

Relatório Analítico dos Investimentos em fevereiro de 2016



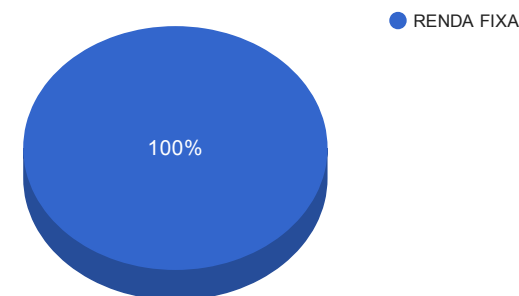
Carteira consolidada de investimentos - base (fevereiro / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	6.207.787,57	33,91%	1.306	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	3.497.768,94	19,10%	539	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.101.406,67	6,02%	623	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.706.983,37	9,32%	1.164	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	3.488.541,07	19,05%	237	0,25%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.245.354,19	6,80%	839	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.061.216,91	5,80%	758	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TOTAL -			18.309.058,72				

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

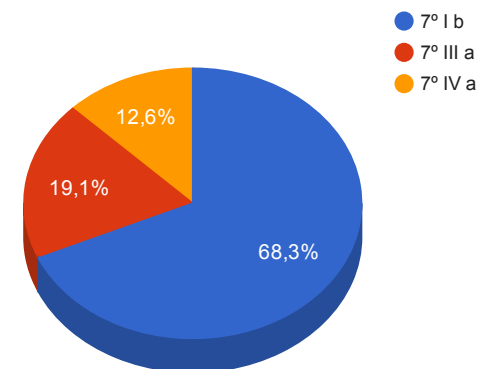
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	100,00%	12.513.946,55	68,35%	5.795.112,17
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	30,00%	3.488.541,07	19,05%	2.004.176,55
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	80,00%	10,00%	0,00	0,00%	1.830.905,87
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	2.306.571,10	12,60%	3.186.146,52
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	30,00%	10,00%	0,00	0,00%	1.830.905,87
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	10,00%	0,00	0,00%	1.830.905,87
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	915.452,94
Total Renda Fixa	100,00%	195,00	18.309.058,72	100,00%	

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	10,00%	0,00	0,00%	1.830.905,87
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	0,00	0,00%	2.746.358,81
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	915.452,94
Total Renda Variável	30,00%	30,00	0,00	0,00%	

Distribuição por Artigo / Resolução



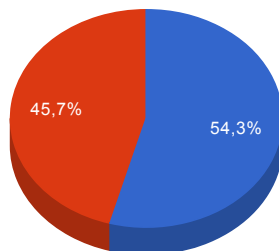
Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (fevereiro / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	2,26%	4,22%	5,80%	8,90%	9,45%	27,71%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,27%	4,09%	5,61%	7,98%	7,80%	25,48%	0,20%	3,096%	9,10%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,24%	4,10%	5,64%	8,58%	9,05%	26,81%	0,20%	3,102%	9,02%
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%
IRF-M 1	1,09%	2,75%	3,97%	7,47%	14,04%	26,55%	-	-	-
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%

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

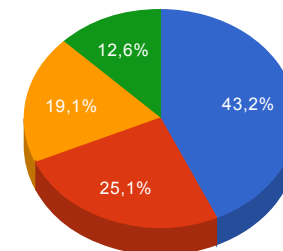
Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	9.938.647,57	54,28%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	8.370.411,15	45,72%

● BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM
● CAIXA ECONÔMICA FEDERAL



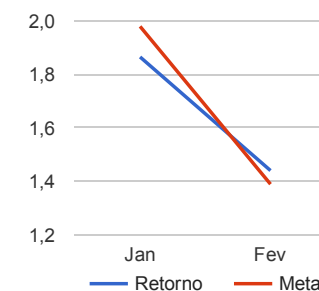
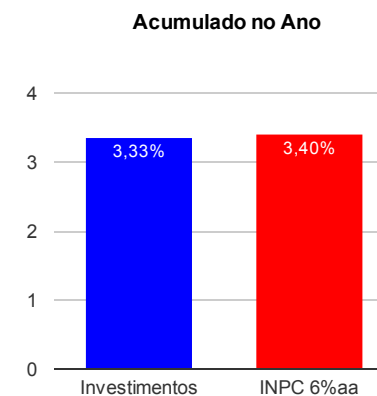
Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	7.914.770,94	43,23%
IMA-B	4.599.175,61	25,12%
IMA-B 5	3.488.541,07	19,05%
CDI	2.306.571,10	12,60%

● IRF-M 1
● IMA-B
● IMA-B 5
● CDI



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	17.381.863,81	198.245,05	346.571,88	17.557.828,89	324.291,91	1,87%	1,98%	94,20%	1,02%
Fevereiro	17.557.828,89	589.552,56	98.394,09	18.309.058,72	260.071,36	1,44%	1,39%	103,33%	1,13%
Acumulado no ano					584.363,27	3,33%	3,40%	97,97%	



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(%)
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.077.009,06	0,00	0,00	1.101.406,67	24.397,61	2,27%	3,10%	2,27%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.421.289,58	0,00	0,00	3.497.768,94	76.479,36	2,24%	3,10%	2,24%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.436.409,59	0,00	0,00	3.488.541,07	52.131,48	1,52%	1,44%	1,52%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.140.212,34	0,00	0,00	6.207.787,57	67.575,23	1,10%	0,18%	1,10%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.050.776,94	0,00	0,00	1.061.216,91	10.439,97	0,99%	0,01%	0,99%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.233.460,85	0,00	21,12	1.245.354,19	11.914,46	0,97%	0,01%	0,97%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.198.670,53	589.552,56	98.372,97	1.706.983,37	17.133,25	0,96%	0,18%	1,10%
Total Renda Fixa					260.071,36	1,44%	1,13%	