

Relatório Analítico dos Investimentos em janeiro de 2016



Carteira consolidada de investimentos - base (janeiro / 2016)

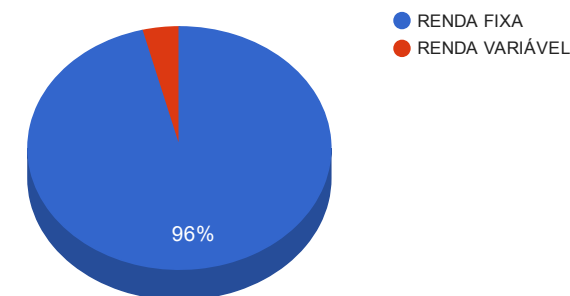
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.676.410,41	7,72%	641	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	7.949.009,71	9,19%	365	0,64%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.252.296,44	2,60%	507	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	370.663,78	0,43%	1.158	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	3.224.298,27	3,73%	665	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	10.950.948,55	12,66%	193	0,48%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.041.950,44	1,20%	1.287	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	15.044.178,88	17,40%	50	8,77%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	7.793.485,98	9,01%	217	0,65%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.937.994,40	2,24%	82	0,19%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2030	4.874.618,95	5,64%	34	2,64%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO PREMIUM FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	9.071.097,25	10,49%	388	0,14%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.329,12	0,00%	583	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	8.462.919,95	9,79%	116	1,81%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IPCA XI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	14/06/2016	3.393.279,00	3,92%	24	3,07%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IPCA VI FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+0	08/11/2016	3.440.389,61	3,98%	17	3,83%	Artigo 8º, Inciso IV
		TOTAL -	86.484.870,74				

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

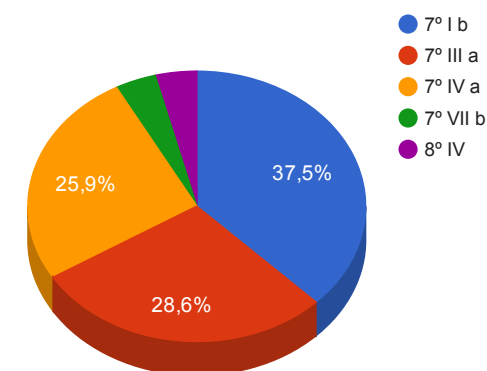
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	50,00%	32.465.577,60	37,54%	10.776.857,77
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	40,00%	24.775.659,26	28,65%	9.818.289,04
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	22.409.965,27	25,91%	3.535.495,95
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	4.324.243,54
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	4.324.243,54
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	3.393.279,00	3,92%	930.964,54
Total Renda Fixa	100,00%	135,00	83.044.481,13	96,02%	

Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	10,00%	0,00	0,00%	8.648.487,07
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	3.440.389,61	3,98%	883.853,93
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	3,00%	0,00	0,00%	2.594.546,12
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	3,00%	0,00	0,00%	2.594.546,12
Total Renda Variável	30,00%	21,00	3.440.389,61	3,98%	

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDKA IPCA 2 Anos	3,76%	3,76%	5,94%	9,76%	18,43%	36,00%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,02%	3,02%	5,53%	8,92%	16,60%	33,43%	0,20%	1,787%	3,03%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,87%	2,87%	5,42%	8,88%	16,63%	33,70%	0,20%	1,673%	2,93%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,81%	1,81%	4,47%	8,57%	-	-	0,20%	0,717%	-

IMA-B 5	2,97%	2,97%	5,73%	8,70%	16,49%	33,78%	-	-	-
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	2,97%	2,97%	5,72%	8,09%	15,60%	-	0,20%	1,723%	3,50%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	2,96%	2,96%	5,67%	8,62%	16,29%	33,31%	0,10%	1,699%	3,31%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2,95%	2,95%	5,63%	8,43%	15,94%	33,11%	0,20%	1,702%	3,31%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,91%	2,91%	5,59%	8,36%	15,89%	32,79%	0,20%	1,694%	3,34%

IMA-B	1,91%	1,91%	4,53%	3,17%	7,61%	30,43%	-	-	-
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	1,76%	1,76%	4,29%	2,73%	7,25%	29,64%	0,20%	2,132%	9,12%

IPCA + 6,00% ao ano	1,74%	1,74%	4,77%	7,99%	17,27%	33,18%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,51%	1,51%	4,55%	4,63%	10,86%	-	0,20%	0,116%	4,12%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,47%	1,47%	4,48%	7,61%	17,26%	-	0,20%	0,111%	0,33%
CAIXA BRASIL IPCA XI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,39%	1,39%	4,31%	7,34%	16,37%	30,77%	0,20%	0,145%	0,41%

IRF-M 1	1,64%	1,64%	3,94%	7,40%	13,65%	26,52%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,62%	1,62%	3,87%	7,21%	13,28%	25,64%	0,10%	0,343%	0,57%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,62%	1,62%	3,89%	7,30%	13,40%	26,01%	0,20%	0,346%	0,55%
Selic	1,06%	1,06%	3,31%	6,78%	13,40%	25,88%	-	-	-
BRDESCO PREMIUM FI REFERENCIADO DI	1,05%	1,05%	3,30%	6,79%	13,48%	26,11%	0,20%	0,005%	0,04%
CDI	1,05%	1,05%	3,31%	6,78%	13,38%	25,75%	-	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,98%	0,98%	3,10%	6,34%	12,51%	23,84%	1,00%	0,010%	0,04%

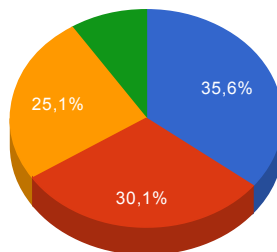
Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (janeiro / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA + 6,00% ao ano	1,74%	1,74%	4,77%	7,99%	17,27%	33,18%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA VI FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1,39%	1,39%	4,31%	7,12%	16,99%	30,27%	0,20%	0,021%	0,32%

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

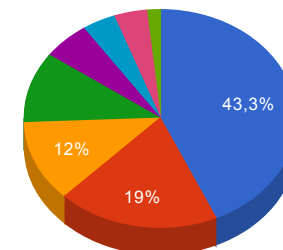
Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	30.803.645,65	35,62%
BANCO BRADESCO	26.053.270,53	30,12%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	21.678.944,85	25,07%
BANCO SANTANDER	7.949.009,71	9,19%

- BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM
- BANCO BRADESCO
- CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
- BANCO SANTANDER



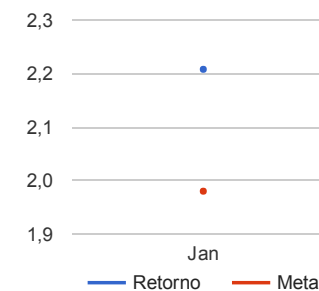
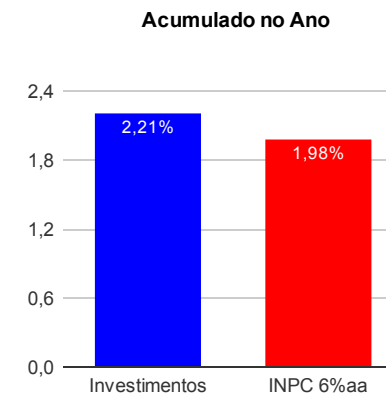
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5	37.463.084,98	43,32%
IDKA IPCA 2A	16.427.543,26	18,99%
IMA-B	10.400.914,35	12,03%
CDI	9.072.426,37	10,49%
IMA-B 5+	4.874.618,95	5,64%
MULTIMERCADO	3.440.389,61	3,98%
CRÉDITO PRIVADO	3.393.279,00	3,92%
IRF-M 1	1.412.614,22	1,63%

- IMA-B 5
- IDKA IPCA 2A
- IMA-B
- CDI
- IMA-B 5+
- MULTIMERCADO
- CRÉDITO PRIVADO
- IRF-M 1



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	85.161.209,79	35.511,76	592.117,36	86.484.870,74	1.880.266,55	2,21%	1,98%	111,48%	1,02%
Acumulado no ano					1.880.266,55	2,21%	1,98%	111,48%	



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de janeiro / 2016

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.129.847,07	0,00	0,00	3.224.298,27	94.451,20	3,02%	1,79%	3,02%
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	15.090.384,95	0,00	495.289,46	15.044.178,88	449.083,39	2,98%	1,72%	2,97%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	7.720.784,97	0,00	0,00	7.949.009,71	228.224,74	2,96%	1,70%	2,96%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	7.570.381,32	0,00	0,00	7.793.485,98	223.104,66	2,95%	1,70%	2,95%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.487.535,90	0,00	0,00	6.676.410,41	188.874,51	2,91%	1,69%	2,91%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.189.462,57	0,00	0,00	2.252.296,44	62.833,87	2,87%	1,67%	2,87%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.756.629,79	0,00	0,00	10.950.948,55	194.318,76	1,81%	0,72%	1,81%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	2.000.428,14	0,00	96.827,90	1.937.994,40	34.394,16	1,72%	2,13%	1,76%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	364.739,76	0,00	0,00	370.663,78	5.924,02	1,62%	0,34%	1,62%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.025.302,51	0,00	0,00	1.041.950,44	16.647,93	1,62%	0,35%	1,62%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.802.280,82	0,00	0,00	4.874.618,95	72.338,13	1,51%	0,12%	1,51%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.340.462,06	0,00	0,00	8.462.919,95	122.457,89	1,47%	0,11%	1,47%
CAIXA BRASIL IPCA XI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	3.346.875,00	0,00	0,00	3.393.279,00	46.404,00	1,39%	0,14%	1,39%
BRDESCO PREMIUM FI REFERENCIADO DI	8.941.576,01	35.511,76	0,00	9.071.097,25	94.009,48	1,05%	0,00%	1,05%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.316,19	0,00	0,00	1.329,12	12,93	0,98%	0,01%	0,98%
Total Renda Fixa					1.833.079,67	2,24%	1,06%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de janeiro / 2016

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IPCA VI FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	3.393.202,73	0,00	0,00	3.440.389,61	47.186,88	1,39%	0,02%	1,39%
				Total Renda Variável	47.186,88	1,39%	0,02%	

