

Relatório Analítico dos Investimentos em abril de 2016



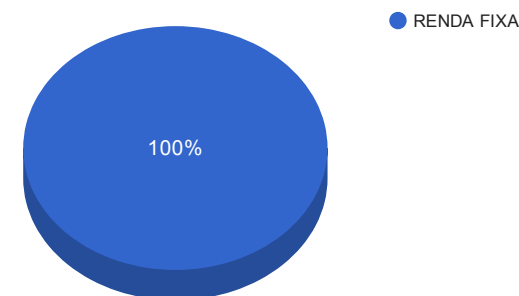
Carteira consolidada de investimentos - base (abril / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	6.353.329,96	33,17%	1.326	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	715.203,22	3,73%	545	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.205.542,20	6,29%	625	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.013.298,58	10,51%	723	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.134.200,79	16,36%	1.174	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	1.148.953,49	6,00%	259	0,07%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.497.522,22	18,26%	844	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.085.158,49	5,67%	749	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
		TOTAL -	19.153.208,95				

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

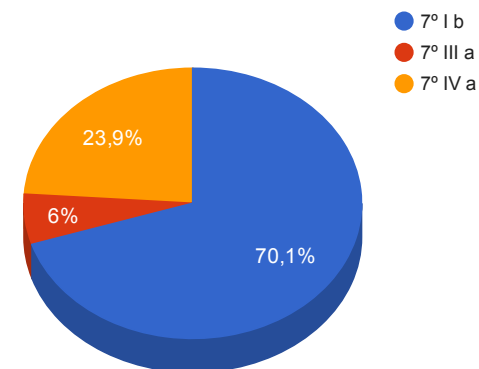
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	100,00%	13.421.574,75	70,07%	5.731.634,20
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	30,00%	1.148.953,49	6,00%	4.597.009,20
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	80,00%	10,00%	0,00	0,00%	1.915.320,90
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	4.582.680,71	23,93%	1.163.281,98
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	30,00%	10,00%	0,00	0,00%	1.915.320,90
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	10,00%	0,00	0,00%	1.915.320,90
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	957.660,45
Total Renda Fixa	100,00%	195,00	19.153.208,95	100,00%	

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	10,00%	0,00	0,00%	1.915.320,90
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	0,00	0,00%	2.872.981,34
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	957.660,45
Total Renda Variável	30,00%	30,00	0,00	0,00%	

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 IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,93%	13,93%	11,93%	16,76%	15,56%	33,21%	0,20%	3,879%	9,88%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,90%	13,93%	11,89%	16,80%	16,85%	34,63%	0,20%	3,855%	9,80%

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%	-	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,55%	6,92%	3,86%	9,71%	17,40%	31,12%	0,20%	1,248%	3,51%

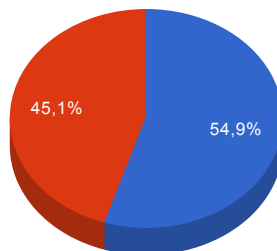
IRF-M 1	1,07%	5,15%	3,45%	7,53%	14,67%	27,38%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,11%	5,15%	3,47%	7,48%	14,38%	26,61%	0,10%	0,179%	0,52%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,11%	5,15%	3,47%	7,49%	14,50%	26,91%	0,20%	0,173%	0,50%

CDI	1,05%	4,34%	3,25%	6,67%	13,85%	26,83%	-	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,07%	4,35%	3,27%	6,67%	13,91%	26,96%	0,20%	0,022%	0,07%
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)

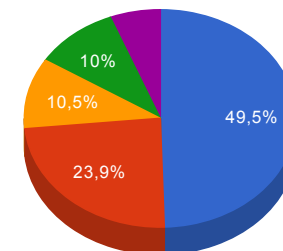
Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	10.509.178,30	54,87%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	8.644.030,65	45,13%

- BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM
- CAIXA ECONÔMICA FEDERAL



Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	9.487.530,75	49,53%
CDI	4.582.680,71	23,93%
IDKA IPCA 2A	2.013.298,58	10,51%
IMA-B	1.920.745,42	10,03%
IMA-B 5	1.148.953,49	6,00%

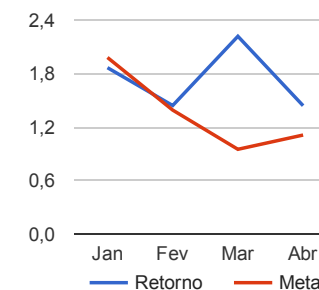
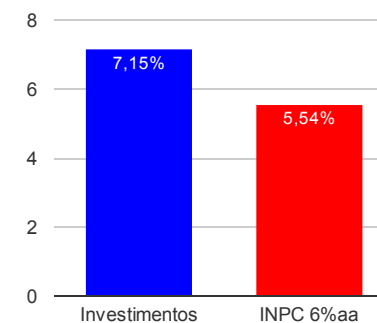
- IRF-M 1
- CDI
- IDKA IPCA 2A
- IMA-B
- IMA-B 5



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	17.381.863,81	198.245,05	346.571,88	17.557.828,89	324.291,91	1,87%	1,98%	94,20%	1,02%
Fevereiro	17.557.828,89	589.552,56	98.394,09	18.309.058,72	260.071,36	1,44%	1,39%	103,33%	1,13%
Março	18.309.058,72	5.777.636,67	5.510.993,56	18.987.665,34	411.963,51	2,22%	0,95%	232,90%	1,06%
Abril	18.987.665,34	0,00	107.756,99	19.153.208,95	273.300,60	1,44%	1,11%	130,08%	0,69%
Acumulado no ano					1.269.627,38	7,15%	5,54%	128,93%	

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 IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.159.934,41	0,00	0,00	1.205.542,20	45.607,79	3,93%	3,88%	3,93%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	688.330,18	0,00	0,00	715.203,22	26.873,04	3,90%	3,85%	3,90%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.980.444,39	0,00	0,00	2.013.298,58	32.854,19	1,66%	1,23%	1,66%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.131.423,81	0,00	0,00	1.148.953,49	17.529,68	1,55%	1,25%	1,55%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.206.428,54	0,00	107.756,99	3.134.200,79	35.529,24	1,11%	0,18%	1,11%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.283.855,20	0,00	0,00	6.353.329,96	69.474,76	1,11%	0,17%	1,11%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.073.720,42	0,00	0,00	1.085.158,49	11.438,07	1,07%	0,02%	1,07%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.463.528,39	0,00	0,00	3.497.522,22	33.993,83	0,98%	0,03%	0,98%
Total Renda Fixa					273.300,60	1,44%	0,69%	