

Relatório Analítico dos Investimentos em fevereiro 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 (fevereiro / 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	2.091.382,90	9,85%	1.306	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.676.678,15	7,90%	110	0,33%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.112.208,06	5,24%	544	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.042.930,16	4,91%	181	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	2.552.516,50	12,02%	57	1,14%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1461	Não há	2.226.231,59	10,48%	5	23,30%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	1.139.904,44	5,37%	43	0,20%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.901.877,17	8,96%	277	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	2.910.343,44	13,70%	387	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	1.447.571,55	6,82%	27	0,72%	Artigo 7º, Inciso VI
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	1.285.647,93	6,05%	71	0,35%	Artigo 7º, Inciso VI
TOTAL MIX FIC AÇÕES	D+64	Não há	536.169,12	2,52%	66	6,83%	Artigo 8º, Inciso III
ELLEVEN II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	1.312.778,64	6,18%	4	4,11%	Desenquadrado - RF
Total			21.236.239,65				

Enquadramentos na Resolução 3.922 / 4.392 / 4.604 e Política de Investimentos - base (fevereiro / 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%	21.236.239,65
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	100,00%	5.923.199,27	27,89%	15.313.040,38
Artigo 7º, Inciso II	15,00%	15,00%	0,00	0,00%	3.185.435,95
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	80,00%	5.918.652,53	27,87%	11.070.339,19
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	30,00%	4.812.220,61	22,66%	1.558.651,29
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	20,00%	20,00%	0,00	0,00%	4.247.247,93
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	13,00%	2.733.219,48	12,87%	27.491,67
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	2,00%	0,00	0,00%	424.724,79
Desenquadrado - RF	0,00%	0,00%	1.312.778,64	6,18%	-1.312.778,64
Total Renda Fixa	100,00%	360,00	20.700.070,53	97,48%	

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	30,00%	0,00	0,00%	6.370.871,90
Artigo 8º, Inciso II	20,00%	20,00%	0,00	0,00%	4.247.247,93
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	536.169,12	2,52%	2.649.266,83
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.061.811,98
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.061.811,98
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.061.811,98
Total	30,00%	80,00	536.169,12	2,52%	

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	2,26%	4,22%	5,80%	8,90%	9,45%	27,71%	-	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	2,24%	4,15%	5,68%	8,51%	8,84%	26,30%	0,20%	3,109%	9,07%
IMA-B 5	1,54%	4,55%	6,77%	10,89%	16,86%	32,06%	-	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	1,52%	4,54%	6,76%	10,57%	16,09%	-	0,20%	1,455%	3,50%
ELLEVEN II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1,31%	3,93%	5,85%	6,33%	10,91%	24,86%	0,70%	1,253%	3,93%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1,10%	-	3,68%	6,85%	-	-	0,70%	0,098%	-
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-3,15%	-0,41%	-8,09%	-4,85%	-1,64%	10,85%	0,70%	8,672%	9,26%
IPCA + 7,00% ao ano	1,42%	3,26%	4,87%	9,17%	18,02%	35,93%	-	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1,50%	2,91%	4,57%	8,14%	16,03%	-	1,65%	0,255%	0,33%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-1,08%	-1,29%	-1,83%	1,02%	9,42%	25,88%	0,00%	-	-
IDKA IPCA 2 Anos	1,20%	5,00%	6,99%	11,37%	18,46%	33,63%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,37%	4,28%	6,33%	10,71%	16,83%	31,71%	0,20%	1,371%	2,93%
IRF-M 1	1,09%	2,75%	3,97%	7,47%	14,04%	26,55%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,10%	2,74%	3,94%	7,40%	13,84%	26,05%	0,20%	0,179%	0,54%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,06%	2,72%	3,91%	7,24%	13,86%	25,92%	0,20%	0,187%	0,81%
Selic	1,00%	2,07%	3,26%	6,67%	13,61%	26,14%	-	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIA DO DI	0,99%	2,05%	3,24%	6,67%	13,65%	26,36%	0,20%	0,006%	0,03%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	0,97%	2,03%	3,20%	6,57%	13,40%	25,66%	0,15%	0,009%	0,03%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	5,91%	-1,28%	-5,16%	-8,22%	-17,04%	-9,13%	-	-	-
TOTAL MIX FIC AÇÕES	2,35%	-2,15%	-4,80%	-5,75%	-15,75%	-15,08%	1,90%	7,631%	15,76%

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

Administrador	Valor	%
BANCO BRADESCO	10.084.345,42	47,49%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	3.203.590,96	15,09%
RJI CORRETORA DE VALORES	2.452.683,08	11,55%
BRIDGE ADMINISTRADORA DE RECURSOS	2.226.231,59	10,48%
CM Capital Markets DTVM	1.447.571,55	6,82%
Orla DTVM	1.285.647,93	6,05%
Única Administradora	536.169,12	2,52%

Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5	7.231.431,17	34,05%
CDI	4.812.220,61	22,66%
IRF-M 1	3.134.313,06	14,76%
FIDC	2.733.219,48	12,87%
IMA-B	1.676.678,15	7,90%
IDKA IPCA 2A	1.112.208,06	5,24%
AÇÕES - LIVRES	536.169,12	2,52%

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%
Acumulado no ano					480.284,06	2,42%	3,11%	77,95%	

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	1.079.090,50	0,00	1.112.208,06	33.117,56	3,07%	1,37%	1,37%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1.639.909,11	0,00	0,00	1.676.678,15	36.769,04	2,24%	3,11%	2,24%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1.426.186,41	0,00	0,00	1.447.571,55	21.385,14	1,50%	0,26%	1,50%
ELLEVEN II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.295.740,67	0,00	0,00	1.312.778,64	17.037,97	1,31%	1,25%	1,31%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	2.003.694,24	517.000,00	0,00	2.552.516,50	31.822,26	1,26%	1,46%	1,52%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2.201.912,28	0,00	0,00	2.226.231,59	24.319,31	1,10%	0,10%	1,10%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.068.617,03	0,00	0,00	2.091.382,90	22.765,87	1,10%	0,18%	1,10%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.032.009,56	0,00	0,00	1.042.930,16	10.920,60	1,06%	0,19%	1,06%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.881.720,55	0,00	0,00	2.910.343,44	28.622,89	0,99%	0,01%	0,99%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	1.883.513,61	0,00	0,00	1.901.877,17	18.363,56	0,97%	0,01%	0,97%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1.299.723,22	0,00	0,00	1.285.647,93	-14.075,29	-1,08%	-	-1,08%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.177.027,28	0,00	0,00	1.139.904,44	-37.122,84	-3,15%	8,67%	-3,15%
Total Renda Fixa					193.926,07	0,95%	1,19%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
TOTAL MIX FIC AÇÕES	523.875,64	0,00	0,00	536.169,12	12.293,48	2,35%	7,63%	2,35%
				Total Renda Variável	12.293,48	2,35%	7,63%	