

Relatório Analítico dos Investimentos em fevereiro de 2016



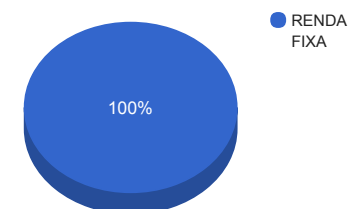
Carteira consolidada de investimentos - base (fevereiro / 2016)

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	1.743.376,73	9,72%	375	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.348.967,75	7,52%	36	1,92%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.217.497,71	29,08%	1.306	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.134.835,69	6,32%	1.164	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2030	2.270.014,00	12,65%	18	5,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.924.145,23	10,72%	690	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.355.911,41	7,56%	654	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	928.125,53	5,17%	2.613	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	1.807.367,03	10,07%	143	0,19%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	214.512,46	1,20%	839	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
		TOTAL -	17.944.753,54				

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

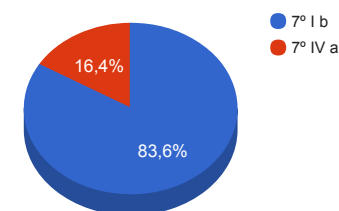
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	90,00%	14.994.748,52	83,56%	1.155.529,67
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	20,00%	0,00	0,00%	3.588.950,71
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	2.950.005,02	16,44%	2.433.421,04
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	897.237,68
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	897.237,68
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	897.237,68
Total Renda Fixa	100,00%	155,00	17.944.753,54	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%	897.237,68
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	10,00%	0,00	0,00%	1.794.475,35
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	897.237,68
Total Renda Variável	30,00%	20,00	0,00	0,00%	

Distribuição por Artigo / Resolução

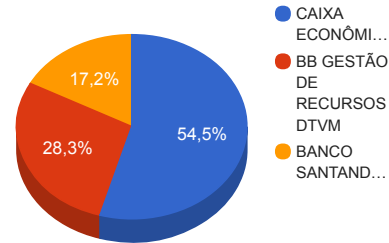


Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (fevereiro / 2016)

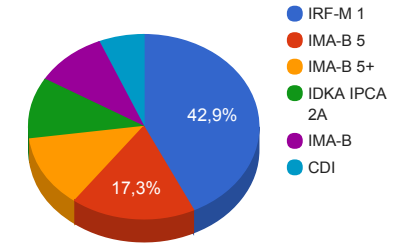
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	2,26%	4,22%	5,80%	8,90%	9,45%	27,71%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,52%	1,85%	3,00%	5,50%	0,81%	-	0,20%	6,501%	12,92%
IMA-B 5	1,54%	4,55%	6,77%	10,89%	16,86%	32,06%	-	-	-
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	1,52%	4,52%	6,71%	10,81%	16,65%	31,60%	0,10%	1,454%	3,33%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,51%	4,47%	6,60%	10,56%	16,32%	31,08%	0,20%	1,440%	3,36%
IPCA + 6,00% ao ano	1,34%	3,11%	4,63%	8,67%	16,92%	33,42%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,63%	3,20%	4,94%	8,59%	17,74%	34,28%	0,20%	0,285%	0,39%
IDKA IPCA 2 Anos	1,20%	5,00%	6,99%	11,37%	18,46%	33,63%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,33%	4,38%	6,45%	10,78%	16,74%	31,36%	0,20%	1,412%	3,03%
IRF-M 1	1,09%	2,75%	3,97%	7,47%	14,04%	26,55%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,10%	2,74%	3,94%	7,40%	13,84%	26,05%	0,20%	0,179%	0,54%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,10%	2,74%	3,93%	7,33%	13,72%	25,72%	0,10%	0,180%	0,56%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1,07%	2,68%	3,85%	7,24%	13,60%	25,42%	0,40%	0,177%	0,55%
CDI	1,00%	2,07%	3,25%	6,67%	13,59%	26,03%	-	-	-
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,99%	2,05%	3,23%	6,68%	13,71%	26,35%	0,25%	0,015%	0,09%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,97%	2,03%	3,23%	6,67%	13,74%	26,44%	0,20%	0,015%	0,05%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	9.771.548,65	54,45%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	5.080.860,41	28,31%
BANCO SANTANDER	3.092.344,48	17,23%



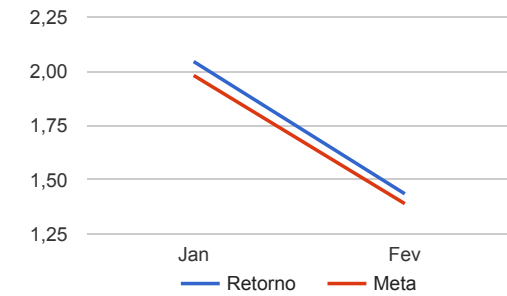
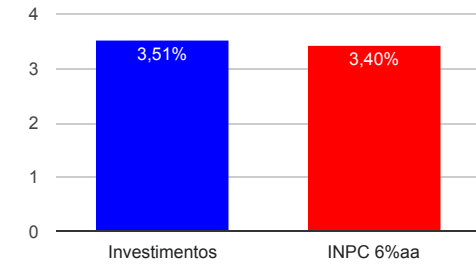
Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	7.701.301,15	42,92%
IMA-B 5	3.099.288,14	17,27%
IMA-B 5+	2.270.014,00	12,65%
IDKA IPCA 2A	1.924.145,23	10,72%
IMA-B	1.807.367,03	10,07%
CDI	1.142.637,99	6,37%



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%
Acumulado no ano					608.270,82	3,51%	3,40%	103,12%	

Acumulado no Ano



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de fevereiro / 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	2.281.982,00	0,00	71.609,15	2.270.014,00	59.641,15	2,61%	6,50%	-0,52%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.832.115,91	0,00	54.281,37	1.807.367,03	29.532,49	1,61%	0,29%	1,63%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	1.717.257,57	0,00	0,00	1.743.376,73	26.119,16	1,52%	1,45%	1,52%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.264.996,57	71.609,15	0,00	1.355.911,41	19.305,69	1,44%	1,44%	1,51%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.898.962,45	0,00	0,00	1.924.145,23	25.182,78	1,33%	1,41%	1,33%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.160.702,35	0,00	0,00	5.217.497,71	56.795,36	1,10%	0,18%	1,10%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.122.499,91	0,00	0,00	1.134.835,69	12.335,78	1,10%	0,18%	1,10%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1.334.751,35	0,00	0,00	1.348.967,75	14.216,40	1,07%	0,18%	1,07%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	919.005,58	0,00	0,00	928.125,53	9.119,95	0,99%	0,01%	0,99%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	158.564,28	54.281,37	0,00	214.512,46	1.666,81	0,78%	0,01%	0,97%
Total Renda Fixa					253.915,57	1,44%	1,33%	