

Relatório Analítico dos Investimentos em fevereiro de 2016



Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

Carteira consolidada de investimentos - base (fevereiro / 2016)

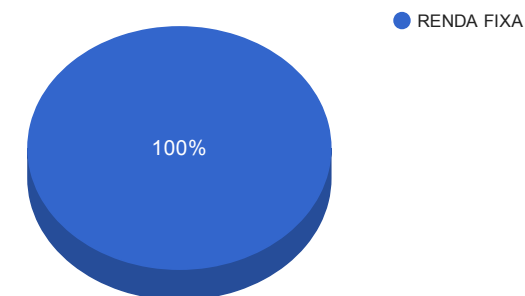
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.143.481,78	4,23%	544	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2016	1.040.572,00	3,85%	85	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.983.693,77	11,03%	1.164	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.109.728,55	18,89%	654	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.888.765,33	21,77%	1.306	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.074.977,40	7,67%	539	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	893.368,22	3,30%	89	0,09%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.628.105,72	6,02%	758	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO PREMIUM FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	4.072.420,48	15,06%	387	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER CORPORATE FIC REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.311.756,22	4,85%	1.382	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IPCA XIII FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	01/08/2016	899.616,71	3,33%	49	0,87%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
TOTAL -			27.046.486,18				

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

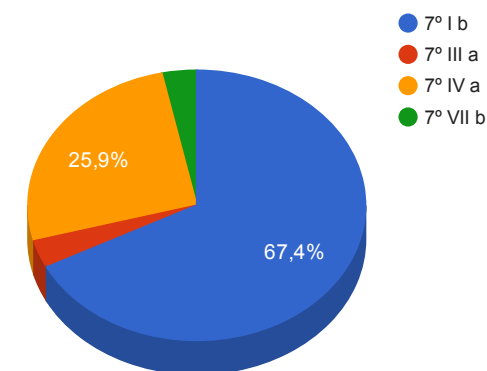
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	90,00%	18.241.218,83	67,44%	6.100.618,73
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	40,00%	893.368,22	3,30%	9.925.226,25
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	7.012.282,42	25,93%	1.101.663,43
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.352.324,31
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.352.324,31
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	899.616,71	3,33%	452.707,60
Total Renda Fixa	100,00%	175,00	27.046.486,18	100,00%	

Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	3,00%	0,00	0,00%	811.394,59
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.352.324,31
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	2,00%	0,00	0,00%	540.929,72
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 (fevereiro / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA	9,00%	2,18%	3,16%	5,63%	10,36%	18,86%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XIII FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,48%	2,89%	4,41%	7,59%	16,39%	32,23%	0,20%	0,109%	0,27%
IMA-B	2,26%	4,22%	5,80%	8,90%	9,45%	27,71%	-	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,24%	4,10%	5,64%	8,58%	9,05%	26,81%	0,20%	3,102%	9,02%
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,84%	-0,30%	1,36%	6,00%	-	-	0,20%	4,878%	-
IMA-B 5	1,54%	4,55%	6,77%	10,89%	16,86%	32,06%	-	-	-
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%
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%
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%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1,06%	2,72%	3,91%	7,26%	13,91%	26,00%	0,20%	0,183%	0,81%
Selic	1,00%	2,07%	3,26%	6,67%	13,61%	26,14%	-	-	-
BRADESCO 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%	-	-	-
CAIXA BRASIL FI REFERENCIADO DI LP	0,99%	2,05%	3,23%	6,66%	13,63%	26,17%	0,20%	0,008%	0,07%

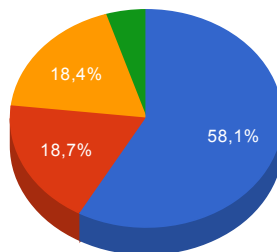
Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (fevereiro / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
SANTANDER CORPORATE FIC REFERENCIADO DI	0,98%	2,04%	3,23%	6,66%	13,67%	26,30%	0,20%	0,009%	0,04%

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

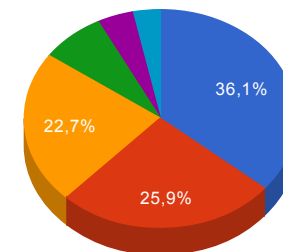
Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	15.710.270,09	58,09%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	5.058.671,17	18,70%
BANCO BRADESCO	4.965.788,70	18,36%
BANCO SANTANDER	1.311.756,22	4,85%

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



Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	9.765.827,32	36,11%
CDI	7.012.282,42	25,93%
IMA-B 5	6.150.300,55	22,74%
IMA-B	2.074.977,40	7,67%
IDKA IPCA 2A	1.143.481,78	4,23%
CRÉDITO PRIVADO	899.616,71	3,33%

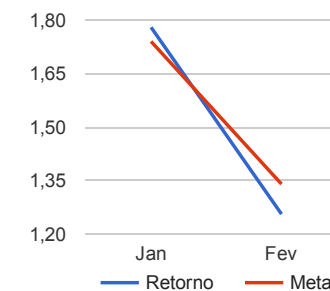
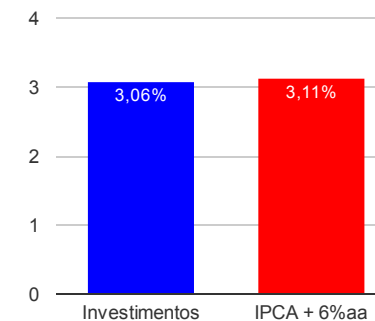
- IRF-M 1
- CDI
- IMA-B 5
- IMA-B
- IDKA IPCA 2A
- CRÉDITO PRIVADO



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	25.552.981,25	854.529,73	325.438,64	26.546.247,99	464.175,65	1,78%	1,74%	102,31%	0,70%
Fevereiro	26.546.247,99	404.290,46	239.479,60	27.046.486,18	335.427,33	1,26%	1,34%	93,42%	0,83%
Acumulado no ano					799.602,98	3,06%	3,11%	98,41%	

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(%)
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.029.607,64	0,00	0,00	2.074.977,40	45.369,76	2,24%	3,10%	2,24%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.033.585,09	0,00	0,00	5.109.728,55	76.143,46	1,51%	1,44%	1,51%
CAIXA BRASIL IPCA XIII FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	886.478,19	0,00	0,00	899.616,71	13.138,52	1,48%	0,11%	1,48%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.128.005,65	0,00	0,00	1.143.481,78	15.476,13	1,37%	1,37%	1,37%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.867.842,35	90.000,00	6.300,00	2.983.693,77	32.151,42	1,09%	0,18%	1,10%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.713.135,24	314.290,46	203.485,92	5.888.765,33	64.825,55	1,08%	0,18%	1,10%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	884.003,52	0,00	0,00	893.368,22	9.364,70	1,06%	0,18%	1,06%
CAIXA BRASIL FI REFERENCIADO DI LP	1.612.088,86	0,00	0,00	1.628.105,72	16.016,86	0,99%	0,01%	0,99%
BRADESCO PREMIUM FI REFERENCIADO DI	4.032.368,70	0,00	0,00	4.072.420,48	40.051,78	0,99%	0,01%	0,99%
SANTANDER CORPORATE FIC REFERENCIADO DI	1.299.004,75	0,00	0,00	1.311.756,22	12.751,47	0,98%	0,01%	0,98%
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.060.128,00	0,00	29.693,68	1.040.572,00	10.137,68	0,96%	4,88%	-1,84%
Total Renda Fixa					335.427,33	1,26%	0,83%	

