

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



Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2016)

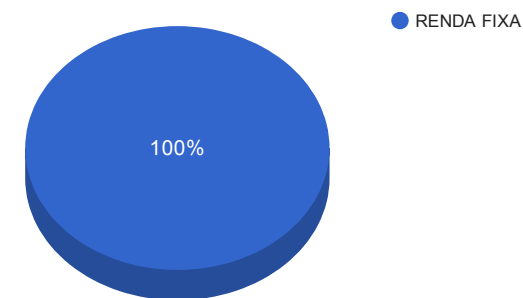
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	824.513,88	7,29%	534	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.178.253,60	19,26%	560	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.581.172,52	13,98%	97	0,45%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.710.829,82	23,97%	738	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.417.611,64	21,37%	1.175	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	599.160,32	5,30%	215	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	999.366,27	8,84%	288	0,06%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
		TOTAL -	11.310.908,05				

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

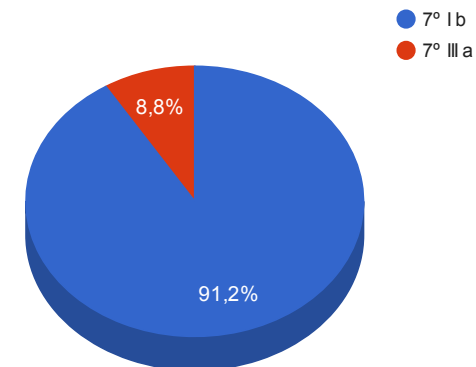
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	100,00%	10.311.541,78	91,16%	999.366,27
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	10,00%	999.366,27	8,84%	131.724,54
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	10,00%	0,00	0,00%	1.131.090,81
Total Renda Fixa	100,00%	120,00	11.310.908,05	100,00%	

Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	565.545,40
Total Renda Variável	30,00%	5,00	0,00	0,00%	

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



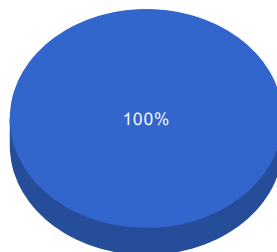
Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (junho / 2016)

	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%	-	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,55%	20,67%	7,31%	20,67%	16,46%	33,52%	0,20%	3,149%	14,00%
IRF-M	2,13%	14,36%	5,94%	14,36%	16,48%	27,75%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,06%	14,28%	5,94%	14,28%	16,18%	27,12%	0,20%	1,357%	4,46%
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%
IMA Geral ex-C	1,79%	12,66%	5,15%	12,66%	15,59%	28,79%	-	-	-
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,77%	12,62%	5,14%	12,62%	15,34%	28,17%	0,20%	1,211%	4,81%
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%
IMA-B 5	0,94%	8,84%	3,31%	8,84%	16,94%	31,07%	-	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,91%	8,75%	3,28%	8,75%	16,54%	30,11%	0,20%	1,106%	3,52%
IDKA IPCA 2 Anos	0,93%	8,58%	3,25%	8,58%	17,00%	31,47%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,82%	8,36%	3,26%	8,36%	16,56%	30,05%	0,20%	1,178%	3,23%

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

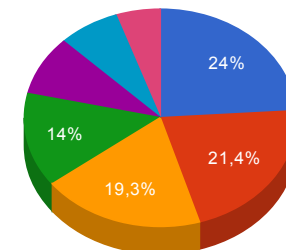
Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	11.310.908,05	100,00%

● BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM



Sub-segmento	Valor	%
IDKA IPCA 2A	2.710.829,82	23,97%
IRF-M 1	2.417.611,64	21,37%
IMA-B	2.178.253,60	19,26%
IMA-GERAL	1.581.172,52	13,98%
IMA-B 5	999.366,27	8,84%
IRF-M	824.513,88	7,29%
IMA-B 5+	599.160,32	5,30%

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



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Acumulado no Ano

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	8.881.902,95	190.000,00	0,00	9.263.130,58	191.227,63	2,11%	1,98%	106,43%	1,47%
Fevereiro	9.263.130,58	380.000,00	0,00	9.792.339,43	149.208,85	1,55%	1,39%	110,96%	1,65%
Março	9.792.339,43	210.000,00	0,00	10.268.518,18	266.178,75	2,66%	0,95%	279,46%	3,17%
Abril	10.268.518,18	200.000,00	0,00	10.727.464,45	258.946,27	2,47%	1,11%	223,55%	1,94%
Mai	10.727.464,45	190.000,00	0,00	10.967.856,98	50.392,53	0,46%	1,47%	31,37%	1,91%
Junho	10.967.856,98	190.000,00	0,00	11.310.908,05	153.051,07	1,37%	0,98%	139,63%	1,28%
Acumulado no ano					1.069.005,10	11,09%	8,15%	136,08%	
Acumulado no 2º Trimestre					462.389,87	4,36%	3,60%	121,00%	

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(%)	
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	584.244,91	0,00	0,00	599.160,32	14.915,41	2,55%	3,15%	2,55%	
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	807.871,42	0,00	0,00	824.513,88	16.642,46	2,06%	1,36%	2,06%	
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.137.551,28	0,00	0,00	2.178.253,60	40.702,32	1,90%	2,30%	1,90%	
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO...	1.553.659,16	0,00	0,00	1.581.172,52	27.513,36	1,77%	1,21%	1,77%	
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.392.864,40	0,00	0,00	2.417.611,64	24.747,24	1,03%	0,12%	1,03%	
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	990.362,01	0,00	0,00	999.366,27	9.004,26	0,91%	1,11%	0,91%	
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.501.303,80	190.000,00	0,00	2.710.829,82	19.526,02	0,73%	1,18%	0,82%	
Total Renda Fixa						153.051,07	1,37%	1,28%	

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	2.059.703,30	0,00	0,00	2.178.253,60	118.550,30	5,76%	5,76%
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	1.503.889,89	0,00	0,00	1.581.172,52	77.282,63	5,14%	5,14%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.342.133,61	0,00	0,00	2.417.611,64	75.478,03	3,22%	3,22%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.058.552,51	580.000,00	0,00	2.710.829,82	72.277,31	3,02%	3,26%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	778.271,31	0,00	0,00	824.513,88	46.242,57	5,94%	5,94%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	558.349,70	0,00	0,00	599.160,32	40.810,62	7,31%	7,31%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	967.617,86	0,00	0,00	999.366,27	31.748,41	3,28%	3,28%
Total Renda Fixa					462.389,87	4,36%	

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	1.878.392,09	0,00	0,00	2.178.253,60	299.861,51	15,96%	15,96%
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	1.403.988,19	0,00	0,00	1.581.172,52	177.184,33	12,62%	12,62%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.252.322,67	0,00	0,00	2.417.611,64	165.288,97	7,34%	7,34%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.769.964,21	780.000,00	0,00	2.710.829,82	160.865,61	7,98%	8,36%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	721.476,89	0,00	0,00	824.513,88	103.036,99	14,28%	14,28%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	496.526,71	0,00	0,00	599.160,32	102.633,61	20,67%	20,67%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	359.232,19	580.000,00	0,00	999.366,27	60.134,08	7,79%	8,75%
Total Renda Fixa					1.069.005,10	11,09%	