

# Relatório Analítico dos Investimentos em fevereiro de 2016



Carteira consolidada de investimentos - base (fevereiro / 2016)

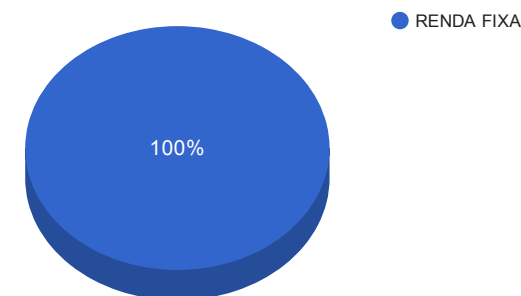
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	9.530.539,76	12,00%	1.164	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	2.973.079,74	3,74%	221	0,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.730.870,37	2,18%	623	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	8.284.356,67	10,43%	97	2,55%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	221.288,59	0,28%	544	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2020	3.612.492,83	4,55%	122	0,36%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.236.678,71	6,59%	203	0,46%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.798.030,70	7,30%	1.306	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	7.224.557,03	9,09%	93	1,58%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.245.276,13	9,12%	335	0,32%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.083.399,09	2,62%	230	0,24%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	4.037.407,40	5,08%	578	0,38%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	16.986.470,61	21,38%	839	0,25%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.663.491,34	3,35%	482	0,13%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IPCA XV FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	30/08/2016	1.820.585,00	2,29%	40	1,91%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
<b>TOTAL -</b>			<b>79.448.523,97</b>				

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

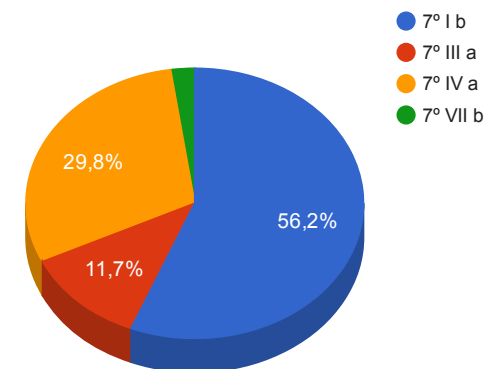
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	85,00%	44.611.894,40	56,15%	22.919.350,97
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	30,00%	9.328.675,22	11,74%	14.505.881,97
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	23.687.369,35	29,81%	147.187,84
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	1.820.585,00	2,29%	2.151.841,20
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.972.426,20
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.972.426,20
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>160,00</b>	<b>79.448.523,97</b>	<b>100,00%</b>	

Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.972.426,20
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.972.426,20
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.972.426,20
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>15,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	

Distribuição por Segmento



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%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XV FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,53%	2,92%	4,47%	7,78%	16,42%	32,37%	0,20%	0,145%	0,31%
IMA-B 5+	2,75%	3,99%	5,16%	7,60%	5,81%	26,21%	-	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,62%	3,75%	4,83%	7,06%	5,30%	25,57%	0,20%	4,301%	12,71%
IMA-B	2,26%	4,22%	5,80%	8,90%	9,45%	27,71%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,27%	4,09%	5,61%	7,98%	7,80%	25,48%	0,20%	3,096%	9,10%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,21%	4,13%	5,69%	8,65%	9,19%	27,31%	0,30%	3,075%	9,00%
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 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,41%	3,13%	5,89%	8,65%	-	-	0,20%	5,936%	-
IMA Geral	1,69%	3,74%	4,79%	7,19%	10,52%	25,12%	-	-	-
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 Geral ex-C	1,62%	3,67%	4,73%	6,94%	10,41%	25,00%	-	-	-
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,59%	3,61%	4,59%	6,72%	10,12%	24,28%	0,20%	1,532%	4,53%
IPCA + 6,00% ao ano	1,34%	3,11%	4,63%	8,67%	16,92%	33,42%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,73%	4,72%	7,01%	10,95%	15,92%	31,73%	0,15%	1,693%	4,19%
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%

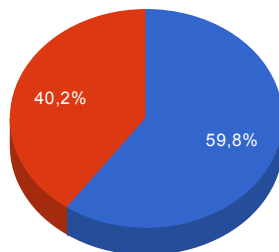
Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (fevereiro / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M 1	1,09%	2,75%	3,97%	7,47%	14,04%	26,55%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,10%	2,74%	3,94%	7,40%	13,84%	26,05%	0,20%	0,179%	0,54%
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%
CDI	1,00%	2,07%	3,25%	6,67%	13,59%	26,03%	-	-	-
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%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,91%	1,90%	3,01%	6,21%	12,67%	24,07%	1,00%	0,012%	0,04%

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

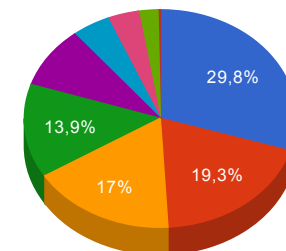
Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	47.507.746,10	59,80%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	31.940.777,87	40,20%

- BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM
- CAIXA ECONÔMICA FEDERAL



Sub-segmento	Valor	%
CDI	23.687.369,35	29,81%
IRF-M 1	15.328.570,46	19,29%
IMA-GERAL	13.521.035,38	17,02%
IMA-B	11.059.545,59	13,92%
IMA-B 5	7.224.557,03	9,09%
IDKA IPCA 3A	3.612.492,83	4,55%
IMA-B 5+	2.973.079,74	3,74%
CRÉDITO PRIVADO	1.820.585,00	2,29%
IDKA IPCA 2A	221.288,59	0,28%

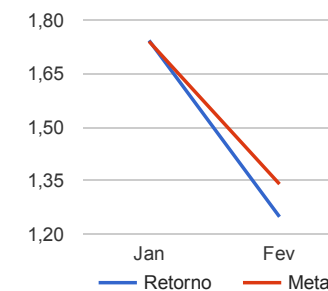
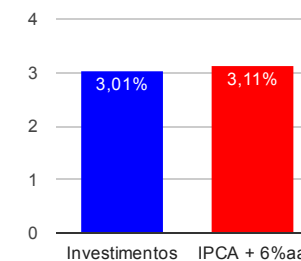
- CDI
- IRF-M 1
- IMA-GERAL
- IMA-B
- IMA-B 5
- IDKA IPCA 3A
- IMA-B 5+
- CRÉDITO PRIVADO
- IDKA IPCA 2A



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	75.972.334,18	1.395.750,08	918.412,98	77.782.013,01	1.332.341,73	1,74%	1,74%	100,19%	1,01%
Fevereiro	77.782.013,01	1.820.519,76	1.133.534,42	79.448.523,97	979.525,62	1,25%	1,34%	92,86%	1,48%
Acumulado no ano					2.311.867,35	3,01%	3,11%	96,97%	

**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(%)	
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.897.238,35	0,00	0,00	2.973.079,74	75.841,39	2,62%	4,30%	2,62%	
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.692.529,31	0,00	0,00	1.730.870,37	38.341,06	2,27%	3,10%	2,27%	
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.038.272,39	0,00	0,00	2.083.399,09	45.126,70	2,21%	3,08%	2,21%	
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	7.093.425,47	0,00	0,00	7.245.276,13	151.850,66	2,14%	2,64%	2,14%	
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.656.269,74	0,00	106.382,46	3.612.492,83	62.605,55	1,71%	1,69%	1,73%	
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.151.963,09	0,00	0,00	5.236.678,71	84.715,62	1,64%	1,56%	1,64%	
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	8.154.932,47	0,00	0,00	8.284.356,67	129.424,20	1,59%	1,53%	1,59%	
CAIXA BRASIL IPCA XV FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.793.191,00	0,00	0,00	1.820.585,00	27.394,00	1,53%	0,14%	1,53%	
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.734.915,90	0,00	0,00	5.798.030,70	63.114,80	1,10%	0,18%	1,10%	
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.426.941,82	0,00	0,00	9.530.539,76	103.597,94	1,10%	0,18%	1,10%	
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.637.024,89	0,00	0,00	2.663.491,34	26.466,45	1,00%	0,05%	1,00%	
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	16.823.961,61	0,00	0,00	16.986.470,61	162.509,00	0,97%	0,01%	0,97%	
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.427.058,52	1.599.231,17	1.027.151,96	4.037.407,40	38.269,67	0,76%	0,01%	0,91%	
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	221.288,59	0,00	221.288,59	0,00	0,00%	1,37%	1,37%	
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.254.288,45	0,00	0,00	7.224.557,03	-29.731,42	-0,41%	5,94%	-0,41%	
<b>Total Renda Fixa</b>						<b>979.525,62</b>	<b>1,25%</b>	<b>1,48%</b>	