

Relatório Analítico dos Investimentos em novembro de 2015



Carteira consolidada de investimentos - base (novembro / 2015)

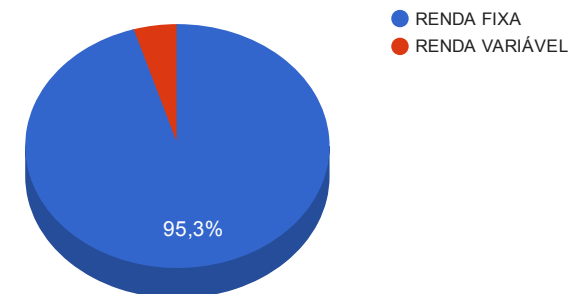
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
TÍTULOS PÚBLICOS			3.456.571,82	10,77%			Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	529.498,86	1,65%	1.265	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	706.060,27	2,20%	216	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.576.141,77	8,03%	657	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.300.292,32	4,05%	430	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2016 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2016	4.147.956,00	12,93%	104	0,56%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.462.952,62	7,68%	1.162	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	826.088,63	2,57%	193	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	968.325,11	3,02%	38	1,38%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2016 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2016	2.581.470,00	8,04%	154	0,58%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.690.316,54	11,50%	623	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRABESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	2.256.218,39	7,03%	63	0,39%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRABESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	119.026,18	0,37%	87	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRABESCO PREMIUM FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.735.574,31	5,41%	399	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	D+3	Não há	2.111.771,35	6,58%	445	1,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.106.215,51	3,45%	745	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER PETROBRÁS PLUS FIC AÇÕES	D+4	Não há	341.673,95	1,06%	2.047	1,40%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA BRASIL IPCA VII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+0	22/11/2016	330.852,00	1,03%	20	0,37%	Artigo 8º, Inciso IV
CAIXA BRASIL IPCA V FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+0	08/11/2016	841.081,50	2,62%	23	0,98%	Artigo 8º, Inciso IV
		TOTAL -	32.088.087,13				

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

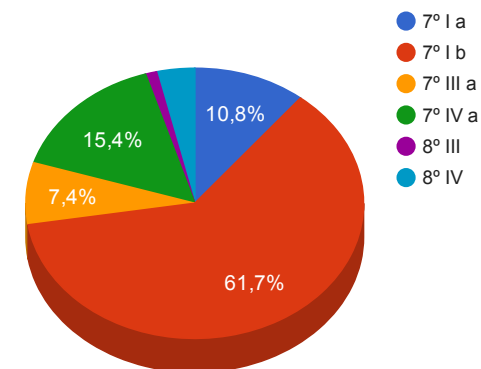
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	20,00%	3.456.571,82	10,77%	2.961.045,61
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	70,00%	19.789.102,12	61,67%	2.672.558,87
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	30,00%	2.375.244,57	7,40%	7.251.181,57
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	4.953.561,17	15,44%	4.672.864,97
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.604.404,36
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	2,00%	0,00	0,00%	641.761,74
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	2,00%	0,00	0,00%	641.761,74
Total Renda Fixa	100,00%	159,00	30.574.479,68	95,28%	

Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.604.404,36
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	5,00%	341.673,95	1,06%	1.262.730,41
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	1.171.933,50	3,65%	432.470,86
Total Renda Variável	30,00%	15,00	1.513.607,45	4,72%	

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses	
IRF-M 1	1,07%	11,69%	3,37%	6,76%	12,70%		-	-	-
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%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1,04%	11,31%	3,26%	6,53%	12,28%	-	0,40%	0,132%	0,51%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1,02%	11,54%	3,22%	6,61%	12,47%	-	0,20%	0,267%	0,78%
Selic	1,06%	11,97%	3,31%	6,81%	13,04%		-	-	-
BRADESCO PREMIUM FI REFERENCIADO DI	1,05%	12,05%	3,32%	6,84%	13,14%	-	0,20%	0,004%	0,05%
CDI	1,06%	11,94%	3,31%	6,81%	13,01%		-	-	-
CAIXA BRASIL FI REFERENCIADO DI LP	1,05%	12,02%	3,32%	6,86%	13,10%	-	0,20%	0,037%	0,09%
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	0,57%	10,08%	2,35%	3,76%	10,53%	-	0,30%	1,510%	3,24%
IMA Geral	1,05%	8,22%	2,29%	1,91%	7,61%		-	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	1,09%	8,07%	2,23%	1,64%	7,40%	-	0,25%	1,789%	5,08%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,01%	7,58%	1,98%	1,49%	7,03%	-	0,20%	1,783%	4,73%
IMA-B	1,03%	7,25%	2,92%	-1,27%	5,20%		-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,02%	5,73%	2,25%	-2,49%	3,69%	-	0,20%	3,730%	9,45%
CAIXA BRASIL 2016 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,95%	-	4,58%	-	-	-	0,20%	0,478%	-
CAIXA BRASIL 2016 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,95%	-	-	-	-	-	0,20%	0,477%	-

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses	
IMA-B 5	0,55%	13,06%	3,86%	6,11%	13,11%		-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,55%	12,56%	3,71%	5,81%	12,62%	-	0,20%	1,654%	3,21%
IDKA IPCA 2 Anos	0,20%	14,22%	4,09%	6,64%	14,11%		-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,87%	-	4,49%	7,45%	-	-	0,20%	0,654%	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,51%	13,27%	4,12%	6,49%	13,34%	-	0,20%	1,447%	2,80%

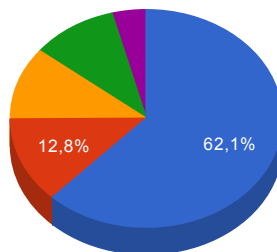
Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (novembro / 2015)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses	
IPCA + 6,00% ao ano	1,48%	15,56%	3,87%	7,17%	17,05%		-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA VII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1,37%	15,04%	3,42%	6,98%	16,23%	-	0,20%	0,129%	0,46%
CAIXA BRASIL IPCA V FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1,32%	15,08%	2,92%	6,78%	16,26%	-	0,20%	0,037%	0,32%
PETROBRAS PN - PETR4	-0,52%	-23,45%	-16,54%	-37,79%	-40,08%		-	-	-
SANTANDER PETROBRÁS PLUS FIC AÇÕES	0,28%	-3,47%	-11,51%	-29,58%	-24,01%	-	3,00%	34,762%	63,45%

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

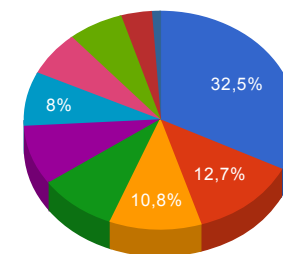
Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	19.921.656,12	62,08%
BANCO BRADESCO	4.110.818,88	12,81%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	3.456.571,82	10,77%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	3.289.041,25	10,25%
BANCO SANTANDER	1.309.999,06	4,08%

- CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
- BANCO BRADESCO
- TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)
- BB GESTÃO DE RECURSO...
- BANCO SANTANDER



Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5	10.419.742,54	32,47%
IRF-M 1	4.079.802,77	12,71%
TÍTULOS PÚBLICOS	3.456.571,82	10,77%
IMA-GERAL	2.962.278,66	9,23%
CDI	2.841.789,82	8,86%
IMA-B	2.576.141,77	8,03%
IDKA 2A	2.126.380,95	6,63%
GESTÃO LIVRE	2.111.771,35	6,58%
MULTIMERCADO	1.171.933,50	3,65%
AÇÕES - SETORIAIS	341.673,95	1,06%

- IMA-B 5
- IRF-M 1
- TÍTULOS PÚBLICOS
- IMA-GERAL
- CDI
- IMA-B
- IDKA 2A
- GESTÃO LIVRE
- MULTIMER...
- AÇÕES - SETORIAIS



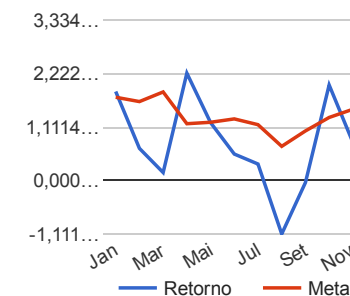
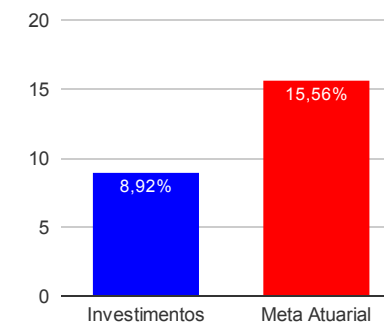
Carteira de Títulos Públicos - base (novembro / 2015)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde.	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	GAP (Atual - Pago)
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/8/2024	11/8/2004	500	1.487,344824	2.553,240676	743.672,41	1.276.620,34	532.947,93
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/8/2024	2/12/2004	270	1.494,58526	2.553,240676	403.538,02	689.374,98	285.836,96
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/5/2045	2/3/2009	630	1.104,73659	2.365,994440	695.984,05	1.490.576,50	794.592,45

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2015

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	28.430.480,66	560.958,97	0,00	29.527.604,09	536.164,46	1,85%	1,73%	106,73%	2,07%
Fevereiro	29.527.604,09	0,00	340.000,00	29.384.784,63	197.180,54	0,67%	1,64%	40,66%	2,49%
Março	29.384.784,63	1.585.053,17	746.299,59	30.273.635,37	50.097,16	0,17%	1,84%	9,02%	2,33%
Abril	30.273.635,37	8.737.654,14	8.625.000,00	31.063.996,81	677.707,30	2,23%	1,18%	189,52%	1,72%
Mai	31.063.996,81	656.584,83	525.000,00	31.570.922,76	375.341,12	1,20%	1,21%	99,69%	1,61%
Junho	31.570.922,76	4.646.599,86	4.544.000,00	31.847.637,68	174.115,06	0,55%	1,28%	42,93%	1,43%
Julho	31.847.637,68	648.451,25	520.000,00	32.085.568,39	109.479,46	0,34%	1,16%	29,60%	1,83%
Agosto	32.085.568,39	705.224,27	740.955,05	31.693.223,93	-356.613,68	-1,11%	0,71%	-157,02%	2,57%
Setembro	31.693.223,93	3.300.000,00	3.410.884,65	31.568.704,09	-13.635,19	-0,04%	1,03%	-4,18%	3,08%
Outubro	31.568.704,09	415.514,27	550.000,00	32.060.652,49	626.434,13	1,98%	1,31%	151,39%	1,58%
Novembro	32.060.652,49	465.821,45	692.354,85	32.088.087,13	253.968,04	0,79%	1,48%	53,59%	1,48%
Acumulado no ano					2.630.238,40	8,92%	15,56%	57,37%	

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(%)	
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	2.231.879,25	0,00	0,00	2.256.218,39	24.339,14	1,09%	1,79%	1,09%	
BRADESCO PREMIUM FI REFERENCIADO DI	1.717.482,04	0,00	0,00	1.735.574,31	18.092,27	1,05%	0,00%	1,05%	
CAIXA BRASIL FI REFERENCIADO DI LP	1.094.696,49	0,00	0,00	1.106.215,51	11.519,02	1,05%	0,04%	1,05%	
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.437.390,93	0,00	0,00	2.462.952,62	25.561,69	1,05%	0,13%	1,05%	
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	117.826,47	0,00	0,00	119.026,18	1.199,71	1,02%	0,27%	1,02%	
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.550.224,50	0,00	0,00	2.576.141,77	25.917,27	1,02%	3,73%	1,02%	
CAIXA BRASIL 2016 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.108.776,00	0,00	0,00	4.147.956,00	39.180,00	0,95%	0,48%	0,95%	
CAIXA BRASIL 2016 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.557.095,00	0,00	0,00	2.581.470,00	24.375,00	0,95%	0,48%	0,95%	
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	971.961,31	0,00	275.000,00	706.060,27	9.098,96	0,94%	1,78%	1,01%	
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	958.445,89	142.354,85	142.354,85	968.325,11	9.879,22	0,90%	0,13%	1,04%	
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	818.941,48	0,00	0,00	826.088,63	7.147,15	0,87%	0,65%	0,87%	
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	2.099.858,54	0,00	0,00	2.111.771,35	11.912,81	0,57%	1,51%	0,57%	
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.670.048,05	0,00	0,00	3.690.316,54	20.268,49	0,55%	1,65%	0,55%	
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	476.941,56	323.466,60	275.000,00	529.498,86	4.090,70	0,51%	0,15%	1,05%	
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.293.756,75	0,00	0,00	1.300.292,32	6.535,57	0,51%	1,45%	0,51%	
TÍTULOS PÚBLICOS	3.458.152,79	0,00	0,00	3.456.571,82	-1.580,97	-0,05%	-	-	
Total Renda Fixa						237.536,03	0,78%	1,12%	

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(%)
CAIXA BRASIL IPCA VII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	326.369,80	0,00	0,00	330.852,00	4.482,20	1,37%	0,13%	1,37%
CAIXA BRASIL IPCA V FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	830.091,50	0,00	0,00	841.081,50	10.990,00	1,32%	0,04%	1,32%
SANTANDER PETROBRÁS PLUS FIC AÇÕES	340.714,14	0,00	0,00	341.673,95	959,81	0,28%	34,76%	0,28%
Total Renda Variável					16.432,01	1,10%	7,90%	

