

Relatório Analítico dos Investimentos em fevereiro 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 (fevereiro / 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	3.573.746,43	1,17%	1.164	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	22.038.309,88	7,24%	654	0,50%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	23.213.086,17	7,63%	1.306	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	40.783.778,85	13,40%	690	0,72%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	22.104.117,52	7,27%	544	0,75%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2016	31.217.160,00	10,26%	85	4,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1901	Não há	1.515.675,85	0,50%			Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	10.259.963,51	3,37%	43	1,80%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	10.812.435,76	3,55%	19	3,64%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	11.303.753,33	3,72%	482	0,56%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	16/05/2023	9.547.001,22	3,14%	52	3,97%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	2.151.022,67	0,71%	59	5,18%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	34.168.215,12	11,23%	758	0,76%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	16.155.005,62	5,31%	387	0,25%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	819.639,69	0,27%	120	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	12.780.771,78	4,20%	71	3,49%	Artigo 7º, Inciso VI
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	12.193.746,75	4,01%	27	6,03%	Artigo 7º, Inciso VI
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	1.666.131,24	0,55%	134	2,03%	Artigo 8º, Inciso III
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	3.123.293,06	1,03%	26	5,74%	Artigo 8º, Inciso III
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+180	Não há	5.309.268,44	1,75%	64	1,74%	Artigo 8º, Inciso IV
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	2.524.533,61	0,83%	19	27,58%	Artigo 8º, Inciso IV
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	7.980.785,48	2,62%	17	10,51%	Artigo 8º, Inciso V

Carteira consolidada de investimentos - base (fevereiro / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	5.079.289,25	1,67%	8	14,08%	Artigo 8º, Inciso V
CSHG BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	Não se aplica	Não se aplica	838.797,67	0,28%			Artigo 8º, Inciso VI
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	Não se aplica	Não se aplica	9.085.629,67	2,99%			Artigo 8º, Inciso VI
Total para cálculo dos limites da Resolução			300.245.158,57				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			4.000.000,00				Artigo 6º
Total			304.245.158,57				

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

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	100,00%	142.930.198,85	47,60%	157.314.959,72
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	30,00%	11.775.639,36	3,92%	78.297.908,21
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	84.957.073,41	28,30%	5.116.474,16
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	11,00%	24.974.518,53	8,32%	8.052.448,91
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	4,00%	0,00	0,00%	12.009.806,34
Total Renda Fixa	100,00%	175,00	264.637.430,15	88,14%	

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	4.789.424,30	1,60%	40.247.349,49
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	7.833.802,05	2,61%	7.178.455,88
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	13.060.074,73	4,35%	1.952.183,20
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	9.924.427,34	3,31%	5.087.830,59
Total	30,00%	30,00	35.607.728,42	11,86%	

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA	9,00%	2,18%	3,16%	5,63%	10,36%	18,86%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,67%	3,10%	4,11%	6,85%	-	-	0,40%	1,124%	-
IMA-B	2,26%	4,22%	5,80%	8,90%	9,45%	27,71%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,84%	-0,30%	1,36%	6,00%	-	-	0,20%	4,878%	-
IMA-B 5	1,54%	4,55%	6,77%	10,89%	16,86%	32,06%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,51%	4,47%	6,60%	10,56%	16,32%	31,08%	0,20%	1,440%	3,36%
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1,27%	3,79%	5,70%	8,61%	-	-	0,97%	-	-
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-3,15%	-0,41%	-8,09%	-4,85%	-1,64%	10,85%	0,70%	8,672%	9,26%
IPCA + 7,00% ao ano	1,42%	3,26%	4,87%	9,17%	18,02%	35,93%	-	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1,50%	2,91%	4,57%	8,14%	16,03%	-	1,65%	0,255%	0,33%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-1,08%	-1,29%	-1,83%	1,02%	9,42%	25,88%	0,00%	-	-
IPCA + 6,00% ao ano	1,34%	3,11%	4,63%	8,67%	16,92%	33,42%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,98%	4,94%	7,80%	9,82%	10,77%	28,36%	0,15%	3,189%	8,86%
IDKA IPCA 2 Anos	1,20%	5,00%	6,99%	11,37%	18,46%	33,63%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,37%	4,28%	6,33%	10,71%	16,83%	31,71%	0,20%	1,371%	2,93%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,33%	4,38%	6,45%	10,78%	16,74%	31,36%	0,20%	1,412%	3,03%
IRF-M 1	1,09%	2,75%	3,97%	7,47%	14,04%	26,55%	-	-	-

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

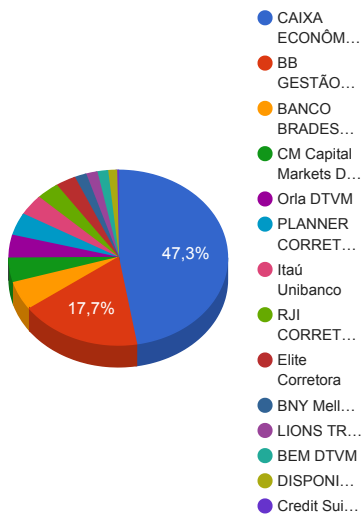
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,10%	2,74%	3,94%	7,40%	13,84%	26,05%	0,20%	0,179%	0,54%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,10%	2,74%	3,93%	7,33%	13,72%	25,72%	0,10%	0,180%	0,56%
Selic	1,00%	2,07%	3,26%	6,67%	13,61%	26,14%	-	-	-
BRANCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,99%	2,05%	3,24%	6,67%	13,65%	26,36%	0,20%	0,006%	0,03%
CDI	1,00%	2,07%	3,25%	6,67%	13,59%	26,03%	-	-	-
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	1,04%	2,31%	3,74%	7,60%	15,14%	28,39%	0,75%	2,360%	6,71%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	1,00%	2,06%	3,25%	6,69%	13,68%	26,25%	0,18%	0,011%	0,05%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,99%	2,05%	3,23%	6,66%	13,63%	26,17%	0,20%	0,008%	0,07%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,00%	2,17%	3,32%	6,54%	13,22%	25,47%	0,20%	0,046%	0,23%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

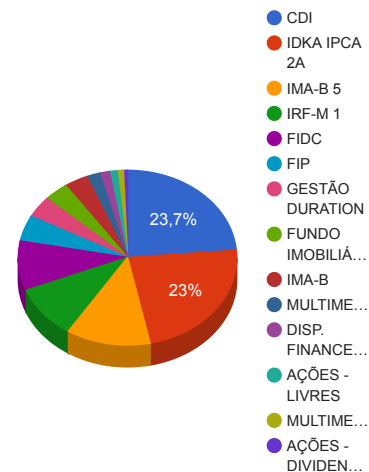
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDIV	8,13%	-2,17%	-5,85%	-13,11%	-27,46%	-35,85%	-	-	-
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	4,43%	1,76%	0,90%	3,97%	-1,76%	3,28%	2,00%	7,144%	13,48%
Ibovespa	5,91%	-1,28%	-5,16%	-8,22%	-17,04%	-9,13%	-	-	-
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3,46%	4,00%	1,18%	-0,97%	-4,75%	-5,00%	1,85%	5,461%	13,01%
CDI	1,00%	2,07%	3,25%	6,67%	13,59%	26,03%	-	-	-
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1,51%	2,05%	3,28%	6,71%	14,72%	30,05%	0,55%	0,782%	1,10%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	0,82%	1,89%	3,40%	8,12%	18,20%	36,50%	1,00%	4,141%	13,16%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CSHG BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	2,59%	-0,28%	-	-	-	-	0,60%	-	17,00%
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	-24,09%	-14,83%	-14,65%	-13,48%	-15,15%	-14,48%	0,00%	41,477%	27,25%
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	-	-	-	-	-	-	1,35%	-	0,00%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	144.044.642,02	47,98%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	53.904.526,50	17,95%
BANCO BRADESCO	16.155.005,62	5,38%
CM Capital Markets DTVM	13.709.422,60	4,57%
Orla DTVM	12.780.771,78	4,26%
PLANNER CORRETORA	12.656.341,76	4,22%
Itaú Unibanco	11.632.075,45	3,87%
RJI CORRETORA DE VALORES	10.259.963,51	3,42%
Elite Corretora	9.085.629,67	3,03%
BNY Mellon Serviços Financeiros	5.309.268,44	1,77%
LIONS TRUST	5.079.289,25	1,69%
BEM DTVM	4.789.424,30	1,60%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	4.000.000,00	1,33%
Credit Suisse Hedging-Griffo Corretora	838.797,67	0,28%



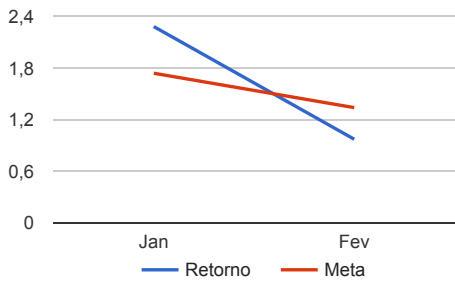
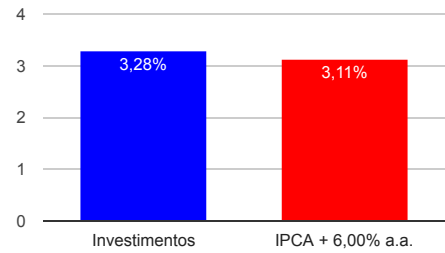
Sub-segmento	Valor	%
CDI	64.597.636,43	21,51%
IDKA IPCA 2A	62.887.896,37	20,95%
IMA-B 5	33.813.949,24	11,26%
IRF-M 1	26.786.832,60	8,92%
FIDC	24.974.518,53	8,32%
FIP	13.060.074,73	4,35%
GESTÃO DURATION	10.812.435,76	3,60%
FUNDO IMOBILIÁRIO	9.924.427,34	3,31%
IMA-B	9.547.001,22	3,18%
MULTIMERCADO - CRÉDITO PRIVADO	5.309.268,44	1,77%
DISP. FINANCEIRA	4.000.000,00	1,33%
AÇÕES - LIVRES	3.123.293,06	1,04%
MULTIMERCADO - MODERADO	2.524.533,61	0,84%
AÇÕES - DIVIDENDOS	1.666.131,24	0,55%



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%
Fevereiro	300.941.364,38	4.968.148,77	8.590.258,37	300.245.158,57	2.925.903,79	0,97%	1,34%	72,33%	2,44%
Acumulado no ano					9.642.377,39	3,28%	3,11%	105,48%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.270.614,03	0,00	0,00	9.547.001,22	276.387,19	2,98%	3,19%	2,98%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	9.821.729,32	813.944,01	0,00	10.812.435,76	176.762,43	1,66%	1,12%	1,67%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	21.709.902,42	0,00	0,00	22.038.309,88	328.407,46	1,51%	1,44%	1,51%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	12.013.607,10	0,00	0,00	12.193.746,75	180.139,65	1,50%	0,26%	1,50%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	21.804.955,60	0,00	0,00	22.104.117,52	299.161,92	1,37%	1,37%	1,37%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	40.250.010,01	0,00	0,00	40.783.778,85	533.768,84	1,33%	1,41%	1,33%
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.496.707,22	0,00	0,00	1.515.675,85	18.968,63	1,27%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	22.960.398,77	0,00	0,00	23.213.086,17	252.687,40	1,10%	0,18%	1,10%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.608.399,47	0,00	74.307,76	3.573.746,43	39.654,72	1,10%	0,18%	1,10%
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	2.128.825,78	0,00	0,00	2.151.022,67	22.196,89	1,04%	2,36%	1,04%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.191.430,79	0,00	0,00	11.303.753,33	112.322,54	1,00%	0,05%	1,00%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	15.996.123,00	0,00	0,00	16.155.005,62	158.882,62	0,99%	0,01%	0,99%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	36.476.127,21	3.321.139,14	6.012.106,35	34.168.215,12	383.055,12	0,96%	0,01%	0,99%
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	31.803.840,00	0,00	890.810,34	31.217.160,00	304.130,34	0,96%	4,88%	-1,84%
LME REC IPCA FIDC MULTISSECTORIAL SÊNIOR	12.920.695,91	0,00	0,00	12.780.771,78	-139.924,13	-1,08%	-	-1,08%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	0,00	833.065,62	0,00	819.639,69	-13.425,93	-1,61%	0,01%	1,00%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	10.594.095,87	0,00	0,00	10.259.963,51	-334.132,36	-3,15%	8,67%	-3,15%
Total Renda Fixa					2.599.043,33	0,98%	1,67%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CSHG BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	787.247,73	0,00	8.441,07	838.797,67	59.991,01	7,62%	-	2,59%
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.595.476,86	0,00	0,00	1.666.131,24	70.654,38	4,43%	7,14%	4,43%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3.018.986,99	0,00	0,00	3.123.293,06	104.306,07	3,46%	5,46%	3,46%
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	5.230.362,84	0,00	0,00	5.309.268,44	78.905,60	1,51%	0,78%	1,51%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	2.503.934,76	0,00	0,00	2.524.533,61	20.598,85	0,82%	4,14%	0,82%
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	9.083.738,40	0,00	0,00	9.085.629,67	1.891,27	0,02%	-	-
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	7.982.885,14	0,00	0,00	7.980.785,48	-2.099,66	-0,03%	0,31%	-0,03%
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	6.691.269,16	0,00	1.604.592,85	5.079.289,25	-7.387,06	-0,11%	41,48%	-24,09%
Total Renda Variável					326.860,46	0,89%	9,99%	