

Relatório Analítico dos Investimentos em janeiro de 2016



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 (janeiro / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.068.617,03	10,64%	1.287	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.639.909,11	8,44%	110	0,32%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.032.009,56	5,31%	183	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	2.003.694,24	10,31%	50	1,17%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1461	Não há	2.201.912,28	11,33%	5	23,30%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	1.177.027,28	6,06%	43	0,20%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.883.513,61	9,69%	275	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	2.881.720,55	14,83%	388	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	1.426.186,41	7,34%	27	0,74%	Artigo 7º, Inciso VI
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	1.299.723,22	6,69%	71	0,35%	Artigo 7º, Inciso VI
TOTAL MIX FIC AÇÕES	D+64	Não há	523.875,64	2,70%	68	5,20%	Artigo 8º, Inciso III
ELLEVEN II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	1.295.740,67	6,67%	4	4,11%	Desenquadrado - RF
Total			19.433.929,60				

Enquadramentos na Resolução 3.922 / 4.392 / 4.604 e Política de Investimentos - base (janeiro / 2016)

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	100,00%	0,00	0,00%	19.433.929,60
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	100,00%	4.740.535,70	24,39%	14.693.393,90
Artigo 7º, Inciso II	15,00%	15,00%	0,00	0,00%	2.915.089,44
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	80,00%	80,00%	5.382.633,80	27,70%	10.164.509,88
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	30,00%	30,00%	4.765.234,16	24,52%	1.064.944,72
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'	20,00%	20,00%	0,00	0,00%	3.886.785,92
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	13,00%	2.725.909,63	14,03%	-199.498,78
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'	5,00%	2,00%	0,00	0,00%	388.678,59
Desenquadrado - RF	0,00%	0,00%	1.295.740,67	6,67%	-1.295.740,67
Total Renda Fixa	100,00%	360,00	18.910.053,96	97,30%	

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	30,00%	0,00	0,00%	5.830.178,88
Artigo 8º, Inciso II	20,00%	20,00%	0,00	0,00%	3.886.785,92
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	523.875,64	2,70%	2.391.213,80
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	971.696,48
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	971.696,48
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	971.696,48
Total	30,00%	80,00	523.875,64	2,70%	

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (janeiro / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5	2,97%	2,97%	5,73%	8,70%	16,49%	33,78%	-	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	2,97%	2,97%	5,72%	8,09%	15,60%	-	0,20%	1,723%	3,50%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2,84%	2,84%	-4,37%	-2,47%	2,54%	17,59%	0,70%	1,369%	7,89%
ELLEVEN II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2,58%	2,58%	5,07%	4,45%	10,67%	27,06%	0,70%	1,519%	3,96%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-	-	3,64%	6,60%	-	-	0,70%	0,371%	-

IMA-B	1,91%	1,91%	4,53%	3,17%	7,61%	30,43%	-	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1,86%	1,86%	4,39%	2,77%	6,97%	28,99%	0,20%	2,125%	9,15%

IPCA + 7,00% ao ano	1,82%	1,82%	5,01%	8,50%	18,36%	35,69%	-	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1,39%	1,39%	4,28%	7,59%	15,65%	-	1,65%	0,115%	0,37%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-0,21%	-0,21%	-0,30%	2,98%	12,35%	28,65%	0,00%	-	-

IRF-M 1	1,64%	1,64%	3,94%	7,40%	13,65%	26,52%	-	-	-
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,65%	1,65%	3,86%	7,25%	13,42%	25,92%	0,20%	0,338%	0,81%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,62%	1,62%	3,89%	7,30%	13,40%	26,01%	0,20%	0,346%	0,55%

Selic	1,06%	1,06%	3,31%	6,78%	13,40%	25,88%	-	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,05%	1,05%	3,30%	6,79%	13,48%	26,11%	0,20%	0,005%	0,04%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	1,04%	1,04%	3,27%	6,70%	13,21%	25,41%	0,15%	0,001%	0,04%

Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (janeiro / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	-6,79%	-6,79%	-11,91%	-20,56%	-13,86%	-15,18%	-	-	-
TOTAL MIX FIC AÇÕES	-4,39%	-4,39%	-7,00%	-15,31%	-12,14%	-17,65%	1,90%	9,111%	15,68%

Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (janeiro / 2016)

Administrador	Valor	%
BANCO BRADESCO	9.440.847,07	48,58%
RJI CORRETORA DE VALORES	2.472.767,95	12,72%
BRIDGE ADMINISTRADORA DE RECURSOS	2.201.912,28	11,33%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	2.068.617,03	10,64%
CM Capital Markets DTVM	1.426.186,41	7,34%
Orla DTVM	1.299.723,22	6,69%
Única Administradora	523.875,64	2,70%

Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5	6.678.374,47	34,36%
CDI	4.765.234,16	24,52%
IRF-M 1	3.100.626,59	15,95%
FIDC	2.725.909,63	14,03%
IMA-B	1.639.909,11	8,44%
AÇÕES - LIVRES	523.875,64	2,70%

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Acumulado no Ano

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	19.199.865,09	0,00	40.000,00	19.433.929,60	274.064,51	1,43%	1,74%	82,06%	0,96%
Acumulado no ano					274.064,51	1,43%	1,74%	82,06%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de janeiro / 2016

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	1.945.858,45	0,00	0,00	2.003.694,24	57.835,79	2,97%	1,72%	2,97%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.144.570,32	0,00	0,00	1.177.027,28	32.456,96	2,84%	1,37%	2,84%
ELLEVEN II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.263.177,28	0,00	0,00	1.295.740,67	32.563,39	2,58%	1,52%	2,58%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1.609.910,86	0,00	0,00	1.639.909,11	29.998,25	1,86%	2,12%	1,86%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.035.565,35	0,00	0,00	2.068.617,03	33.051,68	1,62%	0,35%	1,62%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.055.005,82	0,00	40.000,00	1.032.009,56	17.003,74	1,61%	0,34%	1,65%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1.406.701,63	0,00	0,00	1.426.186,41	19.484,78	1,39%	0,11%	1,39%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2.172.814,22	0,00	0,00	2.201.912,28	29.098,06	1,34%	0,37%	1,34%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.851.749,70	0,00	0,00	2.881.720,55	29.970,85	1,05%	0,00%	1,05%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	1.864.117,37	0,00	0,00	1.883.513,61	19.396,24	1,04%	0,00%	1,04%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1.302.452,35	0,00	0,00	1.299.723,22	-2.729,13	-0,21%	-	-0,21%
Total Renda Fixa					298.130,61	1,60%	0,71%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de janeiro / 2016

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
TOTAL MIX FIC AÇÕES	547.941,74	0,00	0,00	523.875,64	-24.066,10	-4,39%	9,11%	-4,39%
Total Renda Variável					-24.066,10	-4,39%	9,11%	