

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



Carteira consolidada de investimentos - base (dezembro / 2015)

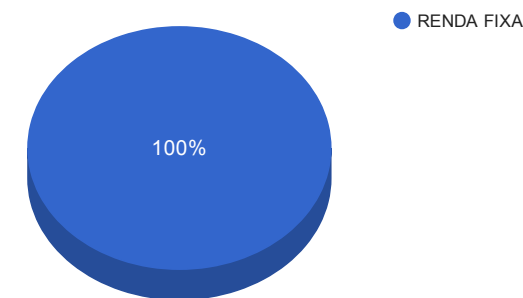
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	405.310,92	9,16%	647	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.983.258,85	67,40%	1.165	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	609.370,15	13,77%	208	0,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	175.026,69	3,95%	579	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	252.957,65	5,72%	831	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
		TOTAL -	4.425.924,26				

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

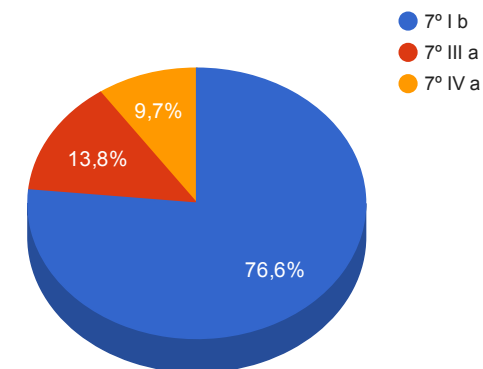
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	100,00%	3.388.569,77	76,56%	1.037.354,49
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	30,00%	609.370,15	13,77%	718.407,13
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	427.984,34	9,67%	899.792,94
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	10,00%	0,00	0,00%	442.592,43
Total Renda Fixa	100,00%	170,00	4.425.924,26	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%	221.296,21
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	10,00%	0,00	0,00%	442.592,43
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	221.296,21
Total Renda Variável	30,00%	20,00	0,00	0,00%	

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



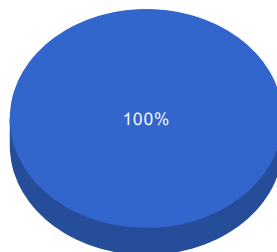
Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (dezembro / 2015)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses	
IMA-B 5	2,12%	15,46%	5,23%	7,45%	15,46%		-	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2,07%	14,87%	5,10%	7,17%	14,87%	25,79%	0,20%	0,827%	3,17%
IDKA IPCA 2 Anos	1,89%	16,38%	5,14%	7,75%	16,38%		-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,98%	15,38%	5,20%	7,57%	15,38%	28,34%	0,20%	0,781%	2,87%
IRF-M 1	1,18%	13,01%	3,60%	7,02%	13,01%		-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,15%	12,58%	3,54%	6,82%	12,58%	24,09%	0,10%	0,100%	0,52%
CDI	1,16%	13,24%	3,36%	6,91%	13,24%		-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,18%	13,46%	3,39%	6,98%	13,46%	25,97%	0,20%	0,010%	0,07%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,08%	12,36%	3,16%	6,47%	12,36%	23,57%	1,00%	0,015%	0,05%

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

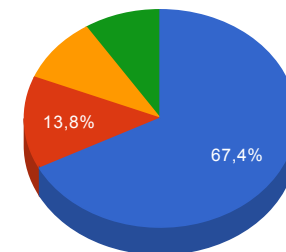
Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	4.425.924,26	100,00%

● BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM



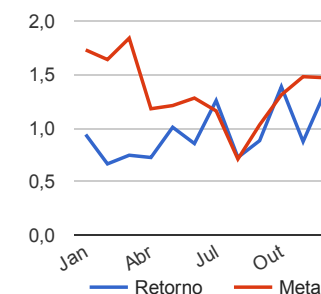
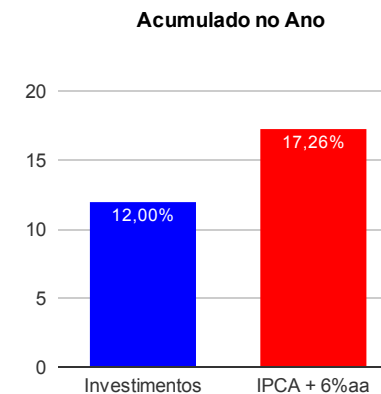
Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	2.983.258,85	67,40%
IMA-B 5	609.370,15	13,77%
CDI	427.984,34	9,67%
IDKA IPCA 2A	405.310,92	9,16%

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



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2015

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	1.933.996,91	246.821,79	3.508,87	2.197.757,33	20.447,50	0,94%	1,73%	54,20%	0,11%
Fevereiro	2.197.757,33	17.017,47	2.056.264,32	173.118,25	14.607,77	0,66%	1,64%	40,48%	0,01%
Março	173.118,25	2.352.273,10	26.891,83	2.517.126,83	18.627,31	0,75%	1,84%	40,59%	0,32%
Abril	2.517.126,83	352.301,60	30.317,78	2.859.675,24	20.564,59	0,72%	1,18%	61,55%	0,33%
Mai	2.859.675,24	132.122,63	29.696,19	2.991.932,44	29.830,76	1,01%	1,21%	83,44%	0,27%
Junho	2.991.932,44	241.054,50	27.104,62	3.233.283,07	27.400,75	0,85%	1,28%	66,74%	0,23%
Julho	3.233.283,07	253.418,71	27.642,75	3.502.529,66	43.470,63	1,26%	1,16%	108,66%	0,42%
Agosto	3.502.529,66	224.955,80	24.855,83	3.729.480,43	26.850,80	0,73%	0,71%	102,45%	0,38%
Setembro	3.729.480,43	77.285,98	46.683,26	3.793.235,74	33.152,59	0,88%	1,03%	85,65%	0,83%
Outubro	3.793.235,74	272.533,42	25.835,27	4.095.935,30	56.001,41	1,39%	1,31%	105,76%	0,52%
Novembro	4.095.935,30	572.558,74	437.223,07	4.268.231,79	36.960,82	0,87%	1,48%	59,09%	0,45%
Dezembro	4.268.231,79	290.273,61	190.869,31	4.425.924,26	58.288,17	1,33%	1,47%	90,48%	0,25%
Acumulado no ano					386.203,10	12,00%	17,26%	69,55%	
Acumulado no 4º Trimestre					151.250,40	3,64%	4,32%	84,09%	



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	597.001,79	0,00	0,00	609.370,15	12.368,36	2,07%	0,83%	2,07%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	397.435,39	0,00	0,00	405.310,92	7.875,53	1,98%	0,78%	1,98%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	329.508,26	0,00	80.398,08	252.957,65	3.847,47	1,17%	0,01%	1,18%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.924.818,25	124.708,56	100.000,00	2.983.258,85	33.732,04	1,11%	0,10%	1,15%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	19.468,10	165.565,05	10.471,23	175.026,69	464,77	0,25%	0,02%	1,08%
Total Renda Fixa					58.288,17	1,33%	0,25%	

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 IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.809.696,71	569.800,72	500.000,00	2.983.258,85	103.761,42	3,35%	3,54%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	579.796,04	0,00	0,00	609.370,15	29.574,11	5,10%	5,10%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	322.460,74	0,00	80.398,08	252.957,65	10.894,99	3,38%	3,39%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	400.000,00	0,00	405.310,92	5.310,92	1,33%	5,20%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	81.282,25	165.565,05	73.529,57	175.026,69	1.708,96	2,05%	3,16%
				Total Renda Fixa	151.250,40	3,64%	

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 (%)
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	3.239.271,25	500.000,00	2.983.258,85	243.987,60	9,98%	12,58%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,00	553.163,01	0,00	609.370,15	56.207,14	10,56%	14,87%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	300.000,00	80.398,08	252.957,65	33.355,73	11,12%	13,46%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.320.680,29	263.839,26	1.609.505,10	0,00	24.985,55	1,59%	12,78%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	200.899,85	276.343,83	317.595,69	175.026,69	15.378,70	9,77%	12,36%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	412.416,77	0,00	419.394,23	0,00	6.977,46	1,69%	13,08%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	400.000,00	0,00	405.310,92	5.310,92	1,33%	15,38%
				Total Renda Fixa	386.203,10	12,00%	