Relatório Analítico dos Inves
em junho, 2º Trimestre e 1º semestre

Consultoria em Inve

Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2016)

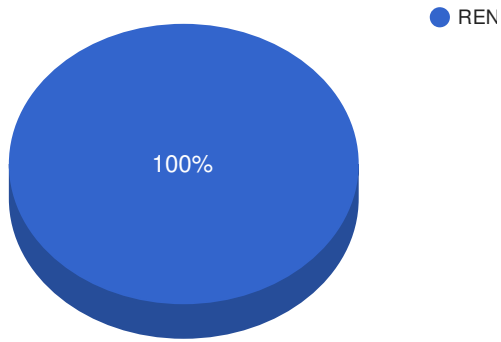
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	R 3.922/2
TÍTULOS PÚBLICOS			6.155.232,10	16,61%			Artigo 7º
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	515.714,26	1,39%	738	0,01%	Artigo 7º
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.910.051,44	7,85%	602	0,08%	Artigo 7º
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2020	1.261.965,57	3,40%	122	0,12%	Artigo 7º
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	774.269,40	2,09%	193	0,12%	Artigo 7º
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	3.675.689,99	9,92%	560	0,08%	Artigo 7º
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.226.567,01	16,80%	701	0,12%	Artigo 7º
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.269.220,81	3,42%	232	0,13%	Artigo 7º,
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	1.060.212,67	2,86%	288	0,06%	Artigo 7º,
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	1.460.043,56	3,94%	60	0,69%	Artigo 7º,
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	428.858,57	1,16%	573	0,04%	Artigo 7º,
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.317.146,54	3,55%	262	0,03%	Artigo 7º,
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	2.861.853,96	7,72%	747	0,06%	Artigo 7º,
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.590.064,14	9,69%	824	0,06%	Artigo 7º,
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.982.084,50	5,35%	381	0,03%	Artigo 7º,
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	1.579.237,20	4,26%	98	1,33%	Artigo 7º,
		TOTAL -	**37.068.211,72**				

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

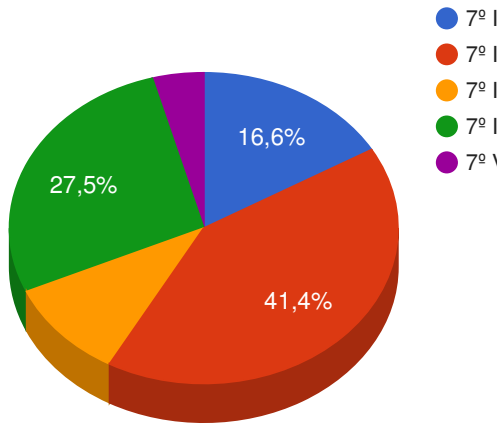
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	30,00%	6.155.232,10	16,61%	4.965.231,42
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	50,00%	15.364.257,67	41,45%	3.169.848,19
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	35,00%	3.789.477,04	10,22%	9.184.397,06
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	10.180.007,71	27,46%	940.455,81
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	1.579.237,20	4,26%	274.173,39
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.853.410,59
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.853.410,59
Total Renda Fixa	100,00%	160,00	37.068.211,72	100,00%	

Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	10,00%	0,00	0,00%	3.706.821,17
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.853.410,59
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.853.410,59
Total Renda Variável	30,00%	20,00	0,00	0,00%	

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



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

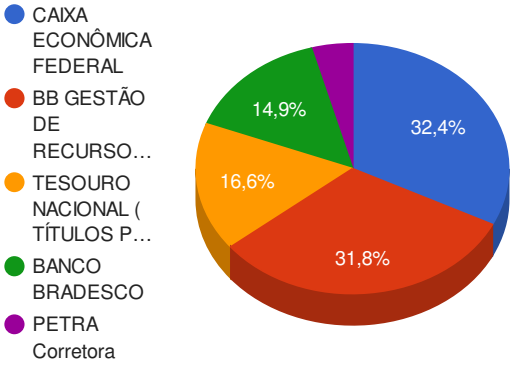
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês
IMA-B	1,93%	16,15%	5,83%	16,15%	16,73%	32,26%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,90%	15,96%	5,76%	15,96%	16,24%	31,43%	0,20%	2,296%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,84%	15,68%	5,64%	15,68%	16,13%	31,42%	0,30%	2,313%
Selic	1,16%	6,73%	3,36%	6,73%	14,11%	27,66%	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,18%	6,72%	3,38%	6,72%	14,11%	27,85%	0,20%	0,013%
CDI	1,16%	6,72%	3,36%	6,72%	14,09%	27,57%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,17%	6,27%	3,20%	6,27%	13,15%	25,58%	1,00%	0,106%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,16%	6,73%	3,36%	6,73%	14,15%	27,71%	0,20%	0,007%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	1,14%	6,55%	3,29%	6,55%	13,83%	27,11%	0,15%	0,001%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,07%	6,49%	3,22%	6,49%	13,92%	27,68%	0,20%	0,271%
IRF-M 1	1,08%	7,42%	3,25%	7,42%	14,96%	27,79%	-	-
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,05%	7,36%	3,21%	7,36%	14,74%	27,24%	0,20%	0,116%
IMA-B 5	0,94%	8,84%	3,31%	8,84%	16,94%	31,07%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,92%	8,66%	3,26%	8,66%	16,43%	30,14%	0,20%	1,106%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,91%	8,75%	3,28%	8,75%	16,54%	30,11%	0,20%	1,106%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	0,88%	8,79%	3,32%	8,79%	16,23%	-	0,20%	1,203%
IDKA IPCA 2 Anos	0,93%	8,58%	3,25%	8,58%	17,00%	31,47%	-	-

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

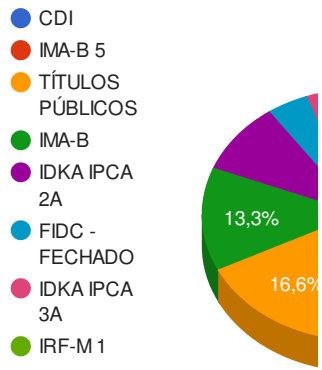
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,88%	8,41%	3,32%	8,41%	16,74%	30,55%	0,20%	1,115%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,82%	8,36%	3,26%	8,36%	16,56%	30,05%	0,20%	1,178%
IPCA + 6,00% ao ano	0,86%	7,45%	3,24%	7,45%	15,38%	33,21%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,91%	9,20%	3,46%	9,20%	16,62%	29,98%	0,15%	1,213%
101,50% do IPCA + 5,75% ao ano	0,79%	7,06%	3,04%	7,06%	14,50%	31,16%	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,10%	-3,90%	-2,30%	-3,90%	-4,34%	-15,24%	0,25%	0,240%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	11.998.472,41	32,37%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	11.801.726,01	31,84%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	6.155.232,10	16,61%
BANCO BRADESCO	5.533.544,00	14,93%
PETRA Corretora	1.579.237,20	4,26%



Sub-segmento	Valor	%
CDI	10.180.007,71	27,46%
IMA-B 5	8.746.823,24	23,60%
TÍTULOS PÚBLICOS	6.155.232,10	16,61%
IMA-B	4.944.910,80	13,34%
IDKA IPCA 2A	3.425.765,70	9,24%
FIDC - FECHADO	1.579.237,20	4,26%
IDKA IPCA 3A	1.261.965,57	3,40%
IRF-M 1	774.269,40	2,09%



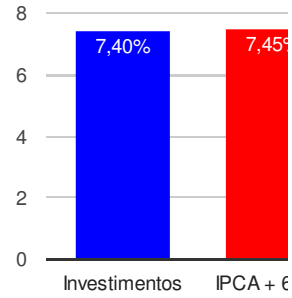
Carteira de Títulos Públicos - base (junho / 2016)

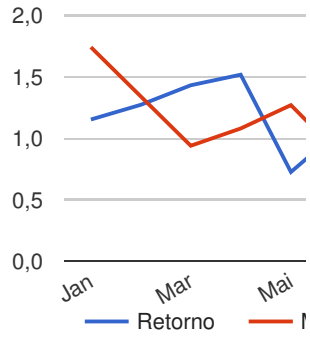
Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde.	P.U. Compra	P.U. Atual	$ Pago	$ Atual	GAP (Atual - Pago)
NTN-F - Nota do Tesouro Nacional - Série F	01/01/2017	27/04/2009	3658	915,328059	1.030,509308	3.348.270,04	3.769.603,05	421.333,01
NTN-F - Nota do Tesouro Nacional - Série F	01/01/2017	20/08/2009	1664	901,008571	1.030,509308	1.499.278,26	1.714.767,49	215.489,23
NTN-F - Nota do Tesouro Nacional - Série F	01/01/2017	07/12/2009	651	920,636489	1.030,509308	599.334,35	670.861,56	71.527,21

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno ($)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	33.071.387,88	640.835,07	109.167,29	33.990.180,11	387.124,45	1,15%	1,74%	66,23%	1,29%
Fevereiro	33.990.180,11	419.262,77	645.741,62	34.196.641,22	432.939,96	1,27%	1,34%	94,75%	1,24%
Março	34.196.641,22	519.948,26	132.905,97	35.079.217,38	495.533,87	1,43%	0,94%	152,08%	2,00%
Abril	35.079.217,38	438.962,31	123.772,37	35.931.871,95	537.464,63	1,52%	1,08%	141,08%	1,26%
Maio	35.931.871,95	360.619,55	128.902,10	36.426.059,53	262.470,13	0,73%	1,27%	57,12%	1,11%
Junho	36.426.059,53	390.807,33	143.295,82	37.068.211,72	394.640,68	1,08%	0,86%	124,87%	0,91%
Acumulado no ano					2.510.173,72	7,40%	7,45%	99,22%	
Acumulado no 2º Trimestre					1.194.575,44	3,36%	3,24%	103,48%	

Acumulado no Ar





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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	VaR - Mês (
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.607.006,93	0,00	0,00	3.675.689,99	68.683,06	1,90%	2,30%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.246.335,26	0,00	0,00	1.269.220,81	22.885,55	1,84%	2,31%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.958.978,80	0,00	0,00	1.982.084,50	23.105,70	1,18%	0,01%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.829.168,23	0,00	0,00	2.861.853,96	32.685,73	1,16%	0,01%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	1.302.274,60	0,00	0,00	1.317.146,54	14.871,94	1,14%	0,00%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.552.227,79	0,00	0,00	3.590.064,14	37.836,35	1,07%	0,27%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	766.187,09	0,00	0,00	774.269,40	8.082,31	1,05%	0,12%
TÍTULOS PÚBLICOS	6.092.179,02	0,00	0,00	6.155.232,10	63.053,08	1,03%	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.169.922,42	0,00	0,00	6.226.567,01	56.644,59	0,92%	1,11%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.050.660,18	0,00	0,00	1.060.212,67	9.552,49	0,91%	1,11%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.250.617,47	0,00	0,00	1.261.965,57	11.348,10	0,91%	1,21%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	1.447.315,29	0,00	0,00	1.460.043,56	12.728,27	0,88%	1,20%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.884.734,54	0,00	0,00	2.910.051,44	25.316,90	0,88%	1,11%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	511.517,30	0,00	0,00	515.714,26	4.196,96	0,82%	1,18%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	176.123,70	390.807,33	141.784,38	428.858,57	3.711,92	0,65%	0,11%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.580.810,91	0,00	1.511,44	1.579.237,20	-62,27	0,00%	0,24%
			Total Renda Fixa		394.640,68	1,08%	0,91%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre / 2016

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.475.642,46	0,00	0,00	3.675.689,99	200.047,53	5,76%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.030.260,98	0,00	0,00	6.226.567,01	196.306,03	3,26%
TÍTULOS PÚBLICOS	5.962.304,08	0,00	0,00	6.155.232,10	192.928,02	3,24%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.478.017,44	0,00	0,00	3.590.064,14	112.046,70	3,22%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.816.424,86	0,00	0,00	2.910.051,44	93.626,58	3,32%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.768.760,30	0,00	0,00	2.861.853,96	93.093,66	3,36%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.201.406,34	0,00	0,00	1.269.220,81	67.814,47	5,64%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.917.245,46	0,00	0,00	1.982.084,50	64.839,04	3,38%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	1.413.119,65	0,00	0,00	1.460.043,56	46.923,91	3,32%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.219.777,80	0,00	0,00	1.261.965,57	42.187,77	3,46%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	1.275.155,80	0,00	0,00	1.317.146,54	41.990,74	3,29%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.026.531,25	0,00	0,00	1.060.212,67	33.681,42	3,28%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	499.411,53	0,00	0,00	515.714,26	16.302,73	3,26%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	760.619,77	0,00	774.269,40	13.649,63	1,84%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	378.816,22	429.769,42	390.100,14	428.858,57	10.373,07	2,60%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.616.343,21	0,00	5.870,15	1.579.237,20	-31.235,86	-1,93%
			Total Renda Fixa		1.194.575,44	3,36%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre / 2016

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.169.689,21	0,00	0,00	3.675.689,99	506.000,78	15,96%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.730.245,93	0,00	0,00	6.226.567,01	496.321,08	8,66%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.395.068,94	291.535,26	0,00	2.910.051,44	223.447,24	8,32%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.371.328,88	0,00	0,00	3.590.064,14	218.735,26	6,49%
TÍTULOS PÚBLICOS	5.973.881,97	0,00	0,00	6.155.232,10	181.350,13	3,04%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.097.170,20	0,00	0,00	1.269.220,81	172.050,61	15,68%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.195.414,07	500.000,00	0,00	2.861.853,96	166.439,89	6,57%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.857.330,48	0,00	0,00	1.982.084,50	124.754,02	6,72%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	1.342.051,33	0,00	0,00	1.460.043,56	117.992,23	8,79%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.189.902,26	0,00	35.637,67	1.261.965,57	107.700,98	9,18%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	974.941,44	0,00	0,00	1.060.212,67	85.271,23	8,75%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	1.236.129,39	0,00	0,00	1.317.146,54	81.017,15	6,55%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	475.933,80	0,00	0,00	515.714,26	39.780,46	8,36%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	418.984,30	1.218.280,26	1.233.633,09	428.858,57	25.227,10	4,75%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	760.619,77	0,00	774.269,40	13.649,63	1,84%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.643.315,68	0,00	14.514,41	1.579.237,20	-49.564,07	-3,03%
			Total Renda Fixa		2.510.173,72	7,40%