

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
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	1.139.784,00	1,66%	26	0,87%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.456.065,46	3,57%	1.176	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.658.273,64	8,23%	1.331	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	347.612,51	0,51%		0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.165.041,18	4,60%	69	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2016	3.218.193,00	4,68%	85	0,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.711.216,39	3,94%	728	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	17/08/2020	1.859.434,50	2,70%	20	3,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.201.825,57	10,47%	579	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2016 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2016	6.436.231,00	9,36%	119	0,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	42.103,86	0,06%	89	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	3.179.396,87	4,62%	57	1,53%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.937.404,98	5,72%	326	0,18%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	814.644,70	1,18%	118	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO PREMIUM FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	2.820.467,51	4,10%	385	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	7.545.802,22	10,97%	828	0,12%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	7.216.801,51	10,49%	748	0,16%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
OURINVEST SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	D+45 a D+75	Não há	68.389,88	0,10%	150	0,02%	Artigo 7º, Inciso VI
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	596.035,00	0,87%	100	0,31%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BB GOVERNANÇA FIAÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	3.555.112,45	5,17%	83	3,70%	Artigo 8º, Inciso III
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	2.909.409,46	4,23%	62	1,45%	Artigo 8º, Inciso IV
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXR111	Não se aplica	Não se aplica	1.860.000,00	2,70%		1,29%	Artigo 8º, Inciso VI

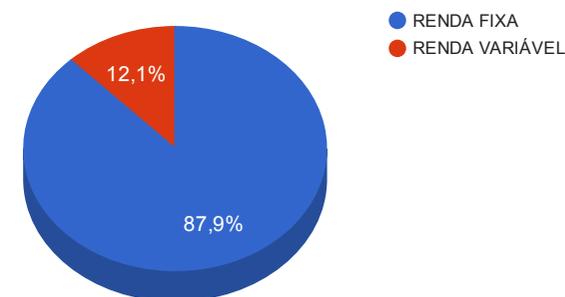
Carteira consolidada de investimentos - base (maio / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	Término do fundo	Não há	53.466,47	0,08%	752	0,63%	Desenquadrado - RF
		TOTAL -	68.792.712,16				

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

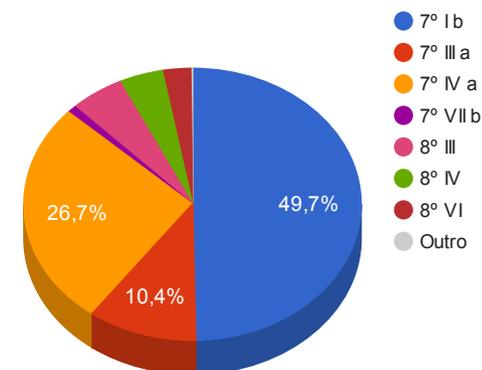
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	80,00%	34.193.677,25	49,71%	20.840.492,48
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	50,00%	7.158.905,71	10,41%	27.237.450,37
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	80,00%	10,00%	0,00	0,00%	6.879.271,22
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	18.397.715,94	26,74%	2.240.097,71
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	30,00%	10,00%	0,00	0,00%	6.879.271,22
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	68.389,88	0,10%	3.371.245,73
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.439.635,61
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	596.035,00	0,87%	2.843.600,61
Desenquadrado - RF	0,00%	0,00%	53.466,47	0,08%	-53.466,47
Total Renda Fixa	100,00%	195,00	60.468.190,25	87,90%	

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%	3.439.635,61
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	10,00%	3.555.112,45	5,17%	3.324.158,77
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	2.909.409,46	4,23%	530.226,15
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.439.635,61
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	1.860.000,00	2,70%	1.579.635,61
Total Renda Variável	30,00%	30,00	8.324.521,91	12,10%	

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
115% do CDI	1,27%	6,35%	3,87%	7,77%	16,24%	31,80%	-	-	-
OURINVEST SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	1,27%	6,35%	3,87%	7,77%	16,24%	31,78%	0,20%	0,000%	0,01%
Selic	1,11%	5,50%	3,36%	6,73%	14,00%	27,24%	-	-	-
BRADESCO 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%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,14%	5,37%	3,27%	6,61%	13,95%	27,37%	0,20%	0,043%	0,05%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	1,12%	5,51%	3,38%	6,74%	14,09%	27,36%	0,18%	0,004%	0,03%
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%	-	-	-
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1,06%	6,26%	3,44%	7,48%	14,58%	27,07%	0,20%	0,087%	0,78%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1,06%	6,15%	3,36%	7,37%	14,45%	26,89%	0,20%	0,087%	0,50%
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%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	0,76%	7,64%	3,02%	9,88%	16,33%	30,17%	0,40%	0,906%	3,48%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	0,75%	7,84%	3,16%	10,14%	16,11%	-	0,20%	-	3,65%
IPCA	0,78%	4,05%	1,83%	5,05%	9,32%	18,58%	-	-	-

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
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,49%	9,75%	4,60%	10,25%	17,61%	-	0,20%	-	3,60%
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%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,75%	7,48%	2,96%	9,61%	16,59%	30,65%	0,20%	1,316%	3,18%
IMA-B	-0,10%	13,95%	9,34%	15,68%	14,21%	29,84%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2016 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,45%	2,78%	3,09%	4,50%	9,66%	-	0,20%	-	4,21%
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,45%	2,78%	3,09%	4,49%	-	-	0,20%	-	-
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,56%	11,33%	8,79%	13,90%	9,36%	-	0,20%	-	10,98%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,34%	7,27%	3,78%	10,15%	9,90%	15,63%	0,20%	3,564%	7,67%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	2,19%	13,28%	9,11%	14,65%	13,11%	28,95%	0,20%	3,195%	8,96%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	-1,03%	11,21%	8,83%	12,65%	33,08%	347,64%	0,00%	25,430%	8,00%

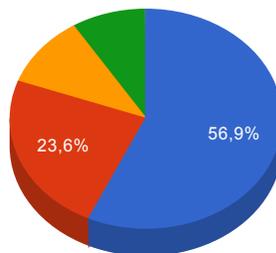
Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (maio / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	3,73%	14,41%	18,44%	11,02%	13,76%	17,75%	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	9,60%	14,67%	23,96%	24,47%	22,31%	-3,44%	1,20%	-	38,83%
CDI	1,11%	5,50%	3,36%	6,72%	13,98%	27,14%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO	1,01%	5,81%	3,55%	6,99%	13,94%	27,04%	0,35%	0,114%	0,39%
IGC	-7,25%	9,11%	9,31%	5,85%	-7,10%	-1,63%	-	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	-7,42%	8,94%	9,28%	5,66%	-7,21%	-2,02%	1,00%	9,330%	22,85%

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

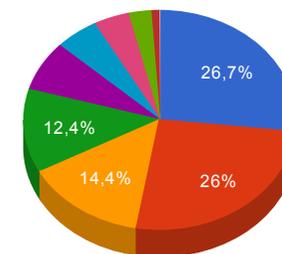
Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	39.123.983,20	56,87%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	16.268.196,52	23,65%
ITAÚ UNIBANCO	7.236.707,85	10,52%
BANCO BRADESCO	6.041.968,24	8,78%
OLIVEIRA TRUST DTVM	68.389,88	0,10%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	53.466,47	0,08%

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



Sub-segmento	Valor	%
CDI	18.397.715,94	26,74%
IMA-B 5	17.858.296,55	25,96%
IDKA IPCA 2A	9.913.041,96	14,41%
IRF-M 1	8.504.055,47	12,36%
IMA-B	5.077.188,98	7,38%
AÇÕES - SETORIAIS	3.555.112,45	5,17%
MULTIMERCADO	2.909.409,46	4,23%
FUNDO IMOBILIÁRIO	1.860.000,00	2,70%
CRÉDITO PRIVADO	649.501,47	0,94%
FIDC - ABERTO	68.389,88	0,10%

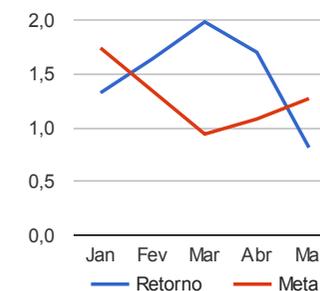
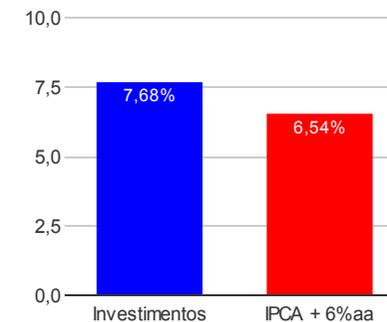
- CDI
- IMA-B 5
- IDKA IPCA 2A
- IRF-M 1
- IMA-B
- AÇÕES - SETORIAIS
- MULTIMER...
- FUNDO IMOBILIÁRIO
- CRÉDITO PRIVADO
- Outro



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%	1,55%
Mai	68.144.370,91	6.653.130,12	6.560.846,88	68.792.712,16	556.058,01	0,81%	1,27%	64,14%	1,35%
Acumulado no ano					4.861.328,08	7,68%	6,54%	117,58%	

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(%)
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	22.859,20	0,00	23.303,00	0,00	443,80	1,94%	3,49%	-0,12%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	555,60	0,00	566,24	0,00	10,64	1,92%	3,44%	-0,14%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	587.285,50	0,00	0,00	596.035,00	8.749,50	1,49%	-	1,49%
CAIXA BRASIL 2016 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.344.156,00	0,00	0,00	6.436.231,00	92.075,00	1,45%	-	1,45%
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.172.167,00	0,00	0,00	3.218.193,00	46.026,00	1,45%	-	1,45%
OURINVEST SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	67.529,05	0,00	0,00	68.389,88	860,83	1,27%	0,00%	1,27%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.946.171,67	0,00	490.000,00	7.545.802,22	89.630,55	1,13%	0,04%	1,14%
BRADESCO PREMIUM FI REFERENCIADO DI	2.789.225,59	0,00	0,00	2.820.467,51	31.241,92	1,12%	0,00%	1,12%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	805.657,45	0,00	0,00	814.644,70	8.987,25	1,12%	0,00%	1,12%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.627,72	0,00	1.645,80	0,00	18,08	1,11%	1,40%	0,79%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	7.137.946,81	0,00	0,00	7.216.801,51	78.854,70	1,10%	0,01%	1,10%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	343.971,50	0,00	0,00	347.612,51	3.641,01	1,06%	0,09%	1,06%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	459.428,07	0,00	464.290,98	0,00	4.862,91	1,06%	0,91%	0,78%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	40.128,74	1.541,12	0,00	42.103,86	434,00	1,04%	0,09%	1,06%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.701.880,42	0,00	3.596.426,36	7.201.825,57	96.371,51	0,90%	1,28%	0,80%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.507.688,64	81.776,38	1.917.614,50	2.711.216,39	39.365,87	0,86%	1,32%	0,75%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	3.141.046,67	0,00	0,00	3.165.041,18	23.994,51	0,76%	0,91%	0,76%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	3.155.857,23	0,00	0,00	3.179.396,87	23.539,64	0,75%	-	0,75%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.233.278,43	4.391.993,73	0,00	5.658.273,64	33.001,48	0,59%	0,08%	1,05%
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.133.491,00	0,00	0,00	1.139.784,00	6.293,00	0,56%	-	0,56%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	533.840,40	1.957.712,31	49.000,00	2.456.065,46	13.512,75	0,54%	0,09%	1,04%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.853.179,50	0,00	0,00	1.859.434,50	6.255,00	0,34%	3,56%	0,34%

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 NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	3.717.148,22	220.106,58	0,00	3.937.404,98	150,18	0,00%	3,20%	0,02%
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	54.024,61	0,00	0,00	53.466,47	-558,14	-1,03%	25,43%	-1,03%
Total Renda Fixa					607.761,99	1,02%	0,81%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.674.000,00	0,00	18.000,00	1.860.000,00	204.000,00	12,19%	-	9,60%
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO	2.880.342,38	0,00	0,00	2.909.409,46	29.067,08	1,01%	0,11%	1,01%
BB GOVERNANÇA FIAÇÕES PREVIDENCIÁRIO	3.839.883,51	0,00	0,00	3.555.112,45	-284.771,06	-7,42%	9,33%	-7,42%
Total Renda Variável					-51.703,98	-0,61%	5,18%	

