

Relatório Analítico dos Investimentos em outubro 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 (outubro / 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	2.281.770,73	8,77%	1.330	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	D+1	Não há	451.421,20	1,73%	43	0,40%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.204.168,88	4,63%	641	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	4.851.235,14	18,64%	116	0,79%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.128.122,82	4,33%	188	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	950.019,29	3,65%	39	0,19%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	2.767.694,54	10,63%	70	0,83%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1461	Não há	2.413.897,78	9,27%	6	20,30%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	D+1471	Não há	263.184,32	1,01%	34	0,23%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	3.676.398,70	14,12%	399	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	2.075.026,27	7,97%	239	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	487.159,67	1,87%	71	0,29%	Artigo 7º, Inciso VI
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	1.576.195,42	6,05%			Artigo 7º, Inciso VI
TOTAL MIX FIC AÇÕES	D+64	Não há	745.637,99	2,86%	54	7,17%	Artigo 8º, Inciso III
ELLEVEN II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	1.159.650,23	4,45%	4	4,11%	Desenquadrado - RF
Total			26.031.582,98				

Enquadramentos na Resolução 3.922 / 4.392 / 4.604 e Política de Investimentos - base (outubro / 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%	26.031.582,98
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	100,00%	9.916.718,77	38,09%	16.114.864,21
Artigo 7º, Inciso II	15,00%	15,00%	0,00	0,00%	3.904.737,45
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	80,00%	80,00%	6.394.795,93	24,57%	14.430.470,45
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	30,00%	30,00%	5.751.424,97	22,09%	2.058.049,92
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'	20,00%	20,00%	0,00	0,00%	5.206.316,60
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	13,00%	2.063.355,09	7,93%	1.320.750,70
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'	5,00%	2,00%	0,00	0,00%	520.631,66
Desenquadrado - RF	0,00%	0,00%	1.159.650,23	4,45%	-1.159.650,23
Total Renda Fixa	100,00%	360,00	25.285.944,99	97,14%	

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	30,00%	0,00	0,00%	7.809.474,89
Artigo 8º, Inciso II	20,00%	20,00%	0,00	0,00%	5.206.316,60
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	745.637,99	2,86%	3.159.099,46
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.301.579,15
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.301.579,15
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.301.579,15
Total	30,00%	80,00	745.637,99	2,86%	

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Selic	1,05%	11,59%	3,41%	6,95%	14,08%	28,69%	-	-	-
BRABESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,17%	11,74%	3,53%	7,13%	14,23%	28,98%	0,20%	0,040%	0,04%
BRABESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	1,03%	11,31%	3,34%	6,81%	13,77%	28,11%	0,15%	0,006%	0,01%

IRF-M 1	0,94%	12,18%	3,36%	6,69%	14,72%	28,94%	-	-	-
BRABESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,95%	12,05%	3,33%	6,59%	14,50%	28,44%	0,20%	0,181%	0,38%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,94%	12,10%	3,33%	6,60%	14,59%	28,51%	0,20%	0,171%	0,35%

IPCA + 7,00% ao ano	0,80%	11,89%	2,53%	6,04%	15,39%	35,66%	-	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	0,76%	12,05%	2,75%	6,44%	15,25%	32,16%	1,65%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSECTORIAL SÊNIOR	-26,29%	-62,60%	-29,12%	-29,32%	-62,63%	-56,12%	0,00%	17,872%	-

IMA-B	0,64%	22,78%	3,13%	7,65%	25,94%	33,95%	-	-	-
BRABESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	0,63%	22,50%	3,06%	7,44%	25,54%	32,83%	0,20%	2,263%	6,81%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	0,51%	20,77%	3,08%	7,09%	23,99%	31,82%	0,20%	1,926%	6,02%

IMA-B 5	0,46%	13,44%	2,99%	6,05%	16,48%	32,40%	-	-	-
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	2,04%	-	4,22%	1,19%	-	-	0,70%	5,967%	-
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1,68%	-	4,31%	5,96%	13,62%	-	0,70%	2,069%	1,97%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,53%	7,17%	3,02%	6,83%	-0,34%	9,80%	0,70%	0,905%	12,72%
BRABESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	0,50%	13,35%	2,99%	5,89%	16,38%	31,08%	0,20%	0,798%	2,63%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
ELLEVEN II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,46%	-8,20%	2,93%	-13,47%	-5,97%	1,96%	0,70%	0,772%	17,84%
IDKA IPCA 2 Anos	0,41%	13,11%	3,23%	5,80%	15,48%	32,92%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,43%	12,90%	3,00%	5,89%	15,70%	31,80%	0,20%	0,673%	2,42%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	11,23%	49,77%	13,29%	20,43%	41,55%	18,85%	-	-	-
TOTAL MIX FIC AÇÕES	10,06%	36,08%	11,13%	20,78%	32,37%	9,53%	1,90%	4,460%	17,95%

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

Administrador	Valor	%
BANCO BRADESCO	14.498.477,47	55,70%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	3.485.939,61	13,39%
BRIDGE ADMINISTRADORA DE RECURSOS	2.413.897,78	9,27%
RJI CORRETORA DE VALORES	2.372.853,84	9,12%
CM Capital Markets DTVM	1.576.195,42	6,05%
Única Administradora	745.637,99	2,86%
Orla DTVM	487.159,67	1,87%
Santander Securities Services	451.421,20	1,73%

Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5	7.554.446,16	29,02%
CDI	5.751.424,97	22,09%
IMA-B	5.302.656,34	20,37%
IRF-M 1	3.409.893,55	13,10%
FIDC	2.063.355,09	7,93%
IDKA IPCA 2A	1.204.168,88	4,63%
AÇÕES - LIVRES	745.637,99	2,86%

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%
Fevereiro	19.433.929,60	1.596.090,50	0,00	21.236.239,65	206.219,55	0,98%	1,34%	72,95%	1,37%
Março	21.236.239,65	679.109,21	6.000,00	21.820.219,71	-89.129,15	-0,41%	0,94%	-43,18%	2,28%
Abril	21.820.219,71	558.000,00	0,00	22.284.367,37	-93.852,34	-0,42%	1,08%	-38,96%	1,42%
Mai	22.284.367,37	422.000,00	0,00	22.841.215,68	134.848,31	0,59%	1,27%	46,74%	1,39%
Junho	22.841.215,68	430.000,00	0,00	23.526.924,49	255.708,81	1,10%	0,86%	127,51%	1,28%
Julho	23.526.924,49	433.000,00	0,00	24.041.226,56	81.302,07	0,34%	1,01%	33,62%	2,30%
Agosto	24.041.226,56	420.000,00	3.000,00	24.671.324,25	213.097,69	0,87%	0,98%	89,31%	0,89%
Setembro	24.671.324,25	482.000,00	0,00	25.396.575,19	243.250,94	0,97%	0,57%	170,52%	1,04%
Outubro	25.396.575,19	460.000,00	0,00	26.031.582,98	175.007,79	0,68%	0,72%	93,39%	1,47%
Acumulado no ano					1.400.518,18	6,28%	11,02%	57,03%	

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	257.932,95	0,00	0,00	263.184,32	5.251,37	2,04%	5,97%	2,04%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2.373.987,85	0,00	0,00	2.413.897,78	39.909,93	1,68%	2,07%	1,68%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	3.633.755,41	0,00	0,00	3.676.398,70	42.643,29	1,17%	0,04%	1,17%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	2.053.859,59	0,00	0,00	2.075.026,27	21.166,68	1,03%	0,01%	1,03%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.117.478,22	0,00	0,00	1.128.122,82	10.644,60	0,95%	0,18%	0,95%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.260.449,40	0,00	0,00	2.281.770,73	21.321,33	0,94%	0,17%	0,94%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1.564.340,26	0,00	0,00	1.576.195,42	11.855,16	0,76%	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	4.364.990,03	460.000,00	0,00	4.851.235,14	26.245,11	0,54%	2,26%	0,63%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	944.981,92	0,00	0,00	950.019,29	5.037,37	0,53%	0,90%	0,53%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	449.143,23	0,00	0,00	451.421,20	2.277,97	0,51%	1,93%	0,51%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	2.753.927,64	0,00	0,00	2.767.694,54	13.766,90	0,50%	0,80%	0,50%
ELLEVEN II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.154.379,32	0,00	0,00	1.159.650,23	5.270,91	0,46%	0,77%	0,46%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.199.030,56	0,00	0,00	1.204.168,88	5.138,32	0,43%	0,67%	0,43%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	590.836,13	0,00	0,00	487.159,67	-103.676,46	-17,55%	17,87%	-9,72%
Total Renda Fixa					106.852,48	0,42%	1,38%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
TOTAL MIX FIC AÇÕES	677.482,68	0,00	0,00	745.637,99	68.155,31	10,06%	4,46%	10,06%
Total Renda Variável					68.155,31	10,06%	4,46%	