

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	35.975.528,92	15,37%	1.164	0,49%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	9.172.522,93	3,92%	1.306	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	31.971.068,87	13,66%	193	1,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	55.387.266,42	23,67%	690	0,97%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	8.766.720,53	3,75%	97	2,70%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	10.715.709,73	4,58%	167	0,54%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	8.213.403,45	3,51%	237	0,58%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VIII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	01/01/2017	12.394.433,29	5,30%	49	2,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	31.643.143,87	13,52%	839	0,47%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	4.172.099,25	1,78%	758	0,09%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	11.925.285,16	5,10%	116	2,59%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+30 a D+2880	Não há	6.584.320,66	2,81%	51	2,25%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BB RPPS I FI RENDA FIXA IPCA CRÉDITO PRIVADO	Término do fundo	Não há	1.782.631,88	0,76%	29	2,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BB CONSUMO FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.500.062,92	0,64%	2.510	2,11%	Artigo 8º, Inciso III
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	647.577,79	0,28%	87	0,69%	Artigo 8º, Inciso III
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	Não se aplica	Não se aplica	3.136.774,87	1,34%			Artigo 8º, Inciso VI
TOTAL -			233.988.550,54				

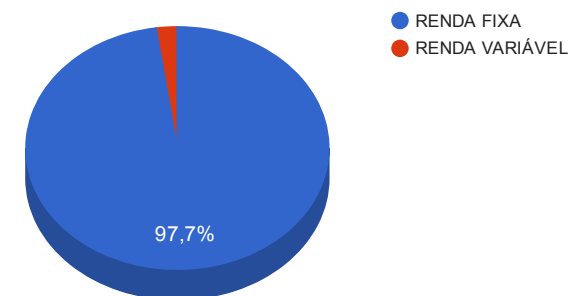
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
					

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

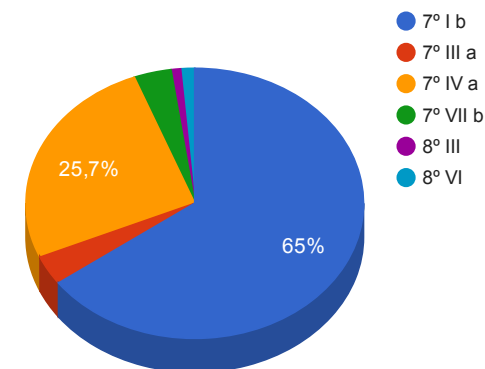
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	100,00%	151.988.817,40	64,96%	81.999.733,14
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	30,00%	8.213.403,45	3,51%	61.983.161,71
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	60.134.961,57	25,70%	10.061.603,59
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	8.366.952,54	3,58%	3.332.474,99
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	11.699.427,53
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	11.699.427,53
Total Renda Fixa	100,00%	175,00	228.704.134,96	97,74%	

Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	5,00%	2.147.640,71	0,92%	9.551.786,82
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	3.136.774,87	1,34%	8.562.652,66
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	5,00%	0,00	0,00%	11.699.427,53
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	11.699.427,53
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	11.699.427,53
Total Renda Variável	30,00%	25,00	5.284.415,58	2,26%	

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%	-	-	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	2,72%	5,54%	8,32%	10,89%	14,12%	31,31%	0,20%	2,572%	6,69%
BB RPPS I FI RENDA FIXA IPCA CRÉDITO PRIVADO	0,97%	2,71%	4,42%	8,46%	15,97%	32,77%	0,20%	0,639%	1,20%
IMA-B	2,26%	4,22%	5,80%	8,90%	9,45%	27,71%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,54%	3,95%	6,09%	10,14%	-	-	0,20%	1,327%	-
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%
IRF-M	1,54%	4,38%	4,97%	5,91%	9,53%	22,12%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VIII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,19%	3,49%	4,77%	6,68%	11,42%	-	0,20%	0,413%	2,84%
IMA-B 5	1,54%	4,55%	6,77%	10,89%	16,86%	32,06%	-	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,52%	4,51%	6,67%	10,65%	16,38%	30,90%	0,20%	1,445%	3,33%
IPCA + 6,00% ao ano	1,34%	3,11%	4,63%	8,67%	16,92%	33,42%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,62%	3,11%	4,80%	8,36%	17,43%	33,53%	0,20%	0,270%	0,37%
IDKA IPCA 2 Anos	1,20%	5,00%	6,99%	11,37%	18,46%	33,63%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,33%	4,38%	6,45%	10,78%	16,74%	31,36%	0,20%	1,412%	3,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,02%	2,84%	4,62%	9,32%	-	-	0,20%	0,576%	-
IRF-M 1	1,09%	2,75%	3,97%	7,47%	14,04%	26,55%	-	-	-

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
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 FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,99%	2,05%	3,23%	6,66%	13,63%	26,17%	0,20%	0,008%	0,07%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,97%	2,03%	3,23%	6,67%	13,74%	26,44%	0,20%	0,015%	0,05%

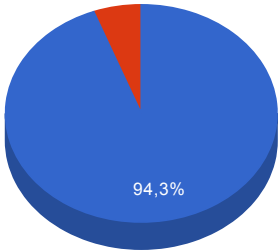
Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (fevereiro / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IGC	5,64%	-0,19%	-3,17%	-5,60%	-13,04%	-2,74%	-	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	5,52%	-0,31%	-3,31%	-5,59%	-13,13%	-2,99%	1,00%	13,688%	20,63%
ICON	4,76%	-0,20%	-1,19%	-6,29%	-7,51%	11,71%	-	-	-
BB CONSUMO FIC AÇÕES	4,69%	-0,30%	-1,29%	-6,99%	-8,54%	9,40%	1,00%	11,673%	18,67%
IFIX	2,95%	-3,41%	-6,27%	-6,65%	-0,58%	2,33%	-	-	-
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	-	-	-	-	-	-	0,30%	-	-

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

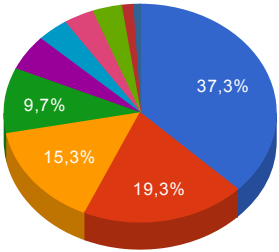
Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	220.643.928,36	94,30%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	13.344.622,18	5,70%

- BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM
- CAIXA ECONÔMICA FEDERAL



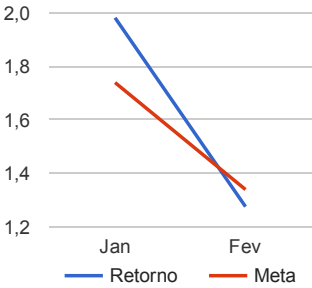
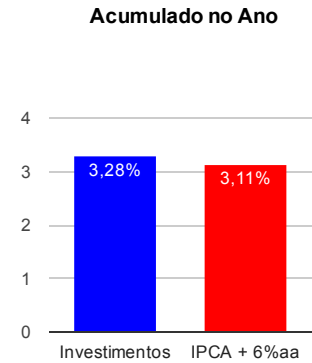
Sub-segmento	Valor	%
IDKA IPCA 2A	87.358.335,29	37,33%
IRF-M 1	45.148.051,85	19,29%
CDI	35.815.243,12	15,31%
IMA-B	22.640.994,89	9,68%
IRF-M	12.394.433,29	5,30%
IMA-GERAL	8.766.720,53	3,75%
CRÉDITO PRIVADO	8.366.952,54	3,58%
IMA-B 5	8.213.403,45	3,51%
FUNDO IMOBILIÁRIO	3.136.774,87	1,34%
AÇÕES - SETORIAIS	2.147.640,71	0,92%

- IDKA IPCA 2A
- IRF-M 1
- CDI
- IMA-B
- IRF-M
- IMA-GERAL
- CRÉDITO PRIVADO
- IMA-B 5
- FUNDO IMOBILIÁRIO
- AÇÕES - SETORIAIS



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	222.268.582,18	3.111.515,01	1.401.422,52	228.418.541,38	4.439.866,71	1,98%	1,74%	113,96%	1,00%
Fevereiro	228.418.541,38	5.467.304,09	2.845.550,27	233.988.550,54	2.948.255,34	1,28%	1,34%	94,93%	0,86%
Acumulado no ano					7.388.122,05	3,28%	3,11%	105,68%	



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 IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	6.410.161,21	0,00	0,00	6.584.320,66	174.159,45	2,72%	2,57%	2,72%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12.085.143,38	0,00	352.847,45	11.925.285,16	192.989,23	1,60%	0,27%	1,62%
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	8.629.760,50	0,00	0,00	8.766.720,53	136.960,03	1,59%	1,53%	1,59%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.864.509,63	0,00	314.411,64	10.715.709,73	165.611,74	1,52%	1,33%	1,54%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	8.090.665,36	0,00	0,00	8.213.403,45	122.738,09	1,52%	1,44%	1,52%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	54.662.370,44	0,00	0,00	55.387.266,42	724.895,98	1,33%	1,41%	1,33%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VIII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12.248.779,56	0,00	0,00	12.394.433,29	145.653,73	1,19%	0,41%	1,19%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.072.674,90	0,00	0,00	9.172.522,93	99.848,03	1,10%	0,18%	1,10%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	31.786.070,87	3.824.288,72	0,00	35.975.528,92	365.169,33	1,03%	0,18%	1,10%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	32.571.372,60	0,00	928.351,87	31.971.068,87	328.048,14	1,01%	0,58%	1,02%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.131.055,25	0,00	0,00	4.172.099,25	41.044,00	0,99%	0,01%	0,99%
BB RPPS I FI RENDA FIXA IPCA CRÉDITO PRIVADO	1.765.423,94	0,00	0,00	1.782.631,88	17.207,94	0,97%	0,64%	0,97%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	30.941.688,58	1.643.015,37	1.249.939,31	31.643.143,87	308.379,23	0,95%	0,01%	0,97%
Total Renda Fixa					2.822.704,92	1,25%	0,75%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	613.717,60	0,00	0,00	647.577,79	33.860,19	5,52%	13,69%	5,52%
BB CONSUMO FIC AÇÕES	1.432.923,38	0,00	0,00	1.500.062,92	67.139,54	4,69%	11,67%	4,69%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	3.112.224,18	0,00	0,00	3.136.774,87	24.550,69	0,79%	-	-
Total Renda Variável					125.550,42	2,43%	12,28%	