

# Relatório Analítico dos Investimentos em dezembro 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 (dezembro / 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	3.131.172,00	5,10%	85	0,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2016 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2016	5.398.420,00	8,80%	119	0,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	20.757.156,48	33,83%	1.280	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	26.213.337,80	42,73%	1.165	0,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.163.266,86	3,53%	579	0,21%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	1.735.269,33	2,83%	831	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	1.191.050,40	1,94%	116	0,26%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	760.303,60	1,24%	100	0,43%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>61.349.976,47</b>				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			957,56	Artigo 6º			
<b>Total</b>			<b>61.350.934,03</b>				

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

---

Sem Política de Investimento cadastrada

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	1,52%	8,88%	5,21%	0,50%	8,88%	24,72%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2016 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,67%	-	4,75%	5,46%	-	-	0,20%	0,225%	-
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,67%	-	4,75%	-	-	-	0,20%	0,225%	-
IRF-M 1	1,18%	13,01%	3,60%	7,02%	13,01%	24,96%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,16%	12,76%	3,55%	6,92%	12,76%	24,43%	0,20%	0,107%	0,50%
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%	25,48%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	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%
IPCA	0,96%	10,67%	2,82%	4,24%	10,67%	17,77%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,64%	17,28%	4,19%	7,38%	17,28%	-	0,20%	0,151%	0,39%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,45%	-	5,56%	5,70%	-	-	0,20%	2,650%	-
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	31.302.924,39	51,02%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	30.047.052,08	48,98%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	957,56	0,00%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	46.970.494,28	76,56%
CDI	3.898.536,19	6,35%
IMA-B 5	1.191.050,40	1,94%
CRÉDITO PRIVADO	760.303,60	1,24%
DISP. FINANCEIRA	957,56	0,00%

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 dezembro / 2015

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL 2016 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.309.770,00	0,00	0,00	5.398.420,00	88.650,00	1,67%	0,22%	1,67%
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.079.773,00	0,00	0,00	3.131.172,00	51.399,00	1,67%	0,22%	1,67%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.171.803,54	0,00	0,00	1.191.050,40	19.246,86	1,64%	0,15%	1,64%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	20.665.093,44	0,00	146.372,74	20.757.156,48	238.435,78	1,15%	0,11%	1,16%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	20.084.263,98	9.528.108,99	3.630.691,66	26.213.337,80	231.656,49	0,78%	0,10%	1,15%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.476.674,97	5.304.781,81	10.700.427,73	2.163.266,86	82.237,81	0,64%	0,02%	1,08%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	756.873,60	0,00	0,00	760.303,60	3.430,00	0,45%	2,65%	0,45%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	543.717,31	1.196.181,43	0,00	1.735.269,33	-4.629,41	-0,27%	0,01%	1,18%
Total Renda Fixa					710.426,53	1,17%	0,15%	