

# Relatório Analítico dos Investimentos em março e 1º Trimestre de 2016



Carteira consolidada de investimentos - base (março / 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	748.452,82	0,29%	1.169	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.085.127,24	2,77%	666	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.808.468,73	0,71%	721	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	10.120.959,22	3,96%	564	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2016 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2016	21.214.180,00	8,31%	103	2,79%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	27.014.959,20	10,58%	122	6,62%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	26.754.959,46	10,47%	193	1,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2024	656.042,09	0,26%	17	0,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	836.597,73	0,33%	84	0,51%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2016 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2016	15.820.080,00	6,19%	154	3,50%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	6.658.264,84	2,61%	307	0,50%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	701.810,52	0,27%	620	1,49%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	2.156.330,82	0,84%	41	3,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.262.051,70	3,23%	201	0,81%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRASESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	9.355.063,69	3,66%	88	0,91%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	3.445.089,96	1,35%	18	1,91%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	D+1	Não há	2.333.497,28	0,91%	13	0,74%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	34.612.476,90	13,55%	330	1,59%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VIII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	01/01/2017	2.521.540,76	0,99%	49	0,41%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.776.461,24	1,09%	843	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRASESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	31.273.282,83	12,24%	388	0,49%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.410.820,99	0,55%	477	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "

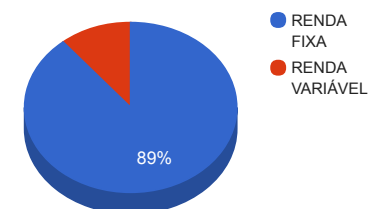
Carteira consolidada de investimentos - base (março / 2016)

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 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	16/05/2023	3.715.378,78	1,45%	52	1,49%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.096.023,79	0,43%	139	0,75%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	2.438.541,21	0,95%	143	0,25%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+30 a D+2880	Não há	1.369.306,02	0,54%	51	0,46%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	1.167.017,00	0,46%	100	0,61%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	D+4	Não há	3.232.963,77	1,27%	3.406	7,02%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	1.348.604,14	0,53%	168	1,06%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	D+12	Não há	1.401.823,83	0,55%	449	2,11%	Artigo 8º, Inciso III
BB CIELO FI AÇÕES	D+4	Não há	1.750.995,51	0,69%	7.167	1,09%	Artigo 8º, Inciso III
XP INVESTOR FI AÇÕES	D+4	Não há	1.524.792,81	0,60%	2.599	1,44%	Artigo 8º, Inciso III
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	1.148.458,79	0,45%	609	6,05%	Artigo 8º, Inciso III
BB PIPE FIC AÇÕES	D+4	03/06/2018	927.959,13	0,36%	48	1,13%	Artigo 8º, Inciso III
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	D+4	Não há	3.120.622,62	1,22%	9.859	1,79%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.089.677,52	0,82%	3.497	0,84%	Artigo 8º, Inciso III
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	2.108.756,52	0,83%	29	5,34%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA BRASIL IPCA VIII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+0	06/12/2016	1.753.189,00	0,69%	21	2,00%	Artigo 8º, Inciso IV
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	7.667.167,23	3,00%	248	5,24%	Artigo 8º, Inciso IV
		<b>TOTAL -</b>	<b>255.427.795,69</b>				

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

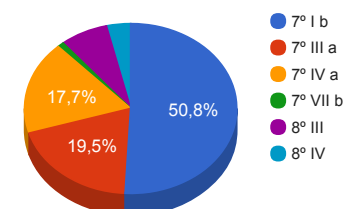
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	10,00%	0,00	0,00%	25.542.779,57
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	75,00%	129.838.284,37	50,83%	61.732.562,40
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	50,00%	49.746.127,83	19,48%	77.967.770,02
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	45.232.049,60	17,71%	31.396.289,11
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	12.771.389,78
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	12.771.389,78
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	2.536.323,02	0,99%	10.235.066,76
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>180,00</b>	<b>227.352.784,82</b>	<b>89,01%</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%	12.771.389,78
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	18.654.654,64	7,30%	19.659.514,71
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	9.420.356,23	3,69%	3.351.033,55
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	12.771.389,78
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	12.771.389,78
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>35,00</b>	<b>28.075.010,87</b>	<b>10,99%</b>	

Distribuição por Artigo / Resolução



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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDKA IPCA 20 Anos	20,28%	22,28%	22,28%	28,42%	15,72%	42,96%	-	-	-
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12,85%	15,30%	15,30%	21,56%	15,41%	38,03%	0,20%	14,390%	18,30%
IMA-B 5+	8,30%	12,62%	12,62%	18,46%	15,77%	35,93%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8,34%	12,47%	12,47%	17,93%	15,09%	34,46%	0,20%	10,098%	13,64%
IMA-B	5,31%	9,75%	9,75%	15,47%	15,59%	33,54%	-	-	-
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	5,23%	9,26%	9,26%	14,76%	14,44%	32,78%	0,20%	6,362%	8,92%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	4,80%	9,11%	9,11%	14,95%	15,77%	35,17%	0,15%	7,348%	9,88%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	4,60%	8,68%	8,68%	14,03%	15,56%	29,35%	0,45%	5,993%	7,73%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4,06%	6,41%	6,41%	11,93%	-	-	0,20%	6,761%	-
CAIXA BRASIL 2016 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,91%	0,61%	0,61%	5,38%	-	-	0,20%	0,333%	-
CAIXA BRASIL 2016 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,91%	0,46%	0,46%	5,23%	-	-	0,20%	0,333%	-
IRF-M 1+	5,21%	11,31%	11,31%	13,17%	13,09%	25,02%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5,24%	11,16%	11,16%	12,95%	12,99%	24,73%	0,20%	4,348%	6,83%
IMA Geral	3,42%	7,28%	7,28%	11,27%	14,24%	28,51%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,34%	7,10%	7,10%	10,88%	13,57%	27,55%	0,20%	3,142%	4,81%
IRF-M 1	1,26%	4,04%	4,04%	7,79%	14,41%	27,15%	-	-	-
BRAPSA IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1,27%	4,02%	4,02%	7,93%	14,27%	26,69%	0,20%	0,157%	0,79%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	1,24%	3,48%	3,48%	7,10%	13,79%	27,01%	0,50%	0,278%	0,48%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,21%	3,99%	3,99%	7,67%	14,09%	26,29%	0,10%	0,171%	0,53%
Selic	1,16%	3,26%	3,26%	6,73%	13,74%	26,64%	-	-	-
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,15%	3,23%	3,23%	6,69%	13,76%	26,83%	0,20%	0,007%	0,03%
CDI	1,16%	3,25%	3,25%	6,72%	13,73%	26,53%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VIII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,37%	4,91%	4,91%	8,45%	12,77%	24,98%	0,20%	0,437%	2,60%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,17%	3,36%	3,36%	6,75%	13,46%	26,04%	0,20%	0,102%	0,23%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,11%	3,16%	3,16%	6,66%	13,82%	26,87%	0,20%	0,015%	0,05%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	1,09%	3,04%	3,04%	6,28%	12,77%	24,47%	0,80%	0,000%	0,03%
IPCA + 6,00% ao ano	0,94%	4,08%	4,08%	8,58%	15,90%	32,87%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,78%	8,90%	8,90%	14,33%	15,21%	32,29%	0,15%	6,002%	9,30%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,19%	4,43%	4,43%	8,93%	16,76%	34,23%	0,20%	0,183%	0,37%
IMA-B 5	0,76%	5,35%	5,35%	10,86%	16,55%	31,87%	-	-	-
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	0,74%	5,30%	5,30%	10,74%	16,35%	31,41%	0,10%	1,835%	3,49%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,73%	5,24%	5,24%	10,60%	16,05%	30,95%	0,20%	1,835%	3,51%
IPCA	0,42%	2,62%	2,62%	5,51%	9,39%	18,28%	-	-	-

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	2,40%	7,45%	7,45%	13,42%	-	-	0,20%	1,277%	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1,76%	7,40%	7,40%	13,11%	16,14%	32,54%	0,20%	3,989%	6,92%
IDKA IPCA 2 Anos	0,15%	5,16%	5,16%	10,57%	17,31%	32,68%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,84%	3,70%	3,70%	8,76%	-	-	0,20%	0,554%	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,62%	4,92%	4,92%	10,39%	16,35%	31,45%	0,20%	1,836%	3,11%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,53%	4,93%	4,93%	10,39%	16,25%	31,02%	0,20%	1,837%	3,20%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFNC	23,32%	24,58%	24,58%	22,79%	3,44%	22,12%	-	-	-
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	22,90%	24,08%	24,08%	22,33%	2,42%	21,17%	1,00%	27,328%	31,92%
BBSEGURIDADE ON NM - BBSE3	23,13%	26,28%	26,28%	23,83%	-3,59%	31,64%	-	-	-
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	22,35%	25,12%	25,12%	22,27%	-5,48%	26,34%	1,5%	33,573%	43,85%
IDIV	20,60%	17,98%	17,98%	11,69%	-8,75%	-27,78%	-	-	-
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	12,51%	18,53%	18,53%	25,82%	10,66%	22,18%	3,00%	12,948%	20,84%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	-6,29%	-9,70%	-9,70%	-10,45%	-8,87%	-7,24%	3,00%	13,061%	20,31%
Ibovespa	16,97%	15,47%	15,47%	11,09%	-2,14%	-0,71%	-	-	-
XP INVESTOR FI AÇÕES	10,21%	13,29%	13,29%	21,17%	7,44%	13,41%	2,00%	11,031%	21,57%
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	9,50%	7,21%	7,21%	4,41%	-1,21%	2,68%	1,00%	12,329%	20,93%
BB PIPE FIC AÇÕES	8,20%	12,36%	12,36%	8,42%	4,18%	17,61%	1,20%	8,288%	14,13%
GERAÇÃO FI AÇÕES	-4,95%	-10,65%	-10,65%	-9,66%	-7,67%	-10,57%	3,00%	12,956%	19,27%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	-5,27%	-9,98%	-9,98%	-7,65%	-5,75%	-5,68%	2,00%	13,518%	18,43%
CIELO ON NM - CIEL3	13,74%	5,00%	5,00%	-3,79%	-6,66%	21,32%	-	-	-
BB CIELO FI AÇÕES	13,42%	4,46%	4,46%	-4,63%	-8,19%	17,38%	1,50%	19,821%	33,12%
S&P 500	6,60%	0,77%	0,77%	7,28%	-0,39%	10,01%	-	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	7,45%	2,35%	2,35%	13,85%	12,23%	37,92%	1,00%	4,860%	16,62%

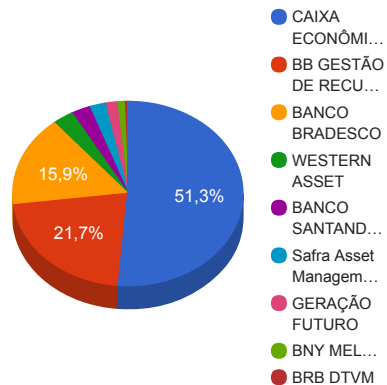


Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (março / 2016)

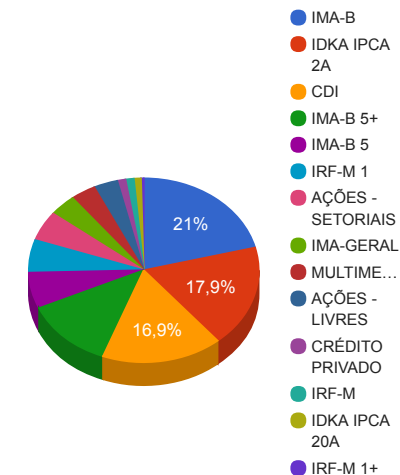
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA + 6,00% ao ano	0,94%	4,08%	4,08%	8,58%	15,90%	32,87%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA VIII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1,58%	4,91%	4,91%	9,20%	17,07%	34,07%	0,15%	0,258%	0,46%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	131.049.524,86	51,31%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	55.430.737,39	21,70%
BANCO BRADESCO	40.628.346,52	15,91%
WESTERN ASSET	7.667.167,23	3,00%
BANCO SANTANDER	6.658.264,84	2,61%
Safra Asset Management	5.778.587,24	2,26%
GERAÇÃO FUTURO	4.193.311,87	1,64%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	2.673.251,60	1,05%
BRB DTVM	1.348.604,14	0,53%



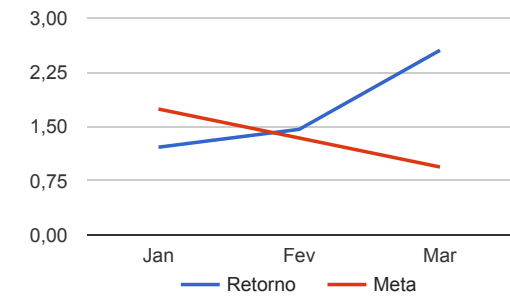
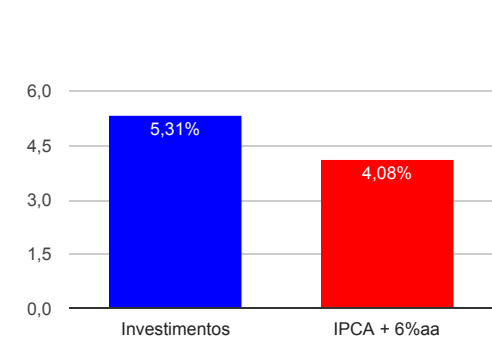
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	45.569.339,46	17,84%
IDKA IPCA 2A	38.684.387,41	15,14%
CDI	36.556.588,85	14,31%
IMA-B 5+	27.014.959,20	10,58%
IMA-B 5	13.743.392,08	5,38%
IRF-M 1	12.437.013,79	4,87%
AÇÕES - SETORIAIS	11.342.718,21	4,44%
IMA-GERAL	8.262.051,70	3,23%
MULTIMERCADO	7.667.167,23	3,00%
AÇÕES - LIVRES	7.311.936,43	2,86%
CRÉDITO PRIVADO	2.536.323,02	0,99%
IRF-M	2.521.540,76	0,99%
IDKA IPCA 20A	2.156.330,82	0,84%
IRF-M 1+	836.597,73	0,33%



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%
Março	248.747.930,53	182.053.778,36	181.728.508,26	255.427.795,69	6.354.595,06	2,55%	0,94%	270,78%	4,25%
Acumulado no ano					12.867.039,88	5,31%	4,08%	130,21%	

**Acumulado no Ano**



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.910.748,18	0,00	0,00	2.156.330,82	245.582,64	12,85%	14,39%	12,85%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	794.934,72	0,00	0,00	836.597,73	41.663,01	5,24%	4,35%	5,24%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	669.673,93	0,00	0,00	701.810,52	32.136,59	4,80%	7,35%	4,80%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	3.293.638,19	0,00	0,00	3.445.089,96	151.451,77	4,60%	5,99%	4,60%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	630.462,30	0,00	0,00	656.042,09	25.579,79	4,06%	6,76%	4,06%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.580.125,45	0,00	0,00	3.715.378,78	135.253,33	3,78%	6,00%	3,78%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.995.187,77	0,00	0,00	8.262.051,70	266.863,93	3,34%	3,14%	3,34%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.139.613,00	0,00	0,00	1.167.017,00	27.404,00	2,40%	1,28%	2,40%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1.345.589,81	0,00	0,00	1.369.306,02	23.716,21	1,76%	3,99%	1,76%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.560.540,73	75.000.000,00	50.600.000,00	27.014.959,20	1.054.418,47	1,38%	10,10%	8,34%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VIII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.487.364,30	0,00	0,00	2.521.540,76	34.176,46	1,37%	0,44%	1,37%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	9.238.003,57	0,00	0,00	9.355.063,69	117.060,12	1,27%	0,16%	1,27%
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	2.305.015,55	0,00	0,00	2.333.497,28	28.481,73	1,24%	0,28%	1,24%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	8.848.364,51	50.242.491,52	25.200.000,00	34.612.476,90	721.620,87	1,22%	6,36%	5,23%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	739.481,10	0,00	0,00	748.452,82	8.971,72	1,21%	0,17%	1,21%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.409.822,70	0,00	0,00	2.438.541,21	28.718,51	1,19%	0,18%	1,19%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	30.918.454,64	0,00	0,00	31.273.282,83	354.828,19	1,15%	0,01%	1,15%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.745.916,24	0,00	0,00	2.776.461,24	30.545,00	1,11%	0,02%	1,11%
CAIXA BRASIL 2016 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	21.023.620,00	0,00	0,00	21.214.180,00	190.560,00	0,91%	0,33%	0,91%
CAIXA BRASIL 2016 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	15.678.045,00	0,00	0,00	15.820.080,00	142.035,00	0,91%	0,33%	0,91%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	26.533.055,03	0,00	0,00	26.754.959,46	221.904,43	0,84%	0,55%	0,84%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	6.609.057,71	0,00	0,00	6.658.264,84	49.207,13	0,74%	1,84%	0,74%

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	600.661,51	800.000,00	0,00	1.410.820,99	10.159,48	0,73%	0,10%	1,17%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.799.005,76	0,00	0,00	1.808.468,73	9.462,97	0,53%	1,84%	0,53%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	34.941.960,43	0,00	25.000.000,00	10.120.959,22	178.998,79	0,51%	1,84%	0,62%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	1.003.458,31	6.011.286,84	5.928.508,26	1.096.023,79	9.786,90	0,14%	0,00%	1,09%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	32.043.215,36	50.000.000,00	75.000.000,00	7.085.127,24	41.911,88	0,05%	1,83%	0,73%
Total Renda Fixa					4.182.498,92	1,87%	3,04%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)	
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	2.630.512,11	0,00	0,00	3.232.963,77	602.451,66	22,90%	27,33%	22,90%	
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	2.550.627,61	0,00	0,00	3.120.622,62	569.995,01	22,35%	33,57%	22,35%	
BB CIELO FI AÇÕES	1.543.823,63	0,00	0,00	1.750.995,51	207.171,88	13,42%	19,82%	13,42%	
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.020.785,32	0,00	0,00	1.148.458,79	127.673,47	12,51%	12,95%	12,51%	
XP INVESTOR FI AÇÕES	1.383.540,56	0,00	0,00	1.524.792,81	141.252,25	10,21%	11,03%	10,21%	
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	1.925.819,57	0,00	0,00	2.108.756,52	182.936,95	9,50%	12,33%	9,50%	
BB PIPE FIC AÇÕES	857.664,50	0,00	0,00	927.959,13	70.294,63	8,20%	8,29%	8,20%	
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	7.135.572,79	0,00	0,00	7.667.167,23	531.594,44	7,45%	4,86%	7,45%	
CAIXA BRASIL IPCA VIII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.725.873,00	0,00	0,00	1.753.189,00	27.316,00	1,58%	0,26%	1,58%	
GERAÇÃO FI AÇÕES	1.418.792,39	0,00	0,00	1.348.604,14	-70.188,25	-4,95%	12,96%	-4,95%	
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	1.479.872,05	0,00	0,00	1.401.823,83	-78.048,22	-5,27%	13,52%	-5,27%	
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.230.031,20	0,00	0,00	2.089.677,52	-140.353,68	-6,29%	13,06%	-6,29%	
<b>Total Renda Variável</b>						<b>2.172.096,14</b>	<b>8,39%</b>	<b>14,06%</b>	

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	33.507.441,50	0,00	25.000.000,00	10.120.959,22	1.613.517,72	4,82%	4,92%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	27.239.824,42	50.393.012,41	44.200.000,00	34.612.476,90	1.179.640,07	4,42%	9,26%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.479.575,20	75.000.000,00	55.600.000,00	27.014.959,20	1.135.384,00	4,77%	12,47%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	81.087.261,89	75.000.000,00	7.085.127,24	997.865,35	3,19%	5,24%
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	30.295.975,61	0,00	0,00	31.273.282,83	977.307,22	3,23%	3,23%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	26.551.596,87	0,00	770.446,91	26.754.959,46	973.809,50	3,69%	3,70%
CAIXA BRASIL 2016 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	21.085.920,00	0,00	598.527,21	21.214.180,00	726.787,21	3,47%	0,61%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.714.066,88	0,00	0,00	8.262.051,70	547.984,82	7,10%	7,10%
CAIXA BRASIL 2016 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	15.747.135,00	0,00	469.203,91	15.820.080,00	542.148,91	3,47%	0,46%
BRADERCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	8.993.129,54	0,00	0,00	9.355.063,69	361.934,15	4,02%	4,02%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	5.838.366,64	500.000,00	0,00	6.658.264,84	319.898,20	5,29%	5,30%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.411.649,13	0,00	0,00	3.715.378,78	303.729,65	8,90%	8,90%
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.870.123,58	0,00	0,00	2.156.330,82	286.207,24	15,30%	15,30%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	3.169.841,51	0,00	0,00	3.445.089,96	275.248,45	8,68%	8,68%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.688.141,79	0,00	6.000.000,00	836.597,73	148.455,94	8,87%	11,16%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VIII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.403.516,67	0,00	0,00	2.521.540,76	118.024,09	4,91%	4,91%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.405.706,10	0,00	72.375,16	2.438.541,21	105.210,27	4,41%	4,43%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1.275.010,05	0,00	0,00	1.369.306,02	94.295,97	7,40%	7,40%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.723.451,20	0,00	0,00	1.808.468,73	85.017,53	4,93%	4,93%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.086.148,00	0,00	0,00	1.167.017,00	80.869,00	7,45%	7,45%
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	2.254.918,99	0,00	0,00	2.333.497,28	78.578,29	3,48%	3,48%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.861.053,15	842.822,07	0,00	2.776.461,24	72.586,02	3,02%	3,16%

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	616.550,10	0,00	19.530,77	656.042,09	59.022,76	9,70%	6,41%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	643.187,48	0,00	0,00	701.810,52	58.623,04	9,11%	9,11%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	719.752,81	0,00	0,00	748.452,82	28.700,01	3,99%	3,99%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	616.077,90	18.905.415,17	18.450.504,26	1.096.023,79	25.034,98	0,35%	3,04%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	587.895,81	800.000,00	0,00	1.410.820,99	22.925,18	2,91%	3,36%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>11.218.805,57</b>	<b>5,20%</b>	



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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	2.605.618,27	0,00	0,00	3.232.963,77	627.345,50	24,08%	24,08%
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	2.494.050,57	0,00	0,00	3.120.622,62	626.572,05	25,12%	25,12%
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	968.933,74	0,00	0,00	1.148.458,79	179.525,05	18,53%	18,53%
XP INVESTOR FI AÇÕES	1.345.864,94	0,00	0,00	1.524.792,81	178.927,87	13,29%	13,29%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	7.491.021,64	0,00	0,00	7.667.167,23	176.145,59	2,35%	2,35%
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	1.967.027,59	0,00	0,00	2.108.756,52	141.728,93	7,21%	7,21%
BB PIPE FIC AÇÕES	825.903,04	0,00	0,00	927.959,13	102.056,09	12,36%	12,36%
CAIXA BRASIL IPCA VIII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.671.209,00	0,00	0,00	1.753.189,00	81.980,00	4,91%	4,91%
BB CIELO FI AÇÕES	1.676.291,41	0,00	0,00	1.750.995,51	74.704,10	4,46%	4,46%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	1.557.272,67	0,00	0,00	1.401.823,83	-155.448,84	-9,98%	-9,98%
GERAÇÃO FI AÇÕES	1.509.376,81	0,00	0,00	1.348.604,14	-160.772,67	-10,65%	-10,65%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.314.206,88	0,00	0,00	2.089.677,52	-224.529,36	-9,70%	-9,70%
Total Renda Variável					1.648.234,31	6,24%	