

Relatório Analítico dos Investimentos em novembro 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 (novembro / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.139.655,59	4,29%	193	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	D+1	Não há	446.672,80	1,68%	40	0,40%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	4.793.925,59	18,05%	113	0,84%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.305.163,69	8,68%	1.346	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.211.042,09	4,56%	628	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	952.044,56	3,59%	38	0,17%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	2.776.421,77	10,46%	70	0,99%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1461	Não há	3.123.846,99	11,76%	6	24,77%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	D+1471	Não há	260.638,72	0,98%	33	0,23%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	3.069.670,09	11,56%	402	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	2.096.216,51	7,89%	239	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	1.590.379,53	5,99%			Artigo 7º, Inciso VI
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	495.393,88	1,87%	71	0,35%	Artigo 7º, Inciso VI
TOTAL MIX FIC AÇÕES	D+64	Não há	702.575,00	2,65%	50	7,93%	Artigo 8º, Inciso III
MULTINVEST FI MULTIMERCADO	D+31	Não há	428.675,59	1,61%	29	2,52%	Artigo 8º, Inciso IV
ELLEVEN II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	1.161.760,54	4,38%	4	4,11%	Desenquadrado - RF
Total			26.554.082,94				

Enquadramentos na Resolução 3.922 / 4.392 / 4.604 e Política de Investimentos - base (novembro / 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%	26.554.082,94
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	100,00%	9.896.459,76	37,27%	16.657.623,18
Artigo 7º, Inciso II	15,00%	15,00%	0,00	0,00%	3.983.112,44
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	80,00%	7.112.952,04	26,79%	14.130.314,31
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	30,00%	5.165.886,60	19,45%	2.800.338,28
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	20,00%	20,00%	0,00	0,00%	5.310.816,59
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	13,00%	2.085.773,41	7,85%	1.366.257,37
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	2,00%	0,00	0,00%	531.081,66
Desenquadrado - RF	0,00%	0,00%	1.161.760,54	4,38%	-1.161.760,54
Total Renda Fixa	100,00%	360,00	25.422.832,35	95,74%	

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	30,00%	0,00	0,00%	7.966.224,88
Artigo 8º, Inciso II	20,00%	20,00%	0,00	0,00%	5.310.816,59
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	702.575,00	2,65%	3.280.537,44
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	428.675,59	1,61%	899.028,56
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.327.704,15
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.327.704,15
Total	30,00%	80,00	1.131.250,59	4,26%	

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M 1	1,05%	13,36%	3,22%	6,67%	14,70%	29,27%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,03%	13,24%	3,17%	6,58%	14,56%	28,82%	0,20%	0,124%	0,35%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,02%	13,20%	3,17%	6,55%	14,50%	28,73%	0,20%	0,124%	0,36%
Selic	1,04%	12,75%	3,23%	6,87%	14,06%	28,94%	-	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,12%	12,99%	3,43%	7,13%	14,31%	29,33%	0,20%	0,042%	0,05%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	1,02%	12,45%	3,16%	6,74%	13,74%	28,36%	0,15%	0,001%	0,44%
IPCA + 7,00% ao ano	0,72%	12,69%	2,18%	5,38%	14,45%	35,21%	-	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1,58%	-62,00%	-29,63%	-29,16%	-62,21%	-55,87%	0,00%	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	0,90%	13,06%	2,53%	6,08%	14,89%	32,26%	1,65%	-	-
IDKA IPCA 2 Anos	0,57%	13,75%	2,50%	5,74%	15,91%	32,27%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,57%	13,55%	2,35%	5,66%	15,78%	31,23%	0,20%	1,272%	2,38%
IMA-B 5	0,40%	13,89%	2,28%	5,63%	16,31%	31,55%	-	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	0,32%	13,71%	2,23%	5,44%	16,12%	30,16%	0,20%	1,878%	2,68%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,21%	7,39%	1,99%	6,27%	-0,89%	8,78%	0,70%	1,907%	12,74%
ELLEVEN II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,18%	-8,03%	2,00%	-13,76%	-6,33%	1,13%	0,70%	1,944%	17,85%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,10%	-	3,11%	5,26%	12,53%	-	0,70%	2,040%	2,31%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	-0,97%	-	2,12%	-0,97%	-	-	0,70%	2,262%	-

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	-1,22%	21,28%	0,97%	6,44%	23,13%	29,54%	-	-	-
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	-1,05%	19,50%	0,93%	6,08%	21,48%	27,79%	0,20%	4,393%	6,28%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	-1,18%	21,06%	1,01%	6,36%	22,84%	28,58%	0,20%	4,673%	7,07%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	1,04%	12,73%	3,23%	6,86%	14,04%	28,88%	-	-	-
MULTINVEST FI MULTIMERCADO	0,58%	11,34%	2,67%	6,23%	12,42%	24,49%	1,00%	1,169%	0,96%
Ibovespa	-4,65%	42,81%	6,92%	27,72%	37,20%	13,12%	-	-	-
TOTAL MIX FIC AÇÕES	-5,78%	28,22%	4,22%	20,14%	24,75%	2,11%	1,90%	11,449%	18,61%

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

Administrador	Valor	%
BANCO BRADESCO	13.875.889,55	52,26%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	3.516.205,78	13,24%
BRIDGE ADMINISTRADORA DE RECURSOS	3.123.846,99	11,76%
RJI CORRETORA DE VALORES	2.803.119,41	10,56%
CM Capital Markets DTVM	1.590.379,53	5,99%
Única Administradora	702.575,00	2,65%
Orla DTVM	495.393,88	1,87%
Santander Securities Services	446.672,80	1,68%

Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5	8.274.712,58	31,16%
IMA-B	5.240.598,39	19,74%
CDI	5.165.886,60	19,45%
IRF-M 1	3.444.819,28	12,97%
FIDC	2.085.773,41	7,85%
IDKA IPCA 2A	1.211.042,09	4,56%
AÇÕES - LIVRES	702.575,00	2,65%
MULTIMERCADO - MODERADO	428.675,59	1,61%

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%
Novembro	26.031.582,98	1.125.000,00	644.000,00	26.554.082,94	41.499,96	0,16%	0,64%	24,29%	2,09%
Acumulado no ano					1.442.018,14	6,45%	11,73%	54,97%	

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)	
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	487.159,67	0,00	0,00	495.393,88	8.234,21	1,69%	-	-17,06%	
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.281.770,73	0,00	0,00	2.305.163,69	23.392,96	1,03%	0,12%	1,03%	
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.128.122,82	0,00	0,00	1.139.655,59	11.532,77	1,02%	0,12%	1,02%	
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	2.075.026,27	0,00	0,00	2.096.216,51	21.190,24	1,02%	0,00%	1,02%	
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	3.676.398,70	0,00	644.000,00	3.069.670,09	37.271,39	1,01%	0,04%	1,12%	
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1.576.195,42	0,00	0,00	1.590.379,53	14.184,11	0,90%	-	-	
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.204.168,88	0,00	0,00	1.211.042,09	6.873,21	0,57%	1,27%	0,57%	
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2.413.897,78	700.000,00	0,00	3.123.846,99	9.949,21	0,32%	2,04%	0,10%	
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	2.767.694,54	0,00	0,00	2.776.421,77	8.727,23	0,32%	1,88%	0,32%	
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	950.019,29	0,00	0,00	952.044,56	2.025,27	0,21%	1,91%	0,21%	
ELLEVEN II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.159.650,23	0,00	0,00	1.161.760,54	2.110,31	0,18%	1,94%	0,18%	
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	263.184,32	0,00	0,00	260.638,72	-2.545,60	-0,97%	2,26%	-0,97%	
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	451.421,20	0,00	0,00	446.672,80	-4.748,40	-1,05%	4,39%	-1,05%	
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	4.851.235,14	0,00	0,00	4.793.925,59	-57.309,55	-1,18%	4,67%	-1,18%	
Total Renda Fixa						80.887,36	0,32%	1,83%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
MULTINVEST FI MULTIMERCADO	0,00	425.000,00	0,00	428.675,59	3.675,59	0,86%	1,17%	0,58%
TOTAL MIX FIC AÇÕES	745.637,99	0,00	0,00	702.575,00	-43.062,99	-5,78%	11,45%	-5,78%
Total Renda Variável					-39.387,40	-3,36%	7,55%	