

Relatório Analítico dos Investimentos em dezembro, 4º Trimestre e ano de 2016



Carteira consolidada de investimentos - base (dezembro / 2016)

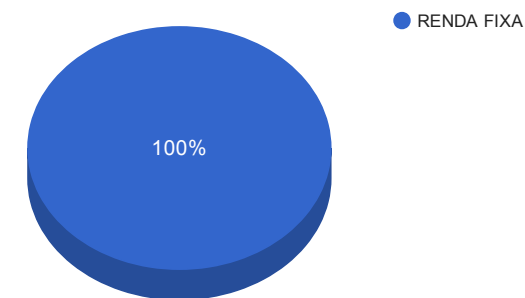
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.181.366,54	27,92%	620	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	79.454,27	1,02%	174	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.838.390,03	49,13%	713	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.713.298,20	21,93%	721	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
TOTAL -			7.812.509,04				

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

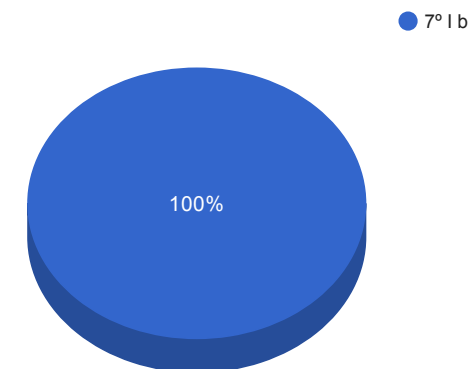
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	100,00%	7.812.509,04	100,00%	0,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	30,00%	0,00	0,00%	2.343.752,71
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	0,00	0,00%	2.343.752,71
Total Renda Fixa	100,00%	160,00	7.812.509,04	100,00%	

Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	390.625,45
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	390.625,45
Total Renda Variável	30,00%	10,00	0,00	0,00%	

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



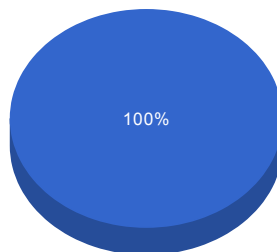
Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (dezembro / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	2,91%	24,81%	2,30%	7,46%	24,81%	35,90%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,88%	24,56%	2,33%	7,42%	24,56%	33,62%	0,20%	3,583%	7,33%
IRF-M	1,84%	23,37%	3,41%	7,88%	23,37%	32,16%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,81%	23,26%	3,41%	7,88%	23,26%	31,35%	0,20%	1,875%	3,61%
IMA-B 5	1,39%	15,48%	2,27%	6,11%	15,48%	33,33%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,38%	15,19%	2,23%	6,01%	15,19%	32,31%	0,20%	1,325%	2,60%
IDKA IPCA 2 Anos	1,28%	15,21%	2,28%	6,11%	15,21%	34,09%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,23%	14,94%	2,24%	6,02%	14,94%	32,76%	0,20%	1,023%	2,42%

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

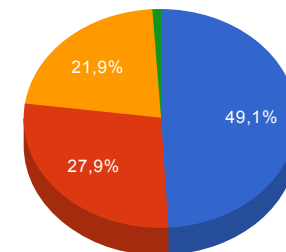
Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	7.812.509,04	100,00%

● CAIXA ECONÔMICA FEDERAL



Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5	3.838.390,03	49,13%
IDKA IPCA 2A	2.181.366,54	27,92%
IMA-B	1.713.298,20	21,93%
IRF-M	79.454,27	1,02%

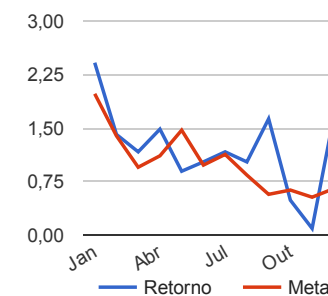
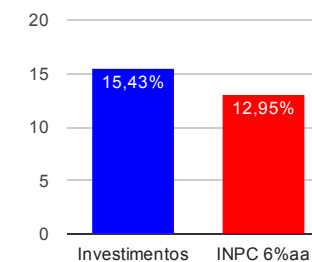
● IMA-B 5
 ● IDKA IPCA 2A
 ● IMA-B
 ● IRF-M



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	6.576.560,74	110.000,00	0,00	6.848.097,46	161.536,72	2,42%	1,98%	121,98%	1,43%
Fevereiro	6.848.097,46	250.000,00	39.105,49	7.158.497,06	99.505,09	1,41%	1,39%	101,09%	2,19%
Março	7.158.497,06	60.992,44	0,00	7.303.658,86	84.169,36	1,17%	0,95%	122,43%	1,94%
Abril	7.303.658,86	1.935.997,16	1.935.997,16	7.412.042,54	108.383,68	1,48%	1,11%	134,11%	1,08%
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Mai	7.412.042,54	0,00	0,00	7.478.308,17	66.265,63	0,89%	1,47%	60,76%	0,90%
Junho	7.478.308,17	0,00	0,00	7.554.971,18	76.663,01	1,03%	0,98%	104,35%	0,93%
Julho	7.554.971,18	0,00	0,00	7.643.044,90	88.073,72	1,17%	1,13%	103,18%	0,58%
Agosto	7.643.044,90	1.461.441,43	1.461.441,43	7.721.359,61	78.314,71	1,02%	0,84%	121,28%	0,77%
Setembro	7.721.359,61	1.500.000,00	1.695.000,00	7.652.112,19	125.752,58	1,63%	0,57%	287,16%	1,02%
Outubro	7.652.112,19	143.000,00	149.000,00	7.683.448,80	37.336,61	0,49%	0,63%	76,92%	1,06%
Novembro	7.683.448,80	0,00	0,00	7.690.509,22	7.060,42	0,09%	0,53%	17,21%	2,22%
Dezembro	7.690.509,22	0,00	6.000,00	7.812.509,04	127.999,82	1,66%	0,65%	255,78%	1,74%
Acumulado no ano					1.061.061,35	15,43%	12,95%	119,19%	

Acumulado no Ano



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de dezembro / 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	1.665.406,96	0,00	0,00	1.713.298,20	47.891,24	2,88%	3,58%	2,88%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	84.000,15	0,00	6.000,00	79.454,27	1.454,12	1,73%	1,88%	1,81%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.786.206,16	0,00	0,00	3.838.390,03	52.183,87	1,38%	1,32%	1,38%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.154.895,95	0,00	0,00	2.181.366,54	26.470,59	1,23%	1,02%	1,23%
Total Renda Fixa					127.999,82	1,66%	1,74%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre / 2016

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.903.330,19	0,00	149.000,00	3.838.390,03	84.059,84	2,22%	2,23%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.133.522,97	0,00	0,00	2.181.366,54	47.843,57	2,24%	2,24%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.532.555,16	143.000,00	0,00	1.713.298,20	37.743,04	2,25%	2,33%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	82.703,87	0,00	6.000,00	79.454,27	2.750,40	3,33%	3,41%
Total Renda Fixa					172.396,85	2,25%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no Ano de 2016

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.345.867,44	60.992,44	1.149.000,00	3.838.390,03	580.530,15	15,07%	15,19%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	3.498.206,02	1.500.000,00	2.181.366,54	183.160,52	8,85%	14,94%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	604.075,70	1.643.000,00	676.764,59	1.713.298,20	142.987,09	17,04%	24,56%
CAIXA BRASIL 2016 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.377.673,89	0,00	1.500.546,92	0,00	122.873,03	9,10%	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	259.232,57	201.000,00	79.454,27	21.221,70	10,69%	23,26%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	248.943,71	0,00	259.232,57	0,00	10.288,86	4,13%	14,00%
Total Renda Fixa					1.061.061,35	15,43%	