

# Relatório Analítico dos Investimentos em junho, 2º Trimestre e 1º semestre de 2016



Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2016)

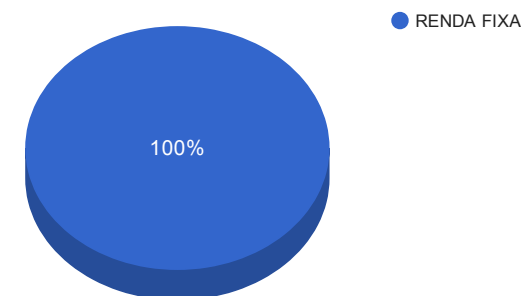
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2020	3.767.109,71	4,37%	122	0,36%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	230.056,48	0,27%	602	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.928.262,45	2,24%	644	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	5.172.999,61	6,00%	738	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	6.059.752,35	7,02%	1.331	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	3.457.867,09	4,01%	215	0,33%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.689.966,71	6,60%	200	0,55%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	9.957.027,74	11,54%	1.175	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	9.004.839,22	10,44%	97	2,59%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	7.549.273,25	8,75%	97	1,35%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.055.975,01	9,34%	330	0,36%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.314.499,04	2,68%	232	0,24%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.044.397,69	1,21%	573	0,10%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.785.072,24	3,23%	472	0,14%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	17.341.849,49	20,10%	824	0,30%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IPCA XV FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	30/08/2016	1.904.226,00	2,21%	40	1,91%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
		<b>TOTAL -</b>	<b>86.263.174,08</b>				

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

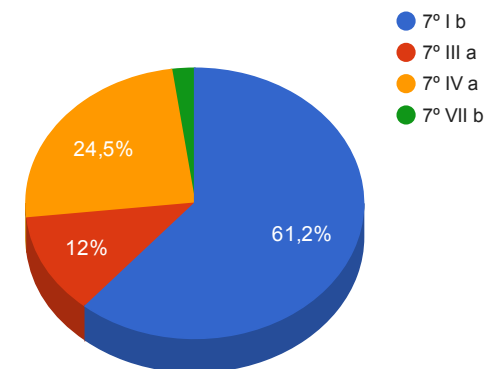
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	85,00%	52.817.154,61	61,23%	20.506.543,36
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	30,00%	10.370.474,05	12,02%	15.508.478,17
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	21.171.319,42	24,54%	4.707.632,80
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	1.904.226,00	2,21%	2.408.932,70
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	4.313.158,70
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	4.313.158,70
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>160,00</b>	<b>86.263.174,08</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%	4.313.158,70
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	4.313.158,70
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	4.313.158,70
<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 (junho / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5+	2,57%	20,82%	7,29%	20,82%	17,14%	33,97%	-	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,55%	20,67%	7,31%	20,67%	16,46%	33,52%	0,20%	3,149%	14,00%
IMA-B	1,93%	16,15%	5,83%	16,15%	16,73%	32,26%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,92%	15,96%	5,78%	15,96%	15,21%	30,03%	0,20%	2,302%	9,79%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	1,90%	15,44%	5,66%	15,44%	15,52%	31,10%	0,20%	2,079%	8,93%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,84%	15,68%	5,64%	15,68%	16,13%	31,42%	0,30%	2,313%	9,70%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,68%	7,77%	3,34%	7,77%	-	-	0,20%	2,100%	-
IMA Geral	1,81%	12,87%	5,20%	12,87%	15,87%	29,08%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,76%	12,62%	5,15%	12,62%	15,21%	28,02%	0,20%	1,222%	4,85%
IMA Geral ex-C	1,79%	12,66%	5,15%	12,66%	15,59%	28,79%	-	-	-
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,77%	12,62%	5,14%	12,62%	15,34%	28,17%	0,20%	1,211%	4,81%
CDI	1,16%	6,72%	3,36%	6,72%	14,09%	27,57%	-	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,17%	6,27%	3,20%	6,27%	13,15%	25,58%	1,00%	0,106%	0,08%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,15%	6,84%	3,36%	6,84%	13,91%	27,06%	0,20%	0,008%	0,23%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,07%	6,49%	3,22%	6,49%	13,92%	27,68%	0,20%	0,271%	0,17%
IRF-M 1	1,08%	7,42%	3,25%	7,42%	14,96%	27,79%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,06%	7,38%	3,25%	7,38%	14,82%	27,31%	0,20%	0,120%	0,49%

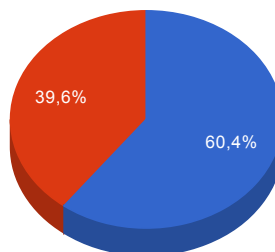
Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (junho / 2016)

	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	1,03%	7,34%	3,22%	7,34%	14,66%	27,00%	0,10%	0,117%	0,51%
IDKA IPCA 2 Anos	0,93%	8,58%	3,25%	8,58%	17,00%	31,47%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,88%	8,41%	3,32%	8,41%	16,74%	30,55%	0,20%	1,115%	3,11%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,82%	8,36%	3,26%	8,36%	16,56%	30,05%	0,20%	1,178%	3,23%
IPCA + 6,00% ao ano	0,86%	7,45%	3,24%	7,45%	15,38%	33,21%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,91%	9,20%	3,46%	9,20%	16,62%	29,98%	0,15%	1,213%	4,18%
IPCA	0,35%	4,42%	1,75%	4,42%	8,84%	18,53%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XV FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,19%	7,65%	3,28%	7,65%	15,06%	32,43%	0,20%	0,062%	0,25%

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

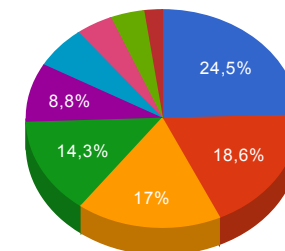
Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	52.060.589,59	60,35%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	34.202.584,49	39,65%

- BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM
- CAIXA ECONÔMICA FEDERAL



Sub-segmento	Valor	%
CDI	21.171.319,42	24,54%
IRF-M 1	16.016.780,09	18,57%
IMA-GERAL	14.694.805,93	17,03%
IMA-B	12.298.736,50	14,26%
IMA-B 5	7.549.273,25	8,75%
IDKA IPCA 2A	5.403.056,09	6,26%
IDKA IPCA 3A	3.767.109,71	4,37%
IMA-B 5+	3.457.867,09	4,01%
CRÉDITO PRIVADO	1.904.226,00	2,21%

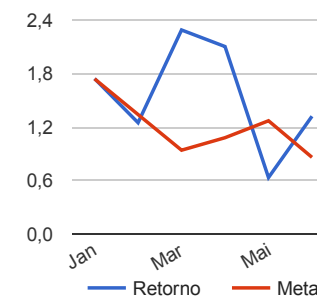
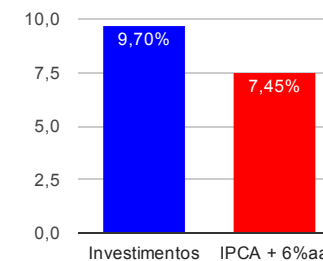
- CDI
- IRF-M 1
- IMA-GERAL
- IMA-B
- IMA-B 5
- IDKA IPCA 2A
- IDKA IPCA 3A
- IMA-B 5+
- CRÉDITO PRIVADO



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%
Mai	83.640.739,93	1.958.100,73	1.176.511,44	84.956.758,79	534.429,57	0,63%	1,27%	49,82%	1,39%
Junho	84.956.758,79	6.582.441,40	6.400.353,35	86.263.174,08	1.124.327,24	1,32%	0,86%	153,24%	1,03%
Acumulado no ano					7.522.862,62	9,70%	7,45%	130,10%	

**Acumulado no Ano**



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de junho / 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	3.371.787,43	0,00	0,00	3.457.867,09	86.079,66	2,55%	3,15%	2,55%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.891.912,98	0,00	0,00	1.928.262,45	36.349,47	1,92%	2,30%	1,92%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	7.905.430,90	0,00	0,00	8.055.975,01	150.544,11	1,90%	2,08%	1,90%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.272.765,90	0,00	0,00	2.314.499,04	41.733,14	1,84%	2,31%	1,84%
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	8.848.149,58	0,00	0,00	9.004.839,22	156.689,64	1,77%	1,21%	1,77%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.591.606,23	0,00	0,00	5.689.966,71	98.360,48	1,76%	1,22%	1,76%
CAIXA BRASIL IPCA XV FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.881.779,00	0,00	0,00	1.904.226,00	22.447,00	1,19%	0,06%	1,19%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.753.462,54	0,00	0,00	2.785.072,24	31.609,70	1,15%	0,01%	1,15%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.996.430,35	0,00	0,00	6.059.752,35	63.322,00	1,06%	0,12%	1,06%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.855.105,27	0,00	0,00	9.957.027,74	101.922,47	1,03%	0,12%	1,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.733.234,35	0,00	0,00	3.767.109,71	33.875,36	0,91%	1,21%	0,91%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	228.055,03	0,00	0,00	230.056,48	2.001,45	0,88%	1,11%	0,88%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12.380.966,14	4.811.118,07	0,00	17.341.849,49	149.765,28	0,87%	0,27%	1,07%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.130.901,01	0,00	0,00	5.172.999,61	42.098,60	0,82%	1,18%	0,82%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.617.077,68	1.771.323,33	6.400.353,35	1.044.397,69	56.350,03	0,76%	0,11%	1,17%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.498.094,40	0,00	0,00	7.549.273,25	51.178,85	0,68%	2,10%	0,68%
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>1.124.327,24</b>	<b>1,32%</b>	<b>1,03%</b>	



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre / 2016

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	8.564.711,64	0,00	0,00	9.004.839,22	440.127,58	5,14%	5,14%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	7.624.362,00	0,00	0,00	8.055.975,01	431.613,01	5,66%	5,66%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12.122.312,63	4.811.118,07	0,00	17.341.849,49	408.418,79	3,02%	3,22%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.646.168,54	0,00	0,00	9.957.027,74	310.859,20	3,22%	3,22%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.411.468,93	0,00	0,00	5.689.966,71	278.497,78	5,15%	5,15%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.305.164,06	0,00	0,00	7.549.273,25	244.109,19	3,34%	3,34%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.222.341,32	0,00	0,00	3.457.867,09	235.525,77	7,31%	7,31%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.869.077,34	0,00	0,00	6.059.752,35	190.675,01	3,25%	3,25%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.586.563,50	4.766.951,18	8.473.757,26	1.044.397,69	164.640,27	2,53%	3,20%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.009.471,01	0,00	0,00	5.172.999,61	163.528,60	3,26%	3,26%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.641.174,38	0,00	0,00	3.767.109,71	125.935,33	3,46%	3,46%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.190.835,35	0,00	0,00	2.314.499,04	123.663,69	5,64%	5,64%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.822.847,23	0,00	0,00	1.928.262,45	105.415,22	5,78%	5,78%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.694.579,54	0,00	0,00	2.785.072,24	90.492,70	3,36%	3,36%
CAIXA BRASIL IPCA XV FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.843.824,00	0,00	0,00	1.904.226,00	60.402,00	3,28%	3,28%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	222.654,75	0,00	0,00	230.056,48	7.401,73	3,32%	3,32%
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>3.381.305,87</b>	<b>4,11%</b>	

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	6.978.459,57	0,00	0,00	8.055.975,01	1.077.515,44	15,44%	15,44%
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	7.995.767,54	0,00	0,00	9.004.839,22	1.009.071,68	12,62%	12,62%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	16.648.566,55	4.811.118,07	5.000.000,00	17.341.849,49	882.164,87	5,96%	6,49%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.276.278,66	0,00	0,00	9.957.027,74	680.749,08	7,34%	7,34%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.052.550,48	0,00	0,00	5.689.966,71	637.416,23	12,62%	12,62%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.865.549,19	0,00	0,00	3.457.867,09	592.317,90	20,67%	20,67%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.005.161,99	0,00	0,00	7.549.273,25	544.111,26	7,77%	7,77%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.643.285,32	0,00	0,00	6.059.752,35	416.467,03	7,38%	7,38%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.551.992,53	0,00	106.382,46	3.767.109,71	321.499,64	9,18%	9,20%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.000.754,61	0,00	0,00	2.314.499,04	313.744,43	15,68%	15,68%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.915.231,11	9.175.172,68	11.333.219,60	1.044.397,69	287.213,50	5,09%	6,27%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.662.926,80	0,00	0,00	1.928.262,45	265.335,65	15,96%	15,96%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.606.884,83	0,00	0,00	2.785.072,24	178.187,41	6,84%	6,84%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	5.000.000,00	0,00	5.172.999,61	172.999,61	3,46%	8,36%
CAIXA BRASIL IPCA XV FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.768.925,00	0,00	0,00	1.904.226,00	135.301,00	7,65%	7,65%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	221.288,59	0,00	230.056,48	8.767,89	3,96%	8,41%
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>7.522.862,62</b>	<b>9,70%</b>	