

Relatório Analítico dos Investimentos em fevereiro de 2016



Carteira consolidada de investimentos - base (fevereiro / 2016)

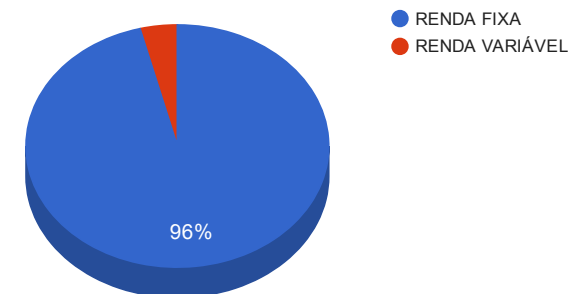
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.777.405,01	7,69%	654	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	8.069.912,63	9,16%	375	0,63%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.283.197,74	2,59%	544	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	6.918.294,63	7,85%	690	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	10.749.118,09	12,20%	193	0,48%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	374.737,21	0,43%	1.164	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.053.417,48	1,20%	1.306	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	14.773.490,71	16,76%	57	6,60%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	7.911.715,76	8,98%	237	0,56%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2030	4.812.565,27	5,46%	34	2,64%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.341,25	0,00%	578	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO PREMIUM FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	9.102.321,09	10,33%	387	0,14%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	8.350.975,29	9,48%	116	1,81%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IPCA XI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	14/06/2016	3.444.876,00	3,91%	24	3,07%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IPCA VI FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+0	08/11/2016	3.502.798,00	3,97%	17	3,83%	Artigo 8º, Inciso IV
TOTAL -			88.126.166,16				

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

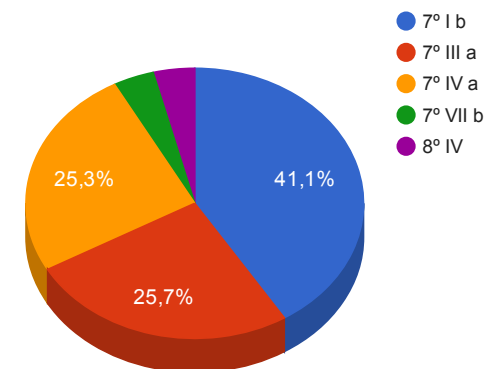
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	50,00%	36.226.082,79	41,11%	7.837.000,29
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	40,00%	22.685.206,47	25,74%	12.565.259,99
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	22.267.202,90	25,27%	4.170.646,95
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	4.406.308,31
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	4.406.308,31
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	3.444.876,00	3,91%	961.432,31
Total Renda Fixa	100,00%	135,00	84.623.368,16	96,03%	

Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	10,00%	0,00	0,00%	8.812.616,62
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	3.502.798,00	3,97%	903.510,31
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	3,00%	0,00	0,00%	2.643.784,98
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	3,00%	0,00	0,00%	2.643.784,98
Total Renda Variável	30,00%	21,00	3.502.798,00	3,97%	

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5	1,54%	4,55%	6,77%	10,89%	16,86%	32,06%	-	-	-
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	1,52%	4,52%	6,71%	10,81%	16,65%	31,60%	0,10%	1,454%	3,33%
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	1,52%	4,54%	6,76%	10,57%	16,09%	-	0,20%	1,455%	3,50%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,52%	4,51%	6,67%	10,65%	16,38%	30,90%	0,20%	1,445%	3,33%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,51%	4,47%	6,60%	10,56%	16,32%	31,08%	0,20%	1,440%	3,36%
IPCA + 6,00% ao ano	1,34%	3,11%	4,63%	8,67%	16,92%	33,42%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,62%	3,11%	4,80%	8,36%	17,43%	33,53%	0,20%	0,270%	0,37%
CAIXA BRASIL IPCA XI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,52%	2,93%	4,55%	8,07%	16,53%	32,57%	0,20%	0,245%	0,43%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,27%	0,21%	1,88%	5,39%	11,07%	19,23%	0,20%	5,021%	4,11%
IDKA IPCA 2 Anos	1,20%	5,00%	6,99%	11,37%	18,46%	33,63%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,37%	4,28%	6,33%	10,71%	16,83%	31,71%	0,20%	1,371%	2,93%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,33%	4,38%	6,45%	10,78%	16,74%	31,36%	0,20%	1,412%	3,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,02%	2,84%	4,62%	9,32%	-	-	0,20%	0,576%	-
IRF-M 1	1,09%	2,75%	3,97%	7,47%	14,04%	26,55%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,10%	2,74%	3,94%	7,40%	13,84%	26,05%	0,20%	0,179%	0,54%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,10%	2,74%	3,93%	7,33%	13,72%	25,72%	0,10%	0,180%	0,56%
Selic	1,00%	2,07%	3,26%	6,67%	13,61%	26,14%	-	-	-

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BRDESCO PREMIUM FI REFERENCIADO DI	0,99%	2,05%	3,24%	6,67%	13,65%	26,36%	0,20%	0,006%	0,03%
CDI	1,00%	2,07%	3,25%	6,67%	13,59%	26,03%	-	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,91%	1,90%	3,01%	6,21%	12,67%	24,07%	1,00%	0,012%	0,04%

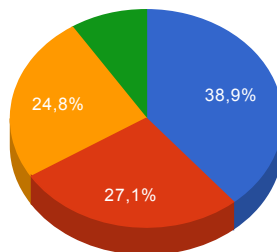
Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (fevereiro / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA + 6,00% ao ano	1,34%	3,11%	4,63%	8,67%	16,92%	33,42%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA VI FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1,81%	3,23%	4,81%	7,86%	17,24%	32,99%	0,20%	0,131%	0,34%

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

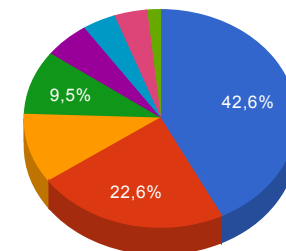
Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	34.306.182,23	38,93%
BANCO BRADESCO	23.875.811,80	27,09%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	21.874.259,50	24,82%
BANCO SANTANDER	8.069.912,63	9,16%

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



Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5	37.532.524,11	42,59%
IDKA IPCA 2A	19.950.610,46	22,64%
CDI	9.103.662,34	10,33%
IMA-B	8.350.975,29	9,48%
IMA-B 5+	4.812.565,27	5,46%
MULTIMERCADO	3.502.798,00	3,97%
CRÉDITO PRIVADO	3.444.876,00	3,91%
IRF-M 1	1.428.154,69	1,62%

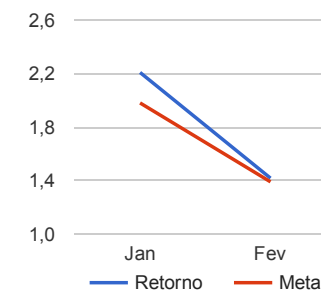
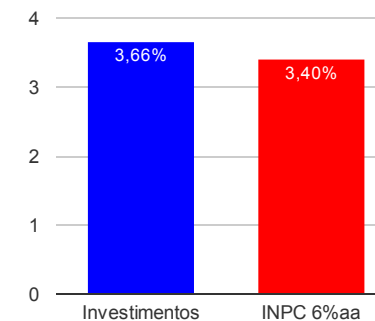
- IMA-B 5
- IDKA IPCA 2A
- CDI
- IMA-B
- IMA-B 5+
- MULTIMERCADO
- CRÉDITO PRIVADO
- IRF-M 1



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%
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%
Acumulado no ano					3.111.967,83	3,66%	3,40%	107,47%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	1.937.994,40	0,00	1.970.371,64	0,00	32.377,24	1,67%	3,10%	2,17%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.874.618,95	0,00	141.971,55	4.812.565,27	79.917,87	1,64%	5,02%	-1,27%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.462.919,95	0,00	247.090,13	8.350.975,29	135.145,47	1,60%	0,27%	1,62%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	7.949.009,71	0,00	0,00	8.069.912,63	120.902,92	1,52%	1,45%	1,52%
CAIXA BRASIL IPCA XI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	3.393.279,00	0,00	0,00	3.444.876,00	51.597,00	1,52%	0,24%	1,52%
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	15.044.178,88	0,00	499.250,14	14.773.490,71	228.561,97	1,52%	1,46%	1,52%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	7.793.485,98	0,00	0,00	7.911.715,76	118.229,78	1,52%	1,44%	1,52%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.676.410,41	0,00	0,00	6.777.405,01	100.994,60	1,51%	1,44%	1,51%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.252.296,44	0,00	0,00	2.283.197,74	30.901,30	1,37%	1,37%	1,37%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.041.950,44	0,00	0,00	1.053.417,48	11.467,04	1,10%	0,18%	1,10%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	370.663,78	0,00	0,00	374.737,21	4.073,43	1,10%	0,18%	1,10%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.950.948,55	0,00	312.124,81	10.749.118,09	110.294,35	1,01%	0,58%	1,02%
BRDESCO PREMIUM FI REFERENCIADO DI	9.071.097,25	0,00	58.600,14	9.102.321,09	89.823,98	0,99%	0,01%	0,99%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.329,12	0,00	0,00	1.341,25	12,13	0,91%	0,01%	0,91%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.224.298,27	3.639.002,55	0,00	6.918.294,63	54.993,81	0,80%	1,41%	1,33%
Total Renda Fixa					1.169.292,89	1,40%	1,19%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de fevereiro / 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	3.440.389,61	0,00	0,00	3.502.798,00	62.408,39	1,81%	0,13%	1,81%
Total Renda Variável					62.408,39	1,62%	0,13%	

