

Relatório Analítico dos Investimentos em junho, 2º Trimestre e 1º semestre de 2016

Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	10.282.651,21	13,40%	602	0,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.137.992,70	5,39%	200	0,40%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.059.492,52	2,68%	136	0,46%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	40.264.201,71	52,48%	560	0,86%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	810.134,51	1,06%	1.175	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	3.954.278,28	5,15%	232	0,41%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	1.110.806,99	1,45%	824	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	538.305,97	0,70%	573	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	10.505.574,99	13,69%	747	0,23%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PETROBRAS FI AÇÕES	D+4	Não há	1.495.380,18	1,95%	60.268	0,37%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA PETROBRAS FI AÇÕES	D+4	Não há	1.570.830,18	2,05%	33.298	0,49%	Artigo 8º, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			76.729.649,24				
			687.554,56	Artigo 6º			
Total			77.417.203,80				

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

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	100,00%	57.554.472,65	75,01%	19.175.176,59
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	30,00%	3.954.278,28	5,15%	19.064.616,49
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	12.154.687,95	15,84%	10.864.206,82
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	15,00%	0,00	0,00%	11.509.447,39
Total Renda Fixa	100,00%	175,00	73.663.438,88	96,00%	

Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	3.066.210,36	4,00%	8.443.237,03
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.836.482,46
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.836.482,46
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.836.482,46
Total Renda Variável	30,00%	30,00	3.066.210,36	4,00%	

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

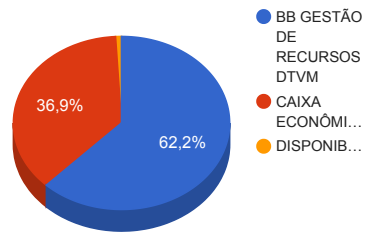
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5+	2,57%	20,82%	7,29%	20,82%	17,14%	33,97%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,58%	20,49%	7,13%	20,49%	16,21%	32,22%	0,20%	3,176%	13,77%
IMA-B	1,93%	16,15%	5,83%	16,15%	16,73%	32,26%	-	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,90%	15,96%	5,76%	15,96%	16,24%	31,43%	0,20%	2,296%	9,75%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,84%	15,68%	5,64%	15,68%	16,13%	31,42%	0,30%	2,313%	9,70%
IMA Geral	1,81%	12,87%	5,20%	12,87%	15,87%	29,08%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,76%	12,62%	5,15%	12,62%	15,21%	28,02%	0,20%	1,222%	4,85%
CDI	1,16%	6,72%	3,36%	6,72%	14,09%	27,57%	-	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,17%	6,27%	3,20%	6,27%	13,15%	25,58%	1,00%	0,106%	0,08%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,16%	6,73%	3,36%	6,73%	14,15%	27,71%	0,20%	0,007%	0,07%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,07%	6,49%	3,22%	6,49%	13,92%	27,68%	0,20%	0,271%	0,17%
IRF-M 1	1,08%	7,42%	3,25%	7,42%	14,96%	27,79%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,03%	7,34%	3,22%	7,34%	14,66%	27,00%	0,10%	0,117%	0,51%
IDKA IPCA 2 Anos	0,93%	8,58%	3,25%	8,58%	17,00%	31,47%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,88%	8,41%	3,32%	8,41%	16,74%	30,55%	0,20%	1,115%	3,11%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

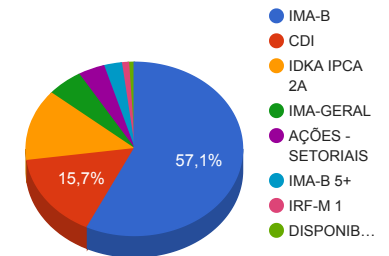
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
PETROBRAS PN - PETR4	17,16%	40,60%	12,81%	40,60%	-25,89%	-45,52%	-	-	-
BB PETROBRAS FI AÇÕES	14,03%	36,53%	8,95%	36,53%	-20,16%	-35,50%	2,00%	27,558%	67,06%
CAIXA PETROBRAS FI AÇÕES	12,88%	34,83%	7,88%	34,83%	-17,14%	-29,73%	1,50%	27,944%	67,69%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	48.173.107,64	62,78%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	28.556.541,60	37,22%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	687.554,56	0,90%



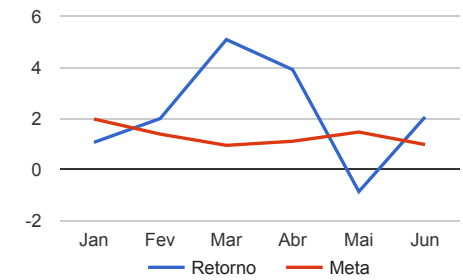
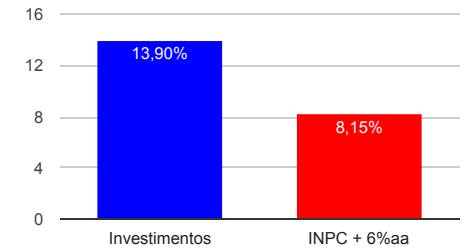
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	44.218.479,99	57,63%
CDI	12.154.687,95	15,84%
IDKA IPCA 2A	10.282.651,21	13,40%
IMA-GERAL	4.137.992,70	5,39%
AÇÕES - SETORIAIS	3.066.210,36	4,00%
IMA-B 5+	2.059.492,52	2,68%
IRF-M 1	810.134,51	1,06%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	687.554,56	0,90%



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%
Abril	71.903.816,26	1.030.653,29	700.000,00	75.059.712,44	2.825.242,89	3,91%	1,11%	353,48%	4,12%
Mai	75.059.712,44	1.156.706,20	719.871,93	74.848.448,60	-648.098,11	-0,86%	1,47%	-58,34%	3,29%
Junho	74.848.448,60	1.167.411,19	834.895,19	76.729.649,24	1.548.684,64	2,06%	0,98%	209,69%	2,74%
Acumulado no ano					9.238.575,65	13,90%	8,15%	170,61%	

Acumulado no Ano



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de junho / 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	2.007.747,75	0,00	0,00	2.059.492,52	51.744,77	2,58%	3,18%	2,58%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	39.511.834,51	0,00	0,00	40.264.201,71	752.367,20	1,90%	2,30%	1,90%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.882.977,98	0,00	0,00	3.954.278,28	71.300,30	1,84%	2,31%	1,84%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.066.460,65	0,00	0,00	4.137.992,70	71.532,05	1,76%	1,22%	1,76%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	10.068.647,82	1.064.039,62	750.000,00	10.505.574,99	122.887,55	1,10%	0,01%	1,16%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1.099.099,99	0,00	0,00	1.110.806,99	11.707,00	1,07%	0,27%	1,07%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	801.841,79	0,00	0,00	810.134,51	8.292,72	1,03%	0,12%	1,03%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	513.691,90	103.371,57	84.895,19	538.305,97	6.137,69	0,99%	0,11%	1,17%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.193.194,10	0,00	0,00	10.282.651,21	89.457,11	0,88%	1,11%	0,88%
Total Renda Fixa					1.185.426,39	1,64%	1,70%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB PETROBRAS FI AÇÕES	1.311.415,76	0,00	0,00	1.495.380,18	183.964,42	14,03%	27,56%	14,03%
CAIXA PETROBRAS FI AÇÕES	1.391.536,35	0,00	0,00	1.570.830,18	179.293,83	12,88%	27,94%	12,88%
Total Renda Variável					363.258,25	13,44%	27,76%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º 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	38.072.843,71	0,00	0,00	40.264.201,71	2.191.358,00	5,76%	5,76%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	9.041.522,45	3.126.581,62	2.000.000,00	10.505.574,99	337.470,92	3,22%	3,36%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.951.822,21	0,00	0,00	10.282.651,21	330.829,00	3,32%	3,32%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.743.001,18	0,00	0,00	3.954.278,28	211.277,10	5,64%	5,64%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.935.456,93	0,00	0,00	4.137.992,70	202.535,77	5,15%	5,15%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.922.360,91	0,00	0,00	2.059.492,52	137.131,61	7,13%	7,13%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1.076.138,45	0,00	0,00	1.110.806,99	34.668,54	3,22%	3,22%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	784.842,05	0,00	0,00	810.134,51	25.292,46	3,22%	3,22%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	547.211,80	228.189,06	254.767,12	538.305,97	17.672,23	2,88%	3,20%
				Total Renda Fixa	3.488.235,63	5,01%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre / 2016

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB PETROBRAS FI AÇÕES	1.372.531,28	0,00	0,00	1.495.380,18	122.848,90	8,95%	8,95%
CAIXA PETROBRAS FI AÇÕES	1.456.085,29	0,00	0,00	1.570.830,18	114.744,89	7,88%	7,88%
Total Renda Variável					237.593,79	8,40%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre / 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	40.264.201,71	5.542.827,61	15,96%	15,96%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.867.607,77	1.659.427,47	0,00	10.282.651,21	755.615,97	8,25%	8,41%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	9.507.761,02	3.577.780,62	3.210.000,00	10.505.574,99	630.033,35	6,51%	6,73%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.418.251,78	0,00	0,00	3.954.278,28	536.026,50	15,68%	15,68%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.674.435,73	0,00	0,00	4.137.992,70	463.556,97	12,62%	12,62%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.709.234,18	0,00	0,00	2.059.492,52	350.258,34	20,49%	20,49%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1.043.127,78	0,00	0,00	1.110.806,99	67.679,21	6,49%	6,49%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	754.746,67	0,00	0,00	810.134,51	55.387,84	7,34%	7,34%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	398.703,02	1.116.369,11	1.008.034,70	538.305,97	31.268,54	5,24%	6,27%
				Total Renda Fixa	8.432.654,33	13,14%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre / 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	1.570.830,18	405.814,47	34,83%	34,83%
BB PETROBRAS FI AÇÕES	1.095.273,33	0,00	0,00	1.495.380,18	400.106,85	36,53%	36,53%
Total Renda Variável					805.921,32	35,66%	