

Relatório Analítico dos Investimentos em abril de 2016



Carteira consolidada de investimentos - base (abril / 2016)

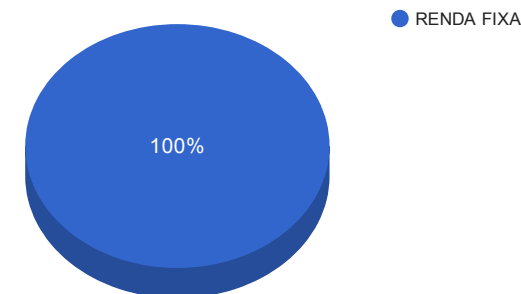
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	3.395.108,49	4,06%	217	0,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.894.520,28	2,27%	625	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	8.815.400,57	10,54%	94	2,55%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	226.255,74	0,27%	567	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	5.092.574,73	6,09%	723	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2020	3.705.028,09	4,43%	122	0,36%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.570.188,14	6,66%	199	0,57%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.933.966,28	7,09%	1.326	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	9.753.706,15	11,66%	1.174	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	7.472.766,87	8,93%	94	1,58%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.903.699,71	9,45%	332	0,35%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.275.993,53	2,72%	225	0,24%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	4.775.591,86	5,71%	577	0,53%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	12.241.290,79	14,64%	844	0,20%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.724.071,70	3,26%	475	0,13%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IPCA XV FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	30/08/2016	1.860.577,00	2,22%	40	1,91%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
		TOTAL -	83.640.739,93				

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

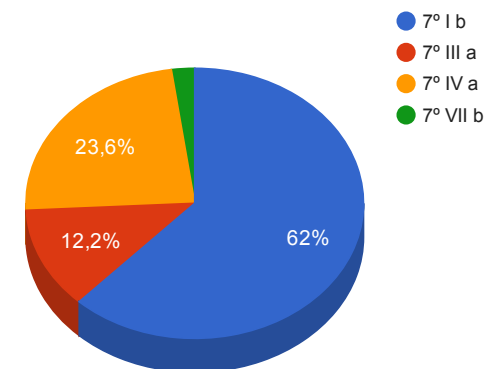
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	85,00%	51.859.515,34	62,00%	19.235.113,60
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	30,00%	10.179.693,24	12,17%	14.912.528,74
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	19.740.954,35	23,60%	5.351.267,63
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	1.860.577,00	2,22%	2.321.460,00
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	4.182.037,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	4.182.037,00
Total Renda Fixa	100,00%	160,00	83.640.739,93	100,00%	

Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	4.182.037,00
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	4.182.037,00
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	4.182.037,00
Total Renda Variável	30,00%	15,00	0,00	0,00%	

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5+	5,37%	18,66%	17,25%	21,62%	17,80%	38,82%	-	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5,36%	18,48%	17,18%	21,33%	17,16%	38,40%	0,20%	5,533%	14,00%
IMA-B	3,93%	14,06%	11,92%	16,99%	17,27%	35,51%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,93%	13,93%	11,93%	16,76%	15,56%	33,21%	0,20%	3,879%	9,88%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,89%	13,76%	11,66%	16,64%	16,80%	34,79%	0,30%	3,834%	9,75%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	3,66%	13,26%	11,42%	16,04%	15,83%	34,34%	0,20%	3,562%	9,00%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,29%	6,68%	3,01%	10,00%	-	-	0,20%	2,730%	-
IMA Geral ex-C	2,91%	10,26%	8,08%	12,50%	15,53%	29,96%	-	-	-
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,93%	10,25%	8,10%	12,41%	15,31%	29,41%	0,20%	2,037%	4,81%
IMA Geral	2,89%	10,39%	8,21%	12,68%	15,71%	30,11%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,93%	10,25%	8,12%	12,52%	15,15%	29,26%	0,20%	2,027%	4,86%
IDKA IPCA 2 Anos	1,66%	6,90%	3,03%	9,15%	18,82%	33,12%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,66%	6,67%	3,55%	9,28%	17,85%	31,37%	0,20%	1,232%	3,20%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,62%	6,62%	3,65%	9,26%	17,94%	31,77%	0,20%	1,222%	3,10%
IPCA + 6,00% ao ano	1,08%	5,20%	3,40%	8,33%	15,78%	32,79%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,75%	7,40%	4,33%	10,37%	17,56%	32,12%	0,15%	1,497%	4,25%
IRF-M 1	1,07%	5,15%	3,45%	7,53%	14,67%	27,38%	-	-	-

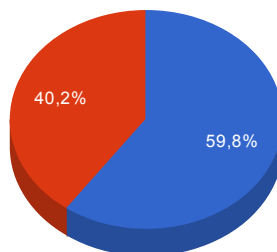
Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (abril / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,11%	5,15%	3,47%	7,48%	14,38%	26,61%	0,10%	0,179%	0,52%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,11%	5,15%	3,47%	7,49%	14,50%	26,91%	0,20%	0,173%	0,50%
CDI	1,05%	4,34%	3,25%	6,67%	13,85%	26,83%	-	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,09%	4,50%	3,30%	6,75%	13,66%	26,38%	0,20%	0,056%	0,24%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,98%	4,18%	3,09%	6,52%	13,83%	27,05%	0,20%	0,027%	0,05%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,92%	3,93%	2,92%	6,11%	12,80%	24,72%	1,00%	0,031%	0,04%
IPCA	0,61%	3,25%	1,95%	5,29%	9,28%	18,21%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XV FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,91%	5,18%	3,76%	8,08%	15,06%	31,95%	0,20%	0,038%	0,27%

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

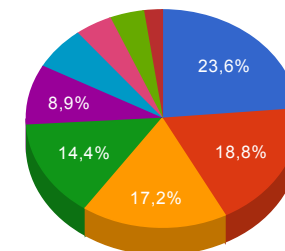
Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	50.054.694,21	59,84%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	33.586.045,72	40,16%

- BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM
- CAIXA ECONÔMICA FEDERAL



Sub-segmento	Valor	%
CDI	19.740.954,35	23,60%
IRF-M 1	15.687.672,43	18,76%
IMA-GERAL	14.385.588,71	17,20%
IMA-B	12.074.213,52	14,44%
IMA-B 5	7.472.766,87	8,93%
IDKA IPCA 2A	5.318.830,47	6,36%
IDKA IPCA 3A	3.705.028,09	4,43%
IMA-B 5+	3.395.108,49	4,06%
CRÉDITO PRIVADO	1.860.577,00	2,22%

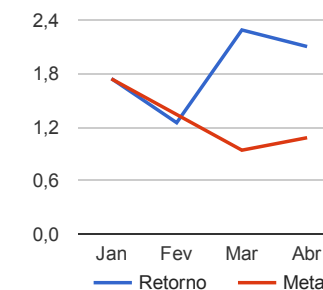
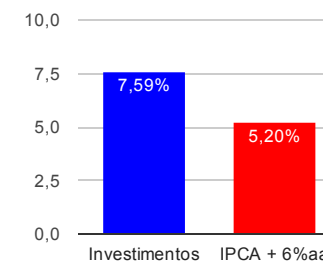
- CDI
- IRF-M 1
- IMA-GERAL
- IMA-B
- IMA-B 5
- IDKA IPCA 2A
- IDKA IPCA 3A
- IMA-B 5+
- CRÉDITO PRIVADO



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%
Março	79.448.523,97	6.413.240,25	5.913.897,40	81.777.556,22	1.829.689,40	2,29%	0,94%	242,90%	2,47%
Abril	81.777.556,22	1.037.527,12	896.892,47	83.640.739,93	1.722.549,06	2,10%	1,08%	195,36%	1,53%
Acumulado no ano					5.864.105,81	7,59%	5,20%	145,92%	

Acumulado no Ano



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de abril / 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	3.222.341,32	0,00	0,00	3.395.108,49	172.767,17	5,36%	5,53%	5,36%	
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.822.847,23	0,00	0,00	1.894.520,28	71.673,05	3,93%	3,88%	3,93%	
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.190.835,35	0,00	0,00	2.275.993,53	85.158,18	3,89%	3,83%	3,89%	
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	7.624.362,00	0,00	0,00	7.903.699,71	279.337,71	3,66%	3,56%	3,66%	
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.411.468,93	0,00	0,00	5.570.188,14	158.719,21	2,93%	2,03%	2,93%	
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	8.564.711,64	0,00	0,00	8.815.400,57	250.688,93	2,93%	2,04%	2,93%	
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.305.164,06	0,00	0,00	7.472.766,87	167.602,81	2,29%	2,73%	2,29%	
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.641.174,38	0,00	0,00	3.705.028,09	63.853,71	1,75%	1,50%	1,75%	
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.009.471,01	0,00	0,00	5.092.574,73	83.103,72	1,66%	1,23%	1,66%	
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	222.654,75	0,00	0,00	226.255,74	3.600,99	1,62%	1,22%	1,62%	
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.646.168,54	0,00	0,00	9.753.706,15	107.537,61	1,11%	0,18%	1,11%	
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.869.077,34	0,00	0,00	5.933.966,28	64.888,94	1,11%	0,17%	1,11%	
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.694.579,54	0,00	0,00	2.724.071,70	29.492,16	1,09%	0,06%	1,09%	
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12.122.312,63	0,00	0,00	12.241.290,79	118.978,16	0,98%	0,03%	0,98%	
CAIXA BRASIL IPCA XV FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.843.824,00	0,00	0,00	1.860.577,00	16.753,00	0,91%	0,04%	0,91%	
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.586.563,50	1.037.527,12	896.892,47	4.775.591,86	48.393,71	0,86%	0,03%	0,92%	
				Total Renda Fixa		1.722.549,06	2,10%	1,53%	