

# Relatório Analítico dos Investimentos em novembro 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 (novembro / 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	3.079.773,00	5,21%	85	0,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2016 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2016	5.309.770,00	8,98%	119	0,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	20.665.093,44	34,97%	1.265	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	20.084.263,98	33,98%	1.162	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	7.476.674,97	12,65%	579	0,89%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	543.717,31	0,92%	823	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	1.171.803,54	1,98%	116	0,26%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	756.873,60	1,28%	100	0,43%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>59.087.969,84</b>				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			14.097,46	Artigo 6º			
<b>Total</b>			<b>59.102.067,30</b>				

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

---

Sem Política de Investimento cadastrada

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M 1	1,07%	11,69%	3,37%	6,76%	12,70%	24,51%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,05%	11,47%	3,34%	6,66%	12,45%	-	0,20%	0,145%	0,51%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,05%	11,30%	3,27%	6,56%	12,28%	-	0,10%	0,132%	0,52%
CDI	1,06%	11,94%	3,31%	6,81%	13,01%	25,01%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,06%	12,14%	3,33%	6,88%	13,27%	-	0,20%	0,041%	0,07%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,00%	11,16%	3,11%	6,39%	12,17%	-	1,00%	0,031%	0,06%
IMA-B	1,03%	7,25%	2,92%	-1,27%	5,20%	24,45%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2016 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,95%	-	4,58%	4,94%	-	-	0,20%	0,478%	-
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,95%	-	4,58%	-	-	-	0,20%	0,478%	-
IPCA	1,01%	9,62%	2,39%	4,07%	10,48%	17,72%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,91%	-	4,47%	6,67%	-	-	0,20%	1,086%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,31%	15,38%	3,39%	7,08%	16,77%	-	0,20%	0,081%	0,38%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	29.811.510,04	50,45%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	29.276.459,80	49,55%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	14.097,46	0,02%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	40.749.357,42	68,96%
CDI	8.020.392,28	13,57%
IMA-B 5	1.171.803,54	1,98%
CRÉDITO PRIVADO	756.873,60	1,28%
DISP. FINANCEIRA	14.097,46	0,02%

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 novembro / 2015

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	531.820,37	0,00	5.000,00	543.717,31	16.896,94	3,18%	0,04%	1,06%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	742.657,30	0,00	0,00	756.873,60	14.216,30	1,91%	1,09%	1,91%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.156.651,25	8.743,55	8.772,03	1.171.803,54	15.180,77	1,30%	0,08%	1,31%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	20.304.623,47	145.552,86	0,00	20.665.093,44	214.917,11	1,05%	0,15%	1,05%
CAIXA BRASIL 2016 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.259.595,00	0,00	0,00	5.309.770,00	50.175,00	0,95%	0,48%	0,95%
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.050.679,00	0,00	0,00	3.079.773,00	29.094,00	0,95%	0,48%	0,95%
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,00	8.743,55	8.772,03	0,00	28,48	0,33%	0,00%	0,73%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.492.518,65	50.129.222,34	53.315.780,27	7.476.674,97	170.714,25	0,28%	0,03%	1,00%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.640.404,52	18.484.404,04	14.129.254,12	20.084.263,98	88.709,54	0,26%	0,13%	1,05%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>599.932,39</b>	<b>1,03%</b>	<b>0,18%</b>	