

Relatório Analítico dos Investimentos em dezembro, 4º Trimestre e ano de 2015



Carteira consolidada de investimentos - base (dezembro / 2015)

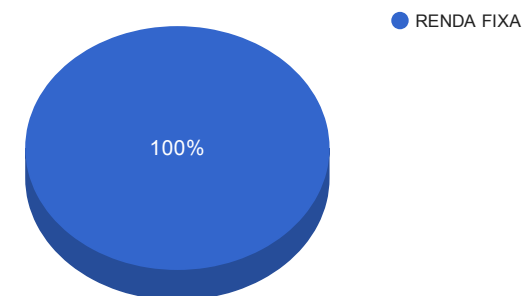
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	604.075,70	9,19%	643	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2016 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2016	1.377.673,89	20,95%	104	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.345.867,44	66,08%	631	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	248.943,71	3,79%	746	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TOTAL -			6.576.560,74				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (dezembro / 2015)

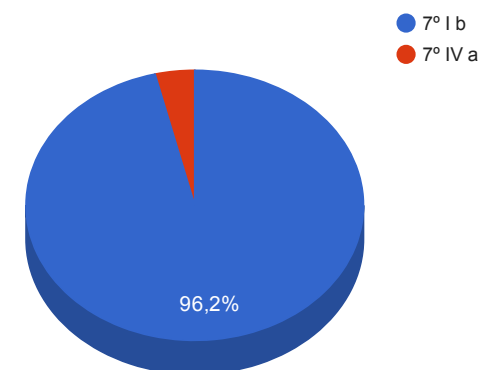
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	100,00%	6.327.617,03	96,21%	248.943,71
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	20,00%	0,00	0,00%	1.315.312,15
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	248.943,71	3,79%	1.724.024,51
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	10,00%	0,00	0,00%	657.656,07
Total Renda Fixa	100,00%	160,00	6.576.560,74	100,00%	

Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	10,00%	0,00	0,00%	657.656,07
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	0,00	0,00%	986.484,11
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	328.828,04
Total Renda Variável	30,00%	30,00	0,00	0,00%	

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



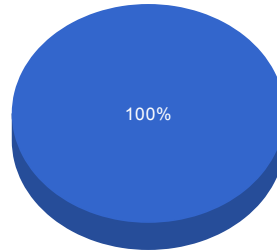
Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (dezembro / 2015)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses	
IMA-B 5	2,12%	15,46%	5,23%	7,45%	15,46%		-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,04%	14,86%	5,10%	7,14%	14,86%	28,00%	0,20%	0,798%	3,20%
IMA-B	1,52%	8,88%	5,21%	0,50%	8,88%		-	-	-
CAIXA BRASIL 2016 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,67%	-	4,75%	5,41%	-	-	0,20%	0,225%	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,46%	7,27%	4,88%	-0,64%	7,27%	22,63%	0,20%	1,406%	9,24%
CDI	1,16%	13,24%	3,36%	6,91%	13,24%		-	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,16%	13,32%	3,36%	6,95%	13,32%	25,65%	0,20%	0,010%	0,08%

Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (dezembro / 2015)

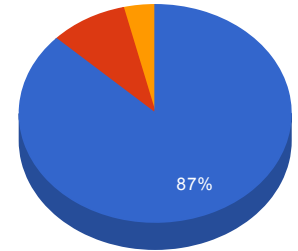
Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	6.576.560,74	100,00%

● CAIXA ECONÔMICA FEDERAL



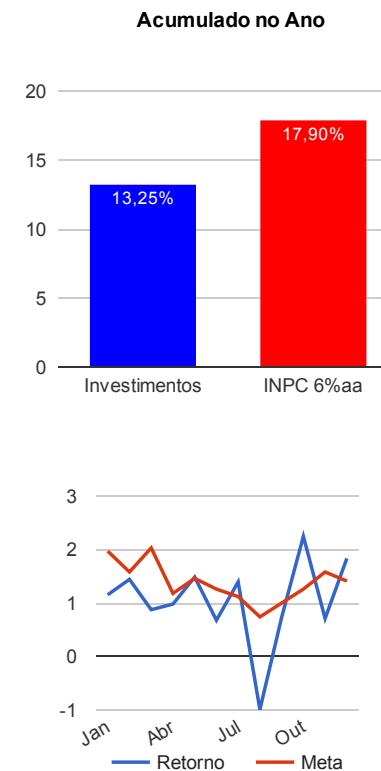
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5	5.723.541,33	87,03%
IMA-B	604.075,70	9,19%
CDI	248.943,71	3,79%

● IMA-B 5
 ● IMA-B
 ● CDI



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2015

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	5.453.977,64	408.117,86	93.250,90	5.835.379,77	66.535,17	1,15%	1,97%	58,43%	1,23%
Fevereiro	5.835.379,77	68.091,00	0,00	5.988.646,30	85.175,53	1,44%	1,58%	91,21%	1,46%
Março	5.988.646,30	165.000,00	100.000,00	6.106.588,78	52.942,48	0,87%	2,03%	43,13%	1,11%
Abril	6.106.588,78	30.000,00	346.125,44	5.850.323,28	59.859,94	0,98%	1,18%	83,30%	0,85%
Mai	5.850.323,28	633.625,44	232.000,00	6.344.819,75	92.871,03	1,49%	1,46%	101,88%	1,15%
Junho	6.344.819,75	1.306.724,00	1.290.313,61	6.404.359,16	43.129,02	0,68%	1,26%	53,79%	0,94%
Julho	6.404.359,16	64.417,86	0,00	6.558.951,92	90.174,90	1,39%	1,12%	124,87%	1,48%
Agosto	6.558.951,92	45.000,00	0,00	6.538.450,96	-65.500,96	-0,99%	0,74%	-134,40%	2,27%
Setembro	6.538.450,96	0,00	81.000,00	6.505.231,42	47.780,46	0,73%	1,00%	73,13%	3,09%
Outubro	6.505.231,42	0,00	0,00	6.651.351,95	146.120,53	2,25%	1,26%	178,20%	1,65%
Novembro	6.651.351,95	0,00	0,00	6.698.627,76	47.275,81	0,71%	1,58%	45,02%	1,48%
Dezembro	6.698.627,76	0,00	245.000,00	6.576.560,74	122.932,98	1,84%	1,41%	129,73%	0,70%
Acumulado no ano					789.296,89	13,25%	17,90%	74,01%	
Acumulado no 4º Trimestre					316.329,32	4,86%	4,31%	112,72%	



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de dezembro / 2015

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.258.832,66	0,00	0,00	4.345.867,44	87.034,78	2,04%	0,80%	2,04%
CAIXA BRASIL 2016 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.355.058,41	0,00	0,00	1.377.673,89	22.615,48	1,67%	0,22%	1,67%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	595.384,03	0,00	0,00	604.075,70	8.691,67	1,46%	1,41%	1,46%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	489.352,66	0,00	245.000,00	248.943,71	4.591,05	0,94%	0,01%	1,16%
Total Renda Fixa					122.932,98	1,84%	0,70%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre / 2015

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	4.135.123,31	0,00	0,00	4.345.867,44	210.744,13	5,10%	5,10%
CAIXA BRASIL 2016 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.315.236,00	0,00	0,00	1.377.673,89	62.437,89	4,75%	4,75%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	575.941,96	0,00	0,00	604.075,70	28.133,74	4,88%	4,88%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	478.930,15	0,00	245.000,00	248.943,71	15.013,56	3,13%	3,36%
Total Renda Fixa					316.329,32	4,86%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no Ano de 2015

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	3.696.696,53	88.117,86	0,00	4.345.867,44	561.053,05	14,82%	14,86%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.441.160,23	0,00	1.515.313,61	0,00	74.153,38	5,27%	12,76%
CAIXA BRASIL 2016 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	1.306.724,00	0,00	1.377.673,89	70.949,89	5,43%	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	725.008,86	526.250,90	248.943,71	50.185,75	11,43%	13,32%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	601.125,44	0,00	604.075,70	2.950,26	0,49%	7,27%
				Total Renda Fixa	759.292,33	12,95%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no Ano de 2015

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	316.120,88	0,00	346.125,44	0,00	30.004,56	9,49%	-14,35%
			Total Renda Variável		30.004,56	9,49%	