

# Relatório Analítico dos Investimentos em maio de 2016



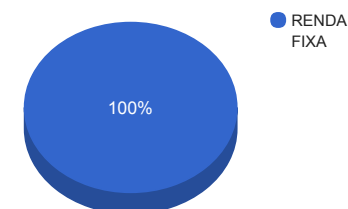
Carteira consolidada de investimentos - base (maio / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.981.153,23	10,60%	728	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.345.711,69	7,20%	34	1,89%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2030	2.552.650,00	13,65%	18	5,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.173.482,87	6,28%	1.176	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.797.045,18	9,61%	297	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.397.507,31	7,48%	686	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.396.032,42	28,86%	1.331	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	1.869.243,73	10,00%	143	0,19%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	959.759,88	5,13%	3.184	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	221.526,61	1,19%	828	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
		<b>TOTAL -</b>	<b>18.694.112,92</b>				

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

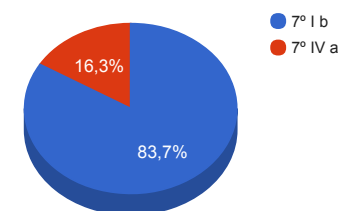
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	90,00%	15.643.582,70	83,68%	1.181.118,93
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	20,00%	0,00	0,00%	3.738.822,58
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	3.050.530,22	16,32%	2.557.703,66
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	934.705,65
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	934.705,65
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	934.705,65
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>155,00</b>	<b>18.694.112,92</b>	<b>100,00%</b>	

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%	934.705,65
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	10,00%	0,00	0,00%	1.869.411,29
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	934.705,65
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>20,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	

Distribuição por Artigo / Resolução

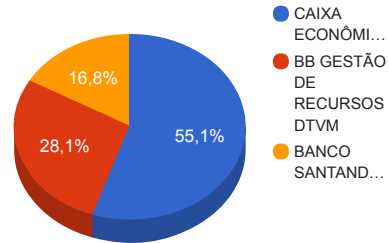


Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (maio / 2016)

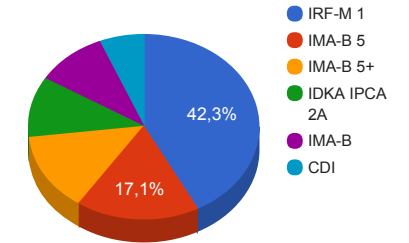
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA + 6,00% ao ano	1,27%	6,54%	3,33%	8,11%	15,85%	33,21%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,23%	6,73%	3,42%	8,53%	16,33%	33,84%	0,20%	0,174%	0,34%
CDI	1,11%	5,50%	3,36%	6,72%	13,98%	27,14%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,14%	5,37%	3,27%	6,61%	13,95%	27,37%	0,20%	0,043%	0,17%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,11%	5,53%	3,41%	6,75%	14,12%	27,48%	0,25%	0,012%	0,08%
IRF-M 1	1,07%	6,27%	3,43%	7,53%	14,79%	27,53%	-	-	-
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%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1,00%	6,04%	3,27%	7,24%	14,24%	26,34%	0,40%	0,092%	0,51%
IMA-B 5	0,80%	7,82%	3,13%	10,11%	16,83%	31,29%	-	-	-
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	0,78%	7,74%	3,08%	10,00%	16,63%	30,83%	0,10%	1,401%	3,52%
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%	3,51%
IDKA IPCA 2 Anos	0,63%	7,57%	2,45%	9,61%	16,89%	32,04%	-	-	-
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%	3,23%
IMA-B	-0,10%	13,95%	9,34%	15,68%	14,21%	29,84%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,09%	14,53%	12,45%	15,83%	6,77%	15,84%	0,20%	6,408%	13,86%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	10.305.949,61	55,13%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	5.245.406,44	28,06%
BANCO SANTANDER	3.142.756,87	16,81%



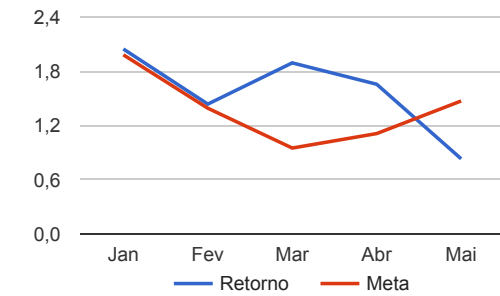
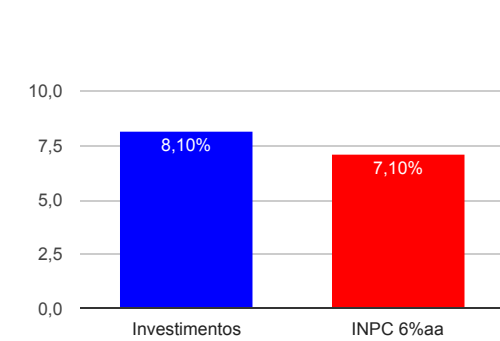
Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	7.915.226,98	42,34%
IMA-B 5	3.194.552,49	17,09%
IMA-B 5+	2.552.650,00	13,65%
IDKA IPCA 2A	1.981.153,23	10,60%
IMA-B	1.869.243,73	10,00%
CDI	1.181.286,49	6,32%



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%
Fevereiro	17.690.837,97	125.890,52	125.890,52	17.944.753,54	253.915,57	1,44%	1,39%	102,93%	1,33%
Março	17.944.753,54	0,00	0,00	18.284.026,30	339.272,76	1,89%	0,95%	198,55%	1,86%
Abril	18.284.026,30	0,00	0,00	18.586.586,58	302.560,28	1,65%	1,11%	149,55%	1,15%
Mai	18.586.586,58	0,00	47.000,00	18.694.112,92	154.526,34	0,83%	1,47%	56,50%	1,27%
Acumulado no ano					1.404.630,20	8,10%	7,10%	114,19%	

**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 TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.846.521,83	0,00	0,00	1.869.243,73	22.721,90	1,23%	0,17%	1,23%	
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	219.027,47	0,00	0,00	221.526,61	2.499,14	1,14%	0,04%	1,14%	
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	949.262,11	0,00	0,00	959.759,88	10.497,77	1,11%	0,01%	1,11%	
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.339.822,63	0,00	0,00	5.396.032,42	56.209,79	1,05%	0,08%	1,05%	
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.161.408,91	0,00	0,00	1.173.482,87	12.073,96	1,04%	0,09%	1,04%	
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1.379.272,69	0,00	47.000,00	1.345.711,69	13.439,00	0,97%	0,09%	1,00%	
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	1.783.122,02	0,00	0,00	1.797.045,18	13.923,16	0,78%	1,40%	0,78%	
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.386.726,31	0,00	0,00	1.397.507,31	10.781,00	0,78%	0,91%	0,78%	
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.966.354,61	0,00	0,00	1.981.153,23	14.798,62	0,75%	1,32%	0,75%	
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.555.068,00	0,00	0,00	2.552.650,00	-2.418,00	-0,09%	6,41%	-0,09%	
Total Renda Fixa						154.526,34	0,83%	1,27%	