

# Relatório Analítico dos Investimentos em junho, 2º Trimestre e 1º semestre de 2016



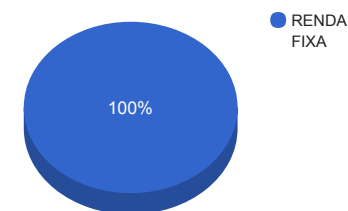
Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2030	2.622.370,00	13,83%	18	5,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.813.597,65	9,57%	301	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.185.619,15	6,25%	1.175	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.410.337,50	7,44%	701	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.453.014,25	28,76%	1.331	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.997.408,42	10,54%	738	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.390.726,49	7,34%	33	1,92%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	1.890.552,92	9,97%	143	0,19%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	223.886,19	1,18%	824	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	970.934,09	5,12%	3.283	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
		<b>TOTAL -</b>	<b>18.958.446,66</b>				

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

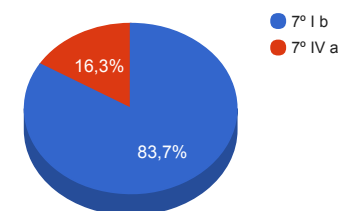
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	90,00%	15.873.073,46	83,73%	1.189.528,53
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	20,00%	0,00	0,00%	3.791.689,33
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	3.085.373,20	16,27%	2.602.160,80
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	947.922,33
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	947.922,33
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	947.922,33
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>155,00</b>	<b>18.958.446,66</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%	947.922,33
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	10,00%	0,00	0,00%	1.895.844,67
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	947.922,33
<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 (junho / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	1,93%	16,15%	5,83%	16,15%	16,73%	32,26%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,73%	17,66%	7,13%	17,66%	10,69%	20,11%	0,20%	2,659%	13,86%

CDI	1,16%	6,72%	3,36%	6,72%	14,09%	27,57%	-	-	-
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,16%	6,75%	3,39%	6,75%	14,22%	27,90%	0,25%	0,017%	0,08%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,07%	6,49%	3,22%	6,49%	13,92%	27,68%	0,20%	0,271%	0,17%

IRF-M 1	1,08%	7,42%	3,25%	7,42%	14,96%	27,79%	-	-	-
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1,10%	7,20%	3,20%	7,20%	14,47%	26,70%	0,40%	0,207%	0,51%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,06%	7,38%	3,25%	7,38%	14,82%	27,31%	0,20%	0,120%	0,49%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,03%	7,34%	3,22%	7,34%	14,66%	27,00%	0,10%	0,117%	0,51%

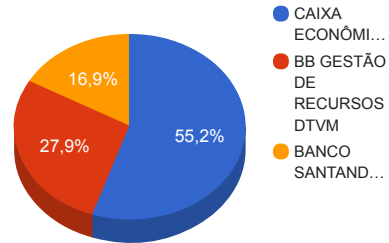
IMA-B 5	0,94%	8,84%	3,31%	8,84%	16,94%	31,07%	-	-	-
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	0,92%	8,73%	3,26%	8,73%	16,74%	30,61%	0,10%	1,106%	3,52%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,92%	8,66%	3,26%	8,66%	16,43%	30,14%	0,20%	1,106%	3,51%

IDKA IPCA 2 Anos	0,93%	8,58%	3,25%	8,58%	17,00%	31,47%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,82%	8,36%	3,26%	8,36%	16,56%	30,05%	0,20%	1,178%	3,23%

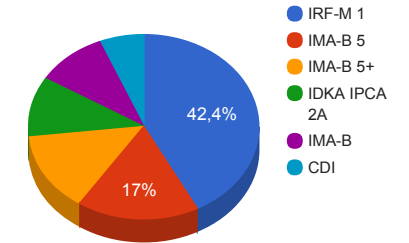
IPCA + 6,00% ao ano	0,86%	7,45%	3,24%	7,45%	15,38%	33,21%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,14%	7,95%	3,37%	7,95%	16,08%	34,16%	0,20%	0,113%	0,34%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	10.456.655,84	55,16%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	5.297.466,68	27,94%
BANCO SANTANDER	3.204.324,14	16,90%



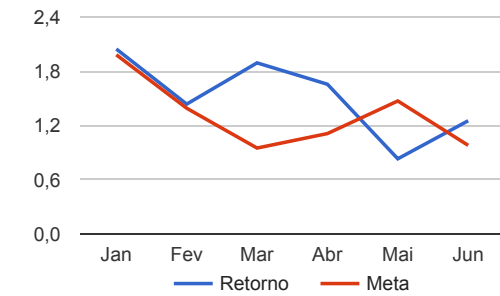
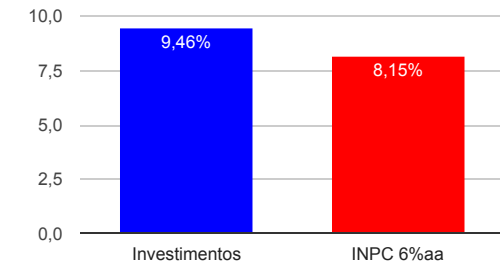
Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	8.029.359,89	42,35%
IMA-B 5	3.223.935,15	17,01%
IMA-B 5+	2.622.370,00	13,83%
IDKA IPCA 2A	1.997.408,42	10,54%
IMA-B	1.890.552,92	9,97%
CDI	1.194.820,28	6,30%



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%
Junho	18.694.112,92	40.000,00	10.000,00	18.958.446,66	234.333,74	1,25%	0,98%	127,39%	0,75%
Acumulado no ano					1.638.963,94	9,46%	8,15%	116,05%	

**Acumulado no Ano**



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.552.650,00	0,00	0,00	2.622.370,00	69.720,00	2,73%	2,66%	2,73%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	959.759,88	0,00	0,00	970.934,09	11.174,21	1,16%	0,02%	1,16%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.869.243,73	0,00	0,00	1.890.552,92	21.309,19	1,14%	0,11%	1,14%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1.345.711,69	40.000,00	10.000,00	1.390.726,49	15.014,80	1,08%	0,21%	1,10%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	221.526,61	0,00	0,00	223.886,19	2.359,58	1,07%	0,27%	1,07%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.396.032,42	0,00	0,00	5.453.014,25	56.981,83	1,06%	0,12%	1,06%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.173.482,87	0,00	0,00	1.185.619,15	12.136,28	1,03%	0,12%	1,03%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	1.797.045,18	0,00	0,00	1.813.597,65	16.552,47	0,92%	1,11%	0,92%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.397.507,31	0,00	0,00	1.410.337,50	12.830,19	0,92%	1,11%	0,92%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.981.153,23	0,00	0,00	1.997.408,42	16.255,19	0,82%	1,18%	0,82%
Total Renda Fixa					234.333,74	1,25%	0,75%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre / 2016

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.447.820,00	0,00	0,00	2.622.370,00	174.550,00	7,13%	7,13%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.281.430,74	0,00	0,00	5.453.014,25	171.583,51	3,25%	3,25%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.934.266,48	0,00	0,00	1.997.408,42	63.141,94	3,26%	3,26%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.828.905,91	0,00	0,00	1.890.552,92	61.647,01	3,37%	3,37%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	1.756.356,88	0,00	0,00	1.813.597,65	57.240,77	3,26%	3,26%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.365.873,56	0,00	0,00	1.410.337,50	44.463,94	3,26%	3,26%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1.364.763,59	40.000,00	57.000,00	1.390.726,49	42.962,90	3,15%	3,20%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.148.604,02	0,00	0,00	1.185.619,15	37.015,13	3,22%	3,22%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	939.106,47	0,00	0,00	970.934,09	31.827,62	3,39%	3,39%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	216.898,65	0,00	0,00	223.886,19	6.987,54	3,22%	3,22%
Total Renda Fixa					691.420,36	3,78%	



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre / 2016

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.228.712,00	0,00	71.609,15	2.622.370,00	465.267,15	21,37%	17,66%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.078.246,35	0,00	0,00	5.453.014,25	374.767,90	7,38%	7,38%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.843.335,07	0,00	0,00	1.997.408,42	154.073,35	8,36%	8,36%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	1.667.953,23	0,00	0,00	1.813.597,65	145.644,42	8,73%	8,73%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.804.279,57	0,00	54.281,37	1.890.552,92	140.554,72	7,93%	7,95%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.229.210,02	71.609,15	0,00	1.410.337,50	109.518,33	8,59%	8,66%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1.313.767,51	40.000,00	57.000,00	1.390.726,49	93.958,98	7,16%	7,20%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.104.559,90	0,00	0,00	1.185.619,15	81.059,25	7,34%	7,34%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	909.507,87	0,00	0,00	970.934,09	61.426,22	6,75%	6,75%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	156.911,20	54.281,37	0,00	223.886,19	12.693,62	6,30%	6,49%
Total Renda Fixa					1.638.963,94	9,46%	