

# Relatório Analítico dos Investimentos em janeiro de 2016



Carteira consolidada de investimentos - base (janeiro / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	731.442,87	0,30%	1.158	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2016 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2016	21.417.320,00	8,75%	104	2,79%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.519.327,52	0,62%	119	0,53%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	34.469.048,35	14,08%	507	1,32%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	27.031.252,08	11,04%	193	1,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	778.896,33	0,32%	94	0,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2024	626.369,03	0,26%	17	0,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2016 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2016	15.994.440,00	6,54%	154	3,50%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	30.492.115,96	12,46%	641	0,73%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	654.422,57	0,27%	591	1,76%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	1.869.459,86	0,76%	47	2,89%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.775.460,78	0,73%	665	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.865.846,77	3,21%	205	0,70%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	6.010.947,50	2,46%	365	0,49%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	3.224.576,73	1,32%	18	2,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.587.057,08	3,51%	338	0,38%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	D+1	Não há	2.280.582,21	0,93%	13	0,82%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRDESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	9.141.166,55	3,74%	84	0,99%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.880.659,62	0,77%	837	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VIII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	01/01/2017	2.458.133,93	1,00%	49	0,41%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	16/05/2023	3.476.480,25	1,42%	52	1,49%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.145.374,96	0,47%	136	0,79%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "

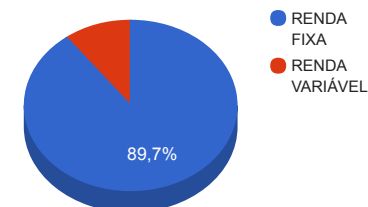
Carteira consolidada de investimentos - base (janeiro / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	2.442.821,22	1,00%	143	0,25%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	594.692,89	0,24%	484	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRASESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	30.614.375,18	12,51%	388	0,47%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	1.127.831,00	0,46%	100	0,61%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+30 a D+2880	Não há	1.309.998,11	0,54%	52	0,45%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	1.839.714,27	0,75%	30	5,15%	Artigo 8º, Inciso III
BB CIELO FI AÇÕES	D+4	Não há	1.687.945,62	0,69%	7.588	1,03%	Artigo 8º, Inciso III
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	951.936,93	0,39%	611	6,11%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.179.625,60	0,89%	3.634	0,85%	Artigo 8º, Inciso III
BB PIPE FIC AÇÕES	D+4	03/06/2018	822.778,36	0,34%	48	1,13%	Artigo 8º, Inciso III
XP INVESTOR FI AÇÕES	D+4	Não há	1.297.099,16	0,53%	2.680	1,43%	Artigo 8º, Inciso III
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	D+4	Não há	2.368.048,89	0,97%	10.396	1,70%	Artigo 8º, Inciso III
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	D+4	Não há	2.498.682,48	1,02%	3.510	6,63%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	D+12	Não há	1.447.982,02	0,59%	472	2,11%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	1.388.120,85	0,57%	175	1,10%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	7.041.649,29	2,88%	283	4,24%	Artigo 8º, Inciso IV
CAIXA BRASIL IPCA VIII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+0	06/12/2016	1.697.717,00	0,69%	21	2,00%	Artigo 8º, Inciso IV
		<b>TOTAL -</b>	<b>244.741.399,82</b>				

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

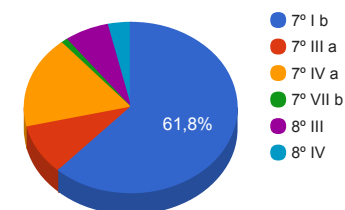
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	10,00%	0,00	0,00%	24.474.139,98
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	75,00%	151.236.349,62	61,79%	32.319.700,25
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	50,00%	23.233.382,57	9,49%	99.137.317,34
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	42.612.538,05	17,41%	30.809.881,90
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	12.237.069,99
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	12.237.069,99
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	2.437.829,11	1,00%	9.799.240,88
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>180,00</b>	<b>219.520.099,35</b>	<b>89,69%</b>	

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	5,00%	0,00	0,00%	12.237.069,99
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	16.481.934,18	6,73%	20.229.275,79
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	8.739.366,29	3,57%	3.497.703,70
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	12.237.069,99
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	12.237.069,99
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>35,00</b>	<b>25.221.300,47</b>	<b>10,31%</b>	

Distribuição por Artigo / Resolução



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
IRF-M 1+	3,79%	3,79%	4,83%	0,90%	4,89%	20,54%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,49%	3,49%	4,59%	0,85%	4,59%	19,82%	0,20%	2,851%	6,43%
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%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,81%	1,81%	4,47%	8,57%	-	-	0,20%	0,717%	-
IMA-B 5	2,97%	2,97%	5,73%	8,70%	16,49%	33,78%	-	-	-
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	2,96%	2,96%	5,67%	8,62%	16,29%	33,31%	0,10%	1,699%	3,31%
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%
IMA Geral	2,02%	2,02%	4,13%	4,19%	9,18%	26,41%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,97%	1,97%	4,07%	3,77%	8,67%	25,39%	0,20%	1,267%	4,64%
IMA-B	1,91%	1,91%	4,53%	3,17%	7,61%	30,43%	-	-	-
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	1,75%	1,75%	4,76%	3,16%	8,46%	32,93%	0,15%	2,148%	9,16%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	1,73%	1,73%	4,38%	4,45%	9,88%	23,77%	0,45%	1,807%	6,75%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	1,65%	1,65%	4,15%	2,80%	7,16%	29,18%	0,20%	1,930%	8,35%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,59%	1,59%	5,44%	-	-	-	0,20%	2,530%	-
CAIXA BRASIL 2016 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,57%	1,57%	4,25%	5,57%	-	-	0,20%	0,499%	-

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
CAIXA BRASIL 2016 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,57%	1,57%	4,25%	-	-	-	0,20%	0,498%	-
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%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,54%	1,54%	4,60%	7,79%	17,56%	-	0,20%	0,125%	0,35%
IRF-M 1	1,64%	1,64%	3,94%	7,40%	13,65%	26,52%	-	-	-
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1,65%	1,65%	3,87%	7,28%	13,47%	25,99%	0,20%	0,336%	0,81%
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%
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	1,14%	1,14%	3,47%	6,69%	13,45%	26,10%	0,50%	0,132%	0,45%
IPCA	1,27%	1,27%	3,27%	4,91%	10,71%	18,61%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	3,84%	3,84%	6,30%	8,69%	-	-	0,20%	2,125%	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	2,74%	2,74%	6,31%	6,04%	12,49%	32,67%	0,20%	2,294%	6,71%
IMA-B 5+	1,21%	1,21%	3,73%	-0,08%	3,15%	29,70%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,07%	1,07%	3,31%	-0,63%	2,48%	28,24%	0,20%	3,124%	12,62%
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%	-	-	-

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
BB TÍTULOS PÚBLICOS VIII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,27%	2,27%	4,38%	5,55%	10,47%	-	0,20%	0,684%	2,96%
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%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,05%	1,05%	3,33%	6,83%	13,59%	26,28%	0,20%	0,016%	0,06%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,99%	0,99%	3,09%	6,33%	12,44%	23,73%	0,80%	0,000%	0,04%
IDKA IPCA 20 Anos	-0,89%	-0,89%	-0,69%	-9,44%	-9,55%	24,80%	-	-	-
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,04%	-0,04%	1,09%	-3,40%	-1,82%	27,56%	0,20%	4,716%	16,61%

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
IPCA + 6,00% ao ano	1,74%	1,74%	4,77%	7,99%	17,27%	33,18%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA VIII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1,59%	1,59%	4,57%	7,41%	17,04%	31,31%	0,15%	0,249%	0,48%
CIELO ON NM - CIEL3	0,83%	0,83%	-7,48%	-21,96%	3,54%	33,59%	-	-	-
BB CIELO FI AÇÕES	0,70%	0,70%	-7,83%	-22,52%	1,94%	29,28%	1,50%	17,030%	28,38%
IDIV	-9,53%	-9,53%	-19,54%	-28,55%	-26,10%	-41,99%	-	-	-
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	-1,75%	-1,75%	0,24%	-8,35%	-4,92%	8,92%	3,00%	12,546%	19,51%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	-5,82%	-5,82%	-6,01%	-11,51%	3,17%	6,01%	3,00%	16,053%	18,64%
Ibovespa	-6,79%	-6,79%	-11,91%	-20,56%	-13,86%	-15,18%	-	-	-
BB PIPE FIC AÇÕES	-0,38%	-0,38%	-4,17%	-10,69%	0,16%	11,54%	1,20%	9,075%	13,84%
XP INVESTOR FI AÇÕES	-3,62%	-3,62%	-2,26%	-9,42%	-1,74%	4,33%	2,00%	12,657%	21,32%
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	-6,47%	-6,47%	-9,91%	-16,73%	-6,43%	-9,71%	1,00%	12,141%	19,44%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	-7,02%	-7,02%	-4,53%	-8,23%	2,65%	4,89%	2,00%	13,529%	16,74%
GERAÇÃO FI AÇÕES	-8,03%	-8,03%	-6,61%	-10,80%	3,50%	1,53%	3,00%	14,556%	17,73%
BBSEGURIDADE ON NM - BBSE3	-4,93%	-4,93%	-13,05%	-26,18%	-16,83%	12,35%	-	-	-
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	-5,05%	-5,05%	-13,34%	-26,73%	-18,06%	8,27%	1,5%	27,320%	39,05%
IFNC	-4,02%	-4,02%	-6,89%	-19,35%	-11,15%	8,55%	-	-	-
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	-4,10%	-4,10%	-6,85%	-19,46%	-11,98%	7,71%	1,00%	12,595%	26,94%

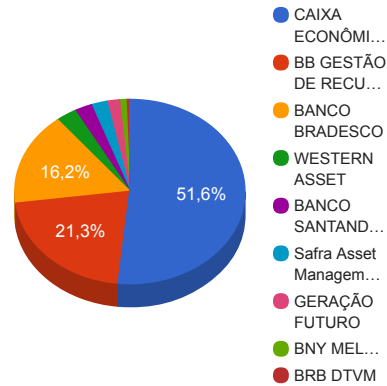


Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (janeiro / 2016)

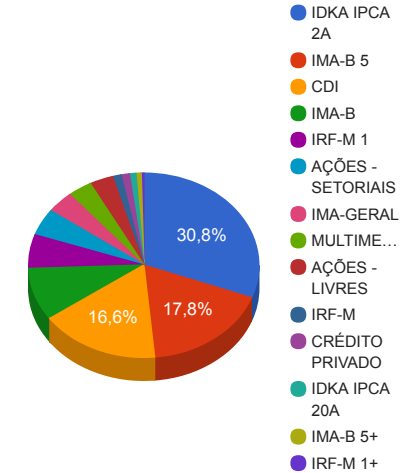
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
S&P 500	-1,72%	-1,72%	-2,24%	9,85%	47,69%	81,36%	-	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	-6,00%	-6,00%	-4,42%	-2,58%	8,24%	33,98%	1,00%	11,406%	16,33%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	126.316.036,89	51,61%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	52.192.878,34	21,33%
BANCO BRADESCO	39.755.541,73	16,24%
WESTERN ASSET	7.041.649,29	2,88%
BANCO SANTANDER	6.010.947,50	2,46%
Safra Asset Management	5.505.158,94	2,25%
GERAÇÃO FUTURO	4.282.030,19	1,75%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	2.249.036,09	0,92%
BRB DTVM	1.388.120,85	0,57%



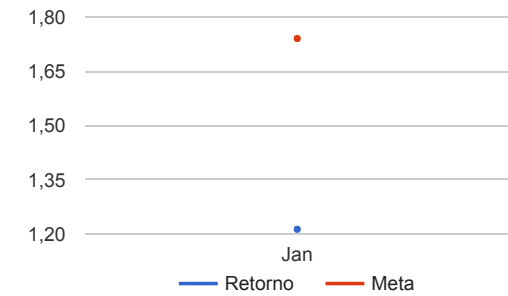
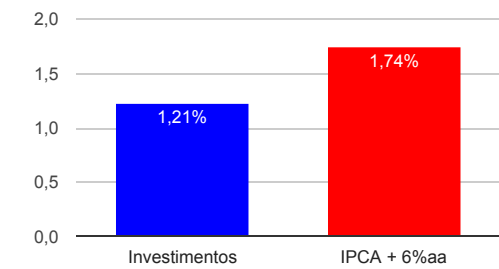
Sub-segmento	Valor	%
IDKA IPCA 2A	63.275.761,21	25,85%
IMA-B 5	36.503.063,46	14,91%
CDI	34.235.102,65	13,99%
IMA-B	19.011.726,88	7,77%
IRF-M 1	12.153.191,63	4,97%
AÇÕES - SETORIAIS	9.686.239,52	3,96%
IMA-GERAL	7.865.846,77	3,21%
MULTIMERCADO	7.041.649,29	2,88%
AÇÕES - LIVRES	6.795.694,66	2,78%
IRF-M	2.458.133,93	1,00%
CRÉDITO PRIVADO	2.437.829,11	1,00%
IDKA IPCA 20A	1.869.459,86	0,76%
IMA-B 5+	1.519.327,52	0,62%
IRF-M 1+	778.896,33	0,32%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	241.212.832,49	35.867.183,30	35.272.132,63	244.741.399,82	2.933.516,66	1,21%	1,74%	69,75%	2,33%
Acumulado no ano					2.933.516,66	1,21%	1,74%	69,75%	

**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(%)
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.086.148,00	0,00	0,00	1.127.831,00	41.683,00	3,84%	2,12%	3,84%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.723.451,20	0,00	0,00	1.775.460,78	52.009,58	3,02%	1,79%	3,02%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	5.838.366,64	0,00	0,00	6.010.947,50	172.580,86	2,96%	1,70%	2,96%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	33.507.441,50	0,00	0,00	34.469.048,35	961.606,85	2,87%	1,67%	2,87%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1.275.010,05	0,00	0,00	1.309.998,11	34.988,06	2,74%	2,29%	2,74%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VIII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.403.516,67	0,00	0,00	2.458.133,93	54.617,26	2,27%	0,68%	2,27%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.714.066,88	0,00	0,00	7.865.846,77	151.779,89	1,97%	1,27%	1,97%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.411.649,13	0,00	0,00	3.476.480,25	64.831,12	1,90%	2,47%	1,90%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	26.551.596,87	0,00	0,00	27.031.252,08	479.655,21	1,81%	0,72%	1,81%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	643.187,48	0,00	0,00	654.422,57	11.235,09	1,75%	2,15%	1,75%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	3.169.841,51	0,00	0,00	3.224.576,73	54.735,22	1,73%	1,81%	1,73%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	8.993.129,54	0,00	0,00	9.141.166,55	148.037,01	1,65%	0,34%	1,65%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	30.000.000,00	0,00	30.492.115,96	492.115,96	1,64%	1,69%	2,91%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	719.752,81	0,00	0,00	731.442,87	11.690,06	1,62%	0,34%	1,62%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	616.550,10	0,00	0,00	626.369,03	9.818,93	1,59%	2,53%	1,59%
CAIXA BRASIL 2016 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	21.085.920,00	0,00	0,00	21.417.320,00	331.400,00	1,57%	0,50%	1,57%
CAIXA BRASIL 2016 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	15.747.135,00	0,00	0,00	15.994.440,00	247.305,00	1,57%	0,50%	1,57%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.405.706,10	0,00	0,00	2.442.821,22	37.115,12	1,54%	0,13%	1,54%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.688.141,79	0,00	6.000.000,00	778.896,33	90.754,54	1,36%	2,85%	3,49%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	587.895,81	0,00	0,00	594.692,89	6.797,08	1,16%	0,07%	1,16%
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	2.254.918,99	0,00	0,00	2.280.582,21	25.663,22	1,14%	0,13%	1,14%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.861.053,15	0,00	0,00	1.880.659,62	19.606,47	1,05%	0,02%	1,05%

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(%)
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	30.295.975,61	0,00	0,00	30.614.375,18	318.399,57	1,05%	0,00%	1,05%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	27.239.824,42	74.148,42	19.000.000,00	8.587.057,08	273.084,24	1,00%	1,93%	1,65%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.479.575,20	0,00	5.000.000,00	1.519.327,52	39.752,32	0,61%	3,12%	1,07%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	616.077,90	5.793.034,88	5.272.132,63	1.145.374,96	8.394,81	0,13%	0,00%	0,99%
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.870.123,58	0,00	0,00	1.869.459,86	-663,72	-0,04%	4,72%	-0,04%
Total Renda Fixa					4.138.992,75	1,92%	1,06%	

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(%)
CAIXA BRASIL IPCA VIII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.671.209,00	0,00	0,00	1.697.717,00	26.508,00	1,59%	0,25%	1,59%
BB CIELO FI AÇÕES	1.676.291,41	0,00	0,00	1.687.945,62	11.654,21	0,70%	17,03%	0,70%
BB PIPE FIC AÇÕES	825.903,04	0,00	0,00	822.778,36	-3.124,68	-0,38%	9,07%	-0,38%
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	968.933,74	0,00	0,00	951.936,93	-16.996,81	-1,75%	12,55%	-1,75%
XP INVESTOR FI AÇÕES	1.345.864,94	0,00	0,00	1.297.099,16	-48.765,78	-3,62%	12,66%	-3,62%
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	2.605.618,27	0,00	0,00	2.498.682,48	-106.935,79	-4,10%	12,60%	-4,10%
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	2.494.050,57	0,00	0,00	2.368.048,89	-126.001,68	-5,05%	27,32%	-5,05%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.314.206,88	0,00	0,00	2.179.625,60	-134.581,28	-5,82%	16,05%	-5,82%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	7.491.021,64	0,00	0,00	7.041.649,29	-449.372,35	-6,00%	11,41%	-6,00%
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	1.967.027,59	0,00	0,00	1.839.714,27	-127.313,32	-6,47%	12,14%	-6,47%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	1.557.272,67	0,00	0,00	1.447.982,02	-109.290,65	-7,02%	13,53%	-7,02%
GERAÇÃO FI AÇÕES	1.509.376,81	0,00	0,00	1.388.120,85	-121.255,96	-8,03%	14,56%	-8,03%
<b>Total Renda Variável</b>					<b>-1.205.476,09</b>	<b>-4,56%</b>	<b>13,43%</b>	