

Relatório Analítico dos Investimentos em abril de 2016



Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

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
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			2.661.985,35	0,82%			Artigo 20
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	21.221.299,26	6,50%	305	1,54%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	38.816.234,25	11,88%	723	0,64%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADERCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	D+1	16/05/2019	11.234.478,07	3,44%	11	15,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	54.982.736,20	16,83%	672	1,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	13.908.056,53	4,26%	13	15,66%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADERCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	35.957.502,36	11,01%	88	3,55%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	23.822.691,00	7,29%	78	2,27%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BTG PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA	D+0 ou D+1	Não há	12.023.082,00	3,68%	12	8,43%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	12.892.298,20	3,95%	95	3,67%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	53.352.303,11	16,33%	844	0,86%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+30 a D+2880	Não há	6.009.958,41	1,84%	51	1,97%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FIAÇÕES	D+4	Não há	6.117.948,39	1,87%	22.526	1,35%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	23/08/2017	1.080.420,00	0,33%	116	0,33%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FIAÇÕES	D+4	Não há	4.983.062,56	1,53%	3.424	2,00%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	D+5	Não há	4.104.434,41	1,26%	22	4,17%	Artigo 8º, Inciso IV
CAIXA BRASIL IPCA VIII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+0	06/12/2016	1.767.657,00	0,54%	21	2,00%	Artigo 8º, Inciso IV
CAIXA BRASIL IPCA III FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+0	31/10/2016	3.598.680,00	1,10%	29	3,97%	Artigo 8º, Inciso IV
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	6.816.826,11	2,09%	235	4,93%	Artigo 8º, Inciso IV
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	966.038,70	0,30%	19	1,02%	Artigo 8º, Inciso V
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	Não se aplica	Não se aplica	3.660.985,17	1,12%	98	0,71%	Artigo 8º, Inciso V
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	Não se aplica	Não se aplica	1.198.671,45	0,37%		0,77%	Artigo 8º, Inciso VI

Carteira consolidada de investimentos - base (abril / 2016)

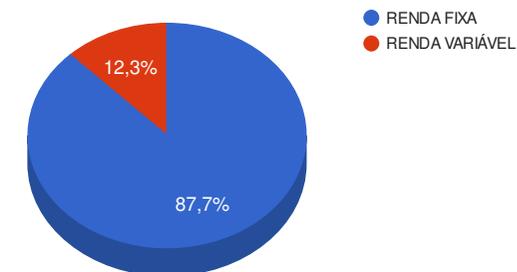
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	Não se aplica	Não se aplica	5.445.191,27	1,67%			Artigo 8º, Inciso VI
		TOTAL -	326.622.539,80				

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

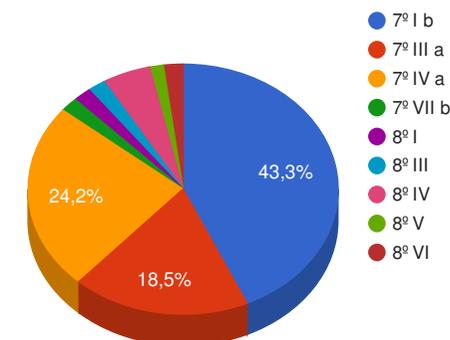
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	80,00%	140.162.804,31	42,91%	121.135.227,53
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	50,00%	59.780.193,36	18,30%	103.531.076,54
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	78.267.683,31	23,96%	19.719.078,63
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	16.331.126,99
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	16.331.126,99
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	6.009.958,41	1,84%	10.321.168,58
Total Renda Fixa	100,00%	175,00	284.220.639,39	87,02%	

Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	5,00%	6.117.948,39	1,87%	10.213.178,60
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	10,00%	6.063.482,56	1,86%	26.598.771,42
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	16.287.597,52	4,99%	43.529,47
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	4.627.023,87	1,42%	11.704.103,12
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	6.643.862,72	2,03%	9.687.264,27
Total Renda Variável	30,00%	30,00	39.739.915,06	12,17%	

Distribuição por Segmento



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%	-	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	4,08%	13,71%	11,74%	16,53%	16,62%	34,90%	0,20%	4,057%	9,81%
BRADESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	2,01%	8,62%	4,52%	8,24%	-	-	0,20%	1,892%	-
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%	-	-	-
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	2,47%	9,86%	5,56%	12,35%	18,23%	31,69%	0,40%	1,893%	4,60%
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 I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,53%	11,95%	9,61%	16,37%	17,57%	33,94%	0,15%	3,824%	8,83%
BTG PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA	0,91%	5,28%	3,75%	5,32%	1,78%	17,37%	0,15%	0,069%	4,10%
IRF-M 1	1,07%	5,15%	3,45%	7,53%	14,67%	27,38%	-	-	-
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1,07%	5,14%	3,43%	7,43%	14,36%	26,94%	0,20%	0,183%	0,78%
CDI	1,05%	4,34%	3,25%	6,67%	13,85%	26,83%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,98%	4,18%	3,09%	6,52%	13,83%	27,05%	0,20%	0,027%	0,05%
IPCA	0,61%	3,25%	1,95%	5,29%	9,28%	18,21%	-	-	-

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
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	2,53%	10,11%	7,17%	13,93%	17,45%	33,55%	0,20%	2,673%	6,91%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDIV	12,39%	32,59%	46,56%	17,92%	-8,30%	-20,59%	-	-	-
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	3,42%	7,43%	10,76%	9,74%	3,42%	8,19%	1,72%	6,932%	15,45%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FIAÇÕES	1,41%	-8,43%	-2,78%	-8,62%	-12,65%	-7,40%	3,00%	11,005%	20,79%
Ibovespa	7,70%	24,36%	33,42%	17,53%	-4,12%	4,42%	-	-	-
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FIAÇÕES	2,59%	-8,72%	-0,76%	-7,25%	-11,42%	-7,51%	4,00%	11,407%	19,91%
IFIX	4,65%	10,29%	17,55%	8,67%	11,24%	15,11%	-	-	-
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	5,78%	-	27,46%	11,47%	9,05%	5,35%	0,40%	-	20,93%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	-	-	-	-	-	-	0,30%	-	-
IPCA + 6,00% ao ano	1,08%	5,20%	3,40%	8,33%	15,78%	32,79%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA III FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	0,89%	5,67%	4,09%	8,71%	15,96%	32,89%	0,20%	0,063%	0,34%
CAIXA BRASIL IPCA VIII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	0,83%	5,77%	4,12%	8,87%	16,22%	33,15%	0,15%	0,157%	0,45%
CDI	1,05%	4,34%	3,25%	6,67%	13,85%	26,83%	-	-	-
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	1,29%	5,28%	2,97%	7,91%	17,95%	36,47%	2,00%	1,012%	2,14%
IPCA	0,61%	3,25%	1,95%	5,29%	9,28%	18,21%	-	-	-
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FIEM QUOTAS DE FIP	-	-	-	-	-	-	2,00%	0,002%	-
S&P 500	0,27%	1,05%	6,45%	-0,68%	-0,97%	9,63%	-	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	1,23%	3,61%	10,22%	5,35%	11,78%	37,55%	1,00%	4,839%	16,69%

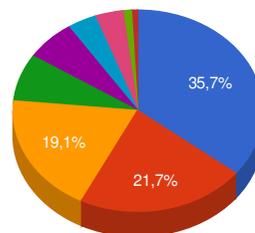
Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (abril / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Não Possui	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,50%	0,028%	39,15%

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

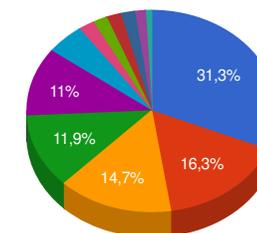
Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	116.515.985,24	35,67%
BANCO BRADESCO	71.014.671,43	21,74%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	62.395.531,90	19,10%
WESTERN ASSET	24.829.317,05	7,60%
BANCO SANTANDER	21.221.299,26	6,50%
GERAÇÃO FUTURO	12.299.682,40	3,77%
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS	12.023.082,00	3,68%
PÁTRIA INVESTIMENTOS	3.660.985,17	1,12%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	2.661.985,35	0,82%

- BB GESTÃO DE RECURS...
- BANCO BRADESCO
- CAIXA ECONÔMIC...
- WESTERN ASSET
- BANCO SANTANDER
- GERAÇÃO FUTURO
- BTG PACTUAL...
- PÁTRIA INVESTIM...
- DISPONIBI...



Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5	102.135.173,99	31,27%
CDI	53.352.303,11	16,33%
IMA-B	47.949.467,27	14,68%
IDKA IPCA 2A	38.816.234,25	11,88%
IRF-M 1	35.957.502,36	11,01%
MULTIMERCADO	16.287.597,52	4,99%
FUNDO IMOBILIÁRIO	6.643.862,72	2,03%
AÇÕES - INDEXADO	6.117.948,39	1,87%
AÇÕES - SETORIAIS	6.063.482,56	1,86%
CRÉDITO PRIVADO	6.009.958,41	1,84%
FIP	4.627.023,87	1,42%
CVS	2.661.985,35	0,82%

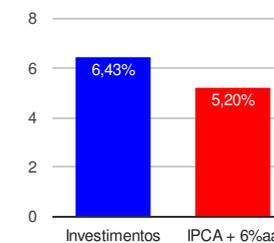
- IMA-B 5
- CDI
- IMA-B
- IDKA IPCA 2A
- IRF-M 1
- MULTIMER...
- FUNDO IMOBILIÁRIO
- AÇÕES - INDEXADO
- AÇÕES - SETORIAIS
- CRÉDITO PRIVADO
- FIP
- CVS



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	308.051.335,34	6.737.337,95	5.182.608,69	314.380.496,84	4.774.432,24	1,54%	1,74%	88,66%	2,27%
Fevereiro	314.380.496,84	18.082.507,36	19.015.521,99	318.569.760,65	5.122.278,44	1,63%	1,34%	121,21%	2,16%
Março	318.569.760,65	74.303.565,24	75.371.269,37	321.768.125,22	4.266.068,70	1,34%	0,94%	142,13%	2,36%
Abril	321.768.125,22	4.872.718,61	8.379.525,53	323.960.554,45	5.699.236,15	1,77%	1,08%	164,56%	1,67%
Acumulado no ano					19.862.015,53	6,43%	5,20%	123,70%	

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(%)
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	22.889.834,91	0,00	0,00	23.822.691,00	932.856,09	4,08%	4,06%	4,08%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12.453.216,34	0,00	0,00	12.892.298,20	439.081,86	3,53%	3,82%	3,53%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	5.861.942,50	0,00	0,00	6.009.958,41	148.015,91	2,53%	2,67%	2,53%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	13.573.343,80	0,00	0,00	13.908.056,53	334.712,73	2,47%	1,89%	2,47%
BRDESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	11.012.990,46	0,00	0,00	11.234.478,07	221.487,61	2,01%	1,89%	2,01%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	38.182.807,46	0,00	0,00	38.816.234,25	633.426,79	1,66%	1,23%	1,66%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	54.155.938,07	0,00	0,00	54.982.736,20	826.798,13	1,53%	1,25%	1,53%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	20.902.761,83	0,00	0,00	21.221.299,26	318.537,43	1,52%	1,24%	1,52%
BRDESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	34.585.374,50	1.000.000,00	0,00	35.957.502,36	372.127,86	1,05%	0,18%	1,07%
BTG PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA	11.914.656,00	0,00	0,00	12.023.082,00	108.426,00	0,91%	0,07%	0,91%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	54.615.656,65	3.872.718,61	5.665.000,00	53.352.303,11	528.927,85	0,90%	0,03%	0,98%
Total Renda Fixa					4.864.398,26	1,74%	1,27%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	1.140.317,72	0,00	10.040,18	1.198.671,45	68.393,91	6,00%	-	6,03%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	5.261.138,95	0,00	42.500,00	5.445.191,27	226.552,32	4,31%	-	-
ITAÚ FOF RPI VALOR FIC AÇÕES	2.561.776,79	0,00	2.661.985,35	0,00	100.208,56	3,91%	8,34%	5,31%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.044.647,00	0,00	0,00	1.080.420,00	35.773,00	3,42%	6,93%	3,42%
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FIAÇÕES	5.963.722,42	0,00	0,00	6.117.948,39	154.225,97	2,59%	11,41%	2,59%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FIAÇÕES	4.913.858,66	0,00	0,00	4.983.062,56	69.203,90	1,41%	11,01%	1,41%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	4.051.967,82	0,00	0,00	4.104.434,41	52.466,59	1,29%	1,01%	1,29%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	6.733.946,54	0,00	0,00	6.816.826,11	82.879,57	1,23%	4,84%	1,23%
CAIXA BRASIL IPCA III FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	3.566.972,00	0,00	0,00	3.598.680,00	31.708,00	0,89%	0,06%	0,89%
CAIXA BRASIL IPCA VIII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.753.189,00	0,00	0,00	1.767.657,00	14.468,00	0,83%	0,16%	0,83%
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	3.661.056,12	0,00	0,00	3.660.985,17	-70,95	0,00%	0,00%	-0,00%
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA FIP	967.009,68	0,00	0,00	966.038,70	-970,98	-0,10%	0,03%	-0,10%
				Total Renda Variável	834.837,89	2,01%	5,13%	

