

Relatório Analítico dos Investimentos em janeiro 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 (janeiro / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.608.399,47	1,20%	1.158	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	21.709.902,42	7,21%	641	0,52%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2016	31.803.840,00	10,57%	85	4,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	22.960.398,77	7,63%	1.287	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	40.250.010,01	13,37%	665	0,74%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	21.804.955,60	7,25%	507	0,84%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	10.594.095,87	3,52%	43	1,80%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1901	Não há	1.496.707,22	0,50%	7	6,18%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	11.191.430,79	3,72%	484	0,58%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	16/05/2023	9.270.614,03	3,08%	52	3,97%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	2.128.825,78	0,71%	60	4,97%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	36.476.127,21	12,12%	753	0,85%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	15.996.123,00	5,32%	388	0,25%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	9.821.729,32	3,26%	18	3,38%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	12.920.695,91	4,29%	71	3,49%	Artigo 7º, Inciso VI
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	12.013.607,10	3,99%	27	6,22%	Artigo 7º, Inciso VI
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	1.595.476,86	0,53%	134	1,94%	Artigo 8º, Inciso III
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	3.018.986,99	1,00%	25	4,78%	Artigo 8º, Inciso III
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+180	Não há	5.230.362,84	1,74%	63	1,75%	Artigo 8º, Inciso IV
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	2.503.934,76	0,83%	19	26,99%	Artigo 8º, Inciso IV
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	7.982.885,14	2,65%	17	11,45%	Artigo 8º, Inciso V
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	6.691.269,16	2,22%	8	14,08%	Artigo 8º, Inciso V

Carteira consolidada de investimentos - base (janeiro / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CSHG BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	Não se aplica	Não se aplica	787.247,73	0,26%			Artigo 8º, Inciso VI
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	Não se aplica	Não se aplica	9.083.738,40	3,02%			Artigo 8º, Inciso VI
Total			300.941.364,38				

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

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	100,00%	142.137.506,27	47,23%	158.803.858,11
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	30,00%	12.090.803,09	4,02%	78.191.606,22
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	84.884.850,13	28,21%	5.397.559,18
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	11,00%	24.934.303,01	8,29%	8.169.247,07
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	4,00%	0,00	0,00%	12.037.654,58
Total Renda Fixa	100,00%	175,00	264.047.462,50	87,74%	

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	4.614.463,85	1,53%	40.526.740,81
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	7.734.297,60	2,57%	7.312.770,62
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	14.674.154,30	4,88%	372.913,92
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	9.870.986,13	3,28%	5.176.082,09
Total	30,00%	30,00	36.893.901,88	12,26%	

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDKA IPCA 2 Anos	3,76%	3,76%	5,94%	9,76%	18,43%	36,00%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,02%	3,02%	5,53%	8,92%	16,60%	33,43%	0,20%	1,787%	3,03%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,87%	2,87%	5,42%	8,88%	16,63%	33,70%	0,20%	1,673%	2,93%
IMA-B 5	2,97%	2,97%	5,73%	8,70%	16,49%	33,78%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,91%	2,91%	5,59%	8,36%	15,89%	32,79%	0,20%	1,694%	3,34%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2,84%	2,84%	-4,37%	-2,47%	2,54%	17,59%	0,70%	1,369%	7,89%
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2,50%	2,50%	4,69%	5,68%	-	-	0,97%	1,692%	-
IMA-B	1,91%	1,91%	4,53%	3,17%	7,61%	30,43%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,57%	1,57%	4,25%	5,53%	-	-	0,20%	0,499%	-
IPCA + 7,00% ao ano	1,82%	1,82%	5,01%	8,50%	18,36%	35,69%	-	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1,39%	1,39%	4,28%	7,59%	15,65%	-	1,65%	0,115%	0,37%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-0,21%	-0,21%	-0,30%	2,98%	12,35%	28,65%	0,00%	-	-
IPCA + 6,00% ao ano	1,74%	1,74%	4,77%	7,99%	17,27%	33,18%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,90%	1,90%	5,56%	3,94%	7,97%	31,05%	0,15%	2,468%	8,95%
IRF-M 1	1,64%	1,64%	3,94%	7,40%	13,65%	26,52%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,62%	1,62%	3,87%	7,21%	13,28%	25,64%	0,10%	0,343%	0,57%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,62%	1,62%	3,89%	7,30%	13,40%	26,01%	0,20%	0,346%	0,55%

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

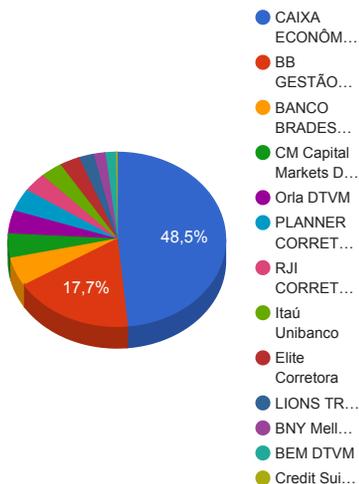
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA	1,27%	1,27%	3,27%	4,91%	10,71%	18,61%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,41%	1,41%	3,24%	5,26%	-	-	0,40%	0,502%	-
Selic	1,06%	1,06%	3,31%	6,78%	13,40%	25,88%	-	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,05%	1,05%	3,30%	6,79%	13,48%	26,11%	0,20%	0,005%	0,04%
CDI	1,05%	1,05%	3,31%	6,78%	13,38%	25,75%	-	-	-
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	1,26%	1,26%	3,88%	7,70%	14,89%	28,09%	0,75%	6,228%	6,86%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,05%	1,05%	3,29%	6,80%	13,45%	25,91%	0,20%	0,014%	0,08%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,16%	1,16%	3,34%	6,56%	13,01%	25,35%	0,20%	0,066%	0,23%

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

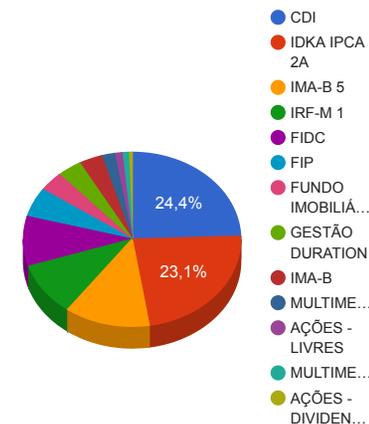
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	1,05%	1,05%	3,31%	6,78%	13,38%	25,75%	-	-	-
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	1,05%	1,05%	3,98%	8,73%	17,73%	36,38%	1,00%	16,151%	13,40%
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	0,53%	0,53%	2,78%	5,96%	14,20%	30,26%	0,55%	0,506%	1,04%
IDIV	-9,53%	-9,53%	-19,54%	-28,55%	-26,10%	-41,99%	-	-	-
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	-2,56%	-2,56%	-2,85%	-6,82%	-1,32%	-5,66%	2,00%	8,770%	13,14%
Ibovespa	-6,79%	-6,79%	-11,91%	-20,56%	-13,86%	-15,18%	-	-	-
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,53%	0,53%	-2,39%	-11,45%	-3,82%	-7,68%	1,85%	7,884%	13,39%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	12,20%	12,20%	12,42%	13,64%	11,51%	12,18%	0,00%	20,922%	12,67%
CSHG BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	-2,80%	-2,80%	-	-	-	-	0,60%	-	16,61%
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	-	-	-	-	-	-	1,35%	-	0,00%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	145.946.654,79	48,50%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	53.129.023,51	17,65%
BANCO BRADESCO	15.996.123,00	5,32%
CM Capital Markets DTVM	13.510.314,32	4,49%
Orla DTVM	12.920.695,91	4,29%
PLANNER CORRETORA	12.615.645,68	4,19%
RJI CORRETORA DE VALORES	10.594.095,87	3,52%
Itaú Unibanco	9.821.729,32	3,26%
Elite Corretora	9.083.738,40	3,02%
LIONS TRUST	6.691.269,16	2,22%
BNY Mellon Serviços Financeiros	5.230.362,84	1,74%
BEM DTVM	4.614.463,85	1,53%
Credit Suisse Hedging-Griffo Corretora	787.247,73	0,26%



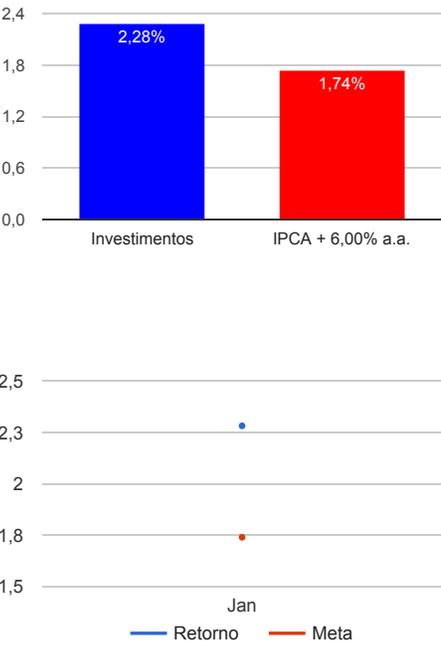
Sub-segmento	Valor	%
CDI	65.792.506,78	21,86%
IDKA IPCA 2A	62.054.965,61	20,62%
IMA-B 5	33.800.705,51	11,23%
IRF-M 1	26.568.798,24	8,83%
FIDC	24.934.303,01	8,29%
FIP	14.674.154,30	4,88%
FUNDO IMOBILIÁRIO	9.870.986,13	3,28%
GESTÃO DURATION	9.821.729,32	3,26%
IMA-B	9.270.614,03	3,08%
MULTIMERCADO - CRÉDITO PRIVADO	5.230.362,84	1,74%
AÇÕES - LIVRES	3.018.986,99	1,00%
MULTIMERCADO - MODERADO	2.503.934,76	0,83%
AÇÕES - DIVIDENDOS	1.595.476,86	0,53%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	294.155.551,80	6.101.666,64	6.032.327,66	300.941.364,38	6.716.473,60	2,28%	1,74%	131,24%	3,00%
Acumulado no ano					6.716.473,60	2,28%	1,74%	131,24%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	39.070.943,59	0,00	0,00	40.250.010,01	1.179.066,42	3,02%	1,79%	3,02%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	21.095.732,97	0,00	0,00	21.709.902,42	614.169,45	2,91%	1,69%	2,91%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	21.196.647,70	0,00	0,00	21.804.955,60	608.307,90	2,87%	1,67%	2,87%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	10.301.959,83	0,00	0,00	10.594.095,87	292.136,04	2,84%	1,37%	2,84%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.097.731,04	0,00	0,00	9.270.614,03	172.882,99	1,90%	2,47%	1,90%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.627.190,14	0,00	77.702,65	3.608.399,47	58.911,98	1,62%	0,34%	1,62%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	26.538.906,50	0,00	4.000.000,00	22.960.398,77	421.492,27	1,59%	0,35%	1,62%
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	31.311.720,00	0,00	0,00	31.803.840,00	492.120,00	1,57%	0,50%	1,57%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	9.685.278,06	0,00	0,00	9.821.729,32	136.451,26	1,41%	0,50%	1,41%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	11.849.475,41	0,00	0,00	12.013.607,10	164.131,69	1,39%	0,11%	1,39%
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	2.102.405,24	0,00	0,00	2.128.825,78	26.420,54	1,26%	6,23%	1,26%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.063.517,54	0,00	0,00	11.191.430,79	127.913,25	1,16%	0,07%	1,16%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	15.829.758,05	0,00	0,00	15.996.123,00	166.364,95	1,05%	0,00%	1,05%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	35.912.706,07	2.101.666,64	1.931.877,05	36.476.127,21	393.631,55	1,04%	0,01%	1,05%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	12.947.826,50	0,00	0,00	12.920.695,91	-27.130,59	-0,21%	-	-0,21%
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,00	1.500.000,00	0,00	1.496.707,22	-3.292,78	-0,22%	1,69%	2,50%
Total Renda Fixa					4.823.576,92	1,84%	0,92%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	6.803.958,19	0,00	0,00	7.982.885,14	1.178.926,95	17,33%	47,99%	17,33%
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	5.963.579,35	0,00	14.481,76	6.691.269,16	742.171,57	12,45%	20,92%	12,20%
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	5.202.782,62	0,00	0,00	5.230.362,84	27.580,22	0,53%	0,51%	0,53%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3.003.138,28	0,00	0,00	3.018.986,99	15.848,71	0,53%	7,88%	0,53%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	0,00	2.500.000,00	0,00	2.503.934,76	3.934,76	0,16%	16,15%	1,05%
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	9.079.758,51	0,00	0,00	9.083.738,40	3.979,89	0,04%	-	-
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.637.381,12	0,00	0,00	1.595.476,86	-41.904,26	-2,56%	8,77%	-2,56%
CSHG BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	833.155,09	0,00	8.266,20	787.247,73	-37.641,16	-4,52%	-	-2,80%
Total Renda Variável					1.892.896,68	5,41%	22,35%	