



Relatório Analítico dos Investimentos em dezembro, 4º Trimestre e ano de 2015

Carteira consolidada de investimentos - base (dezembro / 2015)

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	13.660,98	3,91%	549	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	102.275,51	29,30%	1.165	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	8.027,91	2,30%	1.280	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	6.593,94	1,89%	208	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	7.736,22	2,22%	579	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	104.129,16	29,83%	831	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	106.638,29	30,55%	98	0,09%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
		TOTAL -	349.062,01				

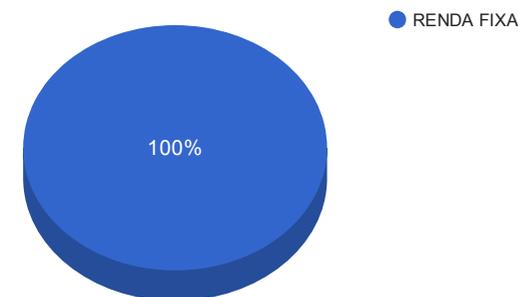
Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (dezembro / 2015)

Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	95,00%	123.964,40	35,51%	207.644,51
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	30,00%	6.593,94	1,89%	98.124,66
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	111.865,38	32,05%	-7.146,78
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	10,00%	0,00	0,00%	34.906,20
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	106.638,29	30,55%	-89.185,19
Total Renda Fixa	100,00%	170,00	349.062,01	100,00%	

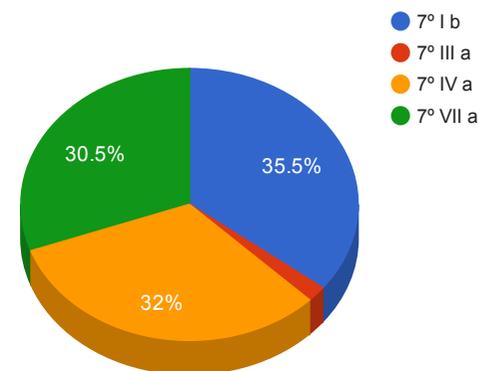
Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	10,00%	0,00	0,00%	34.906,20
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	0,00	0,00%	52.359,30
Total Renda Variável	30,00%	25,00	0,00	0,00%	

⚠ **Atenção!! - Valores em desacordo com Artigo 7º, Inciso VII, § 5º**

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Retorno dos investimentos de Renda Fixa - base (dezembro / 2015)

Ativos Renda Fixa	Benchmark	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	IMA-B 5	2,07%	14,87%	5,10%	7,17%	14,87%	0,20%	0,827%	3,17%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	IMA-B	1,48%	8,53%	5,08%	0,23%	8,53%	0,20%	1,453%	9,17%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	CDI	1,18%	13,46%	3,39%	6,98%	13,46%	0,20%	0,010%	0,07%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	IRF-M 1	1,16%	12,76%	3,55%	6,92%	12,76%	0,20%	0,107%	0,50%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENC...	IRF-M 1	1,15%	12,58%	3,54%	6,82%	12,58%	0,10%	0,100%	0,52%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	101,50% do IPCA + 5,75% ao ano	1,10%	-3,55%	0,37%	-0,46%	-3,55%	0,25%	4,094%	3,17%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	CDI	1,08%	12,36%	3,16%	6,47%	12,36%	1,00%	0,015%	0,05%

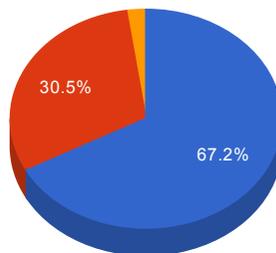
Indicadores e Benchmark's de Renda Fixa - base (dezembro / 2015)

Indicadores - Renda Fixa	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses
IMA-B 5	2,12%	15,46%	5,23%	7,45%	15,46%
IMA-B	1,52%	8,88%	5,21%	0,50%	8,88%
IPCA + 6% a.a. (Meta Atuarial)	1,47%	17,26%	4,32%	7,37%	17,26%
IRF-M 1	1,18%	13,01%	3,60%	7,02%	13,01%
CDI	1,16%	13,24%	3,36%	6,91%	13,24%

Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (dezembro / 2015)

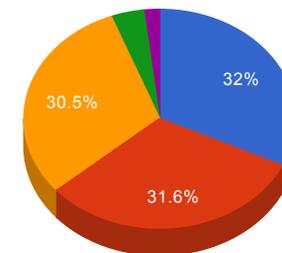
Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	234.395,81	67,15%
PETRA Corretora	106.638,29	30,55%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	8.027,91	2,30%

- BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM
- PETRA Corretora
- CAIXA ECONÔMICA FEDERAL



Sub-segmento	Valor	%
CDI	111.865,38	32,05%
IRF-M 1	110.303,42	31,60%
FIDC - FECHADO	106.638,29	30,55%
IMA-B	13.660,98	3,91%
IMA-B 5	6.593,94	1,89%

- CDI
- IRF-M 1
- FIDC - FECHADO
- IMA-B
- IMA-B 5



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2015

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	2.785.786,29	678.991,19	1.027.687,84	2.492.999,73	55.910,09	2,01%	1,73%	115,82%	1,46%
Fevereiro	2.492.999,73	331.163,65	694.067,44	2.147.140,23	17.044,29	0,68%	1,64%	41,63%	2,15%
Março	2.147.140,23	1.162.840,00	1.254.371,38	2.053.208,81	-2.400,04	-0,11%	1,84%	-6,09%	0,53%
Abril	2.053.208,81	0,00	41.981,09	2.024.636,48	13.408,76	0,65%	1,18%	55,49%	1,12%
Mai	2.024.636,48	1.244.162,44	1.460.743,37	1.826.190,29	18.134,74	0,90%	1,21%	74,21%	1,58%
Junho	1.826.190,29	600.000,00	396.960,58	2.040.156,36	10.926,65	0,54%	1,28%	42,05%	1,10%
Julho	2.040.156,36	73.315,03	437.563,19	1.685.474,13	9.565,93	0,47%	1,16%	40,54%	1,95%
Agosto	1.685.474,13	0,00	21.127,88	1.649.171,43	-15.174,82	-0,90%	0,71%	-127,20%	1,99%
Setembro	1.649.171,43	100.000,00	654.781,48	1.096.100,42	1.710,47	0,10%	1,03%	10,08%	6,19%
Outubro	1.096.100,42	0,00	28.223,16	1.087.415,70	19.538,44	1,78%	1,31%	135,99%	2,70%
Novembro	1.087.415,70	287.837,15	395.292,85	990.480,07	10.520,07	0,97%	1,48%	65,45%	2,27%
Dezembro	990.480,07	29.861,03	682.662,04	349.062,01	11.382,95	1,15%	1,47%	77,92%	1,36%
Acumulado no ano					150.567,53	8,52%	17,26%	49,36%	
Acumulado no 4º Trimestre					41.441,46	3,95%	4,32%	91,30%	



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de dezembro / 2015

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	6.460,10	0,00	0,00	6.593,94	133,84	2,07%	0,83%	2,07%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	105.473,02	0,00	809,60	106.638,29	1.974,87	1,87%	4,09%	1,10%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.935,73	0,00	0,00	8.027,91	92,18	1,16%	0,11%	1,16%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	101.109,03	0,00	0,00	102.275,51	1.166,48	1,15%	0,10%	1,15%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	142.577,53	0,00	40.000,00	104.129,16	1.551,63	1,09%	0,01%	1,18%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	593.440,73	0,00	586.000,00	13.660,98	6.220,25	1,05%	1,45%	1,48%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	33.483,93	29.861,03	55.852,44	7.736,22	243,70	0,38%	0,02%	1,08%
Total Renda Fixa					11.382,95	1,15%	1,36%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre / 2015

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	646.034,98	0,00	662.000,00	13.660,98	29.626,00	4,71%	5,08%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	238.372,11	0,00	140.000,00	104.129,16	5.757,05	2,87%	3,39%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	333,13	100.000,00	0,00	102.275,51	1.942,38	3,26%	3,54%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	106.247,56	0,00	1.384,90	106.638,29	1.775,63	1,68%	0,37%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	91.086,32	217.698,18	302.793,15	7.736,22	1.744,87	1,55%	3,16%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	6.273,92	0,00	0,00	6.593,94	320,02	5,10%	5,10%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.752,40	0,00	0,00	8.027,91	275,51	3,55%	3,55%
Total Renda Fixa					41.441,46	3,95%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no Ano de 2015

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.200.348,30	0,00	1.225.839,66	8.027,91	33.519,27	12,47%	12,76%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	103.493,05	1.133.548,46	1.255.191,71	7.736,22	25.886,42	8,40%	12,36%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.131.899,13	679.162,44	1.821.218,19	13.660,98	23.817,60	2,01%	8,53%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,00	1.477.840,00	1.494.188,70	6.593,94	22.942,64	8,57%	14,87%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	517.619,59	434.000,00	104.129,16	20.509,57	10,23%	13,46%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	110.565,41	0,00	18.464,86	106.638,29	14.537,74	14,16%	-3,55%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	96.075,22	700.000,00	698.491,85	102.275,51	4.692,14	6,19%	12,58%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	143.405,18	0,00	148.067,33	0,00	4.662,15	3,25%	8,25%
				Total Renda Fixa	150.567,53	8,52%	

