

Relatório Analítico dos Investimentos em janeiro de 2016



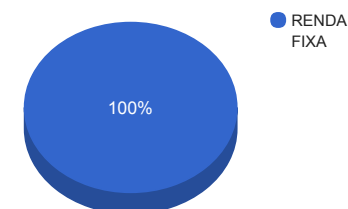
Carteira consolidada de investimentos - base (janeiro / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.717.257,57	9,71%	365	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.334.751,35	7,54%	37	1,92%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.160.702,35	29,17%	1.287	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.122.499,91	6,35%	1.158	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2030	2.281.982,00	12,90%	18	5,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.898.962,45	10,73%	665	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.264.996,57	7,15%	641	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	919.005,58	5,19%	2.482	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	1.832.115,91	10,36%	143	0,19%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	158.564,28	0,90%	837	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
		TOTAL -	17.690.837,97				

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

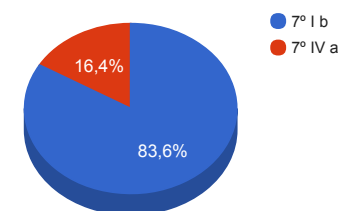
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	90,00%	14.781.152,20	83,55%	1.140.601,97
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	20,00%	0,00	0,00%	3.538.167,59
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	2.909.685,77	16,45%	2.397.565,62
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	884.541,90
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	884.541,90
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	884.541,90
Total Renda Fixa	100,00%	155,00	17.690.837,97	100,00%	

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%	884.541,90
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	10,00%	0,00	0,00%	1.769.083,80
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	884.541,90
Total Renda Variável	30,00%	20,00	0,00	0,00%	

Distribuição por Artigo / Resolução

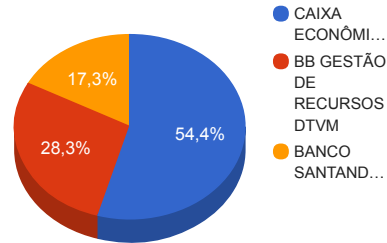


Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (janeiro / 2016)

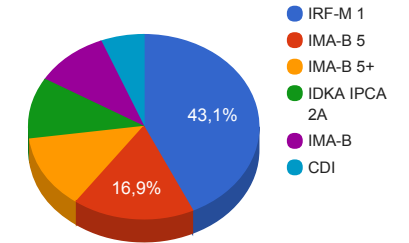
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDKA IPCA 2 Anos	3,76%	3,76%	5,94%	9,76%	18,43%	36,00%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,02%	3,02%	5,53%	8,92%	16,60%	33,43%	0,20%	1,787%	3,03%
IMA-B 5	2,97%	2,97%	5,73%	8,70%	16,49%	33,78%	-	-	-
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	2,96%	2,96%	5,67%	8,62%	16,29%	33,31%	0,10%	1,699%	3,31%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,91%	2,91%	5,59%	8,36%	15,89%	32,79%	0,20%	1,694%	3,34%
IMA-B	1,91%	1,91%	4,53%	3,17%	7,61%	30,43%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,39%	2,39%	4,69%	-1,31%	-1,16%	-	0,20%	3,338%	13,02%
IPCA + 6,00% ao ano	1,74%	1,74%	4,77%	7,99%	17,27%	33,18%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,54%	1,54%	4,60%	7,79%	17,56%	-	0,20%	0,125%	0,35%
IRF-M 1	1,64%	1,64%	3,94%	7,40%	13,65%	26,52%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	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	1,62%	1,62%	3,89%	7,30%	13,40%	26,01%	0,20%	0,346%	0,55%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1,60%	1,60%	3,82%	7,16%	13,19%	25,37%	0,40%	0,347%	0,56%
CDI	1,05%	1,05%	3,31%	6,78%	13,38%	25,75%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,05%	1,05%	3,33%	6,83%	13,59%	26,28%	0,20%	0,016%	0,06%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,04%	1,04%	3,30%	6,83%	13,54%	26,10%	0,25%	0,024%	0,09%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	9.626.686,50	54,42%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	5.012.142,55	28,33%
BANCO SANTANDER	3.052.008,92	17,25%



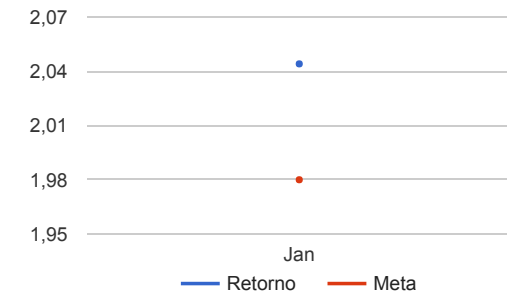
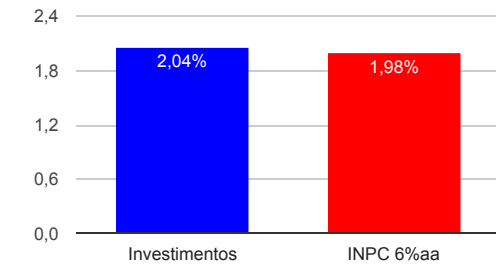
Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	7.617.953,61	43,06%
IMA-B 5	2.982.254,14	16,86%
IMA-B 5+	2.281.982,00	12,90%
IDKA IPCA 2A	1.898.962,45	10,73%
IMA-B	1.832.115,91	10,36%
CDI	1.077.569,86	6,09%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	17.336.482,72	0,00	0,00	17.690.837,97	354.355,25	2,04%	1,98%	103,20%	1,07%
Acumulado no ano					354.355,25	2,04%	1,98%	103,20%	

Acumulado no Ano



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 IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.843.335,07	0,00	0,00	1.898.962,45	55.627,38	3,02%	1,79%	3,02%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	1.667.953,23	0,00	0,00	1.717.257,57	49.304,34	2,96%	1,70%	2,96%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.229.210,02	0,00	0,00	1.264.996,57	35.786,55	2,91%	1,69%	2,91%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.228.712,00	0,00	0,00	2.281.982,00	53.270,00	2,39%	3,34%	2,39%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.104.559,90	0,00	0,00	1.122.499,91	17.940,01	1,62%	0,34%	1,62%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.078.246,35	0,00	0,00	5.160.702,35	82.456,00	1,62%	0,35%	1,62%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1.313.767,51	0,00	0,00	1.334.751,35	20.983,84	1,60%	0,35%	1,60%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.804.279,57	0,00	0,00	1.832.115,91	27.836,34	1,54%	0,13%	1,54%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	156.911,20	0,00	0,00	158.564,28	1.653,08	1,05%	0,02%	1,05%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	909.507,87	0,00	0,00	919.005,58	9.497,71	1,04%	0,02%	1,04%
				Total Renda Fixa	354.355,25	2,04%	1,07%	