

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



Carteira consolidada de investimentos - base (março / 2016)

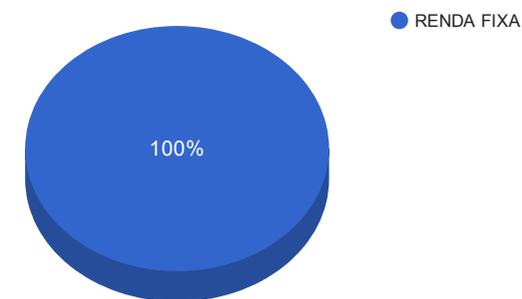
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.419.963,39	68,81%	1.169	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	425.304,84	8,56%	721	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	641.615,46	12,91%	253	0,04%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	74.313,66	1,50%	579	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	409.157,52	8,23%	843	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
		TOTAL -	4.970.354,87				

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

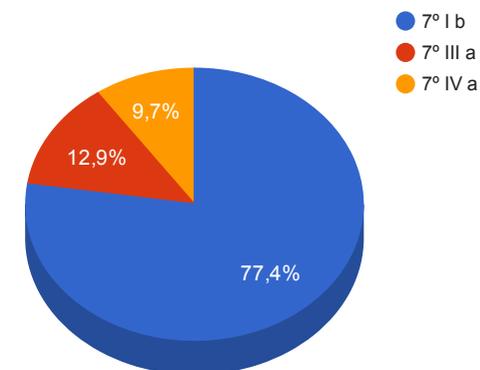
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	90,00%	3.845.268,23	77,36%	628.051,15
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	40,00%	641.615,46	12,91%	1.346.526,49
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	483.471,18	9,73%	1.007.635,28
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	10,00%	0,00	0,00%	497.035,49
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	248.517,74
Total Renda Fixa	100,00%	175,00	4.970.354,87	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%	248.517,74
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	10,00%	0,00	0,00%	497.035,49
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	248.517,74
Total Renda Variável	30,00%	20,00	0,00	0,00%	

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



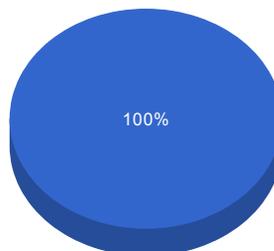
Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (março / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
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%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	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%
IMA-B 5	0,76%	5,35%	5,35%	10,86%	16,55%	31,87%	-	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,75%	5,29%	5,29%	10,66%	16,12%	30,77%	0,20%	1,845%	3,49%
IDKA IPCA 2 Anos	0,15%	5,16%	5,16%	10,57%	17,31%	32,68%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,53%	4,93%	4,93%	10,39%	16,25%	31,02%	0,20%	1,837%	3,20%

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

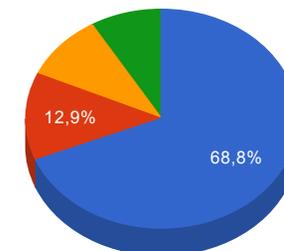
Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	4.970.354,87	100,00%

● BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM



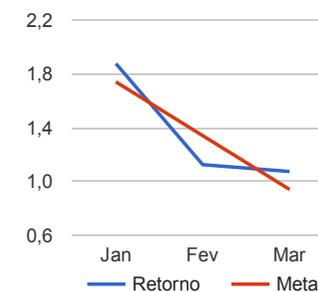
Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	3.419.963,39	68,81%
IMA-B 5	641.615,46	12,91%
CDI	483.471,18	9,73%
IDKA IPCA 2A	425.304,84	8,56%

● IRF-M 1
 ● IMA-B 5
 ● CDI
 ● IDKA IPCA 2A



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	4.425.924,26	0,00	45.513,08	4.463.437,93	83.026,75	1,88%	1,74%	107,85%	0,64%
Fevereiro	4.463.437,93	363.068,39	49.656,31	4.830.555,72	53.705,71	1,12%	1,34%	83,64%	0,44%
Março	4.830.555,72	148.686,72	61.679,25	4.970.354,87	52.791,68	1,07%	0,94%	113,94%	0,51%
Acumulado no ano					189.524,14	4,13%	4,08%	101,20%	



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(%)
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.409.148,73	0,00	30.405,81	3.419.963,39	41.220,47	1,21%	0,17%	1,21%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	103.390,33	0,00	30.124,46	74.313,66	1.047,79	1,01%	0,01%	1,05%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	258.091,75	148.686,72	1.148,98	409.157,52	3.528,03	0,87%	0,02%	1,11%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	636.845,52	0,00	0,00	641.615,46	4.769,94	0,75%	1,85%	0,75%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	423.079,39	0,00	0,00	425.304,84	2.225,45	0,53%	1,84%	0,53%
Total Renda Fixa					52.791,68	1,07%	0,51%	

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 IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.983.258,85	363.068,39	51.001,53	3.419.963,39	124.637,68	3,92%	3,99%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	609.370,15	0,00	0,00	641.615,46	32.245,31	5,29%	5,29%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	405.310,92	0,00	0,00	425.304,84	19.993,92	4,93%	4,93%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	252.957,65	148.686,72	1.148,98	409.157,52	8.662,13	2,91%	3,16%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	175.026,69	0,00	104.698,13	74.313,66	3.985,10	2,88%	2,98%
				Total Renda Fixa	189.524,14	4,13%	