00	35.313.647,81	99,84%	

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Total Renda Variável	30,00%	0,00	0,00	0,00%	

Distribuição por Artigo / Resolução

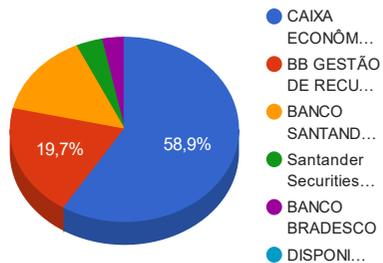


Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (abril / 2016)

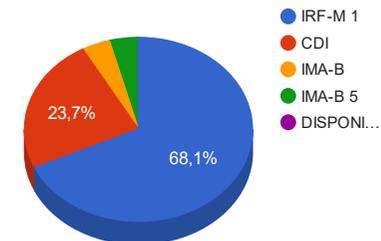
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	3,93%	14,06%	11,92%	16,99%	17,27%	35,51%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,93%	13,93%	11,93%	16,76%	15,56%	33,21%	0,20%	3,879%	9,88%
IMA-B 5	1,54%	6,97%	3,88%	9,83%	17,80%	32,16%	-	-	-
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%
IRF-M 1	1,07%	5,15%	3,45%	7,53%	14,67%	27,38%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,11%	5,15%	3,47%	7,48%	14,38%	26,61%	0,10%	0,179%	0,52%
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%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,06%	5,13%	3,42%	7,42%	14,31%	26,86%	0,20%	0,183%	0,79%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1,06%	4,99%	3,34%	7,28%	14,19%	26,23%	0,40%	0,199%	0,52%
CDI	1,05%	4,34%	3,25%	6,67%	13,85%	26,83%	-	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,09%	4,50%	3,30%	6,75%	13,66%	26,38%	0,20%	0,056%	0,24%
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	1,05%	4,32%	3,21%	6,59%	13,50%	25,99%	0,50%	0,066%	0,17%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,99%	4,06%	3,04%	6,23%	12,89%	24,76%	0,80%	0,000%	0,02%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO	0,98%	4,18%	3,09%	6,52%	13,83%	27,05%	0,20%	0,027%	0,05%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	20.818.110,61	58,86%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	6.972.113,72	19,71%
BANCO SANTANDER	5.112.089,89	14,45%
Santander Securities Services	1.321.967,06	3,74%
BANCO BRADESCO	1.089.366,53	3,08%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	56.315,56	0,16%

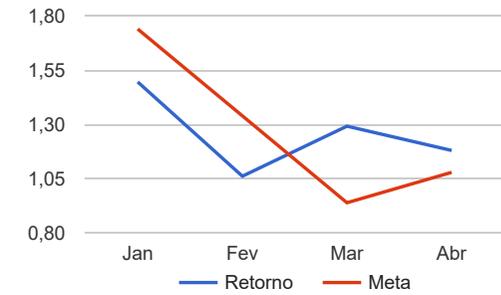
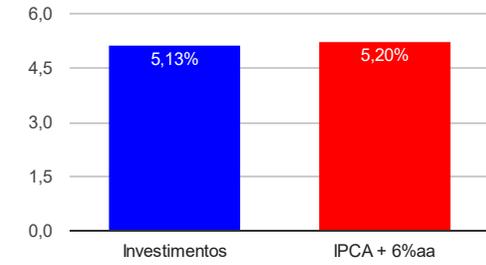


Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	24.099.248,50	68,13%
CDI	8.393.337,83	23,73%
IMA-B	1.413.704,80	4,00%
IMA-B 5	1.407.356,68	3,98%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	56.315,56	0,16%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

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 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	962.047,32	400.000,00	0,00	1.413.704,80	51.657,48	3,79%	3,88%	3,93%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.067.093,30	320.000,00	0,00	1.407.356,68	20.263,38	1,46%	1,25%	1,53%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.346.261,09	0,00	0,00	2.372.417,73	26.156,64	1,11%	0,18%	1,11%
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	1.308.245,66	0,00	0,00	1.321.967,06	13.721,40	1,05%	0,07%	1,05%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.318.189,49	0,00	300.000,00	2.042.305,25	24.115,76	1,04%	0,06%	1,09%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	15.358.666,10	997.262,59	1.000.000,00	15.525.374,35	169.445,66	1,04%	0,17%	1,11%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO	4.554.989,64	0,00	0,00	4.599.695,99	44.706,35	0,98%	0,03%	0,98%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	3.633.538,81	1.436.453,90	0,00	5.112.089,89	42.097,18	0,83%	0,20%	1,06%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.274.664,52	0,00	1.200.000,00	1.089.366,53	14.702,01	0,65%	0,18%	1,06%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	275.359,11	746.561,37	597.711,33	429.369,53	5.160,38	0,50%	0,00%	0,99%
Total Renda Fixa					412.026,24	1,18%	0,34%	