

Relatório Analítico dos Investimentos em abril 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 (abril / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	343.971,50	0,50%	53	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.233.278,43	1,81%	1.326	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	10.701.880,42	15,70%	567	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	533.840,40	0,78%	1.174	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	17/08/2020	1.853.179,50	2,72%	20	3,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	1.133.491,00	1,66%	26	0,87%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	459.428,07	0,67%	672	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2016	3.172.167,00	4,66%	85	0,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	22.859,20	0,03%	545	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	4.507.688,64	6,61%	723	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2016 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2016	6.344.156,00	9,31%	119	0,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.141.046,67	4,61%	65	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	1.627,72	0,00%	259	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	555,60	0,00%	225	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	3.155.857,23	4,63%	57	1,42%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	40.128,74	0,06%	88	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.717.148,22	5,45%	332	0,16%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADESCO PREMIUM FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	2.789.225,59	4,09%	387	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	805.657,45	1,18%	118	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	7.946.171,67	11,66%	844	0,13%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	7.137.946,81	10,47%	749	0,16%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
OURINVEST SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	D+45 a D+75	Não há	67.529,05	0,10%	150	0,02%	Artigo 7º, Inciso VI

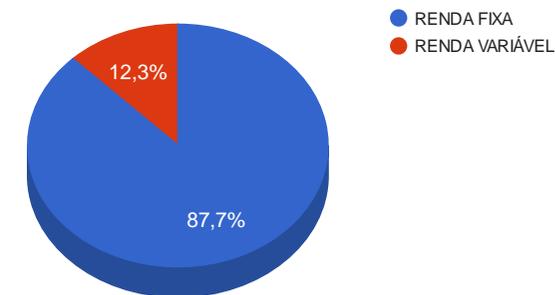
Carteira consolidada de investimentos - base (abril / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	587.285,50	0,86%	100	0,31%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BB GOVERNANÇA FIAÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	3.839.883,51	5,63%	84	3,68%	Artigo 8º, Inciso III
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	2.880.342,38	4,23%	62	1,42%	Artigo 8º, Inciso IV
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se aplica	Não se aplica	1.674.000,00	2,46%		1,27%	Artigo 8º, Inciso VI
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	Término do fundo	Não há	54.024,61	0,08%	752	0,63%	Desenquadrado - RF
		TOTAL -	68.144.370,91				

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

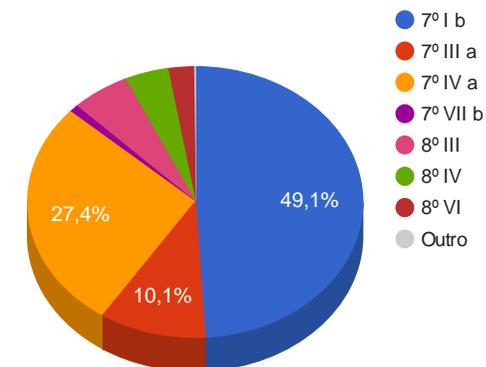
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	80,00%	33.446.986,83	49,08%	21.068.509,90
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	50,00%	6.915.317,51	10,15%	27.156.867,95
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	80,00%	10,00%	0,00	0,00%	6.814.437,09
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	18.679.001,52	27,41%	1.764.309,75
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	30,00%	10,00%	0,00	0,00%	6.814.437,09
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	67.529,05	0,10%	3.339.689,50
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.407.218,55
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	587.285,50	0,86%	2.819.933,05
Desenquadrado - RF	0,00%	0,00%	54.024,61	0,08%	-54.024,61
Total Renda Fixa	100,00%	195,00	59.750.145,02	87,68%	

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%	3.407.218,55
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	10,00%	3.839.883,51	5,63%	2.974.553,58
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	2.880.342,38	4,23%	526.876,17
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.407.218,55
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	1.674.000,00	2,46%	1.733.218,55
Total Renda Variável	30,00%	30,00	8.394.225,89	12,32%	

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%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3,97%	10,71%	8,98%	14,91%	13,06%	-	0,20%	4,778%	11,01%
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%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,89%	13,76%	11,66%	16,64%	16,80%	34,79%	0,30%	3,834%	9,75%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	3,66%	13,26%	11,42%	16,04%	15,83%	34,34%	0,20%	3,562%	9,00%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,29%	6,91%	3,22%	10,27%	17,67%	18,73%	0,20%	2,735%	7,73%
CAIXA BRASIL 2016 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,70%	1,31%	-0,26%	3,98%	-	-	0,20%	0,245%	-
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,70%	1,31%	-0,26%	3,98%	-	-	0,20%	0,245%	-
IDKA IPCA 2 Anos	1,66%	6,90%	3,03%	9,15%	18,82%	33,12%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,66%	6,67%	3,55%	9,28%	17,85%	31,37%	0,20%	1,232%	3,20%
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%	-	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	1,66%	7,05%	3,96%	9,90%	25,99%	-	0,20%	1,350%	3,66%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,55%	6,92%	3,86%	9,71%	17,40%	31,12%	0,20%	1,248%	3,51%
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%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	1,51%	6,82%	3,78%	9,61%	17,29%	31,03%	0,40%	1,242%	3,49%
115% do CDI	1,21%	5,01%	3,75%	7,70%	16,08%	31,43%	-	-	-

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
OURINVEST SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	1,21%	5,01%	3,75%	7,70%	16,08%	31,41%	0,20%	0,000%	0,02%
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%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1,01%	5,03%	3,33%	7,35%	14,23%	26,73%	0,20%	0,182%	0,51%
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%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	1,07%	4,34%	3,26%	6,68%	13,96%	27,04%	0,18%	0,011%	0,03%
CAIXA BRASIL FI REFERENCIADO DI LP	1,07%	4,35%	3,27%	6,67%	13,91%	26,96%	0,20%	0,022%	0,07%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,98%	4,18%	3,09%	6,52%	13,83%	27,05%	0,20%	0,027%	0,05%
IPCA	0,61%	3,25%	1,95%	5,29%	9,28%	18,21%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,65%	8,14%	4,14%	10,71%	-92,99%	-	0,20%	1,589%	3,78%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	7,35%	12,37%	11,59%	15,65%	37,41%	391,34%	0,00%	9,160%	7,59%

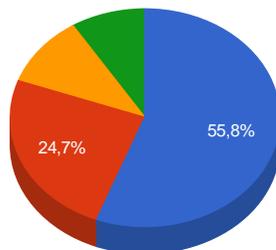
Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (abril / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IGC	5,39%	17,64%	24,51%	12,15%	-4,00%	5,73%	-	-	-
BB GOVERNANÇA FIAÇÕES PREVIDENCIÁRIO	5,53%	17,67%	24,55%	12,27%	-3,99%	5,39%	1,00%	12,186%	22,60%
IFIX	4,65%	10,29%	17,55%	8,67%	11,24%	15,11%	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	2,08%	4,62%	16,25%	5,95%	11,60%	-11,89%	1,20%	9,990%	37,59%
CDI	1,05%	4,34%	3,25%	6,67%	13,85%	26,83%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO	1,20%	4,75%	3,59%	6,90%	13,97%	26,93%	0,35%	0,185%	0,39%

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

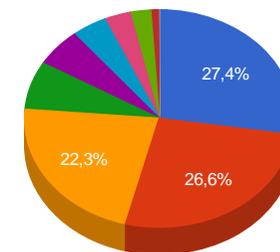
Administrador	Valor	%
Caixa Econômica Federal	38.013.960,95	55,78%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	16.852.626,74	24,73%
ITAÚ UNIBANCO	7.171.018,00	10,52%
BANCO BRADESCO	5.985.211,56	8,78%
OLIVEIRA TRUST DTVM	67.529,05	0,10%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	54.024,61	0,08%

- Caixa Econômica Federal
- BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM
- ITAÚ UNIBANCO
- BANCO BRADESCO
- Outro



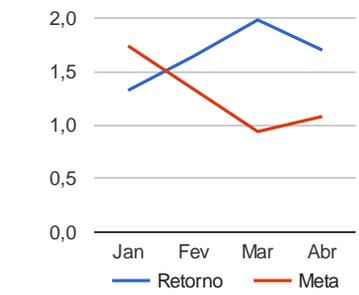
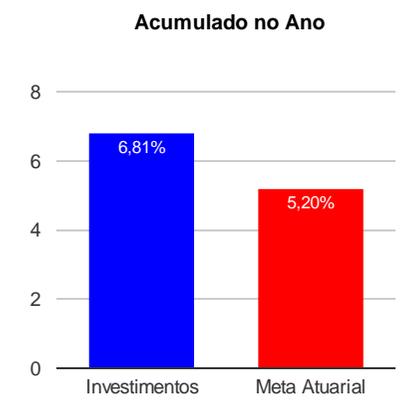
Sub-segmento	Valor	%
CDI	18.679.001,52	27,41%
IMA-B 5	18.127.462,19	26,60%
IDKA 2A	15.209.569,06	22,32%
IMA-B	4.874.054,02	7,15%
AÇÕES - SETORIAIS	3.839.883,51	5,63%
MULTIMERCADO	2.880.342,38	4,23%
IRF-M 1	2.151.219,07	3,16%
FUNDO IMOBILIÁRIO	1.674.000,00	2,46%
CRÉDITO PRIVADO	641.310,11	0,94%
FIDC - ABERTO	67.529,05	0,10%

- CDI
- IMA-B 5
- IDKA 2A
- IMA-B
- AÇÕES - SETORIAIS
- MULTIMERCADO
- IRF-M 1
- FUNDO IMOBILIÁRIO
- 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	3.749.404,56	3.710.428,93	63.141.520,41	824.848,44	1,32%	1,74%	76,10%	1,67%
Fevereiro	63.141.520,41	8.298.722,63	7.841.510,77	64.642.122,27	1.043.390,00	1,64%	1,34%	122,04%	2,26%
Março	64.642.122,27	3.738.261,49	2.934.465,86	66.743.676,02	1.297.758,12	1,98%	0,94%	210,46%	2,09%
Abril	66.743.676,02	688.061,74	426.640,36	68.144.370,91	1.139.273,51	1,70%	1,08%	157,97%	1,76%
Acumulado no ano					4.305.270,07	6,81%	5,20%	131,07%	



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(%)
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	50.327,71	0,00	0,00	54.024,61	3.696,90	7,35%	9,16%	7,35%
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.090.167,00	0,00	0,00	1.133.491,00	43.324,00	3,97%	4,78%	3,97%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	22.000,29	0,00	0,00	22.859,20	858,91	3,90%	3,85%	3,90%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	534,81	0,00	0,00	555,60	20,79	3,89%	3,83%	3,89%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	3.585.774,35	0,00	0,00	3.717.148,22	131.373,87	3,66%	3,56%	3,66%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.811.619,00	0,00	0,00	1.853.179,50	41.560,50	2,29%	2,74%	2,29%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	3.104.277,43	0,00	0,00	3.155.857,23	51.579,80	1,66%	1,35%	1,66%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.434.129,46	0,00	0,00	4.507.688,64	73.559,18	1,66%	1,23%	1,66%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.531.554,08	0,00	0,00	10.701.880,42	170.326,34	1,62%	1,22%	1,62%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.602,89	0,00	0,00	1.627,72	24,83	1,55%	1,25%	1,55%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	452.519,46	0,00	0,00	459.428,07	6.908,61	1,53%	1,25%	1,53%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	3.094.402,19	0,00	0,00	3.141.046,67	46.644,48	1,51%	1,24%	1,51%
OURINVEST SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	66.719,28	0,00	0,00	67.529,05	809,77	1,21%	0,00%	1,21%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	797.161,85	0,00	0,00	805.657,45	8.495,60	1,07%	0,01%	1,07%
CAIXA BRASIL FI REFERENCIADO DI LP	7.062.709,57	0,00	0,00	7.137.946,81	75.237,24	1,07%	0,02%	1,07%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	38.013,16	1.695,17	0,00	40.128,74	420,41	1,06%	0,18%	1,07%
BRADESCO PREMIUM FI REFERENCIADO DI	2.760.381,34	0,00	0,00	2.789.225,59	28.844,25	1,04%	0,00%	1,04%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	340.538,11	0,00	0,00	343.971,50	3.433,39	1,01%	0,18%	1,01%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	509.548,84	68.599,30	50.000,00	533.840,40	5.692,26	0,98%	0,18%	1,11%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.225.488,21	0,00	359.701,23	7.946.171,67	80.384,69	0,98%	0,03%	0,98%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	606.156,11	617.767,27	1.439,13	1.233.278,43	10.794,18	0,88%	0,17%	1,11%
CAIXA BRASIL 2016 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.299.803,40	0,00	0,00	6.344.156,00	44.352,60	0,70%	0,24%	0,70%

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(%)
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.150.009,00	0,00	0,00	3.172.167,00	22.158,00	0,70%	0,24%	0,70%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	583.508,50	0,00	0,00	587.285,50	3.777,00	0,65%	1,59%	0,65%
				Total Renda Fixa	854.277,60	1,45%	0,93%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB GOVERNANÇA FIAÇÕES PREVIDENCIÁRIO	3.638.683,72	0,00	0,00	3.839.883,51	201.199,79	5,53%	12,19%	5,53%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.639.960,00	0,00	15.500,00	1.674.000,00	49.540,00	3,02%	9,99%	3,05%
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO	2.846.086,26	0,00	0,00	2.880.342,38	34.256,12	1,20%	0,18%	1,20%
Total Renda Variável					284.995,91	3,40%	7,63%	