

Relatório Analítico dos Investimentos em fevereiro de 2016



Carteira consolidada de investimentos - base (fevereiro / 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	739.481,10	0,30%	1.164	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2016 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2016	21.023.620,00	8,45%	103	2,79%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.560.540,73	0,63%	116	0,54%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	34.941.960,43	14,05%	544	1,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	26.533.055,03	10,67%	193	1,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	794.934,72	0,32%	89	0,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2024	630.462,30	0,25%	17	0,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2016 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2016	15.678.045,00	6,30%	153	3,50%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	32.043.215,36	12,88%	654	0,73%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	669.673,93	0,27%	582	1,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	1.910.748,18	0,77%	45	2,93%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.799.005,76	0,72%	690	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.995.187,77	3,21%	203	0,70%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	6.609.057,71	2,66%	375	0,51%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	3.293.638,19	1,32%	18	2,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.848.364,51	3,56%	335	0,39%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	D+1	Não há	2.305.015,55	0,93%	13	0,74%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRANCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	9.238.003,57	3,71%	89	0,95%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.745.916,24	1,10%	839	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VIII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	01/01/2017	2.487.364,30	1,00%	49	0,41%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	16/05/2023	3.580.125,45	1,44%	52	1,49%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.003.458,31	0,40%	137	0,66%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "

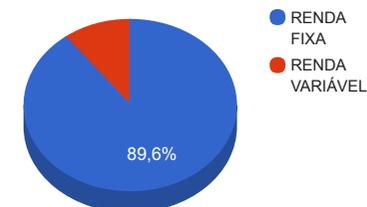
Carteira consolidada de investimentos - base (fevereiro / 2016)

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	2.409.822,70	0,97%	143	0,25%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	600.661,51	0,24%	482	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRASESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	30.918.454,64	12,43%	387	0,47%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	1.139.613,00	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	1.345.589,81	0,54%	51	0,46%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	1.925.819,57	0,77%	28	5,26%	Artigo 8º, Inciso III
BB CIELO FI AÇÕES	D+4	Não há	1.543.823,63	0,62%	7.386	1,05%	Artigo 8º, Inciso III
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	1.020.785,32	0,41%	592	6,16%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.230.031,20	0,90%	3.570	0,84%	Artigo 8º, Inciso III
BB PIPE FIC AÇÕES	D+4	03/06/2018	857.664,50	0,34%	48	1,13%	Artigo 8º, Inciso III
XP INVESTOR FI AÇÕES	D+4	Não há	1.383.540,56	0,56%	2.631	1,43%	Artigo 8º, Inciso III
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	D+4	Não há	2.550.627,61	1,03%	10.159	1,73%	Artigo 8º, Inciso III
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	D+4	Não há	2.630.512,11	1,06%	3.488	6,68%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	D+12	Não há	1.479.872,05	0,59%	459	2,12%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	1.418.792,39	0,57%	168	1,09%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	7.135.572,79	2,87%	265	4,70%	Artigo 8º, Inciso IV
CAIXA BRASIL IPCA VIII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+0	06/12/2016	1.725.873,00	0,69%	21	2,00%	Artigo 8º, Inciso IV
		TOTAL -	248.747.930,53				

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

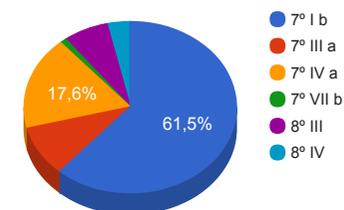
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	10,00%	0,00	0,00%	24.874.793,05
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	75,00%	152.928.988,02	61,48%	33.631.959,88
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	50,00%	23.685.021,82	9,52%	100.688.943,45
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	43.745.803,15	17,59%	30.878.576,01
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	12.437.396,53
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	12.437.396,53
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	2.485.202,81	1,00%	9.952.193,72
Total Renda Fixa	100,00%	180,00	222.845.015,80	89,59%	

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%	12.437.396,53
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	17.041.468,94	6,85%	20.270.720,64
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	8.861.445,79	3,56%	3.575.950,74
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	12.437.396,53
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	12.437.396,53
Total Renda Variável	30,00%	35,00	25.902.914,73	10,41%	

Distribuição por Artigo / Resolução



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%	-	-	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	2,72%	5,54%	8,32%	10,89%	14,12%	31,31%	0,20%	2,572%	6,69%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,04%	4,92%	5,40%	10,11%	-	-	0,20%	1,341%	-
IMA-B 5+	2,75%	3,99%	5,16%	7,60%	5,81%	26,21%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,71%	3,81%	4,81%	7,03%	5,12%	24,82%	0,20%	4,369%	12,52%
IDKA IPCA 20 Anos	2,58%	1,67%	-0,25%	1,80%	-6,50%	19,11%	-	-	-
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,21%	2,17%	1,80%	5,25%	0,53%	23,03%	0,20%	5,736%	16,47%
IMA-B	2,26%	4,22%	5,80%	8,90%	9,45%	27,71%	-	-	-
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	2,33%	4,12%	5,55%	9,31%	10,16%	30,08%	0,15%	3,303%	9,08%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	2,14%	3,91%	5,55%	8,85%	11,20%	24,88%	0,45%	2,822%	6,86%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	2,14%	3,82%	5,08%	8,20%	8,82%	26,96%	0,20%	2,644%	8,26%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,65%	2,26%	4,62%	6,86%	-	-	0,20%	6,336%	-
CAIXA BRASIL 2016 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,84%	-0,30%	1,37%	6,01%	-	-	0,20%	4,867%	-
CAIXA BRASIL 2016 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,98%	-0,44%	1,22%	-	-	-	0,20%	5,104%	-
IRF-M 1+	1,93%	5,79%	5,97%	5,10%	6,87%	19,47%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,06%	5,62%	5,75%	5,16%	6,73%	19,04%	0,20%	2,839%	6,47%
IMA Geral	1,69%	3,74%	4,79%	7,19%	10,52%	25,12%	-	-	-

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 IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,64%	3,64%	4,72%	6,80%	9,98%	24,22%	0,20%	1,557%	4,59%
IMA-B 5	1,54%	4,55%	6,77%	10,89%	16,86%	32,06%	-	-	-
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	1,52%	4,52%	6,71%	10,81%	16,65%	31,60%	0,10%	1,454%	3,33%
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%
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%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,63%	3,20%	4,94%	8,59%	17,74%	34,28%	0,20%	0,285%	0,39%
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%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,02%	2,84%	4,62%	9,32%	-	-	0,20%	0,576%	-
IRF-M 1	1,09%	2,75%	3,97%	7,47%	14,04%	26,55%	-	-	-
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%
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	1,07%	2,22%	3,49%	6,88%	13,62%	26,43%	0,50%	0,161%	0,45%
BRADERCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1,06%	2,72%	3,91%	7,26%	13,91%	26,00%	0,20%	0,183%	0,81%
Selic	1,00%	2,07%	3,26%	6,67%	13,61%	26,14%	-	-	-

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
BRDESCO 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%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VIII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,19%	3,49%	4,77%	6,68%	11,42%	-	0,20%	0,413%	2,84%
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%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,97%	2,03%	3,23%	6,67%	13,74%	26,44%	0,20%	0,015%	0,05%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,94%	1,93%	3,04%	6,23%	12,64%	24,00%	0,80%	0,001%	0,03%

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

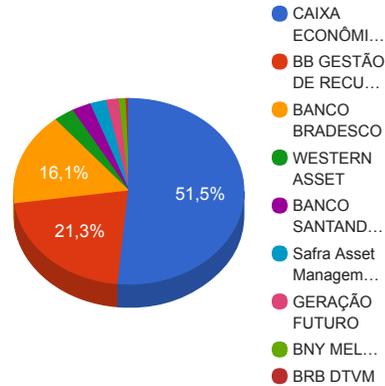
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDIV	8,13%	-2,17%	-5,85%	-13,11%	-27,46%	-35,85%	-	-	-
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	7,23%	5,35%	5,52%	7,61%	-1,98%	15,73%	3,00%	10,091%	19,94%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	2,31%	-3,64%	-6,63%	-2,91%	1,06%	6,67%	3,00%	12,103%	19,28%
BBSEGURIDADE ON NM - BBSE3	7,87%	2,55%	-3,92%	-13,06%	-20,74%	15,22%	-	-	-
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	7,71%	2,27%	-4,28%	-13,69%	-21,76%	11,08%	1,5%	19,084%	39,75%
Ibovespa	5,91%	-1,28%	-5,16%	-8,22%	-17,04%	-9,13%	-	-	-
XP INVESTOR FI AÇÕES	6,66%	2,80%	2,79%	5,02%	-2,85%	7,71%	2,00%	9,853%	21,41%
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	4,68%	-2,09%	-5,43%	-6,63%	-9,41%	-2,33%	1,00%	12,903%	20,24%
BB PIPE FIC AÇÕES	4,24%	3,85%	2,09%	-2,49%	-1,36%	14,60%	1,20%	6,430%	13,67%
GERAÇÃO FI AÇÕES	2,21%	-6,00%	-7,12%	-2,57%	0,87%	0,35%	3,00%	11,202%	18,23%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	2,20%	-4,97%	-5,27%	0,28%	2,50%	5,36%	2,00%	10,060%	17,09%
IFNC	5,25%	1,02%	-3,55%	-4,86%	-16,62%	10,05%	-	-	-
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	5,28%	0,96%	-3,43%	-4,91%	-17,21%	9,58%	1,00%	16,969%	27,96%
IPCA + 6,00% ao ano	1,34%	3,11%	4,63%	8,67%	16,92%	33,42%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA VIII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1,66%	3,27%	4,92%	8,27%	17,40%	33,32%	0,15%	0,095%	0,47%
CIELO ON NM - CIEL3	-8,44%	-7,68%	-11,68%	-18,53%	-15,19%	23,73%	-	-	-
BB CIELO FI AÇÕES	-8,54%	-7,90%	-12,00%	-19,10%	-16,48%	19,75%	1,50%	25,670%	31,44%

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

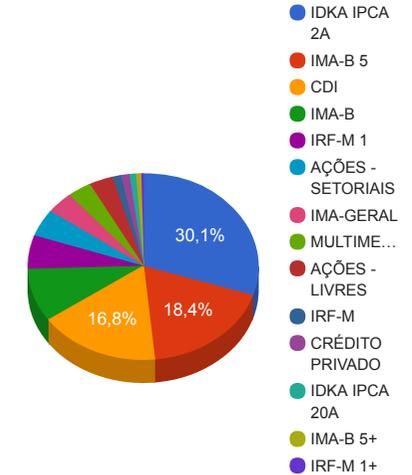
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
S&P 500	-0,41%	-5,47%	-7,12%	-2,03%	-8,19%	3,91%	-	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	1,33%	-4,74%	-4,45%	4,13%	3,70%	30,06%	1,00%	9,013%	16,79%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	127.985.936,64	51,45%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	53.059.555,99	21,33%
BANCO BRADESCO	40.156.458,21	16,14%
WESTERN ASSET	7.135.572,79	2,87%
BANCO SANTANDER	6.609.057,71	2,66%
Safra Asset Management	5.598.653,74	2,25%
GERAÇÃO FUTURO	4.379.577,18	1,76%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	2.404.325,88	0,97%
BRB DTVM	1.418.792,39	0,57%



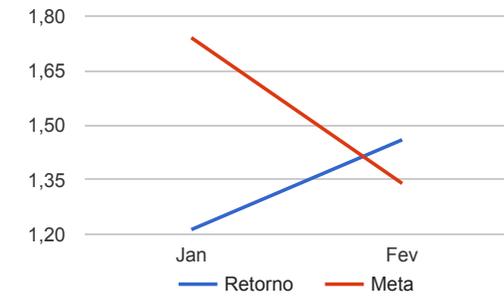
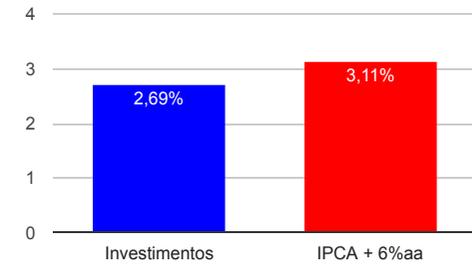
Sub-segmento	Valor	%
IDKA IPCA 2A	63.274.021,22	25,44%
IMA-B 5	38.652.273,07	15,54%
CDI	35.268.490,70	14,18%
IMA-B	19.432.087,08	7,81%
IRF-M 1	12.282.500,22	4,94%
AÇÕES - SETORIAIS	9.975.779,87	4,01%
IMA-GERAL	7.995.187,77	3,21%
MULTIMERCADO	7.135.572,79	2,87%
AÇÕES - LIVRES	7.065.689,07	2,84%
IRF-M	2.487.364,30	1,00%
CRÉDITO PRIVADO	2.485.202,81	1,00%
IDKA IPCA 20A	1.910.748,18	0,77%
IMA-B 5+	1.560.540,73	0,63%
IRF-M 1+	794.934,72	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%
Fevereiro	244.741.399,82	9.607.549,88	9.179.947,33	248.747.930,53	3.578.928,16	1,46%	1,34%	108,59%	2,84%
Acumulado no ano					6.512.444,82	2,69%	3,11%	86,60%	

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(%)
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	626.369,03	0,00	19.530,77	630.462,30	23.624,04	3,77%	6,34%	0,65%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.476.480,25	0,00	0,00	3.580.125,45	103.645,20	2,98%	3,19%	2,98%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1.309.998,11	0,00	0,00	1.345.589,81	35.591,70	2,72%	2,57%	2,72%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.519.327,52	0,00	0,00	1.560.540,73	41.213,21	2,71%	4,37%	2,71%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	654.422,57	0,00	0,00	669.673,93	15.251,36	2,33%	3,30%	2,33%
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.869.459,86	0,00	0,00	1.910.748,18	41.288,32	2,21%	5,74%	2,21%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	3.224.576,73	0,00	0,00	3.293.638,19	69.061,46	2,14%	2,82%	2,14%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	8.587.057,08	76.372,47	0,00	8.848.364,51	184.934,96	2,13%	2,64%	2,14%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	778.896,33	0,00	0,00	794.934,72	16.038,39	2,06%	2,84%	2,06%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.865.846,77	0,00	0,00	7.995.187,77	129.341,00	1,64%	1,56%	1,64%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.442.821,22	0,00	72.375,16	2.409.822,70	39.376,64	1,61%	0,29%	1,63%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	6.010.947,50	500.000,00	0,00	6.609.057,71	98.110,21	1,51%	1,45%	1,52%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	30.492.115,96	1.087.261,89	0,00	32.043.215,36	463.837,51	1,47%	1,44%	1,51%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	34.469.048,35	0,00	0,00	34.941.960,43	472.912,08	1,37%	1,37%	1,37%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.775.460,78	0,00	0,00	1.799.005,76	23.544,98	1,33%	1,41%	1,33%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VIII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.458.133,93	0,00	0,00	2.487.364,30	29.230,37	1,19%	0,41%	1,19%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	731.442,87	0,00	0,00	739.481,10	8.038,23	1,10%	0,18%	1,10%
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	2.280.582,21	0,00	0,00	2.305.015,55	24.433,34	1,07%	0,16%	1,07%
BRADERCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	9.141.166,55	0,00	0,00	9.238.003,57	96.837,02	1,06%	0,18%	1,06%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.127.831,00	0,00	0,00	1.139.613,00	11.782,00	1,04%	1,34%	1,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	27.031.252,08	0,00	770.446,91	26.533.055,03	272.249,86	1,01%	0,58%	1,02%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	594.692,89	0,00	0,00	600.661,51	5.968,62	1,00%	0,05%	1,00%

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(%)
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	30.614.375,18	0,00	0,00	30.918.454,64	304.079,46	0,99%	0,01%	0,99%
CAIXA BRASIL 2016 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	21.417.320,00	0,00	598.527,21	21.023.620,00	204.827,21	0,96%	4,87%	-1,84%
CAIXA BRASIL 2016 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	15.994.440,00	0,00	469.203,91	15.678.045,00	152.808,91	0,96%	5,10%	-1,98%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.880.659,62	842.822,07	0,00	2.745.916,24	22.434,55	0,82%	0,01%	0,97%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	1.145.374,96	7.101.093,45	7.249.863,37	1.003.458,31	6.853,27	0,08%	0,00%	0,94%
Total Renda Fixa					2.897.313,90	1,32%	1,78%	

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(%)	
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	2.368.048,89	0,00	0,00	2.550.627,61	182.578,72	7,71%	19,08%	7,71%	
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	951.936,93	0,00	0,00	1.020.785,32	68.848,39	7,23%	10,09%	7,23%	
XP INVESTOR FI AÇÕES	1.297.099,16	0,00	0,00	1.383.540,56	86.441,40	6,66%	9,85%	6,66%	
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	2.498.682,48	0,00	0,00	2.630.512,11	131.829,63	5,28%	16,97%	5,28%	
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	1.839.714,27	0,00	0,00	1.925.819,57	86.105,30	4,68%	12,90%	4,68%	
BB PIPE FIC AÇÕES	822.778,36	0,00	0,00	857.664,50	34.886,14	4,24%	6,43%	4,24%	
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.179.625,60	0,00	0,00	2.230.031,20	50.405,60	2,31%	12,10%	2,31%	
GERAÇÃO FI AÇÕES	1.388.120,85	0,00	0,00	1.418.792,39	30.671,54	2,21%	11,20%	2,21%	
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	1.447.982,02	0,00	0,00	1.479.872,05	31.890,03	2,20%	10,06%	2,20%	
CAIXA BRASIL IPCA VIII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.697.717,00	0,00	0,00	1.725.873,00	28.156,00	1,66%	0,09%	1,66%	
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	7.041.649,29	0,00	0,00	7.135.572,79	93.923,50	1,33%	9,01%	1,33%	
BB CIELO FI AÇÕES	1.687.945,62	0,00	0,00	1.543.823,63	-144.121,99	-8,54%	25,67%	-8,54%	
Total Renda Variável						681.614,26	2,70%	11,95%	