

Relatório Analítico dos Investimentos em maio de 2016



Carteira consolidada de investimentos - base (maio / 2016)

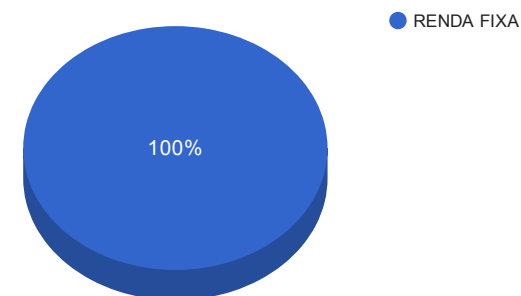
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.996.430,35	7,06%	1.331	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2020	3.733.234,35	4,39%	122	0,36%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	3.371.787,43	3,97%	217	0,33%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.591.606,23	6,58%	198	0,55%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	9.855.105,27	11,60%	1.176	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	228.055,03	0,27%	579	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.891.912,98	2,23%	639	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	5.130.901,01	6,04%	728	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	8.848.149,58	10,41%	93	2,59%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	7.498.094,40	8,83%	95	1,45%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.905.430,90	9,31%	326	0,36%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.272.765,90	2,68%	228	0,24%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	5.617.077,68	6,61%	579	0,57%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.753.462,54	3,24%	472	0,13%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	12.380.966,14	14,57%	828	0,20%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IPCA XV FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	30/08/2016	1.881.779,00	2,21%	40	1,91%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
		TOTAL -	84.956.758,79				

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

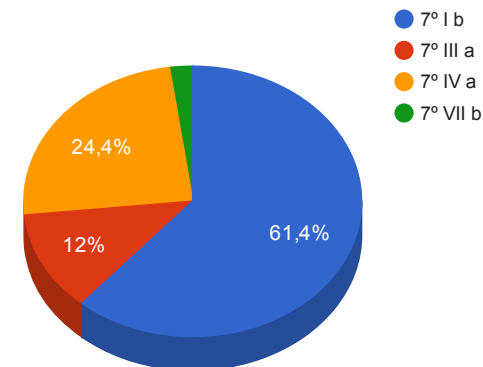
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	85,00%	52.145.276,63	61,38%	20.067.968,34
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	30,00%	10.178.196,80	11,98%	15.308.830,84
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	20.751.506,36	24,43%	4.735.521,28
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	1.881.779,00	2,21%	2.366.058,94
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	4.247.837,94
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	4.247.837,94
Total Renda Fixa	100,00%	160,00	84.956.758,79	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%	4.247.837,94
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	4.247.837,94
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	4.247.837,94
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 (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 II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,76%	8,21%	3,34%	10,59%	16,30%	29,99%	0,15%	2,003%	4,18%
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%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,07%	5,04%	3,08%	6,18%	12,96%	25,07%	1,00%	0,039%	0,08%
IRF-M 1	1,07%	6,27%	3,43%	7,53%	14,79%	27,53%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,05%	6,26%	3,42%	7,49%	14,65%	27,05%	0,20%	0,084%	0,49%
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%
IPCA	0,78%	4,05%	1,83%	5,05%	9,32%	18,58%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XV FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,14%	6,38%	3,36%	7,99%	15,12%	32,05%	0,20%	0,196%	0,25%
IDKA IPCA 2 Anos	0,63%	7,57%	2,45%	9,61%	16,89%	32,04%	-	-	-
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%
IMA Geral ex-C	0,38%	10,68%	6,76%	11,81%	13,89%	27,26%	-	-	-

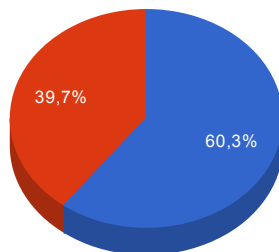
Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (maio / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,37%	10,66%	6,81%	11,71%	13,64%	26,67%	0,20%	2,214%	4,81%
IMA-B 5+	-0,73%	17,79%	13,27%	19,12%	13,37%	29,77%	-	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,69%	17,67%	13,41%	18,89%	12,74%	29,45%	0,20%	6,454%	14,00%
IMA-B	-0,10%	13,95%	9,34%	15,68%	14,21%	29,84%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,34%	7,04%	3,79%	9,90%	-	-	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%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,14%	13,77%	9,30%	15,43%	12,56%	27,54%	0,20%	3,488%	9,79%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,14%	13,60%	9,09%	15,30%	13,70%	29,02%	0,30%	3,437%	9,70%

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

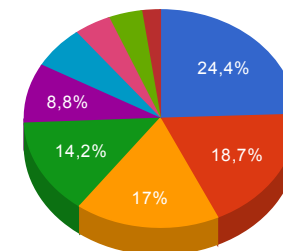
Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	51.209.987,36	60,28%
Caixa Econômica Federal	33.746.771,43	39,72%

- BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM
- Caixa Econômica Federal



Sub-segmento	Valor	%
CDI	20.751.506,36	24,43%
IRF-M 1	15.851.535,62	18,66%
IMA-GERAL	14.439.755,81	17,00%
IMA-B	12.070.109,78	14,21%
IMA-B 5	7.498.094,40	8,83%
IDKA IPCA 2A	5.358.956,04	6,31%
IDKA IPCA 3A	3.733.234,35	4,39%
IMA-B 5+	3.371.787,43	3,97%
CRÉDITO PRIVADO	1.881.779,00	2,21%

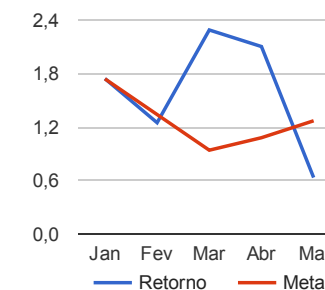
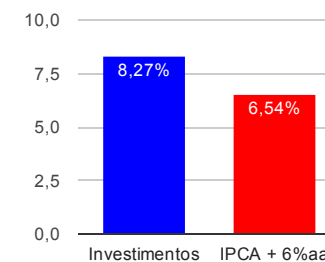
- CDI
- IRF-M 1
- IMA-GERAL
- IMA-B
- IMA-B 5
- IDKA IPCA 2A
- IDKA IPCA 3A
- IMA-B 5+
- CRÉDITO PRIVADO



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%
Acumulado no ano					6.398.535,38	8,27%	6,54%	126,50%	

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	12.241.290,79	0,00	0,00	12.380.966,14	139.675,35	1,14%	0,04%	1,14%	
CAIXA BRASIL IPCA XV FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.860.577,00	0,00	0,00	1.881.779,00	21.202,00	1,14%	0,20%	1,14%	
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.724.071,70	0,00	0,00	2.753.462,54	29.390,84	1,08%	0,01%	1,08%	
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.933.966,28	0,00	0,00	5.996.430,35	62.464,07	1,05%	0,08%	1,05%	
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.753.706,15	0,00	0,00	9.855.105,27	101.399,12	1,04%	0,09%	1,04%	
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.775.591,86	1.958.100,73	1.176.511,44	5.617.077,68	59.896,53	0,89%	0,04%	1,07%	
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	226.255,74	0,00	0,00	228.055,03	1.799,29	0,80%	1,28%	0,80%	
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.705.028,09	0,00	0,00	3.733.234,35	28.206,26	0,76%	2,00%	0,76%	
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.092.574,73	0,00	0,00	5.130.901,01	38.326,28	0,75%	1,32%	0,75%	
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.570.188,14	0,00	0,00	5.591.606,23	21.418,09	0,38%	1,79%	0,38%	
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	8.815.400,57	0,00	0,00	8.848.149,58	32.749,01	0,37%	2,21%	0,37%	
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.472.766,87	0,00	0,00	7.498.094,40	25.327,53	0,34%	-	0,34%	
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	7.903.699,71	0,00	0,00	7.905.430,90	1.731,19	0,02%	3,20%	0,02%	
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.894.520,28	0,00	0,00	1.891.912,98	-2.607,30	-0,14%	3,49%	-0,14%	
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.275.993,53	0,00	0,00	2.272.765,90	-3.227,63	-0,14%	3,44%	-0,14%	
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.395.108,49	0,00	0,00	3.371.787,43	-23.321,06	-0,69%	6,45%	-0,69%	
Total Renda Fixa						534.429,57	0,63%	1,39%	