

Relatório Analítico dos Investimentos em novembro de 2015



Carteira consolidada de investimentos - base (novembro / 2015)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	3.551.506,82	20,60%	554	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.042.946,67	6,05%	657	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.170.752,01	6,79%	1.162	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.972.724,90	34,64%	1.265	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	3.270.283,30	18,97%	198	0,28%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.206.841,41	7,00%	823	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.027.996,21	5,96%	745	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
		TOTAL	17.243.051,32				

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

Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	100,00%	11.737.930,40	68,07%	5.505.120,92
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	30,00%	3.270.283,30	18,97%	1.902.632,10
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	2.234.837,62	12,96%	2.938.077,78
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	10,00%	0,00	0,00%	1.724.305,13
Total Renda Fixa	100,00%	170,00	17.243.051,32	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%	862.152,57
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	0,00	0,00%	2.586.457,70
Total Renda Variável	30,00%	20,00	0,00	0,00%	

Retorno dos investimentos de Renda Fixa - base (novembro / 2015)

Ativos Renda Fixa	Benchmark	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	CDI	1,06%	12,14%	3,33%	6,88%	13,27%	0,20%	0,041%	0,07%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	IRF-M 1	1,05%	11,47%	3,34%	6,66%	12,45%	0,20%	0,145%	0,51%
CAIXA BRASIL FI REFERENCIADO DI LP	CDI	1,05%	12,02%	3,32%	6,86%	13,10%	0,20%	0,037%	0,09%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENC...	IRF-M 1	1,05%	11,30%	3,27%	6,56%	12,28%	0,10%	0,132%	0,52%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	IMA-B	1,03%	6,95%	2,78%	-1,50%	4,86%	0,20%	3,535%	9,38%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	IMA-B	1,02%	5,73%	2,25%	-2,49%	3,69%	0,20%	3,730%	9,45%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	IMA-B 5	0,52%	12,53%	3,73%	5,83%	12,55%	0,20%	1,564%	3,18%

Indicadores e Benchmark's de Renda Fixa - base (novembro / 2015)

Indicadores - Renda Fixa	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses
INPC + 6% a.a. (Meta Atuarial)	1,58%	16,25%	3,89%	7,16%	17,57%
IRF-M 1	1,07%	11,69%	3,37%	6,76%	12,70%
CDI	1,06%	11,94%	3,31%	6,81%	13,01%
IMA-B	1,03%	7,25%	2,92%	-1,27%	5,20%
IMA-B 5	0,55%	13,06%	3,86%	6,11%	13,11%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	9.199.383,54	53,35%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	8.043.667,78	46,65%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	7.143.476,91	41,43%
IMA-B	4.594.453,49	26,65%
IMA-B 5	3.270.283,30	18,97%
CDI	2.234.837,62	12,96%

