

Relatório Analítico dos Investimentos em outubro 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 (outubro / 2015)

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	1.991.187,38	11,01%	1.256	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	592.316,84	3,27%	178	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	1.895.282,96	10,48%	42	1,64%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1461	Não há	2.124.598,16	11,74%	5	23,30%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.570.910,23	8,68%	112	0,34%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	1.230.773,28	6,80%	42	0,21%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.823.929,87	10,08%	252	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	2.396.430,63	13,24%	406	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	1.367.589,75	7,56%	27	0,76%	Artigo 7º, Inciso VI
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	1.303.665,48	7,21%	70	0,35%	Artigo 7º, Inciso VI
TOTAL MIX FIC AÇÕES	D+64	Não há	563.299,28	3,11%	24	7,06%	Artigo 8º, Inciso III
ELLEVEN II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	1.233.259,97	6,82%	4	4,11%	Desenquadrado - RF
Total			18.093.243,83				

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

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	100,00%	0,00	0,00%	18.093.243,83
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	100,00%	2.583.504,22	14,28%	15.509.739,61
Artigo 7º, Inciso II	15,00%	15,00%	0,00	0,00%	2.713.986,57
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	80,00%	6.821.564,63	37,70%	7.653.030,43
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	30,00%	4.220.360,50	23,33%	1.207.612,65
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	20,00%	20,00%	0,00	0,00%	3.618.648,77
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	13,00%	2.671.255,23	14,76%	-319.133,53
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	2,00%	0,00	0,00%	361.864,88
Desenquadrado - RF	0,00%	0,00%	1.233.259,97	6,82%	-1.233.259,97
Total Renda Fixa	100,00%	360,00	17.529.944,55	96,89%	

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	30,00%	0,00	0,00%	5.427.973,15
Artigo 8º, Inciso II	20,00%	20,00%	0,00	0,00%	3.618.648,77
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	563.299,28	3,11%	2.150.687,29
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	904.662,19
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	904.662,19
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	904.662,19
Total	30,00%	80,00	563.299,28	3,11%	

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	2,58%	6,15%	-1,30%	0,24%	6,36%	18,76%	-	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	2,41%	5,63%	-1,55%	-0,16%	5,80%	-	0,20%	4,070%	9,72%
IMA-B 5	2,49%	12,45%	2,81%	7,25%	13,67%	27,00%	-	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	2,43%	11,48%	2,24%	14,64%	12,64%	-	0,20%	1,873%	3,29%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2,26%	9,26%	1,98%	4,95%	10,17%	-	0,70%	1,933%	3,74%
ELLEVEN II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2,01%	7,18%	-0,59%	3,23%	8,44%	-	0,70%	1,803%	3,82%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,75%	-	2,86%	5,83%	-	-	0,70%	0,595%	-
IPCA + 7,00% ao ano	1,39%	14,76%	3,32%	7,39%	17,56%	34,08%	-	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1,37%	14,70%	3,29%	7,31%	17,42%	-	0,00%	0,173%	0,67%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1,22%	12,47%	3,17%	6,87%	14,67%	-	1,65%	0,101%	0,64%
IRF-M 1	1,31%	10,51%	3,33%	6,64%	12,39%	24,10%	-	-	-
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,52%	10,38%	3,27%	6,42%	12,18%	-	0,20%	0,624%	0,77%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,30%	10,30%	3,29%	6,52%	12,14%	-	0,20%	0,346%	0,50%
Selic	1,11%	10,80%	3,36%	6,74%	12,80%	24,74%	-	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,11%	10,88%	3,38%	6,78%	12,91%	-	0,20%	0,006%	0,06%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	1,10%	10,64%	3,32%	6,65%	12,61%	-	0,15%	0,001%	0,06%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	1,80%	-8,28%	-9,82%	-18,43%	-16,04%	-15,46%	-	-	-
TOTAL MIX FIC AÇÕES	0,47%	-12,52%	-8,94%	-14,91%	-17,26%	-	1,90%	7,583%	16,97%

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

Administrador	Valor	%
BANCO BRADESCO	8.278.870,53	45,76%
RJI CORRETORA DE VALORES	2.464.033,25	13,62%
BRIDGE ADMINISTRADORA DE RECURSOS	2.124.598,16	11,74%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	1.991.187,38	11,01%
CM Capital Markets DTVM	1.367.589,75	7,56%
Orla DTVM	1.303.665,48	7,21%
Única Administradora	563.299,28	3,11%

Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5	6.483.914,37	35,84%
CDI	4.220.360,50	23,33%
FIDC	2.671.255,23	14,76%
IRF-M 1	2.583.504,22	14,28%
IMA-B	1.570.910,23	8,68%
AÇÕES - LIVRES	563.299,28	3,11%

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2015

Acumulado no Ano

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	13.510.627,56	0,00	48.000,00	13.630.912,10	168.284,54	1,25%	1,73%	71,88%	1,35%
Fevereiro	13.630.912,10	0,00	104.500,00	13.685.437,94	159.025,84	1,17%	1,64%	71,04%	1,48%
Março	13.685.437,94	3.030.000,00	1.811.062,03	15.001.210,43	96.834,52	0,65%	1,84%	35,37%	1,35%
Abril	15.001.210,43	1.085.000,00	655.000,00	15.611.401,55	180.191,12	1,17%	1,18%	99,23%	1,15%
Mai	15.611.401,55	450.000,00	70.352,00	16.179.402,98	188.353,43	1,18%	1,21%	97,59%	1,09%
Junho	16.179.402,98	460.000,00	60.000,00	16.682.030,25	102.627,27	0,62%	1,28%	48,34%	0,91%
Julho	16.682.030,25	430.000,00	151.655,82	17.091.999,95	131.625,52	0,78%	1,16%	67,10%	1,23%
Agosto	17.091.999,95	0,00	0,00	17.027.915,22	-64.084,73	-0,37%	0,71%	-52,97%	1,34%
Setembro	17.027.915,22	1.350.000,00	920.000,00	17.513.445,15	55.529,93	0,32%	1,03%	30,90%	2,24%
Outubro	17.513.445,15	319.000,00	3.040,19	18.093.243,83	263.838,87	1,48%	1,31%	112,90%	1,19%
Acumulado no ano					1.282.226,31	8,52%	13,87%	61,43%	

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

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	1.850.233,44	0,00	0,00	1.895.282,96	45.049,52	2,43%	1,87%	2,43%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1.533.985,77	0,00	0,00	1.570.910,23	36.924,46	2,41%	4,07%	2,41%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.203.525,36	0,00	0,00	1.230.773,28	27.247,92	2,26%	1,93%	2,26%
ELLEVEN II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.208.953,07	0,00	0,00	1.233.259,97	24.306,90	2,01%	1,80%	2,01%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	586.435,81	0,00	3.040,19	592.316,84	8.921,22	1,52%	0,62%	1,52%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1.286.085,34	0,00	0,00	1.303.665,48	17.580,14	1,37%	0,17%	1,37%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.965.706,42	0,00	0,00	1.991.187,38	25.480,96	1,30%	0,35%	1,30%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1.351.107,58	0,00	0,00	1.367.589,75	16.482,17	1,22%	0,10%	1,22%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	1.804.144,33	0,00	0,00	1.823.929,87	19.785,54	1,10%	0,00%	1,10%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.053.871,08	319.000,00	0,00	2.396.430,63	23.559,55	0,99%	0,01%	1,11%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2.108.745,91	0,00	0,00	2.124.598,16	15.852,25	0,75%	0,59%	0,75%
Total Renda Fixa					261.190,63	1,51%	0,98%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
TOTAL MIX FIC AÇÕES	560.651,04	0,00	0,00	563.299,28	2.648,24	0,47%	7,58%	0,47%
				Total Renda Variável	2.648,24	0,47%	7,58%	