

Relatório Analítico dos Investimentos em janeiro 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 (janeiro / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
ITAU INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.026.694,85	4,80%	62	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	4.286.986,97	6,79%	665	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2016	3.180.384,00	5,04%	85	0,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2016 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2016	6.360.616,40	10,08%	119	0,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAU SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	332.873,48	0,53%	52	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	3.551.232,22	5,63%	544	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	17/08/2020	1.795.441,50	2,85%	20	3,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	1.040.110,00	1,65%	26	0,87%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	480.389,23	0,76%	1.158	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	442.524,82	0,70%	641	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	489.535,06	0,78%	1.287	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.954.970,76	11,02%	507	0,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRANCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	3.035.784,37	4,81%	50	1,77%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	3.314.347,18	5,25%	217	0,28%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.336.072,33	5,29%	338	0,15%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRANCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	35.567,73	0,06%	84	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	88.089,91	0,14%	239	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
ITAU INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	780.258,01	1,24%	115	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	6.370.182,15	10,10%	753	0,15%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRANCO PREMIUM FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	2.702.221,91	4,28%	388	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.556.172,31	5,64%	837	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
OURINVEST SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	D+45 a D+75	Não há	65.089,65	0,10%	111	0,02%	Artigo 7º, Inciso VI

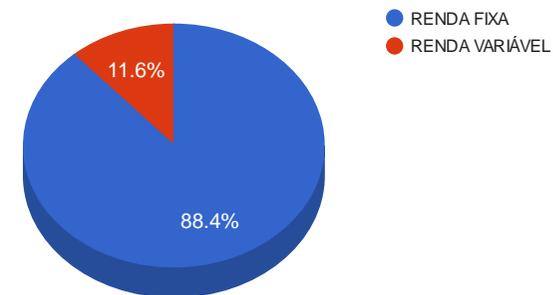
Carteira consolidada de investimentos - base (janeiro / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	563.915,50	0,89%	100	0,31%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BB GOVERNANÇA FIAÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	3.083.101,58	4,89%	88	3,44%	Artigo 8º, Inciso III
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	2.780.544,83	4,41%	64	1,50%	Artigo 8º, Inciso IV
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se aplica	Não se aplica	1.440.000,00	2,28%		1,27%	Artigo 8º, Inciso VI
		TOTAL	63.093.106,75				

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

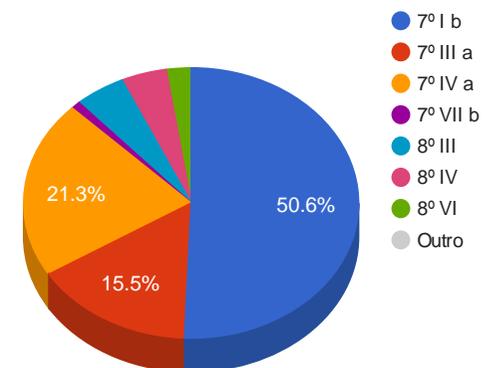
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	80,00%	31.941.759,29	50,63%	18.532.726,11
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	50,00%	9.809.861,52	15,55%	21.736.691,86
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	80,00%	10,00%	0,00	0,00%	6.309.310,68
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	13.408.834,38	21,25%	5.519.097,65
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	30,00%	10,00%	0,00	0,00%	6.309.310,68
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	65.089,65	0,10%	3.089.565,69
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.154.655,34
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	563.915,50	0,89%	2.590.739,84
Total Renda Fixa	100,00%	195,00	55.789.460,34	88,42%	

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.154.655,34
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	10,00%	3.083.101,58	4,89%	3.226.209,10
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	2.780.544,83	4,41%	374.110,51
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.154.655,34
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	1.440.000,00	2,28%	1.714.655,34
Total Renda Variável	30,00%	30,00	7.303.646,41	11,58%	

Distribuição por Artigo / Resolução



Retorno dos investimentos de Renda Fixa - base (janeiro / 2016)

Ativos Renda Fixa	Benchmark	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	IPCA	3,84%	3,84%	6,30%	8,69%	-	-	0,20%	2,125%	-
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	IMA-B	3,57%	3,57%	6,83%	4,13%	6,67%	-	0,20%	2,565%	7,68%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	IDKA IPCA 2 Anos	3,02%	3,02%	5,53%	8,92%	16,60%	33,43%	0,20%	1,787%	3,03%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	IMA-B 5	2,97%	2,97%	5,72%	8,09%	15,60%	-	0,20%	1,723%	3,50%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	IMA-B 5	2,95%	2,95%	5,63%	8,43%	15,94%	33,11%	0,20%	1,702%	3,31%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	IMA-B 5	2,93%	2,93%	5,62%	8,47%	15,98%	32,64%	0,40%	1,694%	3,29%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	IMA-B 5	2,91%	2,91%	5,59%	8,36%	15,89%	32,79%	0,20%	1,694%	3,34%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	IDKA IPCA 2 Anos	2,87%	2,87%	5,42%	8,88%	16,63%	33,70%	0,20%	1,673%	2,93%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	IMA-B	1,88%	1,88%	4,45%	3,05%	7,34%	29,92%	0,30%	2,103%	9,08%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	IMA-B	1,83%	1,83%	4,39%	2,94%	7,23%	29,48%	0,20%	2,118%	9,08%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	IMA-B	1,65%	1,65%	4,15%	2,80%	7,16%	29,18%	0,20%	1,930%	8,35%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	IRF-M 1	1,65%	1,65%	3,87%	7,28%	13,47%	25,99%	0,20%	0,336%	0,81%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	IRF-M 1	1,65%	1,65%	3,88%	7,29%	13,37%	25,92%	0,20%	0,333%	0,54%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENC...	IRF-M 1	1,62%	1,62%	3,87%	7,21%	13,28%	25,64%	0,10%	0,343%	0,57%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	IRF-M 1	1,62%	1,62%	3,89%	7,30%	13,40%	26,01%	0,20%	0,346%	0,55%
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	IMA-B	1,59%	1,59%	5,44%	-0,20%	-	-	0,20%	2,532%	-
CAIXA BRASIL 2016 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	IMA-B	1,57%	1,57%	4,25%	5,61%	-	-	0,20%	0,499%	-
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	IMA-B	1,57%	1,57%	4,25%	5,53%	-	-	0,20%	0,499%	-
OURINVEST SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	115% do CDI	1,21%	1,21%	3,81%	7,83%	15,53%	30,13%	0,20%	0,000%	0,05%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	CDI	1,06%	1,06%	3,32%	6,84%	13,50%	25,98%	0,18%	0,009%	0,05%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	CDI	1,05%	1,05%	3,33%	6,83%	13,59%	26,28%	0,20%	0,016%	0,06%
BRADESCO PREMIUM FI REFERENCIADO DI	Selic	1,05%	1,05%	3,30%	6,79%	13,48%	26,11%	0,20%	0,005%	0,04%
CAIXA BRASIL FI REFERENCIADO DI LP	CDI	1,05%	1,05%	3,29%	6,80%	13,45%	25,91%	0,20%	0,014%	0,08%

Indicadores e Benchmark's de Renda Fixa - base (janeiro / 2016)

Indicadores - Renda Fixa	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses
IDKA IPCA 2 Anos	3,76%	3,76%	5,94%	9,76%	18,43%	36,00%
IMA-B 5	2,97%	2,97%	5,73%	8,70%	16,49%	33,78%
IMA-B	1,91%	1,91%	4,53%	3,17%	7,61%	30,43%
IPCA + 6% a.a. (Meta Atuarial)	1,74%	1,74%	4,77%	7,99%	17,27%	33,18%
IRF-M 1	1,64%	1,64%	3,94%	7,40%	13,65%	26,52%
IPCA	1,27%	1,27%	3,27%	4,91%	10,71%	18,61%
115% do CDI	1,21%	1,21%	3,81%	7,83%	15,54%	30,15%
Selic	1,06%	1,06%	3,31%	6,78%	13,40%	25,88%
CDI	1,05%	1,05%	3,31%	6,78%	13,38%	25,75%

Retorno dos investimentos de Renda Variável - base (janeiro / 2016)

Ativos Renda Variável	Benchmark	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO	CDI	1,12%	1,12%	3,19%	6,40%	13,18%	25,60%	0,35%	0,084%	0,37%
BB GOVERNANÇA FIAÇÕES PREVIDENCIÁRIO	IGC	-5,52%	-5,52%	-9,86%	-17,94%	-11,19%	-7,79%	1,00%	12,614%	19,63%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	IFIX	-10,00%	-10,00%	-8,86%	-27,99%	-12,20%	-61,90%	1,20%	-	37,35%

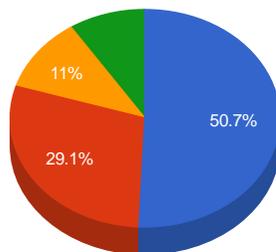
Indicadores e Benchmark's de Renda Variável - base (janeiro / 2016)

Indicadores - Renda Variável	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses
IPCA + 6% a.a. (Meta Atuarial)	1,74%	1,74%	4,77%	7,99%	17,27%	33,18%
CDI	1,05%	1,05%	3,31%	6,78%	13,38%	25,75%
IFIX	-6,17%	-6,17%	-7,55%	-10,07%	-3,64%	3,12%
IGC	-5,52%	-5,52%	-9,92%	-18,08%	-11,20%	-7,61%

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

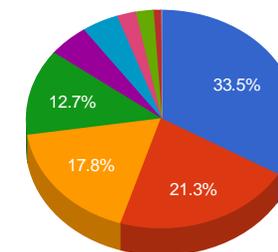
Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	31.973.752,52	50,68%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	18.360.319,40	29,10%
ITAÚ UNIBANCO	6.920.371,17	10,97%
BANCO BRADESCO	5.773.574,01	9,15%
OLIVEIRA TRUST DTVM	65.089,65	0,10%

- CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
- BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM
- ITAÚ UNIBANCO
- BANCO BRADESCO
- Outro



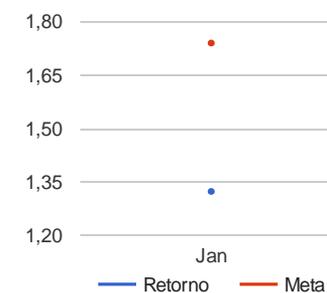
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5	21.155.793,12	33,53%
CDI	13.408.834,38	21,25%
IDKA 2A	11.241.957,73	17,82%
IMA-B	8.015.504,46	12,70%
AÇÕES - SETORIAIS	3.083.101,58	4,89%
MULTIMERCADO	2.780.544,83	4,41%
FUNDO IMOBILIÁRIO	1.440.000,00	2,28%
IRF-M 1	1.338.365,50	2,12%
CRÉDITO PRIVADO	563.915,50	0,89%
FIDC - ABERTO	65.089,65	0,10%

- IMA-B 5
- CDI
- IDKA 2A
- IMA-B
- AÇÕES - SETORIAIS
- MULTIMERCADO
- FUNDO IMOBILIÁRIO
- IRF-M 1
- CRÉDITO PRIVADO
- Outro



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	62.277.696,34	3.701.327,02	3.710.428,93	63.093.106,75	824.512,32	1,32%	1,74%	76,11%	1,67%
Acumulado no ano					824.512,32	1,32%	1,74%	76,11%	



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	543.074,00	0,00	0,00	563.915,50	20.841,50	3,84%	2,12%	3,84%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.733.470,50	0,00	0,00	1.795.441,50	61.971,00	3,57%	2,57%	3,57%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	2.948.157,73	0,00	0,00	3.035.784,37	87.626,64	2,97%	1,72%	2,97%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.219.467,13	0,00	0,00	3.314.347,18	94.880,05	2,95%	1,70%	2,95%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	2.940.425,83	0,00	0,00	3.026.694,85	86.269,02	2,93%	1,69%	2,93%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	430.005,88	0,00	0,00	442.524,82	12.518,94	2,91%	1,69%	2,91%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.277.904,28	1.500.000,00	0,00	6.954.970,76	177.066,48	2,61%	1,67%	2,87%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.384.167,42	1.800.000,00	0,00	4.286.986,97	102.819,55	2,46%	1,79%	3,02%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	86.468,46	0,00	0,00	88.089,91	1.621,45	1,88%	2,10%	1,88%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	327.482,93	0,00	0,00	332.873,48	5.390,55	1,65%	0,33%	1,65%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	484.334,97	0,00	2.627,27	489.535,06	7.827,36	1,62%	0,35%	1,62%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	32.333,38	2.673,52	0,00	35.567,73	560,83	1,60%	0,34%	1,65%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	508.545,13	0,00	36.274,30	480.389,23	8.118,40	1,60%	0,34%	1,62%
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.023.825,00	0,00	0,00	1.040.110,00	16.285,00	1,59%	2,53%	1,59%
CAIXA BRASIL 2016 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.262.167,20	0,00	0,00	6.360.616,40	98.449,20	1,57%	0,50%	1,57%
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.131.172,00	0,00	0,00	3.180.384,00	49.212,00	1,57%	0,50%	1,57%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.273.101,64	0,00	1.800.000,00	3.551.232,22	78.130,58	1,48%	2,12%	1,83%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	4.770.500,52	0,00	1.500.000,00	3.336.072,33	65.571,81	1,37%	1,93%	1,65%
OURINVEST SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	64.308,86	0,00	0,00	65.089,65	780,79	1,21%	0,00%	1,21%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	772.109,82	0,00	0,00	780.258,01	8.148,19	1,06%	0,01%	1,06%
BRADESCO PREMIUM FI REFERENCIADO DI	2.674.117,92	0,00	0,00	2.702.221,91	28.103,99	1,05%	0,00%	1,05%
CAIXA BRASIL FI REFERENCIADO DI LP	6.117.228,29	187.668,99	0,00	6.370.182,15	65.284,87	1,04%	0,01%	1,05%

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.660.294,09	210.984,51	355.000,00	3.556.172,31	39.893,71	1,03%	0,02%	1,05%
			Total Renda Fixa		1.117.371,91	2,04%	1,15%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO	2.749.773,15	0,00	0,00	2.780.544,83	30.771,68	1,12%	0,08%	1,12%
BB GOVERNANÇA FIAÇÕES PREVIDENCIÁRIO	3.263.260,21	0,00	0,00	3.083.101,58	-180.158,63	-5,52%	12,61%	-5,52%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.600.000,00	0,00	16.527,36	1.440.000,00	-143.472,64	-8,97%	-	-10,00%
				Total Renda Variável	-292.859,59	-3,85%	6,67%	