

Relatório Analítico dos Investimentos em abril 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 (abril / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.137.173,21	5,10%	567	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	2.859.443,88	12,83%	109	0,50%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.061.279,92	4,76%	194	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.140.415,64	9,61%	1.326	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1461	Não há	2.278.052,73	10,22%	5	22,16%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	D+1471	Não há	260.076,68	1,17%	40	0,20%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	2.613.734,50	11,73%	57	1,18%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	889.256,80	3,99%	40	0,20%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.942.762,33	8,72%	262	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	2.974.503,55	13,35%	387	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	1.480.842,39	6,65%	28	0,71%	Artigo 7º, Inciso VI
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	689.281,23	3,09%	71	0,35%	Artigo 7º, Inciso VI
TOTAL MIX FIC AÇÕES	D+64	Não há	617.334,33	2,77%	65	6,98%	Artigo 8º, Inciso III
ELLEVEN II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	1.340.210,18	6,01%	4	4,11%	Desenquadrado - RF
Total			22.284.367,37				

Enquadramentos na Resolução 3.922 / 4.392 / 4.604 e Política de Investimentos - base (abril / 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%	22.284.367,37
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	100,00%	7.198.312,65	32,30%	15.086.054,72
Artigo 7º, Inciso II	15,00%	15,00%	0,00	0,00%	3.342.655,11
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	80,00%	80,00%	6.041.120,71	27,11%	11.786.373,19
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	30,00%	30,00%	4.917.265,88	22,07%	1.768.044,33
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'	20,00%	20,00%	0,00	0,00%	4.456.873,47
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	13,00%	2.170.123,62	9,74%	726.844,14
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'	5,00%	2,00%	0,00	0,00%	445.687,35
Desenquadrado - RF	0,00%	0,00%	1.340.210,18	6,01%	-1.340.210,18
Total Renda Fixa	100,00%	360,00	21.667.033,04	97,23%	

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	30,00%	0,00	0,00%	6.685.310,21
Artigo 8º, Inciso II	20,00%	20,00%	0,00	0,00%	4.456.873,47
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	617.334,33	2,77%	2.725.320,78
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.114.218,37
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.114.218,37
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.114.218,37
Total	30,00%	80,00	617.334,33	2,77%	

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	3,93%	14,06%	11,92%	16,99%	17,27%	35,51%	-	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	3,94%	14,02%	11,94%	16,85%	16,66%	34,20%	0,20%	3,888%	9,84%
IDKA IPCA 2 Anos	1,66%	6,90%	3,03%	9,15%	18,82%	33,12%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,62%	6,62%	3,65%	9,26%	17,94%	31,77%	0,20%	1,222%	3,10%
IMA-B 5	1,54%	6,97%	3,88%	9,83%	17,80%	32,16%	-	-	-
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1,88%	0,31%	-2,45%	-6,71%	-2,10%	9,07%	0,70%	2,395%	13,07%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	1,66%	7,05%	3,96%	9,90%	25,99%	-	0,20%	1,350%	3,66%
ELLEVEN II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1,48%	6,10%	3,43%	8,67%	12,18%	24,66%	0,70%	1,330%	4,05%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,88%	-	3,46%	7,22%	13,47%	-	0,70%	0,073%	0,64%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	-	-	-	-	-	-	0,70%	4,682%	-
IPCA + 7,00% ao ano	1,15%	5,52%	3,64%	8,83%	16,87%	35,30%	-	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	0,98%	5,27%	3,83%	8,28%	15,72%	-	1,65%	0,973%	0,66%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-39,37%	-47,08%	-46,97%	-47,13%	-43,26%	-34,37%	0,00%	-	-
IRF-M 1	1,07%	5,15%	3,45%	7,53%	14,67%	27,38%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,11%	5,15%	3,47%	7,49%	14,50%	26,91%	0,20%	0,173%	0,50%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,06%	5,13%	3,42%	7,42%	14,31%	26,86%	0,20%	0,183%	0,79%
Selic	1,06%	4,35%	3,26%	6,67%	13,86%	26,93%	-	-	-

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,04%	4,30%	3,22%	6,63%	13,86%	27,10%	0,20%	0,003%	0,02%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	1,03%	4,22%	3,15%	6,52%	13,60%	26,38%	0,15%	0,005%	0,02%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	7,70%	24,36%	33,42%	17,53%	-4,12%	4,42%	-	-	-
TOTAL MIX FIC AÇÕES	6,35%	12,66%	17,84%	9,59%	-6,75%	-5,45%	1,90%	11,851%	17,62%

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

Administrador	Valor	%
BANCO BRADESCO	11.451.724,18	51,39%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	3.277.588,85	14,71%
RJI CORRETORA DE VALORES	2.489.543,66	11,17%
BRIDGE ADMINISTRADORA DE RECURSOS	2.278.052,73	10,22%
CM Capital Markets DTVM	1.480.842,39	6,65%
Orla DTVM	689.281,23	3,09%
Única Administradora	617.334,33	2,77%

Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5	7.381.330,89	33,12%
CDI	4.917.265,88	22,07%
IRF-M 1	3.201.695,56	14,37%
IMA-B	2.859.443,88	12,83%
FIDC	2.170.123,62	9,74%
IDKA IPCA 2A	1.137.173,21	5,10%
AÇÕES - LIVRES	617.334,33	2,77%

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%
Acumulado no ano					297.302,57	1,58%	5,20%	30,34%	

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	2.200.916,06	558.000,00	0,00	2.859.443,88	100.527,82	3,64%	3,89%	3,94%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	254.109,21	0,00	0,00	260.076,68	5.967,47	2,35%	4,68%	2,35%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	872.884,90	0,00	0,00	889.256,80	16.371,90	1,88%	2,40%	1,88%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	2.571.015,23	0,00	0,00	2.613.734,50	42.719,27	1,66%	1,35%	1,66%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.119.074,48	0,00	0,00	1.137.173,21	18.098,73	1,62%	1,22%	1,62%
ELLEVEN II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.320.706,67	0,00	0,00	1.340.210,18	19.503,51	1,48%	1,33%	1,48%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.117.009,82	0,00	0,00	2.140.415,64	23.405,82	1,11%	0,17%	1,11%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.050.099,08	0,00	0,00	1.061.279,92	11.180,84	1,06%	0,18%	1,06%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.943.743,30	0,00	0,00	2.974.503,55	30.760,25	1,04%	0,00%	1,04%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	1.922.970,28	0,00	0,00	1.942.762,33	19.792,05	1,03%	0,01%	1,03%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1.466.500,50	0,00	0,00	1.480.842,39	14.341,89	0,98%	0,97%	0,98%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2.258.263,60	0,00	0,00	2.278.052,73	19.789,13	0,88%	0,07%	0,88%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1.142.455,71	0,00	0,00	689.281,23	-453.174,48	-39,67%	-	-39,37%
Total Renda Fixa					-130.715,80	-0,60%	1,11%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
TOTAL MIX FIC AÇÕES	580.470,87	0,00	0,00	617.334,33	36.863,46	6,35%	11,85%	6,35%
Total Renda Variável					36.863,46	6,35%	11,85%	