

# Relatório Analítico dos Investimentos em abril de 2016



Carteira consolidada de investimentos - base (abril / 2016)

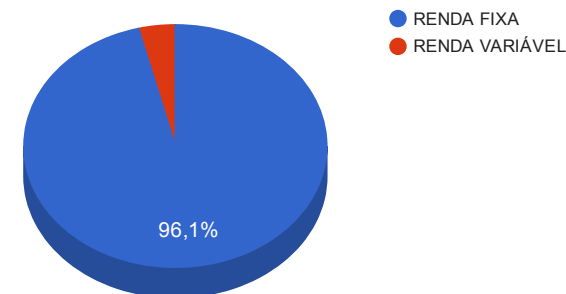
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.479.125,49	2,71%	567	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	8.253.889,53	9,02%	305	0,60%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.903.548,16	4,27%	672	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	4.117.039,69	4,50%	1.326	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	10.934.154,19	11,95%	193	0,48%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.905.267,66	3,18%	1.174	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	8.258.042,00	9,03%	723	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	2.017.563,80	2,21%	259	0,12%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	16.401.568,02	17,93%	88	1,62%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2030	4.914.740,00	5,37%	34	2,64%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	8.527.091,06	9,32%	116	1,81%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO PREMIUM FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	8.112.050,98	8,87%	387	0,13%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.552.913,56	3,88%	844	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.367,89	0,00%	577	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IPCA XI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	14/06/2016	3.514.559,40	3,84%	24	3,07%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IPCA VI FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+0	08/11/2016	3.588.029,70	3,92%	17	3,83%	Artigo 8º, Inciso IV
		<b>TOTAL -</b>	<b>91.480.951,13</b>				

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

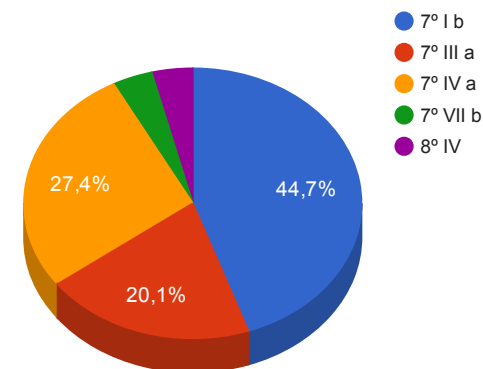
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	50,00%	40.851.066,72	44,66%	4.889.408,85
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	40,00%	18.419.131,82	20,13%	18.173.248,63
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	25.108.163,49	27,45%	2.336.121,85
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	4.574.047,56
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	4.574.047,56
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	3.514.559,40	3,84%	1.059.488,16
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>135,00</b>	<b>87.892.921,43</b>	<b>96,08%</b>	

Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	10,00%	0,00	0,00%	9.148.095,11
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	3.588.029,70	3,92%	986.017,86
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	3,00%	0,00	0,00%	2.744.428,53
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	3,00%	0,00	0,00%	2.744.428,53
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>21,00</b>	<b>3.588.029,70</b>	<b>3,92%</b>	

**Distribuição por Segmento**



**Distribuição por Artigo / Resolução**



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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDKA IPCA 2 Anos	1,66%	6,90%	3,03%	9,15%	18,82%	33,12%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,66%	6,67%	3,55%	9,28%	17,85%	31,37%	0,20%	1,232%	3,20%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,62%	6,62%	3,65%	9,26%	17,94%	31,77%	0,20%	1,222%	3,10%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,88%	4,61%	2,76%	7,35%	-	-	0,20%	0,353%	-
IMA-B 5	1,54%	6,97%	3,88%	9,83%	17,80%	32,16%	-	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,55%	6,92%	3,86%	9,71%	17,40%	31,12%	0,20%	1,248%	3,51%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,53%	6,84%	3,82%	9,63%	17,30%	31,22%	0,20%	1,247%	3,52%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	1,52%	6,90%	3,84%	9,72%	17,62%	31,70%	0,10%	1,241%	3,51%
IPCA + 6,00% ao ano	1,08%	5,20%	3,40%	8,33%	15,78%	32,79%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,92%	5,01%	3,57%	8,04%	15,14%	31,98%	0,20%	0,061%	0,38%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,92%	2,34%	0,82%	5,41%	9,48%	18,60%	0,20%	0,068%	4,10%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,91%	5,28%	3,76%	8,41%	16,04%	32,89%	0,20%	0,062%	0,34%
IRF-M 1	1,07%	5,15%	3,45%	7,53%	14,67%	27,38%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,11%	5,15%	3,47%	7,48%	14,38%	26,61%	0,10%	0,179%	0,52%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,11%	5,15%	3,47%	7,49%	14,50%	26,91%	0,20%	0,173%	0,50%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1,07%	5,14%	3,43%	7,43%	14,36%	26,94%	0,20%	0,183%	0,78%
Selic	1,06%	4,35%	3,26%	6,67%	13,86%	26,93%	-	-	-

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BRDESCO PREMIUM FI REFERENCIADO DI	1,04%	4,30%	3,22%	6,63%	13,86%	27,10%	0,20%	0,003%	0,02%
CDI	1,05%	4,34%	3,25%	6,67%	13,85%	26,83%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,98%	4,18%	3,09%	6,52%	13,83%	27,05%	0,20%	0,027%	0,05%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,92%	3,93%	2,92%	6,11%	12,80%	24,72%	1,00%	0,031%	0,04%

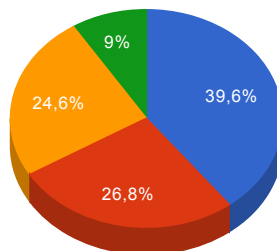
Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (abril / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA + 6,00% ao ano	1,08%	5,20%	3,40%	8,33%	15,78%	32,79%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA VI FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	0,88%	5,74%	4,29%	8,79%	15,95%	32,89%	0,20%	0,017%	0,34%

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

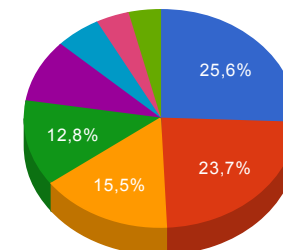
Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	36.196.400,16	39,57%
BANCO BRADESCO	24.513.619,00	26,80%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	22.517.042,44	24,61%
BANCO SANTANDER	8.253.889,53	9,02%

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



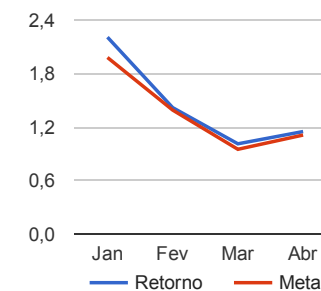
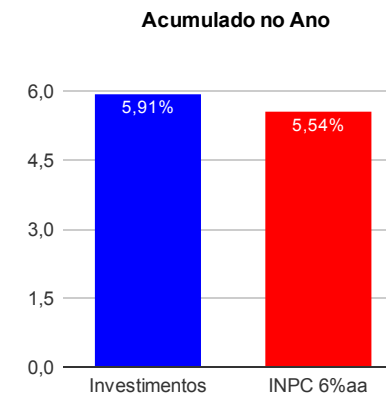
Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	23.423.875,37	25,61%
IDKA IPCA 2A	21.671.321,68	23,69%
IMA-B 5	14.175.001,49	15,50%
CDI	11.666.332,43	12,75%
IMA-B	8.527.091,06	9,32%
IMA-B 5+	4.914.740,00	5,37%
MULTIMERCADO	3.588.029,70	3,92%
CRÉDITO PRIVADO	3.514.559,40	3,84%

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



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%
Fevereiro	86.484.870,74	3.639.002,55	3.229.408,41	88.126.166,16	1.231.701,28	1,42%	1,39%	101,65%	1,15%
Março	88.126.166,16	25.268.944,51	24.472.426,08	89.822.194,38	899.509,79	1,01%	0,95%	106,23%	0,64%
Abril	89.822.194,38	3.782.263,41	3.162.842,39	91.480.951,13	1.039.335,73	1,15%	1,11%	103,86%	0,44%
Acumulado no ano					5.050.813,35	5,91%	5,54%	106,61%	





Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de abril / 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	8.123.282,28	0,00	0,00	8.258.042,00	134.759,72	1,66%	1,23%	1,66%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.439.668,85	0,00	0,00	2.479.125,49	39.456,64	1,62%	1,22%	1,62%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.986.781,74	0,00	0,00	2.017.563,80	30.782,06	1,55%	1,25%	1,55%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.844.848,90	0,00	0,00	3.903.548,16	58.699,26	1,53%	1,25%	1,53%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	8.129.996,42	0,00	0,00	8.253.889,53	123.893,11	1,52%	1,24%	1,52%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.072.019,17	0,00	0,00	4.117.039,69	45.020,52	1,11%	0,17%	1,11%
BRDESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	14.989.507,79	1.241.517,75	0,00	16.401.568,02	170.542,48	1,05%	0,18%	1,07%
BRDESCO PREMIUM FI REFERENCIADO DI	8.645.156,06	40.745,66	662.842,39	8.112.050,98	88.991,65	1,02%	0,00%	1,04%
CAIXA BRASIL IPCA XI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	3.482.352,00	0,00	0,00	3.514.559,40	32.207,40	0,92%	0,06%	0,92%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.355,38	0,00	0,00	1.367,89	12,51	0,92%	0,03%	0,92%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.869.870,11	0,00	0,00	4.914.740,00	44.869,89	0,92%	0,07%	0,92%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.450.182,39	0,00	0,00	8.527.091,06	76.908,67	0,91%	0,06%	0,91%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	379.283,69	2.500.000,00	0,00	2.905.267,66	25.983,97	0,90%	0,18%	1,11%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.839.016,40	0,00	0,00	10.934.154,19	95.137,79	0,88%	0,35%	0,88%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.012.158,14	0,00	2.500.000,00	3.552.913,56	40.755,42	0,68%	0,03%	0,98%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>1.008.021,09</b>	<b>1,16%</b>	<b>0,46%</b>	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de abril / 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	3.556.715,06	0,00	0,00	3.588.029,70	31.314,64	0,88%	0,02%	0,88%
				Total Renda Variável	31.314,64	0,75%	0,02%	

