



Relatório Analítico dos Investimentos em setembro e 3º Trimestre de 2016

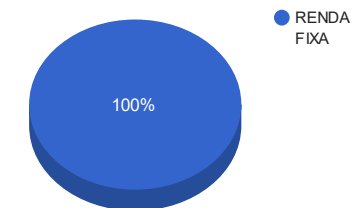
Carteira consolidada de investimentos - base (setembro / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			15.379,17	0,04%			Artigo 20
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	5.397.042,10	14,59%	33	7,54%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.484.303,41	4,01%	733	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.150.176,44	3,11%	188	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	15.548.416,74	42,04%	1.331	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.503.894,81	6,77%	1.171	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.510.386,58	4,08%	728	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	4.868.167,87	13,16%	801	0,09%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.159.599,47	5,84%	463	0,10%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	1.918.734,29	5,19%	2.334	0,22%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	428.557,38	1,16%	179	0,14%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
		TOTAL -	36.984.658,26				

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

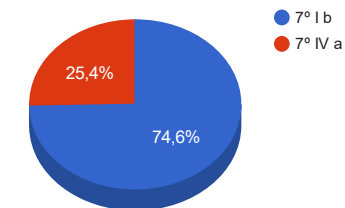
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	0,00%	27.594.220,08	74,61%	-27.594.220,08
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	0,00%	9.375.059,01	25,35%	-9.375.059,01
Total Renda Fixa	100,00%	0,00	36.969.279,09	99,96%	

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

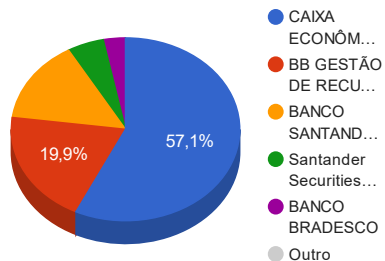


Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (setembro / 2016)

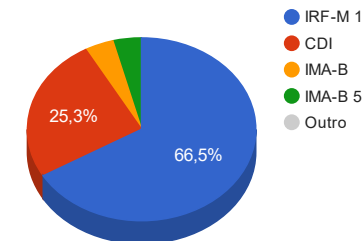
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	1,57%	22,00%	5,04%	11,16%	28,36%	35,87%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,58%	21,72%	4,97%	11,04%	27,66%	33,42%	0,20%	2,300%	7,11%
IMA-B 5	1,41%	12,92%	3,76%	7,19%	18,83%	33,03%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,40%	12,68%	3,70%	7,08%	18,43%	32,08%	0,20%	0,778%	2,72%
IRF-M 1	1,19%	11,14%	3,46%	6,82%	15,14%	28,83%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,17%	11,05%	3,42%	6,78%	14,99%	28,37%	0,20%	0,075%	0,40%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,17%	11,00%	3,39%	6,71%	15,14%	28,28%	0,20%	0,075%	0,53%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,16%	10,97%	3,39%	6,72%	14,91%	28,05%	0,10%	0,076%	0,39%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1,12%	10,84%	3,39%	6,70%	14,73%	27,83%	0,40%	0,078%	0,42%
CDI	1,11%	10,42%	3,47%	6,94%	14,13%	28,50%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO	1,11%	10,26%	3,54%	6,88%	14,00%	28,66%	0,20%	0,027%	0,17%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,10%	10,50%	3,43%	6,90%	14,12%	27,99%	0,20%	0,016%	0,14%
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	1,07%	10,18%	3,48%	6,72%	13,82%	27,59%	0,50%	0,042%	0,15%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	1,04%	9,73%	3,25%	6,49%	13,18%	26,36%	0,80%	0,000%	0,00%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	21.131.263,58	57,14%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	7.372.062,68	19,93%
BANCO SANTANDER	5.397.042,10	14,59%
Santander Securities Services	1.918.734,29	5,19%
BANCO BRADESCO	1.150.176,44	3,11%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	15.379,17	0,04%

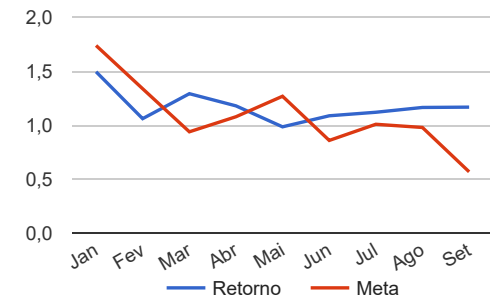
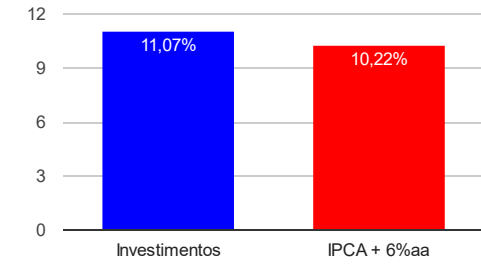


Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	24.599.530,09	66,51%
CDI	9.375.059,01	25,35%
IMA-B	1.510.386,58	4,08%
IMA-B 5	1.484.303,41	4,01%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	15.379,17	0,04%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Acumulado no Ano



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de setembro / 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	1.486.844,68	0,00	0,00	1.510.386,58	23.541,90	1,58%	2,30%	1,58%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.463.830,57	0,00	0,00	1.484.303,41	20.472,84	1,40%	0,78%	1,40%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	15.813.869,19	0,00	450.000,00	15.548.416,74	184.547,55	1,17%	0,08%	1,17%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.136.925,12	0,00	0,00	1.150.176,44	13.251,32	1,17%	0,08%	1,17%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.475.217,45	0,00	0,00	2.503.894,81	28.677,36	1,16%	0,08%	1,16%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	5.337.049,80	0,00	0,00	5.397.042,10	59.992,30	1,12%	0,08%	1,12%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO	4.814.504,06	0,00	0,00	4.868.167,87	53.663,81	1,11%	0,03%	1,11%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.136.139,25	0,00	0,00	2.159.599,47	23.460,22	1,10%	0,02%	1,10%
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	1.898.501,12	0,00	0,00	1.918.734,29	20.233,17	1,07%	0,04%	1,07%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	176.346,13	385.510,20	134.841,62	428.557,38	1.542,67	0,27%	0,00%	1,04%
Total Renda Fixa					429.383,14	1,17%	0,18%	