

# Relatório Analítico dos Investimentos em maio de 2016

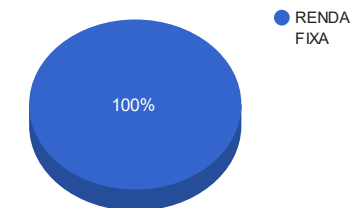
Carteira consolidada de investimentos - base (maio / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			148.102,30	0,41%			Artigo 20
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	5.163.284,36	14,19%	34	7,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	15.688.802,62	43,13%	1.331	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.397.081,28	6,59%	1.176	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.411.759,20	3,88%	639	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.100.886,54	3,03%	194	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.418.298,06	3,90%	686	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.064.340,27	5,67%	472	0,10%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	4.652.179,35	12,79%	828	0,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	495.987,37	1,36%	148	0,28%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	1.835.822,42	5,05%	2.164	0,22%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
		<b>TOTAL -</b>	<b>36.376.543,77</b>				

Enquadramentos na Resolução 3.922 / 4.392 / 4.604 e Política de Investimentos - base (maio / 2016)

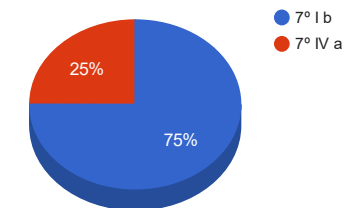
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	0,00%	27.180.112,06	74,72%	-27.180.112,06
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	0,00%	9.048.329,41	24,87%	-9.048.329,41
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>36.228.441,47</b>	<b>99,59%</b>	

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	

Distribuição por Artigo / Resolução

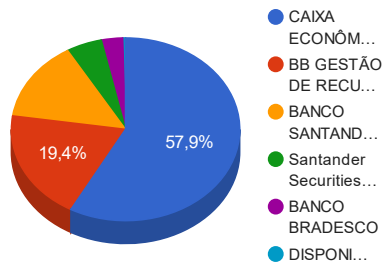


Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (maio / 2016)

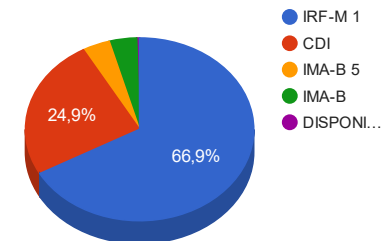
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	1,11%	5,50%	3,36%	6,72%	13,98%	27,14%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO	1,14%	5,37%	3,27%	6,61%	13,95%	27,37%	0,20%	0,043%	0,17%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,08%	5,62%	3,38%	6,81%	13,75%	26,63%	0,20%	0,010%	0,23%
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	1,05%	5,42%	3,25%	6,64%	13,59%	26,23%	0,50%	0,052%	0,18%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	1,04%	5,13%	3,14%	6,28%	13,03%	25,06%	0,80%	0,036%	0,01%
IRF-M 1	1,07%	6,27%	3,43%	7,53%	14,79%	27,53%	-	-	-
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,06%	6,24%	3,42%	7,46%	14,54%	26,97%	0,20%	0,087%	0,77%
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%	3,51%
IMA-B	-0,10%	13,95%	9,34%	15,68%	14,21%	29,84%	-	-	-
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%	9,79%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	21.079.187,52	57,95%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	7.049.260,63	19,38%
BANCO SANTANDER	5.163.284,36	14,19%
Santander Securities Services	1.835.822,42	5,05%
BANCO BRADESCO	1.100.886,54	3,03%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	148.102,30	0,41%

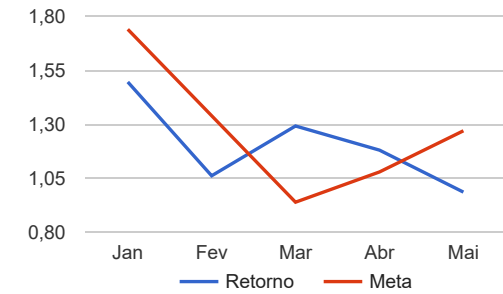
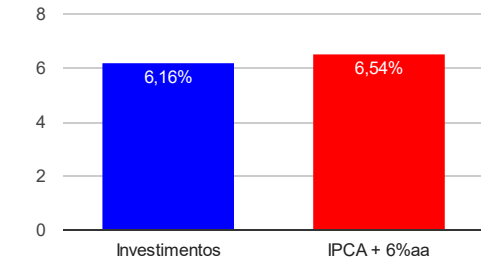


Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	24.350.054,80	66,94%
CDI	9.048.329,41	24,87%
IMA-B 5	1.418.298,06	3,90%
IMA-B	1.411.759,20	3,88%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	148.102,30	0,41%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

**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(%)
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO	4.599.695,99	0,00	0,00	4.652.179,35	52.483,36	1,14%	0,04%	1,14%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.042.305,25	0,00	0,00	2.064.340,27	22.035,02	1,08%	0,01%	1,08%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.089.366,53	0,00	0,00	1.100.886,54	11.520,01	1,06%	0,09%	1,06%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	15.525.374,35	0,00	0,00	15.688.802,62	163.428,27	1,05%	0,08%	1,05%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.372.417,73	0,00	0,00	2.397.081,28	24.663,55	1,04%	0,09%	1,04%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	5.112.089,89	0,00	0,00	5.163.284,36	51.194,47	1,00%	0,09%	1,00%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.407.356,68	0,00	0,00	1.418.298,06	10.941,38	0,78%	0,91%	0,78%
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	1.321.967,06	500.000,00	0,00	1.835.822,42	13.855,36	0,76%	0,05%	1,05%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	429.369,53	568.014,74	507.064,12	495.987,37	5.667,22	0,57%	0,04%	1,04%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.413.704,80	0,00	0,00	1.411.759,20	-1.945,60	-0,14%	3,49%	-0,14%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>353.843,04</b>	<b>0,99%</b>	<b>0,24%</b>	