

Relatório Analítico dos Investimentos em dezembro 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 (dezembro / 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	2.035.565,35	10,60%	1.280	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.055.005,82	5,49%	181	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	1.945.858,45	10,13%	45	1,47%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1461	Não há	2.172.814,22	11,32%	5	23,30%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.609.910,86	8,39%	112	0,34%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	1.144.570,32	5,96%	43	0,20%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.864.117,37	9,71%	278	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	2.851.749,70	14,85%	390	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	1.406.701,63	7,33%	27	0,76%	Artigo 7º, Inciso VI
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	1.302.452,35	6,78%	70	0,35%	Artigo 7º, Inciso VI
TOTAL MIX FIC AÇÕES	D+64	Não há	547.941,74	2,85%	25	7,00%	Artigo 8º, Inciso III
ELLEVEN II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	1.263.177,28	6,58%	4	4,11%	Desenquadrado - RF
Total			19.199.865,09				

Enquadramentos na Resolução 3.922 / 4.392 / 4.604 e Política de Investimentos - base (dezembro / 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%	19.199.865,09
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b '	100,00%	100,00%	3.090.571,17	16,10%	16.109.293,92
Artigo 7º, Inciso II	15,00%	15,00%	0,00	0,00%	2.879.979,76
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a '	80,00%	80,00%	6.873.153,85	35,80%	8.486.738,22
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a '	30,00%	30,00%	4.715.867,07	24,56%	1.044.092,46
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a '	20,00%	20,00%	0,00	0,00%	3.839.973,02
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	13,00%	2.709.153,98	14,11%	-213.171,52
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a '	5,00%	2,00%	0,00	0,00%	383.997,30
Desenquadrado - RF	0,00%	0,00%	1.263.177,28	6,58%	-1.263.177,28
Total Renda Fixa	100,00%	360,00	18.651.923,35	97,15%	

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	30,00%	0,00	0,00%	5.759.959,53
Artigo 8º, Inciso II	20,00%	20,00%	0,00	0,00%	3.839.973,02
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	547.941,74	2,85%	2.332.038,02
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	959.993,25
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	959.993,25
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	959.993,25
Total	30,00%	80,00	547.941,74	2,85%	

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5	2,12%	15,46%	5,23%	7,45%	15,46%	28,90%	-	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	2,13%	14,45%	5,17%	6,83%	14,45%	-	0,20%	0,850%	3,37%
ELLEVEN II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1,85%	9,78%	4,49%	3,37%	9,78%	22,71%	0,70%	0,703%	3,88%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-7,71%	1,61%	-4,90%	-4,04%	1,61%	13,08%	0,70%	10,953%	7,85%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-	-	-	-	-	-	0,70%	0,103%	-

IPCA + 7,00% ao ano	1,56%	18,36%	4,57%	7,89%	18,36%	34,79%	-	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1,62%	15,69%	4,11%	7,48%	15,69%	-	1,65%	0,167%	0,44%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-0,55%	14,59%	1,27%	4,46%	14,59%	30,66%	0,00%	3,453%	2,46%

IMA-B	1,52%	8,88%	5,21%	0,50%	8,88%	24,72%	-	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1,47%	8,25%	4,95%	-0,01%	8,25%	23,33%	0,20%	1,450%	9,25%

IRF-M 1	1,18%	13,01%	3,60%	7,02%	13,01%	24,96%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,16%	12,76%	3,55%	6,92%	12,76%	24,43%	0,20%	0,107%	0,50%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,15%	12,78%	3,73%	6,87%	12,78%	24,38%	0,20%	0,120%	0,78%

Selic	1,16%	13,27%	3,36%	6,91%	13,27%	25,62%	-	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,16%	13,35%	3,36%	6,93%	13,35%	25,87%	0,20%	0,013%	0,05%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	1,15%	13,08%	3,32%	6,83%	13,08%	25,15%	0,15%	0,001%	0,05%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	-3,93%	-13,31%	-3,80%	-18,33%	-13,31%	-15,84%	-	-	-
TOTAL MIX FIC AÇÕES	-2,71%	-14,90%	-2,27%	-14,13%	-14,90%	-20,00%	1,90%	7,994%	16,00%

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

Administrador	Valor	%
BANCO BRADESCO	9.326.642,20	48,58%
RJI CORRETORA DE VALORES	2.407.747,60	12,54%
BRIDGE ADMINISTRADORA DE RECURSOS	2.172.814,22	11,32%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	2.035.565,35	10,60%
CM Capital Markets DTVM	1.406.701,63	7,33%
Orla DTVM	1.302.452,35	6,78%
Única Administradora	547.941,74	2,85%

Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5	6.526.420,27	33,99%
CDI	4.715.867,07	24,56%
IRF-M 1	3.090.571,17	16,10%
FIDC	2.709.153,98	14,11%
IMA-B	1.609.910,86	8,39%
AÇÕES - LIVRES	547.941,74	2,85%

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%
Dezembro	18.775.145,30	395.000,00	75.000,00	19.199.865,09	104.719,79	0,55%	1,47%	37,18%	1,41%
Acumulado no ano					1.386.946,10	9,12%	15,55%	58,63%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de dezembro / 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	1.905.361,86	0,00	0,00	1.945.858,45	40.496,59	2,13%	0,85%	2,13%
ELLEVEN II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.240.231,96	0,00	0,00	1.263.177,28	22.945,32	1,85%	0,70%	1,85%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1.384.278,48	0,00	0,00	1.406.701,63	22.423,15	1,62%	0,17%	1,62%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1.586.515,27	0,00	0,00	1.609.910,86	23.395,59	1,47%	1,45%	1,47%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2.147.199,94	0,00	0,00	2.172.814,22	25.614,28	1,19%	0,10%	1,19%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.818.954,66	0,00	0,00	2.851.749,70	32.795,04	1,16%	0,01%	1,16%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.012.191,07	0,00	0,00	2.035.565,35	23.374,28	1,16%	0,11%	1,16%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	1.842.957,75	0,00	0,00	1.864.117,37	21.159,62	1,15%	0,00%	1,15%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	724.378,98	395.000,00	75.000,00	1.055.005,82	10.626,84	0,95%	0,12%	1,15%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1.309.665,48	0,00	0,00	1.302.452,35	-7.213,13	-0,55%	3,45%	-0,55%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.240.226,63	0,00	0,00	1.144.570,32	-95.656,31	-7,71%	10,95%	-7,67%
				Total Renda Fixa	119.961,27	0,65%	1,22%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
TOTAL MIX FIC AÇÕES	563.183,22	0,00	0,00	547.941,74	-15.241,48	-2,71%	7,99%	-2,71%
Total Renda Variável					-15.241,48	-2,71%	7,99%	