

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 3.922/2010 - 4.392/2014
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.337.841,03	3,79%	628	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	479.758,92	0,78%	1.265	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	2.880.388,74	4,67%	55	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	17/08/2020	1.688.146,50	2,74%	20	3,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	323.758,92	0,53%	53	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	1.000.717,00	1,62%	26	0,87%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	5.196.346,49	8,43%	554	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2016	3.079.773,00	5,00%	85	0,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	607.033,96	0,98%	1.162	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	421.394,15	0,68%	623	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2016 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2016	6.159.333,20	9,99%	119	0,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.175.298,85	8,40%	430	0,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	2.886.801,60	4,68%	43	2,30%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	3.154.121,75	5,12%	198	0,27%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.713.538,90	7,65%	349	0,20%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	27.752,43	0,05%	87	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	85.191,53	0,14%	244	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	5.749.282,86	9,33%	745	0,15%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO PREMIUM FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	2.643.365,63	4,29%	399	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	4.103.050,25	6,66%	823	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	763.215,58	1,24%	104	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
OURINVEST SUPPLIERCARD FIDC SÊNOR	D+45 a D+75	Não há	63.460,64	0,10%	111	0,02%	Artigo 7º, Inciso VI

Carteira consolidada de investimentos - base (novembro / 2015)

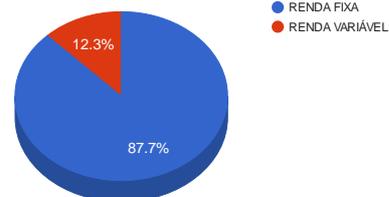
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	540.624,00	0,88%	100	0,31%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BB GOVERNANÇA FIAÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	3.364.697,28	5,46%	89	3,42%	Artigo 8º, Inciso III
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIMULTIMERCADO	D+1	Não há	2.719.220,06	4,41%	67	1,21%	Artigo 8º, Inciso IV
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se aplica	Não se aplica	1.474.020,00	2,39%		1,27%	Artigo 8º, Inciso VI
		TOTAL -	61.638.133,27				

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

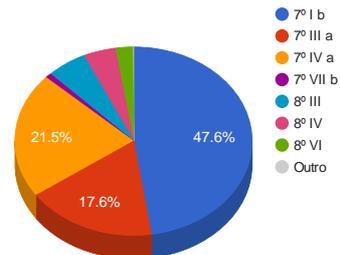
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	90,00%	29.349.790,76	47,62%	26.124.529,18
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	40,00%	10.867.406,21	17,63%	13.787.847,10
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	13.258.914,32	21,51%	5.232.525,66
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	63.460,64	0,10%	3.018.446,02
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.081.906,66
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	540.624,00	0,88%	2.541.282,66
Total Renda Fixa	100,00%	175,00	54.080.195,93	87,74%	

Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.081.906,66
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	3.364.697,28	5,46%	5.881.022,71
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	2.719.220,06	4,41%	362.686,60
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	1.474.020,00	2,39%	1.607.886,66
Total Renda Variável	30,00%	30,00	7.557.937,34	12,26%	

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



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
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	IPCA	1,91%	-	4,47%	6,67%	-	0,20%	1,086%	-
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	IMA-B	1,45%	-	2,14%	-3,99%	-	0,20%	3,809%	-
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	IMA-B	1,24%	7,29%	2,97%	-1,35%	5,44%	0,20%	3,108%	8,61%
OURINVEST SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	115% do CDI	1,21%	13,84%	3,81%	7,86%	15,09%	0,20%	0,000%	0,06%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	CDI	1,06%	12,08%	3,34%	6,89%	13,16%	0,18%	0,007%	0,06%
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%
BRDESCO PREMIUM FI REFERENCIADO DI	Selic	1,05%	12,05%	3,32%	6,84%	13,14%	0,20%	0,004%	0,05%
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%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	IRF-M 1	1,04%	11,48%	3,27%	6,60%	12,44%	0,20%	0,132%	0,50%
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%
BRDESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	IRF-M 1	1,02%	11,54%	3,22%	6,61%	12,47%	0,20%	0,267%	0,78%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	IMA-B	1,02%	7,02%	2,80%	-1,38%	4,97%	0,30%	3,544%	9,39%
CAIXA BRASIL 2016 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	IMA-B	0,95%	-	4,58%	4,94%	-	0,20%	0,478%	-
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	IMA-B	0,95%	-	4,58%	-	-	0,20%	0,478%	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	IMA-B 5	0,55%	12,56%	3,71%	5,81%	12,62%	0,20%	1,654%	3,21%
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	IMA-B 5	0,53%	12,07%	3,57%	5,43%	12,09%	0,20%	1,632%	3,37%
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%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	IMA-B 5	0,51%	12,60%	3,75%	5,87%	12,60%	0,40%	1,552%	3,17%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	IDKA IPCA 2 Anos	0,51%	13,27%	4,12%	6,49%	13,34%	0,20%	1,447%	2,80%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	IDKA IPCA 2 Anos	0,45%	13,14%	4,07%	6,37%	13,11%	0,20%	1,430%	2,89%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	IMA-B	0,45%	3,42%	2,62%	-0,22%	2,31%	0,20%	2,822%	7,68%

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

Indicadores - Renda Fixa	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses
IPCA + 6% a.a. (Meta Atuarial)	1,48%	15,56%	3,87%	7,17%	17,05%
115% do CDI	1,21%	13,85%	3,81%	7,87%	15,10%
IRF-M 1	1,07%	11,69%	3,37%	6,76%	12,70%
Selic	1,06%	11,97%	3,31%	6,81%	13,04%
CDI	1,06%	11,94%	3,31%	6,81%	13,01%
IMA-B	1,03%	7,25%	2,92%	-1,27%	5,20%
IPCA	1,01%	9,62%	2,39%	4,07%	10,48%
IMA-B 5	0,55%	13,06%	3,86%	6,11%	13,11%
IDKA IPCA 2 Anos	0,20%	14,22%	4,09%	6,64%	14,11%

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

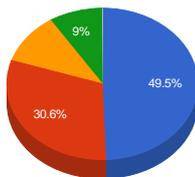
Ativos Renda Variável	Benchmark	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIMULTIMERCADO	CDI	0,92%	11,75%	3,15%	6,49%	12,79%	0,35%	0,107%	0,37%
BB GOVERNANÇA FIAÇÕES PREVIDENCIÁRIO	IGC	-1,62%	-9,18%	-2,36%	-12,18%	-15,54%	1,00%	10,813%	19,86%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	IFIX	-6,71%	-11,20%	-11,20%	-1,73%	-22,21%	1,20%	-	37,35%

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

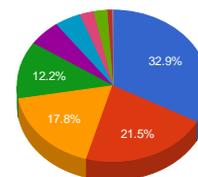
Indicadores - Renda Variável	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses
IFIX	1,54%	8,68%	-0,41%	2,47%	6,69%
IPCA + 6% a.a. (Meta Atuarial)	1,48%	15,56%	3,87%	7,17%	17,05%
CDI	1,06%	11,94%	3,31%	6,81%	13,01%
IGC	-1,73%	-9,26%	-2,51%	-12,24%	-15,64%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	30.481.887,38	49,45%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	18.848.282,29	30,58%
ITAÚ UNIBANCO	6.686.583,30	10,85%
BANCO BRADESCO	5.557.919,66	9,02%
OLIVEIRA TRUST DTVM	63.460,64	0,10%



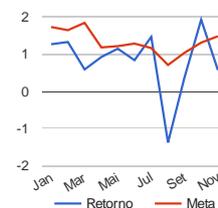
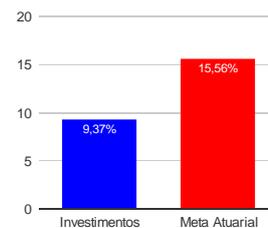
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5	20.269.958,94	32,89%
CDI	13.258.914,32	21,51%
IMA-B	10.995.793,92	17,84%
IDKA 2A	7.513.139,88	12,19%
AÇÕES - SETORIAIS	3.364.697,28	5,46%
MULTIMERCADO	2.719.220,06	4,41%
FUNDO IMOBILIÁRIO	1.474.020,00	2,39%
IRF-M 1	1.438.304,23	2,33%
CRÉDITO PRIVADO	540.624,00	0,88%
FIDC - ABERTO	63.460,64	0,10%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2015

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Cap (%)	VaR (%)
Janeiro	55.188.173,69	438.379,43	293.211,96	56.035.503,66	702.162,50	1,27%	1,73%	73,23%	1,73%
Fevereiro	56.035.503,66	704.258,17	351.863,10	57.136.997,70	749.098,97	1,33%	1,64%	80,90%	1,94%
Março	57.136.997,70	14.937.633,70	14.760.004,75	57.653.218,91	338.592,26	0,59%	1,84%	32,16%	1,46%
Abril	57.653.218,91	1.714.639,95	1.605.750,38	58.292.783,83	530.675,35	0,92%	1,18%	78,07%	1,54%
Mai	58.292.783,83	10.741.994,25	10.947.268,74	58.754.250,59	666.741,25	1,14%	1,21%	94,77%	1,78%
Junho	58.754.250,59	160.000,00	361.270,64	59.042.349,90	489.369,95	0,83%	1,28%	65,04%	1,24%
Julho	59.042.349,90	3.625.741,78	3.346.232,89	60.187.568,22	865.709,43	1,46%	1,16%	126,18%	1,83%
Agosto	60.187.568,22	911.780,27	716.484,19	59.551.281,74	-831.582,56	-1,38%	0,71%	-194,57%	2,69%
Setembro	59.551.281,74	413.304,21	356.442,21	59.828.543,51	220.399,77	0,37%	1,03%	35,92%	3,64%
Outubro	59.828.543,51	5.959.815,31	5.786.263,88	61.157.030,89	1.154.935,95	1,92%	1,31%	146,85%	1,97%
Novembro	61.157.030,89	538.081,48	404.648,33	61.638.133,27	347.669,23	0,57%	1,48%	38,37%	1,83%
Acumulado no ano					5.233.772,10	9,37%	15,56%	60,22%	

Acumulado no Ano



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(%)
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	530.469,50	0,00	0,00	540.624,00	10.154,50	1,91%	1,09%	1,91%
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	986.440,00	0,00	0,00	1.000.717,00	14.277,00	1,45%	3,81%	1,45%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	4.655.984,31	0,00	0,00	4.713.538,90	57.554,59	1,24%	3,11%	1,24%
OURINVEST SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	62.699,25	0,00	0,00	63.460,64	761,39	1,21%	0,00%	1,21%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	755.208,33	0,00	0,00	763.215,58	8.007,25	1,06%	0,01%	1,06%
BRADERCO PREMIUM FI REFERENCIADO DI	2.615.810,21	0,00	0,00	2.643.365,63	27.555,42	1,05%	0,00%	1,05%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.382.251,56	0,00	325.000,00	4.103.050,25	45.798,69	1,05%	0,04%	1,06%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	320.426,71	0,00	0,00	323.758,92	3.332,21	1,04%	0,13%	1,04%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	489.723,37	0,00	15.000,00	479.758,92	5.035,55	1,03%	0,15%	1,05%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.143.560,41	0,00	0,00	5.196.346,49	52.786,08	1,03%	3,54%	1,03%
BRADERCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	27.472,70	0,00	0,00	27.752,43	279,73	1,02%	0,27%	1,02%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	84.333,29	0,00	0,00	85.191,53	858,24	1,02%	3,54%	1,02%
CAIXA BRASIL FI REFERENCIADO DI LP	5.378.345,12	313.081,48	0,00	5.749.282,86	57.856,26	1,02%	0,04%	1,05%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	649.138,14	0,00	48.648,33	607.033,96	6.544,15	1,01%	0,13%	1,05%
CAIXA BRASIL 2016 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.101.130,20	0,00	0,00	6.159.333,20	58.203,00	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%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	419.079,70	0,00	0,00	421.394,15	2.314,45	0,55%	1,65%	0,55%
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	2.871.531,12	0,00	0,00	2.886.801,60	15.270,48	0,53%	1,63%	0,53%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.137.742,80	0,00	0,00	3.154.121,75	16.378,95	0,52%	1,56%	0,52%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	2.865.656,79	0,00	0,00	2.880.388,74	14.731,95	0,51%	1,55%	0,51%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.133.420,51	16.000,00	0,00	5.175.298,85	25.878,34	0,50%	1,45%	0,51%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.680.582,00	0,00	0,00	1.688.146,50	7.564,50	0,45%	2,82%	0,45%

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 IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.120.590,11	209.000,00	0,00	2.337.841,03	8.250,92	0,35%	1,43%	0,45%
			Total Renda Fixa		468.487,65	0,87%	1,35%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de novembro / 2015

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIMULTIMERCADO	2.694.502,78	0,00	0,00	2.719.220,06	24.717,28	0,92%	0,11%	0,92%
BB GOVERNANÇA FIAÇÕES PREVIDENCIÁRIO	3.420.252,98	0,00	0,00	3.364.697,28	-55.555,70	-1,62%	10,81%	-1,62%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.580.000,00	0,00	16.000,00	1.474.020,00	-89.980,00	-5,69%	-	-6,71%
				Total Renda Variável	-120.818,42	-1,54%	6,03%	