

Relatório Analítico dos Investimentos em maio de 2016



Carteira consolidada de investimentos - base (maio / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	7.579.641,78	2,89%	297	0,52%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	2.267.755,83	0,86%	40	3,33%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	764.664,36	0,29%	1.176	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2016 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2016	21.673.400,00	8,26%	103	2,79%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.537.079,36	3,25%	198	0,84%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.249.219,48	2,76%	686	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	27.352.078,52	10,43%	193	1,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.852.306,16	0,71%	728	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2024	685.911,03	0,26%	17	0,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	36.522.427,42	13,92%	579	0,99%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2016 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2016	16.162.380,00	6,16%	154	3,50%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	728.981,68	0,28%	701	1,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.350.754,70	0,90%	136	0,52%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	3.561.147,18	1,36%	17	2,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	877.174,69	0,33%	91	0,50%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADERCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	9.555.698,47	3,64%	89	0,93%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	D+1	Não há	2.384.250,38	0,91%	12	0,74%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	36.150.801,19	13,78%	326	1,66%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.946.491,78	1,12%	828	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	31.954.019,09	12,18%	385	0,49%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.441.650,79	0,55%	472	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	16/05/2023	3.758.037,41	1,43%	52	1,49%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "

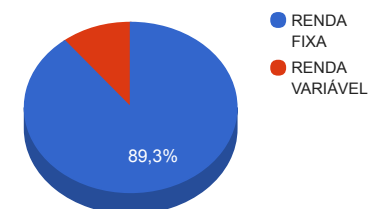
Carteira consolidada de investimentos - base (maio / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	309.783,57	0,12%	148	0,17%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	2.492.324,97	0,95%	143	0,25%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VIII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	01/01/2017	2.575.643,35	0,98%	49	0,41%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	1.192.070,00	0,45%	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	1.410.421,11	0,54%	51	0,46%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	D+4	Não há	2.862.775,65	1,09%	9.580	1,82%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	1.949.150,25	0,74%	3.362	0,85%	Artigo 8º, Inciso III
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	2.063.436,58	0,79%	27	5,62%	Artigo 8º, Inciso III
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	D+4	Não há	3.104.115,31	1,18%	3.419	7,60%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	1.268.589,30	0,48%	161	1,05%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	D+12	Não há	1.333.823,01	0,51%	432	2,16%	Artigo 8º, Inciso III
BB CIELO FI AÇÕES	D+4	Não há	1.899.766,40	0,72%	7.043	1,10%	Artigo 8º, Inciso III
XP INVESTOR FI AÇÕES	D+4	Não há	1.626.001,50	0,62%	2.578	1,42%	Artigo 8º, Inciso III
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	1.202.736,84	0,46%	737	6,04%	Artigo 8º, Inciso III
BB PIPE FIC AÇÕES	D+4	03/06/2018	940.343,45	0,36%	48	1,13%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA BRASIL IPCA VIII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+0	06/12/2016	1.788.068,00	0,68%	21	2,00%	Artigo 8º, Inciso IV
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	7.977.994,21	3,04%	233	5,76%	Artigo 8º, Inciso IV
		TOTAL -	262.352.914,80				

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

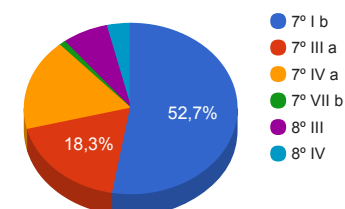
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	10,00%	0,00	0,00%	26.235.291,48
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	75,00%	138.164.922,19	52,66%	58.599.763,91
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	50,00%	48.090.750,04	18,33%	83.085.707,36
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	45.477.950,96	17,33%	33.227.923,48
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	13.117.645,74
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	13.117.645,74
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	2.602.491,11	0,99%	10.515.154,63
Total Renda Fixa	100,00%	180,00	234.336.114,30	89,32%	

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%	13.117.645,74
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	18.250.738,29	6,96%	21.102.198,93
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	9.766.062,21	3,72%	3.351.583,53
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	13.117.645,74
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	13.117.645,74
Total Renda Variável	30,00%	35,00	28.016.800,50	10,68%	

Distribuição por Artigo / Resolução



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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA + 6,00% ao ano	1,27%	6,54%	3,33%	8,11%	15,85%	33,21%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,23%	6,73%	3,42%	8,53%	16,33%	33,84%	0,20%	0,174%	0,34%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,45%	13,32%	7,99%	16,41%	16,04%	30,09%	0,15%	4,262%	9,39%
Selic	1,11%	5,50%	3,36%	6,73%	14,00%	27,24%	-	-	-
BRABESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,12%	5,47%	3,35%	6,70%	14,00%	27,41%	0,20%	0,005%	0,02%
CDI	1,11%	5,50%	3,36%	6,72%	13,98%	27,14%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,14%	5,37%	3,27%	6,61%	13,95%	27,37%	0,20%	0,043%	0,17%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,08%	5,62%	3,38%	6,81%	13,75%	26,63%	0,20%	0,010%	0,23%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	1,04%	5,13%	3,14%	6,28%	13,03%	25,06%	0,80%	0,036%	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VIII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,03%	7,16%	3,55%	8,49%	12,83%	22,99%	0,20%	1,368%	2,39%
IRF-M 1	1,07%	6,27%	3,43%	7,53%	14,79%	27,53%	-	-	-
BRABESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1,06%	6,26%	3,44%	7,48%	14,58%	27,07%	0,20%	0,087%	0,77%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,04%	6,24%	3,41%	7,47%	14,52%	26,76%	0,10%	0,086%	0,51%
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	1,00%	5,74%	3,44%	7,05%	13,98%	27,60%	0,50%	0,228%	0,50%
IMA-B 5	0,80%	7,82%	3,13%	10,11%	16,83%	31,29%	-	-	-
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	0,78%	7,74%	3,08%	10,00%	16,63%	30,83%	0,10%	1,401%	3,52%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,78%	7,67%	3,07%	9,87%	16,25%	30,33%	0,20%	0,906%	3,51%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA	0,78%	4,05%	1,83%	5,05%	9,32%	18,58%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,49%	9,75%	4,60%	10,25%	17,61%	-	0,20%	0,850%	3,58%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,47%	10,62%	4,82%	13,54%	16,03%	30,64%	0,20%	2,849%	6,89%
IDKA IPCA 2 Anos	0,63%	7,57%	2,45%	9,61%	16,89%	32,04%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,34%	6,02%	3,09%	7,85%	15,89%	-	0,20%	0,200%	1,40%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,80%	7,47%	3,06%	9,58%	16,70%	31,05%	0,20%	1,279%	3,11%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,75%	7,48%	2,96%	9,61%	16,59%	30,65%	0,20%	1,316%	3,23%
IMA Geral	0,42%	10,85%	6,86%	11,97%	14,11%	27,45%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,38%	10,67%	6,78%	11,82%	13,49%	26,53%	0,20%	1,786%	4,85%
IDKA IPCA 20 Anos	-2,02%	30,89%	28,75%	28,42%	8,90%	29,00%	-	-	-
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,86%	21,26%	18,68%	20,82%	10,95%	28,16%	0,20%	8,754%	18,59%
IMA-B 5+	-0,73%	17,79%	13,27%	19,12%	13,37%	29,77%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,80%	17,46%	13,15%	18,59%	12,51%	27,92%	0,20%	5,104%	13,77%
IRF-M 1+	-0,14%	16,48%	10,10%	16,67%	14,57%	25,99%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,02%	16,55%	10,35%	16,70%	14,78%	25,97%	0,20%	2,602%	7,09%
IMA-B	-0,10%	13,95%	9,34%	15,68%	14,21%	29,84%	-	-	-

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL 2016 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,45%	2,79%	3,09%	4,50%	-	-	0,20%	0,150%	4,22%
CAIXA BRASIL 2016 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,45%	2,64%	3,09%	4,35%	-	-	0,20%	0,150%	-
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,56%	11,25%	8,79%	13,82%	-	-	0,20%	-	-
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	0,02%	13,28%	9,11%	14,65%	13,11%	28,95%	0,20%	3,195%	8,93%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	-0,09%	13,34%	8,86%	14,90%	14,38%	31,53%	0,15%	4,565%	9,96%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	-0,14%	12,34%	8,12%	14,12%	15,81%	30,08%	0,45%	3,593%	8,20%

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

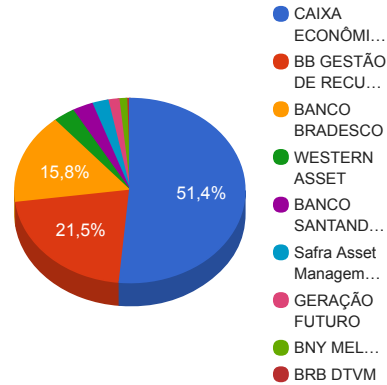
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
S&P 500	1,53%	2,59%	8,53%	0,80%	-0,49%	9,01%	-	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	2,79%	6,50%	11,81%	6,83%	12,47%	37,24%	1,00%	6,718%	17,20%
IPCA + 6,00% ao ano	1,27%	6,54%	3,33%	8,11%	15,85%	33,21%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA VIII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1,15%	6,99%	3,60%	8,70%	16,16%	33,27%	0,15%	0,258%	0,43%
IDIV	-11,84%	16,89%	19,49%	12,50%	-13,11%	-27,92%	-	-	-
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	0,43%	24,13%	17,82%	24,33%	15,05%	22,80%	3,00%	9,540%	21,08%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	-8,02%	-15,77%	-12,60%	-18,39%	-17,29%	-18,30%	3,00%	8,441%	21,83%
IFNC	-10,48%	19,54%	18,33%	14,13%	-0,04%	12,76%	-	-	-
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	-10,23%	19,13%	18,00%	13,96%	-0,59%	11,89%	1,00%	14,823%	33,34%
Ibovespa	-10,09%	11,82%	13,27%	7,43%	-8,13%	-5,40%	-	-	-
BB PIPE FIC AÇÕES	-1,60%	13,86%	9,64%	11,93%	1,66%	13,90%	1,20%	6,781%	15,33%
XP INVESTOR FI AÇÕES	-2,39%	20,81%	17,52%	20,81%	16,86%	16,58%	2,00%	8,090%	22,19%
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	-7,46%	4,90%	7,15%	1,33%	-7,95%	0,90%	1,00%	9,943%	22,25%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	-7,83%	-14,35%	-9,87%	-14,62%	-12,55%	-15,74%	2,00%	8,670%	20,27%
GERAÇÃO FI AÇÕES	-8,25%	-15,95%	-10,59%	-16,95%	-15,20%	-20,92%	3,00%	8,689%	21,15%
BBSEGURIDADE ON NM - BBSE3	-9,13%	15,90%	13,02%	8,58%	-12,97%	6,46%	-	-	-
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	-9,23%	14,78%	12,24%	7,43%	-14,55%	2,49%	1,5%	18,143%	44,84%

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

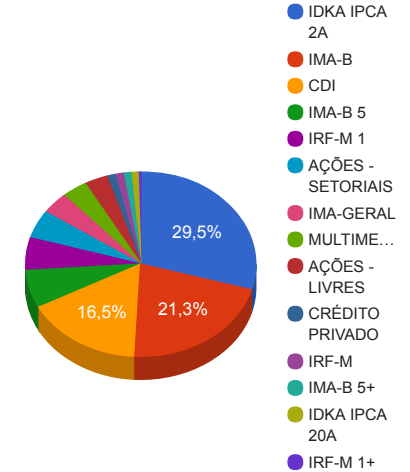
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CIELO ON NM - CIEL3	-5,22%	14,40%	23,92%	9,45%	-3,20%	19,39%	-	-	-
BB CIELO FI AÇÕES	-5,32%	13,33%	23,06%	8,28%	-4,93%	15,50%	1,50%	13,964%	34,19%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	134.940.720,23	51,43%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	56.290.160,88	21,46%
BANCO BRADESCO	41.509.717,56	15,82%
WESTERN ASSET	7.977.994,21	3,04%
BANCO SANTANDER	7.579.641,78	2,89%
Safra Asset Management	5.945.397,56	2,27%
GERAÇÃO FUTURO	4.011.954,94	1,53%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	2.828.738,34	1,08%
BRB DTVM	1.268.589,30	0,48%



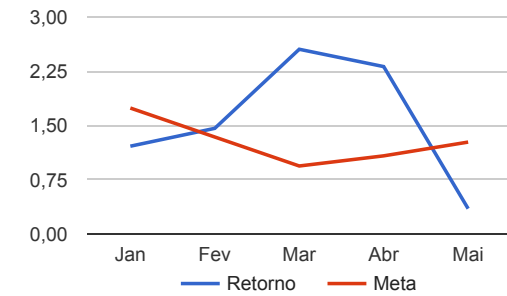
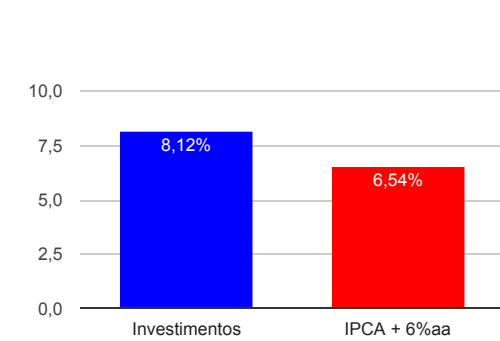
Sub-segmento	Valor	%
IDKA IPCA 2A	65.726.812,10	25,05%
IMA-B	47.377.203,46	18,06%
CDI	36.651.945,23	13,97%
IMA-B 5	14.828.861,26	5,65%
IRF-M 1	12.704.613,21	4,84%
AÇÕES - SETORIAIS	11.018.544,45	4,20%
IMA-GERAL	8.537.079,36	3,25%
MULTIMERCADO	7.977.994,21	3,04%
AÇÕES - LIVRES	7.232.193,84	2,76%
CRÉDITO PRIVADO	2.602.491,11	0,99%
IRF-M	2.575.643,35	0,98%
IMA-B 5+	2.350.754,70	0,90%
IDKA IPCA 20A	2.267.755,83	0,86%
IRF-M 1+	877.174,69	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%
Abril	255.427.795,69	32.599.986,76	32.762.345,97	261.171.295,48	5.905.859,00	2,31%	1,08%	214,81%	2,40%
Mai	261.171.295,48	6.516.425,80	6.252.173,84	262.352.914,80	917.367,36	0,35%	1,27%	27,62%	2,12%
Acumulado no ano					19.690.266,24	8,12%	6,54%	124,30%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.803.711,67	0,00	0,00	2.946.491,78	142.780,11	5,09%	0,04%	1,14%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.174.571,00	0,00	0,00	1.192.070,00	17.499,00	1,49%	0,85%	1,49%
CAIXA BRASIL 2016 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	21.363.440,00	0,00	0,00	21.673.400,00	309.960,00	1,45%	0,15%	1,45%
CAIXA BRASIL 2016 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	15.931.320,00	0,00	0,00	16.162.380,00	231.060,00	1,45%	0,15%	1,45%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	26.989.796,96	0,00	0,00	27.352.078,52	362.281,56	1,34%	0,20%	1,34%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.462.029,10	0,00	0,00	2.492.324,97	30.295,87	1,23%	0,17%	1,23%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	31.600.068,90	0,00	0,00	31.954.019,09	353.950,19	1,12%	0,00%	1,12%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.426.262,42	0,00	0,00	1.441.650,79	15.388,37	1,08%	0,01%	1,08%
BRDESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	9.455.051,78	0,00	0,00	9.555.698,47	100.646,69	1,06%	0,09%	1,06%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	756.796,73	0,00	0,00	764.664,36	7.867,63	1,04%	0,09%	1,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VIII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.549.418,45	0,00	0,00	2.575.643,35	26.224,90	1,03%	1,37%	1,03%
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	2.360.755,61	0,00	0,00	2.384.250,38	23.494,77	1,00%	0,23%	1,00%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	36.234.275,45	0,00	0,00	36.522.427,42	288.151,97	0,80%	1,28%	0,80%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	7.520.916,16	0,00	0,00	7.579.641,78	58.725,62	0,78%	1,40%	0,78%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.193.295,80	0,00	0,00	7.249.219,48	55.923,68	0,78%	0,91%	0,78%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.838.469,99	0,00	0,00	1.852.306,16	13.836,17	0,75%	1,32%	0,75%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	682.119,68	0,00	0,00	685.911,03	3.791,35	0,56%	-	0,56%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.848.982,28	0,00	110.205,01	3.758.037,41	19.260,14	0,50%	4,26%	0,45%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1.403.881,43	0,00	0,00	1.410.421,11	6.539,68	0,47%	2,85%	0,47%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.504.378,94	0,00	0,00	8.537.079,36	32.700,42	0,38%	1,79%	0,38%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	96.972,17	6.349.310,87	6.141.968,83	309.783,57	5.469,36	0,08%	0,04%	1,04%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	35.976.050,91	167.114,93	0,00	36.150.801,19	7.635,35	0,02%	3,20%	0,02%

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	877.335,12	0,00	0,00	877.174,69	-160,43	-0,02%	2,60%	-0,02%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	729.629,46	0,00	0,00	728.981,68	-647,78	-0,09%	4,56%	-0,09%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	3.566.083,26	0,00	0,00	3.561.147,18	-4.936,08	-0,14%	3,59%	-0,14%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.369.757,39	0,00	0,00	2.350.754,70	-19.002,69	-0,80%	5,10%	-0,80%
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.310.657,87	0,00	0,00	2.267.755,83	-42.902,04	-1,86%	8,75%	-1,86%
Total Renda Fixa					2.045.833,81	0,88%	1,22%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	7.761.532,62	0,00	0,00	7.977.994,21	216.461,59	2,79%	6,72%	2,79%
CAIXA BRASIL IPCA VIII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.767.657,00	0,00	0,00	1.788.068,00	20.411,00	1,15%	0,26%	1,15%
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.197.620,76	0,00	0,00	1.202.736,84	5.116,08	0,43%	9,54%	0,43%
BB PIPE FIC AÇÕES	955.598,09	0,00	0,00	940.343,45	-15.254,64	-1,60%	6,78%	-1,60%
XP INVESTOR FI AÇÕES	1.665.743,97	0,00	0,00	1.626.001,50	-39.742,47	-2,39%	8,09%	-2,39%
BB CIELO FI AÇÕES	2.006.580,28	0,00	0,00	1.899.766,40	-106.813,88	-5,32%	13,96%	-5,32%
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	2.229.732,75	0,00	0,00	2.063.436,58	-166.296,17	-7,46%	9,94%	-7,46%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	1.447.071,17	0,00	0,00	1.333.823,01	-113.248,16	-7,83%	8,67%	-7,83%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.119.107,31	0,00	0,00	1.949.150,25	-169.957,06	-8,02%	8,44%	-8,02%
GERAÇÃO FI AÇÕES	1.382.618,11	0,00	0,00	1.268.589,30	-114.028,81	-8,25%	8,69%	-8,25%
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	3.154.035,99	0,00	0,00	2.862.775,65	-291.260,34	-9,23%	18,14%	-9,23%
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	3.457.968,90	0,00	0,00	3.104.115,31	-353.853,59	-10,23%	14,82%	-10,23%
Total Renda Variável					-1.128.466,45	-3,87%	9,60%	