

Relatório Analítico dos Investimentos em abril de 2016



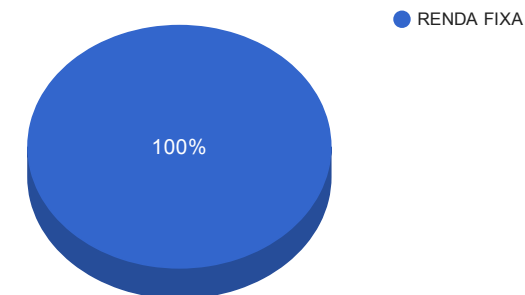
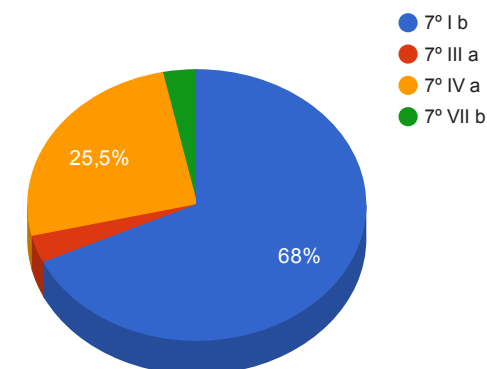
Carteira consolidada de investimentos - base (abril / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.528.713,04	12,55%	1.174	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2016	1.057.389,00	3,76%	85	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.270.883,69	8,07%	545	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	-0,01	-0,00%	105	-0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.169.148,92	4,16%	567	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.870.689,89	20,87%	1.326	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.225.854,05	18,58%	672	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	914.358,02	3,25%	88	0,09%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
SANTANDER CORPORATE FIC REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.340.779,31	4,77%	1.401	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO PREMIUM FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	4.162.199,22	14,80%	387	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.664.836,59	5,92%	749	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TOTAL -			28.125.050,43				

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%	90,00%	19.122.678,58	67,99%	6.189.866,81
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	40,00%	914.358,02	3,25%	10.335.662,15
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	7.167.815,12	25,49%	1.269.700,01
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.406.252,52
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.406.252,52
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	920.198,70	3,27%	486.053,82
Total Renda Fixa	100,00%	175,00	28.125.050,42	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%	843.751,51
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.406.252,52
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	2,00%	0,00	0,00%	562.501,01
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 (abril / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	3,93%	14,06%	11,92%	16,99%	17,27%	35,51%	-	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,90%	13,93%	11,89%	16,80%	16,85%	34,63%	0,20%	3,855%	9,80%
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,70%	1,31%	-0,26%	3,98%	-	-	0,20%	0,245%	-
IRF-M	3,46%	11,68%	8,65%	13,35%	15,97%	28,22%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,53%	11,62%	8,77%	13,30%	15,44%	27,40%	0,20%	2,049%	4,27%
IDKA IPCA 2 Anos	1,66%	6,90%	3,03%	9,15%	18,82%	33,12%	-	-	-
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%
IMA-B 5	1,54%	6,97%	3,88%	9,83%	17,80%	32,16%	-	-	-
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%
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%	-	-	-
BRADESCO 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%	-	-	-
CAIXA BRASIL FI REFERENCIADO DI LP	1,07%	4,35%	3,27%	6,67%	13,91%	26,96%	0,20%	0,022%	0,07%

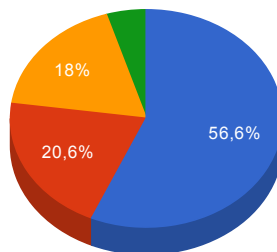
Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (abril / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
SANTANDER CORPORATE FIC REFERENCIADO DI	1,06%	4,30%	3,22%	6,64%	13,89%	27,05%	0,20%	0,007%	0,03%
IPCA	0,61%	3,25%	1,95%	5,29%	9,28%	18,21%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XIII FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,94%	5,24%	3,80%	8,10%	15,12%	32,00%	0,20%	0,025%	0,23%

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

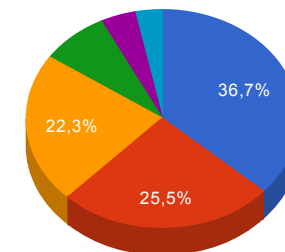
Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	15.908.117,15	56,56%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	5.799.596,73	20,62%
BANCO BRADESCO	5.076.557,24	18,05%
BANCO SANTANDER	1.340.779,31	4,77%

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



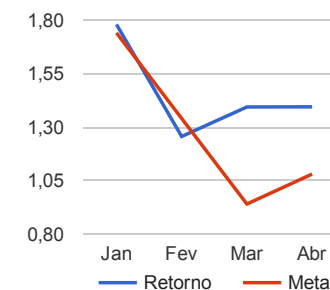
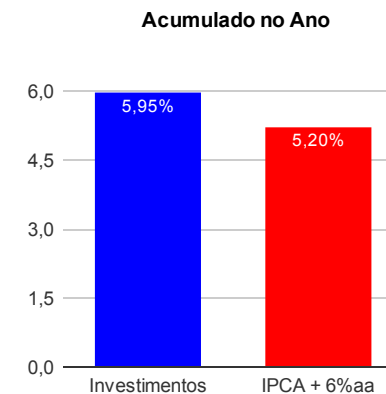
Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	10.313.760,95	36,67%
CDI	7.167.815,12	25,49%
IMA-B 5	6.283.243,05	22,34%
IMA-B	2.270.883,69	8,07%
IDKA IPCA 2A	1.169.148,92	4,16%
CRÉDITO PRIVADO	920.198,70	3,27%

- 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%
Março	27.046.486,18	380.512,11	212.378,29	27.593.914,58	379.294,58	1,39%	0,94%	147,92%	1,04%
Abril	27.593.914,58	385.152,67	240.788,77	28.125.050,42	386.771,94	1,39%	1,08%	129,55%	0,67%
Acumulado no ano					1.565.669,50	5,95%	5,20%	114,47%	



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 IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.185.557,50	0,00	0,00	2.270.883,69	85.326,19	3,90%	3,85%	3,90%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.150.541,27	0,00	0,00	1.169.148,92	18.607,65	1,62%	1,22%	1,62%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.147.270,72	0,00	0,00	5.225.854,05	78.583,33	1,53%	1,25%	1,53%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.884.983,03	145.652,67	225.778,64	5.870.689,89	65.832,83	1,09%	0,17%	1,11%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.259.762,79	239.500,00	8.700,00	3.528.713,04	38.150,25	1,09%	0,18%	1,11%
BRDESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	904.688,60	0,00	0,00	914.358,02	9.669,42	1,07%	0,18%	1,07%
CAIXA BRASIL FI REFERENCIADO DI LP	1.647.288,45	0,00	0,00	1.664.836,59	17.548,14	1,07%	0,02%	1,07%
SANTANDER CORPORATE FIC REFERENCIADO DI	1.326.708,39	0,00	0,00	1.340.779,31	14.070,92	1,06%	0,01%	1,06%
BRDESCO PREMIUM FI REFERENCIADO DI	4.119.156,63	0,00	0,00	4.162.199,22	43.042,59	1,04%	0,00%	1,04%
CAIXA BRASIL IPCA XIII FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	911.642,67	0,00	0,00	920.198,70	8.556,03	0,94%	0,03%	0,94%
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.050.003,00	0,00	0,00	1.057.389,00	7.386,00	0,70%	0,24%	0,70%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.311,53	0,00	6.310,13	-0,01	-1,41	-0,02%	2,05%	3,53%
Total Renda Fixa					386.771,94	1,39%	0,67%	

