

# Relatório Analítico dos Investimentos em outubro de 2015



Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

## Carteira consolidada de investimentos - base (outubro / 2015)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2016	3.050.679,00	5,33%	88	0,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2016 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2016	5.259.595,00	9,20%	119	0,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	15.640.404,52	27,35%	1.162	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	20.304.623,47	35,50%	1.256	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	1.156.651,25	2,02%	116	0,26%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	531.820,37	0,93%	816	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	10.492.518,65	18,35%	566	1,17%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	742.657,30	1,30%	100	0,43%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>57.178.949,56</b>				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			16.235,33	Artigo 6º			
<b>Total</b>			<b>57.195.184,89</b>				

Enquadramentos na Resolução 3.922 / 4.392 / 4.604 e Política de Investimentos - base (outubro / 2015)

Sem Política de Investimento cadastrada

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	2,58%	6,15%	-1,30%	0,24%	6,36%	18,76%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2016 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,06%	-	1,31%	-	-	-	0,20%	0,476%	-
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,05%	-	1,23%	-	-	-	0,20%	0,476%	-
IRF-M 1	1,31%	10,51%	3,33%	6,64%	12,39%	24,10%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	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	1,30%	10,30%	3,29%	6,52%	12,14%	-	0,20%	0,346%	0,50%
CDI	1,11%	10,77%	3,36%	6,73%	12,77%	24,59%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,12%	10,96%	3,39%	6,86%	13,01%	-	0,20%	0,012%	0,08%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,03%	10,05%	3,14%	6,31%	11,90%	-	1,00%	0,004%	0,06%
IPCA	0,82%	8,53%	1,59%	3,79%	9,93%	17,17%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	3,11%	-	2,24%	5,59%	-	-	0,20%	2,279%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,18%	13,89%	2,99%	7,04%	16,28%	-	0,20%	0,054%	0,39%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	29.357.554,77	51,34%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	27.821.394,79	48,66%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	16.235,33	0,03%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	35.945.027,99	62,86%
CDI	11.024.339,02	19,28%
IMA-B 5	1.156.651,25	2,02%
CRÉDITO PRIVADO	742.657,30	1,30%
DISP. FINANCEIRA	16.235,33	0,03%

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2015

---

Sem Meta Atuarial cadastrada

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(%)
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	720.241,20	0,00	0,00	742.657,30	22.416,10	3,11%	2,28%	3,11%
CAIXA BRASIL 2016 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.153.680,00	0,00	0,00	5.259.595,00	105.915,00	2,06%	0,48%	2,06%
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.989.275,00	0,00	0,00	3.050.679,00	61.404,00	2,05%	0,48%	2,05%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.143.184,61	0,00	0,00	1.156.651,25	13.466,64	1,18%	0,05%	1,18%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	16.533.204,67	839.178,32	1.934.175,61	15.640.404,52	202.197,14	1,16%	0,34%	1,30%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	497.901,30	51.200,00	22.810,00	531.820,37	5.529,07	1,01%	0,01%	1,12%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	24.073.202,96	20.387.623,47	24.455.155,67	20.304.623,47	298.952,71	0,67%	0,35%	1,30%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.824.227,49	6.619.000,00	0,00	10.492.518,65	49.291,16	0,47%	0,00%	1,03%
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,00	2.404.026,49	2.404.906,39	0,00	879,90	0,04%	0,00%	0,77%
Total Renda Fixa					760.051,72	1,35%	0,32%	