



Relatório Analítico dos Investimentos em março e 1º Trimestre de 2016

Carteira consolidada de investimentos - base (março / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	784.842,05	1,09%	1.169	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	38.072.843,71	52,95%	539	0,91%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	9.951.822,21	13,84%	564	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.935.456,93	5,47%	201	0,39%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.922.360,91	2,67%	122	0,47%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	3.743.001,18	5,21%	226	0,41%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	547.211,80	0,76%	579	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	1.076.138,45	1,50%	843	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	9.041.522,45	12,57%	752	0,21%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PETROBRAS FI AÇÕES	D+4	Não há	1.372.531,28	1,91%	61.339	0,36%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA PETROBRAS FI AÇÕES	D+4	Não há	1.456.085,29	2,03%	33.779	0,48%	Artigo 8º, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			71.903.816,26				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			593.021,41				Artigo 6º
Total			72.496.837,67				

Enquadramentos na Resolução 3.922 / 4.392 / 4.604 e Política de Investimentos - base (março / 2016)

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	100,00%	54.667.325,81	76,03%	17.236.490,45
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	30,00%	3.743.001,18	5,21%	17.828.143,70
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	10.664.872,70	14,83%	10.906.272,18
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	15,00%	0,00	0,00%	10.785.572,44
Total Renda Fixa	100,00%	175,00	69.075.199,69	96,07%	

Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	2.828.616,57	3,93%	7.956.955,87
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.595.190,81
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.595.190,81
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.595.190,81
Total Renda Variável	30,00%	30,00	2.828.616,57	3,93%	

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

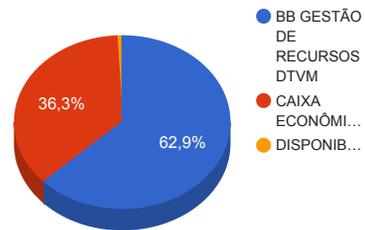
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5+	8,30%	12,62%	12,62%	18,46%	15,77%	35,93%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8,34%	12,47%	12,47%	17,93%	15,09%	34,46%	0,20%	10,098%	13,64%
IMA-B	5,31%	9,75%	9,75%	15,47%	15,59%	33,54%	-	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5,33%	9,65%	9,65%	15,22%	15,24%	32,68%	0,20%	6,878%	9,71%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5,16%	9,50%	9,50%	15,02%	15,22%	32,95%	0,30%	6,766%	9,67%
IMA Geral	3,42%	7,28%	7,28%	11,27%	14,24%	28,51%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,34%	7,10%	7,10%	10,88%	13,57%	27,55%	0,20%	3,142%	4,81%
IRF-M 1	1,26%	4,04%	4,04%	7,79%	14,41%	27,15%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,21%	3,99%	3,99%	7,67%	14,09%	26,29%	0,10%	0,171%	0,53%
CDI	1,16%	3,25%	3,25%	6,72%	13,73%	26,53%	-	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,18%	3,25%	3,25%	6,72%	13,80%	26,69%	0,20%	0,036%	0,07%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,11%	3,16%	3,16%	6,66%	13,82%	26,87%	0,20%	0,015%	0,05%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,05%	2,98%	2,98%	6,23%	12,77%	24,51%	1,00%	0,009%	0,03%
IDKA IPCA 2 Anos	0,15%	5,16%	5,16%	10,57%	17,31%	32,68%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,62%	4,92%	4,92%	10,39%	16,35%	31,45%	0,20%	1,836%	3,11%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

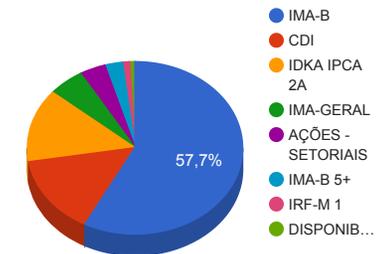
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
PETROBRAS PN - PETR4	62,45%	24,63%	24,63%	15,33%	-14,18%	-43,69%	-	-	-
BB PETROBRAS FI AÇÕES	49,80%	25,31%	25,31%	22,99%	2,56%	-33,24%	2,00%	40,554%	65,25%
CAIXA PETROBRAS FI AÇÕES	44,50%	24,98%	24,98%	26,21%	11,68%	-27,03%	1,50%	38,254%	66,45%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	45.596.568,47	63,41%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	26.307.247,79	36,59%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	593.021,41	0,82%



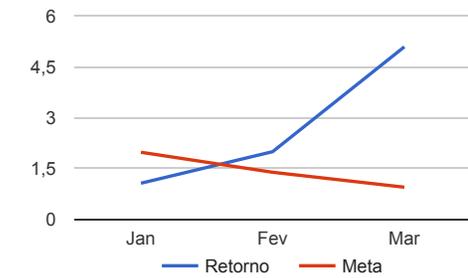
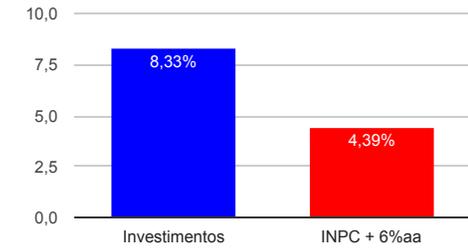
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	41.815.844,89	58,16%
CDI	10.664.872,70	14,83%
IDKA IPCA 2A	9.951.822,21	13,84%
IMA-GERAL	3.935.456,93	5,47%
AÇÕES - SETORIAIS	2.828.616,57	3,93%
IMA-B 5+	1.922.360,91	2,67%
IRF-M 1	784.842,05	1,09%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	593.021,41	0,82%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	65.355.531,09	851.277,97	600.000,00	66.306.944,47	700.135,41	1,07%	1,98%	53,88%	2,60%
Fevereiro	66.306.944,47	1.048.853,29	702.298,40	67.984.512,89	1.331.013,53	2,00%	1,39%	143,20%	3,48%
Março	67.984.512,89	1.098.675,26	660.969,18	71.903.816,26	3.481.597,29	5,09%	0,95%	534,36%	6,19%
Acumulado no ano					5.512.746,23	8,33%	4,39%	189,89%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.774.429,89	0,00	0,00	1.922.360,91	147.931,02	8,34%	10,10%	8,34%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	36.146.516,51	0,00	0,00	38.072.843,71	1.926.327,20	5,33%	6,88%	5,33%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.559.448,34	0,00	0,00	3.743.001,18	183.552,84	5,16%	6,77%	5,16%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.808.341,83	0,00	0,00	3.935.456,93	127.115,10	3,34%	3,14%	3,34%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	775.434,14	0,00	0,00	784.842,05	9.407,91	1,21%	0,17%	1,21%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	8.703.302,53	234.899,00	0,00	9.041.522,45	103.320,92	1,16%	0,04%	1,18%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1.064.299,40	0,00	0,00	1.076.138,45	11.839,05	1,11%	0,02%	1,11%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.890.759,82	0,00	0,00	9.951.822,21	61.062,39	0,62%	1,84%	0,62%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	338.114,26	863.776,26	660.969,18	547.211,80	6.290,46	0,52%	0,01%	1,05%
				Total Renda Fixa	2.576.846,89	3,88%	4,89%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB PETROBRAS FI AÇÕES	916.214,31	0,00	0,00	1.372.531,28	456.316,97	49,80%	40,55%	49,80%
CAIXA PETROBRAS FI AÇÕES	1.007.651,86	0,00	0,00	1.456.085,29	448.433,43	44,50%	38,25%	44,50%
Total Renda Variável					904.750,40	47,03%	39,37%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre / 2016

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	34.721.374,10	0,00	0,00	38.072.843,71	3.351.469,61	9,65%	9,65%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.867.607,77	1.659.427,47	0,00	9.951.822,21	424.786,97	4,77%	4,92%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.418.251,78	0,00	0,00	3.743.001,18	324.749,40	9,50%	9,50%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	9.507.761,02	451.199,00	1.210.000,00	9.041.522,45	292.562,43	3,19%	3,25%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.674.435,73	0,00	0,00	3.935.456,93	261.021,20	7,10%	7,10%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.709.234,18	0,00	0,00	1.922.360,91	213.126,73	12,47%	12,47%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1.043.127,78	0,00	0,00	1.076.138,45	33.010,67	3,16%	3,16%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	754.746,67	0,00	0,00	784.842,05	30.095,38	3,99%	3,99%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	398.703,02	888.180,05	753.267,58	547.211,80	13.596,31	2,29%	2,98%
				Total Renda Fixa	4.944.418,70	7,75%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre / 2016

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA PETROBRAS FI AÇÕES	1.165.015,71	0,00	0,00	1.456.085,29	291.069,58	24,98%	24,98%
BB PETROBRAS FI AÇÕES	1.095.273,33	0,00	0,00	1.372.531,28	277.257,95	25,31%	25,31%
Total Renda Variável					568.327,53	25,14%	