

Relatório Analítico dos Investimentos em outubro de 2015



Carteira consolidada de investimentos - base (outubro / 2015)

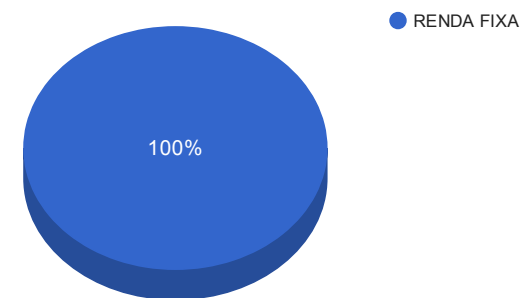
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	3.485.009,89	20,46%	558	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.032.454,12	6,06%	669	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.138.828,96	6,69%	1.162	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.910.380,30	34,70%	1.256	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	3.253.301,14	19,10%	194	0,29%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.194.233,12	7,01%	816	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.017.291,68	5,97%	738	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
		TOTAL	17.031.499,21				

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

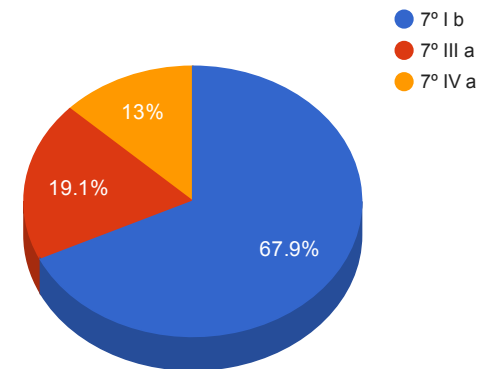
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	100,00%	11.566.673,27	67,91%	5.464.825,94
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	30,00%	3.253.301,14	19,10%	1.856.148,62
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	2.211.524,80	12,98%	2.897.924,96
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	10,00%	0,00	0,00%	1.703.149,92
Total Renda Fixa	100,00%	170,00	17.031.499,21	100,00%	

Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	5,00%	0,00	0,00%	851.574,96
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	0,00	0,00%	2.554.724,88
Total Renda Variável	30,00%	20,00	0,00	0,00%	

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



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

Ativos Renda Fixa	Benchmark	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	IMA-B	2,50%	5,86%	-1,39%	0,04%	5,97%	0,20%	4,065%	9,65%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	IMA-B 5	2,43%	11,95%	2,65%	7,02%	13,12%	0,20%	1,812%	3,10%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	IMA-B	2,34%	4,66%	-2,22%	-1,03%	4,80%	0,20%	4,159%	9,68%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENC...	IRF-M 1	1,30%	10,14%	3,21%	6,42%	11,97%	0,10%	0,341%	0,52%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	IRF-M 1	1,30%	10,30%	3,29%	6,52%	12,14%	0,20%	0,346%	0,50%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	CDI	1,12%	10,96%	3,39%	6,86%	13,01%	0,20%	0,012%	0,08%
CAIXA BRASIL FI REFERENCIADO DI LP	CDI	1,11%	10,86%	3,40%	6,78%	12,87%	0,20%	0,076%	0,09%

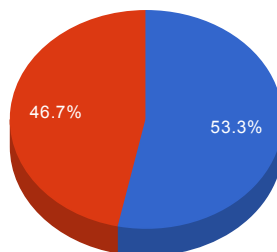
Indicadores e Benchmark's de Renda Fixa - base (outubro / 2015)

Indicadores - Renda Fixa	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses
IMA-B	2,58%	6,15%	-1,30%	0,24%	6,36%
IMA-B 5	2,49%	12,45%	2,81%	7,25%	13,67%
IRF-M 1	1,31%	10,51%	3,33%	6,64%	12,39%
INPC + 6% a.a. (Meta Atuarial)	1,26%	14,45%	3,03%	7,03%	16,90%
CDI	1,11%	10,77%	3,36%	6,73%	12,77%

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

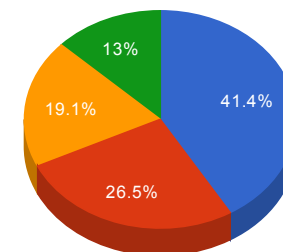
Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	9.071.373,11	53,26%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	7.960.126,10	46,74%

- BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM
- CAIXA ECONÔMICA FEDERAL



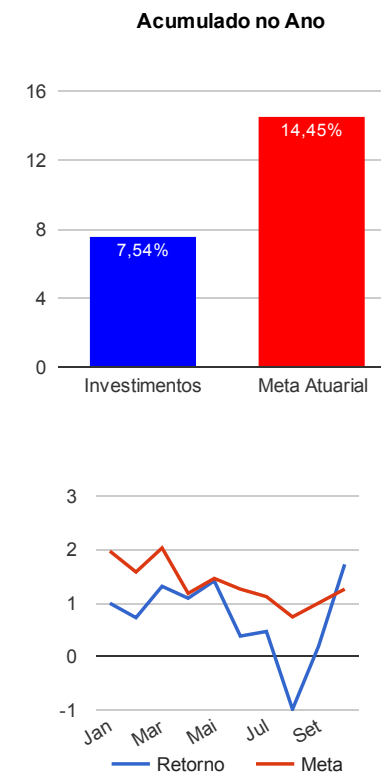
Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	7.049.209,26	41,39%
IMA-B	4.517.464,01	26,52%
IMA-B 5	3.253.301,14	19,10%
CDI	2.211.524,80	12,98%

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



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2015

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	14.756.287,07	875.384,28	547.259,96	15.234.603,14	150.191,75	1,00%	1,97%	50,44%	0,14%
Fevereiro	15.234.603,14	29.208,89	87.865,15	15.286.598,92	110.652,04	0,73%	1,58%	45,91%	0,23%
Março	15.286.598,92	6.305.127,18	6.091.796,19	15.703.471,66	203.541,75	1,31%	2,03%	64,76%	1,03%
Abril	15.703.471,66	1.164.052,86	1.070.058,60	15.969.600,26	172.134,34	1,09%	1,18%	92,59%	1,02%
Mai	15.969.600,26	3.373.263,33	3.276.569,37	16.293.467,97	227.173,75	1,41%	1,46%	96,97%	1,80%
Junho	16.293.467,97	187.246,94	121.665,78	16.421.464,97	62.415,84	0,38%	1,26%	30,27%	1,17%
Julho	16.421.464,97	185.769,02	90.918,50	16.593.635,65	77.320,16	0,47%	1,12%	41,94%	1,90%
Agosto	16.593.635,65	188.323,55	97.564,80	16.519.797,88	-164.596,52	-0,99%	0,74%	-133,68%	1,94%
Setembro	16.519.797,88	186.386,02	91.437,30	16.646.904,19	32.157,59	0,19%	1,00%	19,37%	4,71%
Outubro	16.646.904,19	2.252.941,62	2.156.775,98	17.031.499,21	288.429,38	1,72%	1,26%	136,67%	1,58%
Acumulado no ano					1.159.420,08	7,54%	14,45%	52,16%	



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.464.717,67	0,00	65.684,14	3.485.009,89	85.976,36	2,48%	4,07%	2,50%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.176.032,87	0,00	0,00	3.253.301,14	77.268,27	2,43%	1,81%	2,43%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.844.205,04	2.000.000,00	0,00	5.910.380,30	66.175,26	1,13%	0,35%	1,30%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.194.833,44	1.151,06	15.091,84	1.194.233,12	13.340,46	1,12%	0,01%	1,12%
CAIXA BRASIL FI REFERENCIADO DI LP	1.006.101,34	0,00	0,00	1.017.291,68	11.190,34	1,11%	0,08%	1,11%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	950.224,49	251.790,56	76.000,00	1.138.828,96	12.813,91	1,07%	0,34%	1,30%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.010.789,34	0,00	2.000.000,00	1.032.454,12	21.664,78	0,72%	4,16%	2,34%
Total Renda Fixa					288.429,38	1,72%	1,58%	

