

Relatório Analítico dos Investimentos em janeiro de 2016



Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

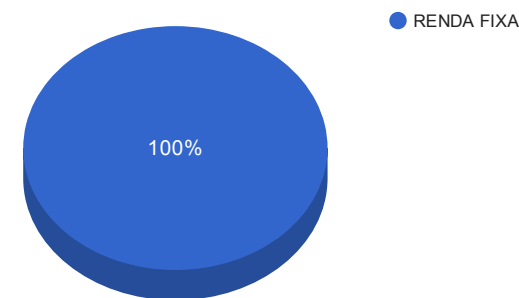
Carteira consolidada de investimentos - base (janeiro / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	3.421.289,58	19,49%	544	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.077.009,06	6,13%	629	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.198.670,53	6,83%	1.158	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	6.140.212,34	34,97%	1.287	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	3.436.409,59	19,57%	217	0,29%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.233.460,85	7,03%	837	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.050.776,94	5,98%	753	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TOTAL			17.557.828,89				

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

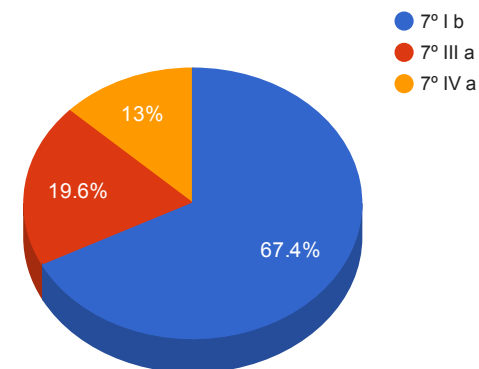
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	100,00%	11.837.181,51	67,42%	5.720.647,38
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	30,00%	3.436.409,59	19,57%	1.830.939,08
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	80,00%	10,00%	0,00	0,00%	1.755.782,89
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	2.284.237,79	13,01%	2.983.110,88
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	30,00%	10,00%	0,00	0,00%	1.755.782,89
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	10,00%	0,00	0,00%	1.755.782,89
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	877.891,44
Total Renda Fixa	100,00%	195,00	17.557.828,89	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%	1.755.782,89
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	0,00	0,00%	2.633.674,33
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	877.891,44
Total Renda Variável	30,00%	30,00	0,00	0,00%	

Distribuição por Artigo / Resolução



Retorno dos investimentos de Renda Fixa - base (janeiro / 2016)

Ativos Renda Fixa	Benchmark	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	IMA-B 5	2,95%	2,95%	5,63%	8,43%	15,94%	33,11%	0,20%	1,702%	3,31%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	IMA-B	1,83%	1,83%	4,39%	2,94%	7,23%	29,48%	0,20%	2,118%	9,08%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	IMA-B	1,78%	1,78%	4,32%	2,00%	5,95%	28,05%	0,20%	2,149%	9,16%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENC...	IRF-M 1	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	IRF-M 1	1,62%	1,62%	3,89%	7,30%	13,40%	26,01%	0,20%	0,346%	0,55%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	CDI	1,05%	1,05%	3,33%	6,83%	13,59%	26,28%	0,20%	0,016%	0,06%
CAIXA BRASIL FI REFERENCIADO DI LP	CDI	1,05%	1,05%	3,29%	6,80%	13,45%	25,91%	0,20%	0,014%	0,08%

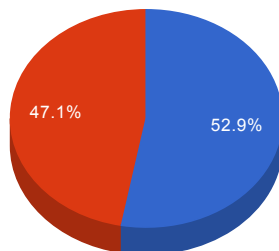
Indicadores e Benchmark's de Renda Fixa - base (janeiro / 2016)

Indicadores - Renda Fixa	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses
INPC + 6% a.a. (Meta Atuarial)	198,05%	198,05%	505,58%	823,59%	17,91%	33,89%
IMA-B 5	2,97%	2,97%	5,73%	8,70%	16,49%	33,78%
IMA-B	1,91%	1,91%	4,53%	3,17%	7,61%	30,43%
IRF-M 1	1,64%	1,64%	3,94%	7,40%	13,65%	26,52%
CDI	1,05%	1,05%	3,31%	6,78%	13,38%	25,75%

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

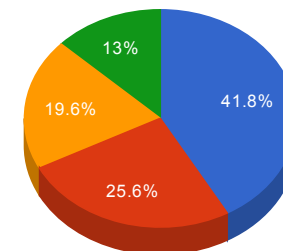
Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	9.289.830,55	52,91%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	8.267.998,34	47,09%

● BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM
● CAIXA ECONÔMICA FEDERAL



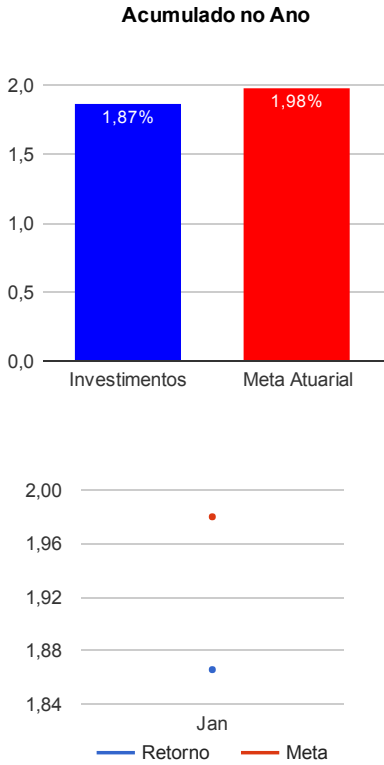
Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	7.338.882,87	41,80%
IMA-B	4.498.298,64	25,62%
IMA-B 5	3.436.409,59	19,57%
CDI	2.284.237,79	13,01%

● 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%
Acumulado no ano					324.291,91	1,87%	1,98%	94,20%	



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(%)
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.338.035,26	0,00	0,00	3.436.409,59	98.374,33	2,95%	1,70%	2,95%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.603.966,07	0,00	248.565,86	3.421.289,58	65.889,37	1,83%	2,12%	1,83%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.058.172,06	0,00	0,00	1.077.009,06	18.837,00	1,78%	2,15%	1,78%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.042.106,06	0,00	0,00	6.140.212,34	98.106,28	1,62%	0,35%	1,62%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.078.958,97	198.245,05	97.865,36	1.198.670,53	19.331,87	1,51%	0,34%	1,62%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.220.741,37	0,00	140,66	1.233.460,85	12.860,14	1,05%	0,02%	1,05%
CAIXA BRASIL FI REFERENCIADO DI LP	1.039.884,02	0,00	0,00	1.050.776,94	10.892,92	1,05%	0,01%	1,05%
Total Renda Fixa					324.291,91	1,87%	1,02%	

