

Relatório Analítico dos Investimentos em maio de 2016



Carteira consolidada de investimentos - base (maio / 2016)

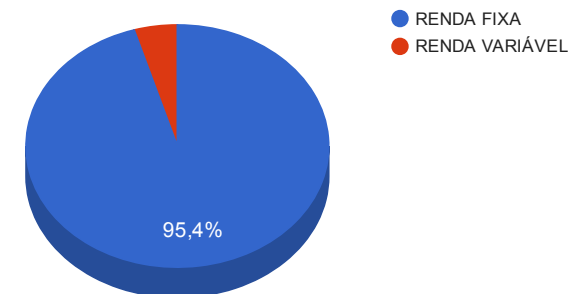
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
TÍTULOS PÚBLICOS			3.993.139,74	11,21%			Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.038.464,27	2,92%	34	1,46%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.255.976,39	6,33%	1.331	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2016 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2016	4.334.680,00	12,17%	103	0,56%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.852.371,77	10,81%	1.176	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	865.698,55	2,43%	193	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2016 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2016	2.693.730,00	7,56%	154	0,58%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	720.365,34	2,02%	639	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	138.496,17	0,39%	198	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.054.674,20	11,38%	686	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.514.901,63	9,87%	579	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	127.932,05	0,36%	89	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	94.823,02	0,27%	57	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADESCO PREMIUM FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	2.582.486,47	7,25%	385	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	D+3	Não há	2.325.550,82	6,53%	393	1,16%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.385.759,55	3,89%	748	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER PETROBRÁS PLUS FIC AÇÕES	D+4	Não há	370.192,10	1,04%	1.975	1,45%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA BRASIL IPCA VII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+0	22/11/2016	359.092,80	1,01%	20	0,37%	Artigo 8º, Inciso IV
CAIXA BRASIL IPCA V FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+0	08/11/2016	913.362,00	2,56%	23	0,98%	Artigo 8º, Inciso IV
		TOTAL -	35.621.696,87				

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

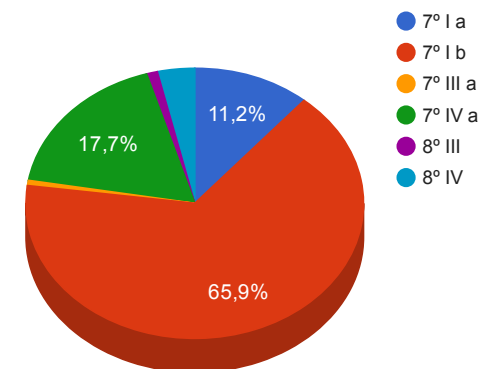
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	15,00%	3.993.139,74	11,21%	1.350.114,79
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	85,00%	23.469.358,32	65,89%	6.809.084,02
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	40,00%	222.755,07	0,63%	14.025.923,68
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	6.293.796,84	17,67%	4.392.712,22
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.781.084,84
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.781.084,84
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.781.084,84
Total Renda Fixa	100,00%	185,00	33.979.049,97	95,39%	

Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.781.084,84
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	5,00%	370.192,10	1,04%	1.410.892,74
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	1.272.454,80	3,57%	508.630,04
Total Renda Variável	30,00%	15,00	1.642.646,90	4,61%	

Distribuição por Segmento



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
Selic	1,11%	5,50%	3,36%	6,73%	14,00%	27,24%	-	-	-
BRDESCO PREMIUM FI REFERENCIADO DI	1,12%	5,47%	3,35%	6,70%	14,00%	27,41%	0,20%	0,005%	0,02%
CDI	1,11%	5,50%	3,36%	6,72%	13,98%	27,14%	-	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,10%	5,51%	3,39%	6,73%	14,05%	27,30%	0,20%	0,005%	0,07%
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	0,84%	8,11%	3,73%	10,12%	14,27%	28,00%	0,30%	0,949%	3,58%
IRF-M 1	1,07%	6,27%	3,43%	7,53%	14,79%	27,53%	-	-	-
BRDESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1,06%	6,26%	3,44%	7,48%	14,58%	27,07%	0,20%	0,087%	0,78%
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%	-	-	-
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%	3,49%
IDKA IPCA 2 Anos	0,63%	7,57%	2,45%	9,61%	16,89%	32,04%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,34%	6,02%	3,09%	7,85%	15,89%	-	0,20%	-	1,44%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,80%	7,47%	3,06%	9,58%	16,70%	31,05%	0,20%	1,279%	3,07%
IMA Geral	0,42%	10,85%	6,86%	11,97%	14,11%	27,45%	-	-	-
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	0,47%	10,79%	6,91%	11,85%	13,68%	26,65%	0,25%	1,959%	5,11%

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
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,38%	10,67%	6,78%	11,82%	13,49%	26,53%	0,20%	1,786%	4,86%
IMA-B	-0,10%	13,95%	9,34%	15,68%	14,21%	29,84%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2016 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,45%	2,79%	3,09%	4,50%	-	-	0,20%	-	-
CAIXA BRASIL 2016 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,45%	2,64%	3,09%	4,35%	-	-	0,20%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,14%	13,77%	9,30%	15,43%	12,56%	27,54%	0,20%	3,488%	9,82%

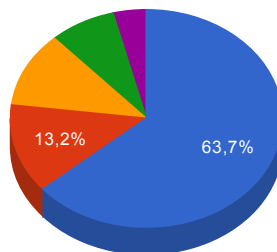
Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (maio / 2016)

	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%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA VII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1,23%	6,83%	3,46%	8,54%	16,11%	33,17%	0,20%	0,232%	0,44%
CAIXA BRASIL IPCA V FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1,12%	6,95%	3,58%	8,59%	15,96%	32,98%	0,20%	0,155%	0,33%
PETROBRAS ON - PETR3	-23,29%	18,79%	38,50%	8,18%	-23,17%	-35,32%	-	-	-
SANTANDER PETROBRÁS PLUS FIC AÇÕES	-23,53%	18,87%	37,71%	8,35%	-23,70%	-37,48%	3,00%	23,793%	66,73%

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

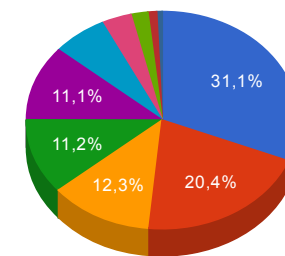
Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	22.696.588,90	63,72%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	4.718.070,32	13,24%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	3.993.139,74	11,21%
BANCO BRADESCO	2.805.241,54	7,88%
BANCO SANTANDER	1.408.656,37	3,95%

- CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
- BB GESTÃO DE RECURSO...
- TESOURO NACIONAL (TÍTULOS P...
- BANCO BRADESCO
- BANCO SANTANDER



Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5	11.083.084,20	31,11%
IRF-M 1	7.274.744,48	20,42%
IDKA IPCA 2A	4.380.600,18	12,30%
TÍTULOS PÚBLICOS	3.993.139,74	11,21%
CDI	3.968.246,02	11,14%
GESTÃO LIVRE	2.325.550,82	6,53%
MULTIMERCADO	1.272.454,80	3,57%
IMA-B	720.365,34	2,02%
AÇÕES - SETORIAIS	370.192,10	1,04%
IMA-GERAL	233.319,19	0,65%

- IMA-B 5
- IRF-M 1
- IDKA IPCA 2A
- TÍTULOS PÚBLICOS
- CDI
- GESTÃO LIVRE
- MULTIMER...
- IMA-B
- AÇÕES - SETORIAIS
- IMA-GERAL



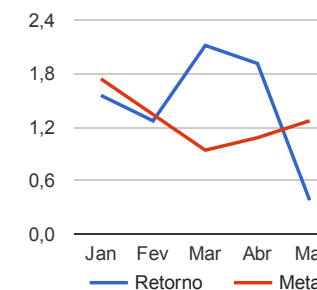
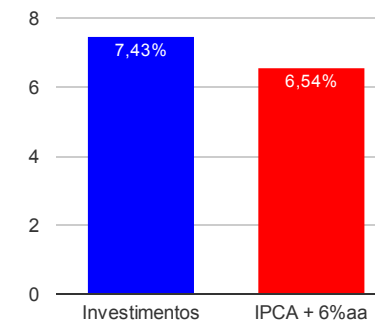
Carteira de Títulos Públicos - base (maio / 2016)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde.	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	GAP (Atual - Pago)
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	02/03/2009	630	1.104,73659	2.782,899065	695.984,05	1.753.226,41	1.057.242,36
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	11/08/2004	500	1.487,344824	2.908,978350	743.672,41	1.454.489,18	710.816,76
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	02/12/2004	270	1.494,58526	2.908,978350	403.538,02	785.424,15	381.886,13

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	30.803.950,98	4.171.192,91	2.700.000,00	32.776.920,78	501.776,89	1,55%	1,74%	89,38%	1,13%
Fevereiro	32.776.920,78	1.338.931,86	1.207.290,88	33.326.255,10	417.693,34	1,27%	1,34%	94,42%	2,13%
Março	33.326.255,10	734.958,21	690.000,00	34.077.050,51	705.837,20	2,12%	0,94%	224,49%	1,40%
Abril	34.077.050,51	938.403,18	490.000,00	35.185.926,08	660.472,39	1,91%	1,08%	177,73%	1,08%
Mai	35.185.926,08	781.358,91	480.000,00	35.621.696,87	134.411,88	0,38%	1,27%	29,81%	0,97%
Acumulado no ano					2.420.191,70	7,43%	6,54%	113,74%	

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(%)	
CAIXA BRASIL 2016 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.272.688,00	0,00	0,00	4.334.680,00	61.992,00	1,45%	-	1,45%	
CAIXA BRASIL 2016 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.655.220,00	0,00	0,00	2.693.730,00	38.510,00	1,45%	-	1,45%	
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	854.232,27	0,00	0,00	865.698,55	11.466,28	1,34%	-	1,34%	
BRADESCO PREMIUM FI REFERENCIADO DI	2.553.880,63	0,00	0,00	2.582.486,47	28.605,84	1,12%	0,00%	1,12%	
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.370.617,98	0,00	0,00	1.385.759,55	15.141,57	1,10%	0,01%	1,10%	
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	126.584,59	0,00	0,00	127.932,05	1.347,46	1,06%	0,09%	1,06%	
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.786.972,71	26.000,00	0,00	3.852.371,77	39.399,06	1,03%	0,09%	1,04%	
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1.028.167,80	0,00	0,00	1.038.464,27	10.296,47	1,00%	0,09%	1,00%	
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	2.306.113,32	0,00	0,00	2.325.550,82	19.437,50	0,84%	0,95%	0,84%	
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.487.170,02	0,00	0,00	3.514.901,63	27.731,61	0,80%	1,28%	0,80%	
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.023.394,63	0,00	0,00	4.054.674,20	31.279,57	0,78%	0,91%	0,78%	
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.963.121,72	755.358,91	480.000,00	2.255.976,39	17.495,76	0,64%	0,08%	1,05%	
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	94.382,73	0,00	0,00	94.823,02	440,29	0,47%	1,96%	0,47%	
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	137.965,67	0,00	0,00	138.496,17	530,50	0,38%	1,79%	0,38%	
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	721.358,10	0,00	0,00	720.365,34	-992,76	-0,14%	3,49%	-0,14%	
TÍTULOS PÚBLICOS	4.062.014,50	0,00	0,00	3.993.139,74	-68.874,76	-1,70%	-	-	
Total Renda Fixa						233.806,39	0,69%	0,63%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IPCA VII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	354.723,20	0,00	0,00	359.092,80	4.369,60	1,23%	0,23%	1,23%
CAIXA BRASIL IPCA V FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	903.229,00	0,00	0,00	913.362,00	10.133,00	1,12%	0,16%	1,12%
SANTANDER PETROBRÁS PLUS FIC AÇÕES	484.089,21	0,00	0,00	370.192,10	-113.897,11	-23,53%	23,79%	-23,53%
Total Renda Variável					-99.394,51	-4,86%	5,50%	