

Relatório Analítico dos Investimentos em janeiro de 2016



Carteira consolidada de investimentos - base (janeiro / 2016)

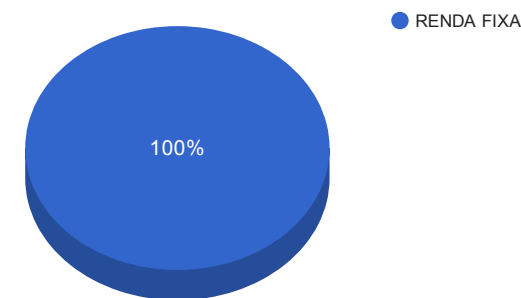
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.734.915,90	7,37%	1.287	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	9.426.941,82	12,12%	1.158	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	2.897.238,35	3,72%	231	0,39%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.692.529,31	2,18%	629	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	8.154.932,47	10,48%	103	2,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2020	3.656.269,74	4,70%	122	0,36%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.151.963,09	6,62%	205	0,46%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	7.254.288,45	9,33%	81	1,66%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.093.425,47	9,12%	338	0,31%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.038.272,39	2,62%	239	0,24%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.427.058,52	4,41%	583	0,30%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	16.823.961,61	21,63%	837	0,26%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.637.024,89	3,39%	484	0,14%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IPCA XV FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	30/08/2016	1.793.191,00	2,31%	40	1,91%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
TOTAL -			77.782.013,01				

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

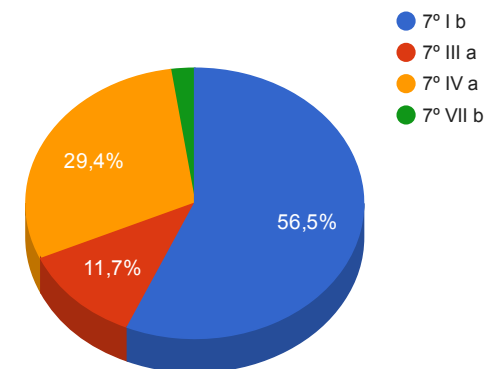
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	85,00%	43.969.079,13	56,53%	22.145.631,93
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	30,00%	9.131.697,86	11,74%	14.202.906,04
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	22.888.045,02	29,43%	446.558,88
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	1.793.191,00	2,31%	2.095.909,65
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.889.100,65
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.889.100,65
Total Renda Fixa	100,00%	160,00	77.782.013,01	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%	3.889.100,65
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.889.100,65
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.889.100,65
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 (janeiro / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA Geral ex-C	2,02%	2,02%	4,10%	4,06%	9,19%	26,25%	-	-	-
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,99%	1,99%	3,99%	3,86%	8,94%	25,61%	0,20%	1,272%	4,59%
IMA Geral	2,02%	2,02%	4,13%	4,19%	9,18%	26,41%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,97%	1,97%	4,07%	3,77%	8,67%	25,39%	0,20%	1,267%	4,64%
IMA-B	1,91%	1,91%	4,53%	3,17%	7,61%	30,43%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3,56%	3,56%	6,78%	3,90%	-	-	0,20%	2,537%	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,88%	1,88%	4,45%	3,05%	7,34%	29,92%	0,30%	2,103%	9,08%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,78%	1,78%	4,32%	2,00%	5,95%	28,05%	0,20%	2,149%	9,16%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	1,65%	1,65%	4,15%	2,80%	7,16%	29,18%	0,20%	1,930%	8,35%
IPCA + 6,00% ao ano	1,74%	1,74%	4,77%	7,99%	17,27%	33,18%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,94%	2,94%	5,78%	8,10%	15,09%	-	0,15%	1,831%	4,26%
IRF-M 1	1,64%	1,64%	3,94%	7,40%	13,65%	26,52%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,62%	1,62%	3,87%	7,21%	13,28%	25,64%	0,10%	0,343%	0,57%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,62%	1,62%	3,89%	7,30%	13,40%	26,01%	0,20%	0,346%	0,55%
IPCA	1,27%	1,27%	3,27%	4,91%	10,71%	18,61%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XV FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,37%	1,37%	4,16%	7,16%	16,31%	30,05%	0,20%	0,063%	0,30%
IMA-B 5+	1,21%	1,21%	3,73%	-0,08%	3,15%	29,70%	-	-	-

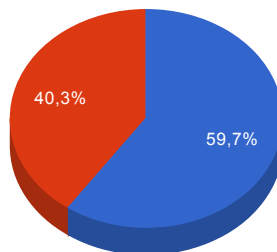
Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (janeiro / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,11%	1,11%	3,54%	-0,53%	2,86%	29,07%	0,20%	3,151%	12,81%
CDI	1,05%	1,05%	3,31%	6,78%	13,38%	25,75%	-	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,16%	1,16%	3,34%	6,56%	13,01%	25,35%	0,20%	0,066%	0,23%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,05%	1,05%	3,33%	6,83%	13,59%	26,28%	0,20%	0,016%	0,06%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,98%	0,98%	3,10%	6,34%	12,51%	23,84%	1,00%	0,010%	0,04%

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

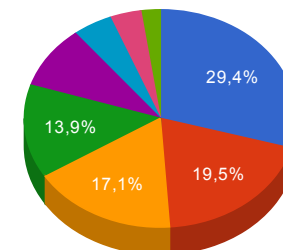
Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	46.424.674,90	59,69%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	31.357.338,11	40,31%

- BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM
- CAIXA ECONÔMICA FEDERAL



Sub-segmento	Valor	%
CDI	22.888.045,02	29,43%
IRF-M 1	15.161.857,72	19,49%
IMA-GERAL	13.306.895,56	17,11%
IMA-B	10.824.227,17	13,92%
IMA-B 5	7.254.288,45	9,33%
IDKA IPCA 3A	3.656.269,74	4,70%
IMA-B 5+	2.897.238,35	3,72%
CRÉDITO PRIVADO	1.793.191,00	2,31%

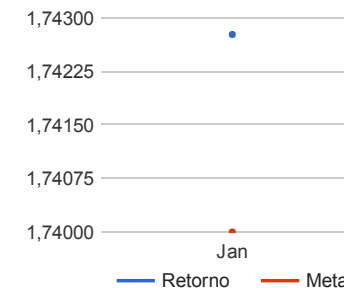
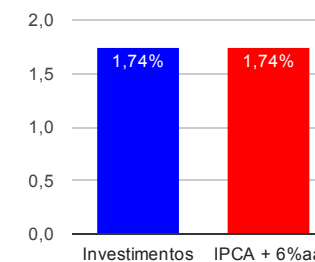
- CDI
- IRF-M 1
- IMA-GERAL
- IMA-B
- IMA-B 5
- IDKA IPCA 3A
- IMA-B 5+
- CRÉDITO PRIVADO



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%
Acumulado no ano					1.332.341,73	1,74%	1,74%	100,19%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)	
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.005.161,99	0,00	0,00	7.254.288,45	249.126,46	3,56%	2,54%	3,56%	
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.551.992,53	0,00	0,00	3.656.269,74	104.277,21	2,94%	1,83%	2,94%	
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	7.995.767,54	0,00	0,00	8.154.932,47	159.164,93	1,99%	1,27%	1,99%	
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.052.550,48	0,00	0,00	5.151.963,09	99.412,61	1,97%	1,27%	1,97%	
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.000.754,61	0,00	0,00	2.038.272,39	37.517,78	1,88%	2,10%	1,88%	
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.662.926,80	0,00	0,00	1.692.529,31	29.602,51	1,78%	2,15%	1,78%	
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	6.978.459,57	0,00	0,00	7.093.425,47	114.965,90	1,65%	1,93%	1,65%	
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.276.278,66	0,00	0,00	9.426.941,82	150.663,16	1,62%	0,34%	1,62%	
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.643.285,32	0,00	0,00	5.734.915,90	91.630,58	1,62%	0,35%	1,62%	
CAIXA BRASIL IPCA XV FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.768.925,00	0,00	0,00	1.793.191,00	24.266,00	1,37%	0,06%	1,37%	
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.606.884,83	0,00	0,00	2.637.024,89	30.140,06	1,16%	0,07%	1,16%	
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.865.549,19	0,00	0,00	2.897.238,35	31.689,16	1,11%	3,15%	1,11%	
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	16.648.566,55	0,00	0,00	16.823.961,61	175.395,06	1,05%	0,02%	1,05%	
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.915.231,11	1.395.750,08	918.412,98	3.427.058,52	34.490,31	0,80%	0,01%	0,98%	
Total Renda Fixa						1.332.341,73	1,74%	1,01%	