

# Relatório Analítico dos Investimentos em maio de 2016



Carteira consolidada de investimentos - base (maio / 2016)

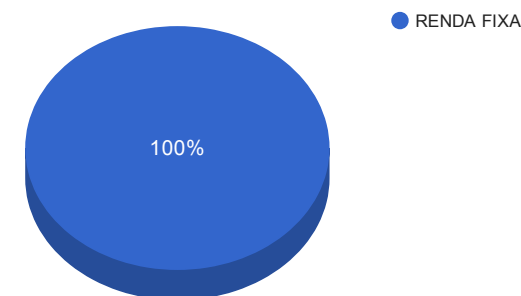
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.268.162,25	7,94%	547	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2016	1.072.731,00	3,75%	85	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.178.446,54	4,12%	579	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.266.482,02	18,43%	686	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	6.014.751,51	21,05%	1.331	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.673.684,64	12,86%	1.176	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	924.091,13	3,23%	89	0,09%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.683.228,47	5,89%	748	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO PREMIUM FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	4.208.819,73	14,73%	385	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER CORPORATE FIC REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.355.751,25	4,74%	1.384	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IPCA XIII FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	01/08/2016	930.307,40	3,26%	49	0,87%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
<b>TOTAL -</b>			<b>28.576.455,94</b>				

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

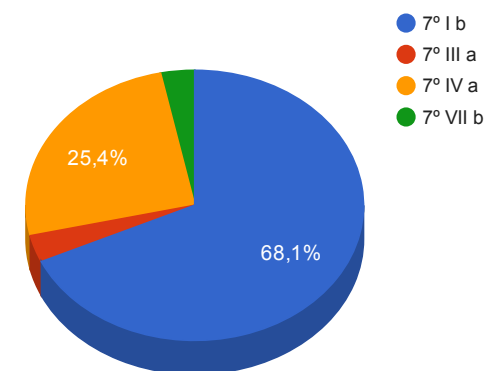
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	90,00%	19.474.257,96	68,15%	6.244.552,39
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	40,00%	924.091,13	3,23%	10.506.491,25
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	7.247.799,45	25,36%	1.325.137,33
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.428.822,80
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.428.822,80
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	930.307,40	3,26%	498.515,40
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>175,00</b>	<b>28.576.455,94</b>	<b>100,00%</b>	

Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	3,00%	0,00	0,00%	857.293,68
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.428.822,80
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	2,00%	0,00	0,00%	571.529,12
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>10,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	

**Distribuição por Segmento**



**Distribuição por Artigo / Resolução**



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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Selic	1,11%	5,50%	3,36%	6,73%	14,00%	27,24%	-	-	-
BRDESCO PREMIUM FI REFERENCIADO DI	1,12%	5,47%	3,35%	6,70%	14,00%	27,41%	0,20%	0,005%	0,02%
CDI	1,11%	5,50%	3,36%	6,72%	13,98%	27,14%	-	-	-
SANTANDER CORPORATE FIC REFERENCIADO DI	1,12%	5,47%	3,35%	6,70%	14,02%	27,36%	0,20%	0,005%	0,02%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,10%	5,51%	3,39%	6,73%	14,05%	27,30%	0,20%	0,005%	0,07%
IRF-M 1	1,07%	6,27%	3,43%	7,53%	14,79%	27,53%	-	-	-
BRDESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1,06%	6,26%	3,44%	7,48%	14,58%	27,07%	0,20%	0,087%	0,78%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,05%	6,26%	3,42%	7,49%	14,65%	27,05%	0,20%	0,084%	0,49%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,04%	6,24%	3,41%	7,47%	14,52%	26,76%	0,10%	0,086%	0,51%
IMA-B 5	0,80%	7,82%	3,13%	10,11%	16,83%	31,29%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,78%	7,67%	3,07%	9,87%	16,25%	30,33%	0,20%	0,906%	3,49%
IPCA	0,78%	4,05%	1,83%	5,05%	9,32%	18,58%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XIII FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,10%	6,40%	3,41%	7,97%	15,09%	31,99%	0,20%	0,175%	0,23%
IDKA IPCA 2 Anos	0,63%	7,57%	2,45%	9,61%	16,89%	32,04%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,80%	7,47%	3,06%	9,58%	16,70%	31,05%	0,20%	1,279%	3,07%
IMA-B	-0,10%	13,95%	9,34%	15,68%	14,21%	29,84%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,45%	2,78%	3,09%	4,49%	-	-	0,20%	-	-

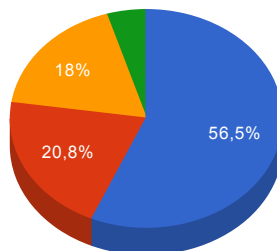
Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (maio / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,12%	13,80%	9,31%	15,48%	13,74%	29,01%	0,20%	3,492%	9,77%

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

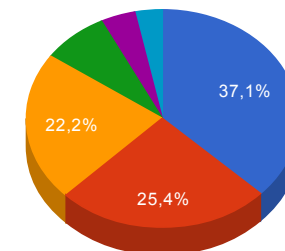
Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	16.145.946,94	56,50%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	5.941.846,89	20,79%
BANCO BRADESCO	5.132.910,86	17,96%
BANCO SANTANDER	1.355.751,25	4,74%

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



Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	10.612.527,28	37,14%
CDI	7.247.799,45	25,36%
IMA-B 5	6.339.213,02	22,18%
IMA-B	2.268.162,25	7,94%
IDKA IPCA 2A	1.178.446,54	4,12%
CRÉDITO PRIVADO	930.307,40	3,26%

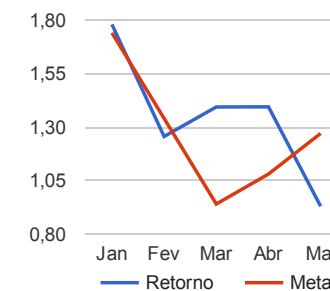
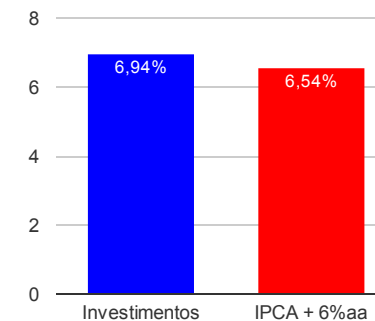
- IRF-M 1
- CDI
- IMA-B 5
- IMA-B
- IDKA IPCA 2A
- CRÉDITO PRIVADO



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%
Mai	28.125.050,42	431.708,14	243.515,75	28.576.455,94	263.213,13	0,93%	1,27%	73,17%	0,56%
Acumulado no ano					1.828.882,63	6,94%	6,54%	106,13%	

**Acumulado no Ano**



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.057.389,00	0,00	0,00	1.072.731,00	15.342,00	1,45%	-	1,45%
BRDESCO PREMIUM FI REFERENCIADO DI	4.162.199,22	0,00	0,00	4.208.819,73	46.620,51	1,12%	0,00%	1,12%
SANTANDER CORPORATE FIC REFERENCIADO DI	1.340.779,31	0,00	0,00	1.355.751,25	14.971,94	1,12%	0,01%	1,12%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.664.836,59	0,00	0,00	1.683.228,47	18.391,88	1,10%	0,01%	1,10%
CAIXA BRASIL IPCA XIII FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	920.198,70	0,00	0,00	930.307,40	10.108,70	1,10%	0,17%	1,10%
BRDESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	914.358,02	0,00	0,00	924.091,13	9.733,11	1,06%	0,09%	1,06%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.528.713,04	111.596,00	4.000,00	3.673.684,64	37.375,60	1,03%	0,09%	1,04%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.870.689,89	320.112,14	239.515,75	6.014.751,51	63.465,23	1,03%	0,08%	1,05%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.169.148,92	0,00	0,00	1.178.446,54	9.297,62	0,80%	1,28%	0,80%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.225.854,05	0,00	0,00	5.266.482,02	40.627,97	0,78%	0,91%	0,78%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.270.883,69	0,00	0,00	2.268.162,25	-2.721,44	-0,12%	3,49%	-0,12%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>263.213,12</b>	<b>0,93%</b>	<b>0,56%</b>	