

Relatório Analítico dos Investimentos em novembro 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 (novembro / 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	2.012.191,07	10,72%	1.265	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	724.378,98	3,86%	179	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	1.905.361,86	10,15%	43	1,52%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1461	Não há	2.147.199,94	11,44%	5	23,30%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.586.515,27	8,45%	111	0,33%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	1.240.226,63	6,61%	42	0,20%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.842.957,75	9,82%	259	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	2.818.954,66	15,01%	399	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	1.384.278,48	7,37%	27	0,76%	Artigo 7º, Inciso VI
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	1.309.665,48	6,98%	70	0,35%	Artigo 7º, Inciso VI
TOTAL MIX FIC AÇÕES	D+64	Não há	563.183,22	3,00%	25	7,00%	Artigo 8º, Inciso III
ELLEVEN II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	1.240.231,96	6,61%	4	4,11%	Desenquadrado - RF
Total			18.775.145,30				

Enquadramentos na Resolução 3.922 / 4.392 / 4.604 e Política de Investimentos - base (novembro / 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%	18.775.145,30
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b '	100,00%	100,00%	2.736.570,05	14,58%	16.038.575,25
Artigo 7º, Inciso II	15,00%	15,00%	0,00	0,00%	2.816.271,80
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a '	80,00%	80,00%	6.879.303,70	36,64%	8.140.812,54
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a '	30,00%	30,00%	4.661.912,41	24,83%	970.631,18
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a '	20,00%	20,00%	0,00	0,00%	3.755.029,06
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	13,00%	2.693.943,96	14,35%	-253.175,07
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a '	5,00%	2,00%	0,00	0,00%	375.502,91
Desenquadrado - RF	0,00%	0,00%	1.240.231,96	6,61%	-1.240.231,96
Total Renda Fixa	100,00%	360,00	18.211.962,08	97,00%	

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	30,00%	0,00	0,00%	5.632.543,59
Artigo 8º, Inciso II	20,00%	20,00%	0,00	0,00%	3.755.029,06
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	563.183,22	3,00%	2.253.088,58
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	938.757,27
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	938.757,27
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	938.757,27
Total	30,00%	80,00	563.183,22	3,00%	

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA + 7,00% ao ano	1,55%	16,54%	4,11%	7,67%	18,15%	34,70%	-	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1,22%	13,84%	3,41%	7,12%	15,12%	-	1,65%	0,169%	0,45%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	0,46%	15,22%	2,90%	6,65%	16,78%	-	0,00%	1,710%	1,21%

IRF-M 1	1,07%	11,69%	3,37%	6,76%	12,70%	24,51%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,05%	11,47%	3,34%	6,66%	12,45%	-	0,20%	0,145%	0,51%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,01%	11,50%	3,21%	6,58%	12,42%	-	0,20%	0,264%	0,78%

Selic	1,06%	11,97%	3,31%	6,81%	13,04%	25,16%	-	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIA DO DI	1,05%	12,05%	3,32%	6,84%	13,14%	-	0,20%	0,004%	0,05%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIA DO DI	1,04%	11,79%	3,27%	6,72%	12,85%	-	0,15%	0,001%	0,05%

IMA-B	1,03%	7,25%	2,92%	-1,27%	5,20%	24,45%	-	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	0,99%	6,68%	2,67%	-1,76%	4,67%	-	0,20%	3,525%	9,46%

IMA-B 5	0,55%	13,06%	3,86%	6,11%	13,11%	27,70%	-	-	-
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1,06%	-	3,05%	5,98%	-	-	0,70%	0,098%	-
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,77%	10,10%	3,53%	3,98%	9,76%	-	0,70%	1,424%	3,75%
ELLEVEN II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,57%	7,79%	0,45%	2,20%	7,96%	-	0,70%	1,476%	3,88%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	0,53%	12,07%	3,57%	5,43%	12,09%	-	0,20%	1,632%	3,37%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	-1,63%	-9,77%	-3,23%	-14,48%	-17,55%	-14,03%	-	-	-
TOTAL MIX FIC AÇÕES	-0,02%	-12,53%	-1,00%	-12,23%	-18,15%	-	1,90%	8,254%	16,72%

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

Administrador	Valor	%
BANCO BRADESCO	8.878.168,52	47,29%
RJI CORRETORA DE VALORES	2.480.458,59	13,21%
BRIDGE ADMINISTRADORA DE RECURSOS	2.147.199,94	11,44%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	2.012.191,07	10,72%
CM Capital Markets DTVM	1.384.278,48	7,37%
Orla DTVM	1.309.665,48	6,98%
Única Administradora	563.183,22	3,00%

Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5	6.533.020,39	34,80%
CDI	4.661.912,41	24,83%
IRF-M 1	2.736.570,05	14,58%
FIDC	2.693.943,96	14,35%
IMA-B	1.586.515,27	8,45%
AÇÕES - LIVRES	563.183,22	3,00%

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 novembro / 2015

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1.367.589,75	0,00	0,00	1.384.278,48	16.688,73	1,22%	0,17%	1,22%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2.124.598,16	0,00	0,00	2.147.199,94	22.601,78	1,06%	0,10%	1,06%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.991.187,38	0,00	0,00	2.012.191,07	21.003,69	1,05%	0,15%	1,05%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	1.823.929,87	0,00	0,00	1.842.957,75	19.027,88	1,04%	0,00%	1,04%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1.570.910,23	0,00	0,00	1.586.515,27	15.605,04	0,99%	3,52%	0,99%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.396.430,63	395.000,00	0,00	2.818.954,66	27.524,03	0,99%	0,00%	1,05%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	592.316,84	125.000,00	0,00	724.378,98	7.062,14	0,98%	0,26%	1,01%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.230.773,28	0,00	0,00	1.240.226,63	9.453,35	0,77%	1,42%	0,77%
ELLEVEN II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.233.259,97	0,00	0,00	1.240.231,96	6.971,99	0,57%	1,48%	0,57%
BRADESCO INSTITUCIONAL L FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	1.895.282,96	0,00	0,00	1.905.361,86	10.078,90	0,53%	1,63%	0,53%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1.303.665,48	0,00	0,00	1.309.665,48	6.000,00	0,46%	1,71%	0,46%
Total Renda Fixa					162.017,53	0,90%	0,85%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
TOTAL MIX FIC AÇÕES	563.299,28	0,00	0,00	563.183,22	-116,06	-0,02%	8,25%	-0,02%
Total Renda Variável					-116,06	-0,02%	8,25%	