

# Relatório Analítico dos Investimentos em abril de 2016



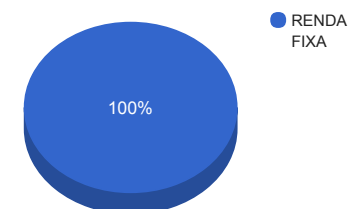
Carteira consolidada de investimentos - base (abril / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.386.726,31	7,46%	672	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.966.354,61	10,58%	723	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.339.822,63	28,73%	1.326	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.379.272,69	7,42%	36	1,93%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.161.408,91	6,25%	1.174	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2030	2.555.068,00	13,75%	18	5,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.783.122,02	9,59%	305	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	1.846.521,83	9,93%	143	0,19%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	949.262,11	5,11%	3.008	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	219.027,47	1,18%	844	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
		<b>TOTAL -</b>	<b>18.586.586,58</b>				

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

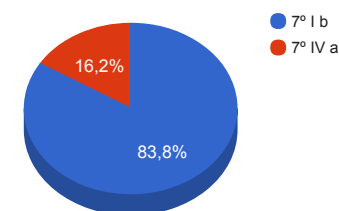
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	90,00%	15.571.775,17	83,78%	1.156.152,75
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	20,00%	0,00	0,00%	3.717.317,32
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	3.014.811,41	16,22%	2.561.164,56
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	929.329,33
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	929.329,33
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	929.329,33
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>155,00</b>	<b>18.586.586,58</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%	929.329,33
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	10,00%	0,00	0,00%	1.858.658,66
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	929.329,33
<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

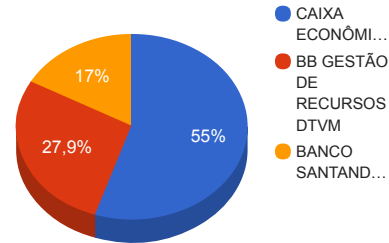


Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (abril / 2016)

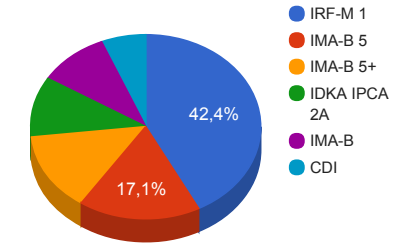
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	3,93%	14,06%	11,92%	16,99%	17,27%	35,51%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4,38%	14,64%	11,97%	17,22%	15,15%	23,24%	0,20%	5,266%	13,91%
IDKA IPCA 2 Anos	1,66%	6,90%	3,03%	9,15%	18,82%	33,12%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,66%	6,67%	3,55%	9,28%	17,85%	31,37%	0,20%	1,232%	3,20%
IMA-B 5	1,54%	6,97%	3,88%	9,83%	17,80%	32,16%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,53%	6,84%	3,82%	9,63%	17,30%	31,22%	0,20%	1,247%	3,52%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	1,52%	6,90%	3,84%	9,72%	17,62%	31,70%	0,10%	1,241%	3,51%
IPCA + 6,00% ao ano	1,08%	5,20%	3,40%	8,33%	15,78%	32,79%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,96%	5,44%	3,83%	8,61%	16,24%	33,66%	0,20%	0,070%	0,36%
IRF-M 1	1,07%	5,15%	3,45%	7,53%	14,67%	27,38%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,11%	5,15%	3,47%	7,48%	14,38%	26,61%	0,10%	0,179%	0,52%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,11%	5,15%	3,47%	7,49%	14,50%	26,91%	0,20%	0,173%	0,50%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1,06%	4,99%	3,34%	7,28%	14,19%	26,23%	0,40%	0,199%	0,52%
CDI	1,05%	4,34%	3,25%	6,67%	13,85%	26,83%	-	-	-
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,08%	4,37%	3,29%	6,70%	13,99%	27,17%	0,25%	0,033%	0,09%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,98%	4,18%	3,09%	6,52%	13,83%	27,05%	0,20%	0,027%	0,05%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	10.230.879,05	55,04%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	5.193.312,82	27,94%
BANCO SANTANDER	3.162.394,71	17,01%



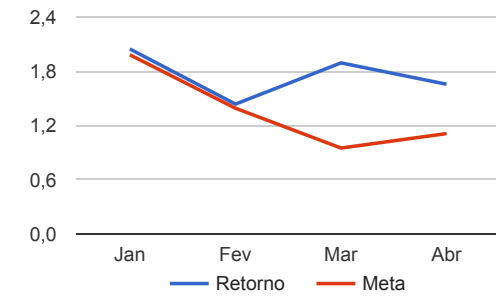
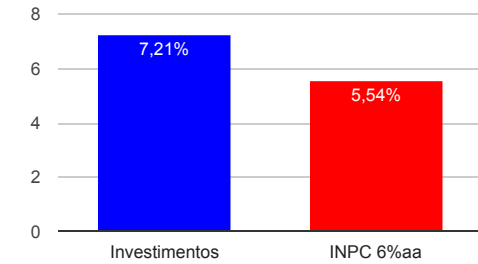
Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	7.880.504,23	42,40%
IMA-B 5	3.169.848,33	17,05%
IMA-B 5+	2.555.068,00	13,75%
IDKA IPCA 2A	1.966.354,61	10,58%
IMA-B	1.846.521,83	9,93%
CDI	1.168.289,58	6,29%



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%
Acumulado no ano					1.250.103,86	7,21%	5,54%	130,11%	

**Acumulado no Ano**



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de abril / 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	2.447.820,00	0,00	0,00	2.555.068,00	107.248,00	4,38%	5,27%	4,38%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.934.266,48	0,00	0,00	1.966.354,61	32.088,13	1,66%	1,23%	1,66%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.365.873,56	0,00	0,00	1.386.726,31	20.852,75	1,53%	1,25%	1,53%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	1.756.356,88	0,00	0,00	1.783.122,02	26.765,14	1,52%	1,24%	1,52%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.148.604,02	0,00	0,00	1.161.408,91	12.804,89	1,11%	0,18%	1,11%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.281.430,74	0,00	0,00	5.339.822,63	58.391,89	1,11%	0,17%	1,11%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	939.106,47	0,00	0,00	949.262,11	10.155,64	1,08%	0,03%	1,08%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1.364.763,59	0,00	0,00	1.379.272,69	14.509,10	1,06%	0,20%	1,06%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	216.898,65	0,00	0,00	219.027,47	2.128,82	0,98%	0,03%	0,98%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.828.905,91	0,00	0,00	1.846.521,83	17.615,92	0,96%	0,07%	0,96%
Total Renda Fixa					302.560,28	1,65%	1,15%	