

Relatório Analítico dos Investimentos em junho, 2º Trimestre e 1º semestre de 2016

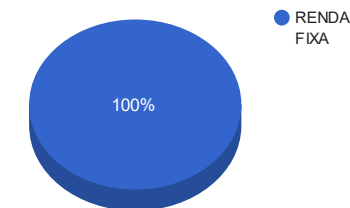
Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			9.665,36	0,03%			Artigo 20
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.438.883,43	3,96%	644	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.112.499,51	3,06%	193	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	15.602.703,52	42,97%	1.331	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	5.219.941,55	14,38%	33	7,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.431.319,13	3,94%	701	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.421.872,13	6,67%	1.175	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	4.701.731,78	12,95%	824	0,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	1.854.286,73	5,11%	2.186	0,22%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	431.200,33	1,19%	151	0,23%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.088.038,88	5,75%	472	0,10%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
		TOTAL -	36.312.142,35				

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

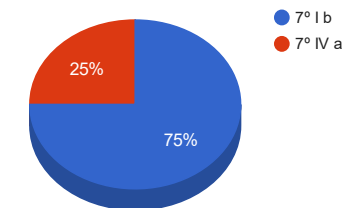
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	0,00%	27.227.219,27	74,98%	-27.227.219,27
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	0,00%	9.075.257,72	24,99%	-9.075.257,72
Total Renda Fixa	100,00%	0,00	36.302.476,99	99,97%	

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

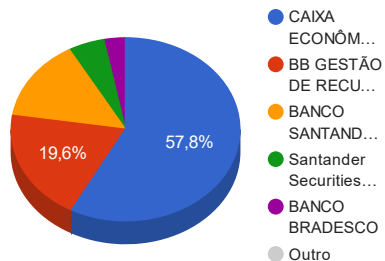


Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (junho / 2016)

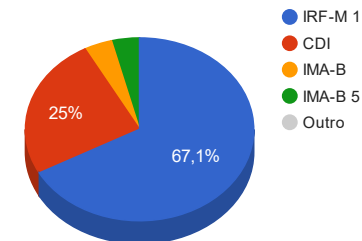
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5	0,94%	8,84%	3,31%	8,84%	16,94%	31,07%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,92%	8,66%	3,26%	8,66%	16,43%	30,14%	0,20%	1,106%	3,51%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	20.992.145,29	57,81%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	7.123.603,91	19,62%
BANCO SANTANDER	5.219.941,55	14,38%
Santander Securities Services	1.854.286,73	5,11%
BANCO BRADESCO	1.112.499,51	3,06%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	9.665,36	0,03%

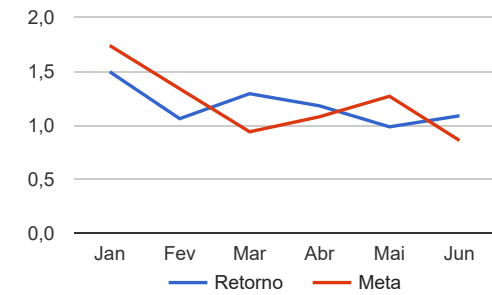
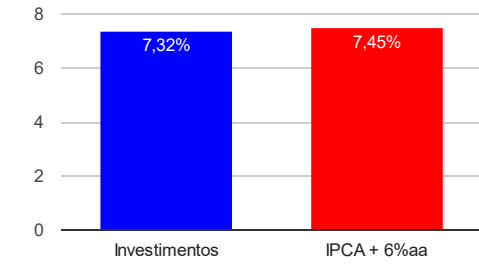


Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	24.357.016,71	67,08%
CDI	9.075.257,72	24,99%
IMA-B	1.438.883,43	3,96%
IMA-B 5	1.431.319,13	3,94%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	9.665,36	0,03%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Acumulado no Ano



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de junho / 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	1.411.759,20	0,00	0,00	1.438.883,43	27.124,23	1,92%	2,30%	1,92%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.064.340,27	0,00	0,00	2.088.038,88	23.698,61	1,15%	0,01%	1,15%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	5.163.284,36	0,00	0,00	5.219.941,55	56.657,19	1,10%	0,21%	1,10%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO	4.652.179,35	0,00	0,00	4.701.731,78	49.552,43	1,07%	0,27%	1,07%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.100.886,54	0,00	0,00	1.112.499,51	11.612,97	1,05%	0,12%	1,05%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	15.688.802,62	0,00	251.000,00	15.602.703,52	164.900,90	1,05%	0,12%	1,06%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.397.081,28	0,00	0,00	2.421.872,13	24.790,85	1,03%	0,12%	1,03%
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	1.835.822,42	0,00	0,00	1.854.286,73	18.464,31	1,01%	0,09%	1,01%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.418.298,06	0,00	0,00	1.431.319,13	13.021,07	0,92%	1,11%	0,92%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	495.987,37	505.005,76	574.665,78	431.200,33	4.872,98	0,49%	0,00%	1,09%
Total Renda Fixa					394.695,54	1,09%	0,27%	