Relatório Analítico dos Investimentos em junho, 2º Trimestre e 1º semestre 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 (junho / 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	1.083.816,47	4,61%	193	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	D+1	Não há	428.176,94	1,82%	37	0,47%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.330.324,03	14,16%	111	0,63%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.156.275,93	4,91%	602	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.185.787,39	9,29%	1.331	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	908.837,10	3,86%	37	0,23%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	2.656.388,12	11,29%	60	1,25%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1461	Não há	2.326.644,03	9,89%	5	22,16%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	D+1471	Não há	266.705,58	1,13%	36	0,22%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	3.043.297,31	12,94%	381	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.986.293,47	8,44%	262	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	674.327,71	2,87%	71	0,35%	Artigo 7º, Inciso VI
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	1.517.763,28	6,45%	33	0,58%	Artigo 7º, Inciso VI
TOTAL MIX FIC AÇÕES	D+64	Não há	606.501,90	2,58%	58	7,13%	Artigo 8º, Inciso III
ELLEVEN II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	1.355.785,23	5,76%	4	4,11%	Desenquadrado - RF
		Total	**23.526.924,49**				

LEMA Economia & Finanças
Av. Dom Luís, 609 - Fortaleza - CE - Telefone: (85) 3085-8886

Enquadramentos na Resolução 3.922 / 4.392 / 4.604 e Política de Investimentos - base (junho / 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%	23.526.924,49
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	100,00%	8.184.380,76	34,79%	15.342.543,73
Artigo 7º, Inciso II	15,00%	15,00%	0,00	0,00%	3.529.038,67
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	80,00%	6.158.574,83	26,18%	12.662.964,76
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	30,00%	5.029.590,78	21,38%	2.028.486,57
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	20,00%	20,00%	0,00	0,00%	4.705.384,90
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	13,00%	2.192.090,99	9,32%	866.409,19
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	2,00%	0,00	0,00%	470.538,49
Desenquadrado - RF	0,00%	0,00%	1.355.785,23	5,76%	-1.355.785,23
Total Renda Fixa	100,00%	360,00	22.920.422,59	97,42%	

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	30,00%	0,00	0,00%	7.058.077,35
Artigo 8º, Inciso II	20,00%	20,00%	0,00	0,00%	4.705.384,90
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	606.501,90	2,58%	2.922.536,77
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.176.346,22
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.176.346,22
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.176.346,22
Total	30,00%	80,00	606.501,90	2,58%	

LEMA Economia & Finanças
Av. Dom Luís, 609 - Fortaleza - CE - Telefone: (85) 3085-8886

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	1,93%	16,15%	5,83%	16,15%	16,73%	32,26%	-	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1,85%	15,93%	5,68%	15,93%	15,92%	30,93%	0,20%	2,350%	9,81%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	1,68%	14,55%	5,12%	14,55%	15,13%	30,13%	0,20%	2,266%	8,99%
Selic	1,16%	6,73%	3,36%	6,73%	14,11%	27,66%	-	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,18%	6,72%	3,38%	6,72%	14,11%	27,85%	0,20%	0,013%	0,02%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	1,14%	6,55%	3,29%	6,55%	13,83%	27,11%	0,15%	0,001%	0,02%
IRF-M 1	1,08%	7,42%	3,25%	7,42%	14,96%	27,79%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,06%	7,38%	3,25%	7,38%	14,82%	27,31%	0,20%	0,120%	0,49%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,05%	7,36%	3,21%	7,36%	14,74%	27,24%	0,20%	0,116%	0,77%
IPCA + 7,00% ao ano	0,94%	7,95%	3,49%	7,95%	16,46%	35,74%	-	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1,23%	7,90%	3,50%	7,90%	15,97%	-	1,65%	0,156%	0,75%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-3,47%	-48,23%	-40,69%	-48,23%	-45,92%	-37,02%	0,00%	9,782%	-
IMA-B 5	0,94%	8,84%	3,31%	8,84%	16,94%	31,07%	-	-	-
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1,45%	2,52%	4,12%	2,52%	-1,62%	8,34%	0,70%	1,015%	13,01%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1,35%	-	3,03%	-	13,86%	-	0,70%	0,369%	0,71%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	1,34%	-	-	-	-	-	0,70%	1,178%	-
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	0,88%	8,79%	3,32%	8,79%	16,23%	-	0,20%	1,203%	3,69%

LEMA Economia & Finanças
Av. Dom Luís, 609 - Fortaleza - CE - Telefone: (85) 3085-8886

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
ELLEVEN II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,64%	7,33%	2,66%	7,33%	10,95%	22,72%	0,70%	1,188%	4,06%
IDKA IPCA 2 Anos	0,93%	8,58%	3,25%	8,58%	17,00%	31,47%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,88%	8,41%	3,32%	8,41%	16,74%	30,55%	0,20%	1,115%	3,11%

LEMA Economia & Finanças
Av. Dom Luís, 609 - Fortaleza - CE - Telefone: (85) 3085-8886

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	6,30%	18,86%	2,94%	18,86%	-2,93%	-3,09%	-	-	-
TOTAL MIX FIC AÇÕES	3,71%	10,69%	4,48%	10,69%	-4,95%	-10,27%	1,90%	9,585%	18,47%

LEMA Economia & Finanças
Av. Dom Luís, 609 - Fortaleza - CE - Telefone: (85) 3085-8886

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

Administrador	Valor	%
BANCO BRADESCO	12.100.119,40	51,43%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	3.342.063,32	14,21%
RJI CORRETORA DE VALORES	2.531.327,91	10,76%
BRIDGE ADMINISTRADORA DE RECURSOS	2.326.644,03	9,89%
CM Capital Markets DTVM	1.517.763,28	6,45%
Orla DTVM	674.327,71	2,87%
Única Administradora	606.501,90	2,58%
Santander Securities Services	428.176,94	1,82%

Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5	7.514.360,06	31,94%
CDI	5.029.590,78	21,38%
IMA-B	3.758.500,97	15,98%
IRF-M 1	3.269.603,86	13,90%
FIDC	2.192.090,99	9,32%
IDKA IPCA 2A	1.156.275,93	4,91%
AÇÕES - LIVRES	606.501,90	2,58%

LEMA Economia & Finanças
Av. Dom Luís, 609 - Fortaleza - CE - Telefone: (85) 3085-8886

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

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%
Maio	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%
Acumulado no ano					687.859,69	3,30%	7,45%	44,32%	

Acumulado no Ano

LEMA Economia & Finanças
Av. Dom Luís, 609 - Fortaleza - CE - Telefone: (85) 3085-8886

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de junho / 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	3.269.676,33	0,00	0,00	3.330.324,03	60.647,70	1,85%	2,35%	1,85%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	895.867,88	0,00	0,00	908.837,10	12.969,22	1,45%	1,02%	1,45%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2.295.575,08	0,00	0,00	2.326.644,03	31.068,95	1,35%	0,37%	1,35%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	263.190,01	0,00	0,00	266.705,58	3.515,57	1,34%	1,18%	1,34%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1.499.248,53	0,00	0,00	1.517.763,28	18.514,75	1,23%	0,16%	1,23%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	3.007.820,77	0,00	0,00	3.043.297,31	35.476,54	1,18%	0,01%	1,18%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	1.963.866,17	0,00	0,00	1.986.293,47	22.427,30	1,14%	0,00%	1,14%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.162.946,78	0,00	0,00	2.185.787,39	22.840,61	1,06%	0,12%	1,06%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.072.502,93	0,00	0,00	1.083.816,47	11.313,54	1,05%	0,12%	1,05%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	2.633.230,44	0,00	0,00	2.656.388,12	23.157,68	0,88%	1,20%	0,88%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.146.216,55	0,00	0,00	1.156.275,93	10.059,38	0,88%	1,11%	0,88%
ELLEVEN II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.347.178,78	0,00	0,00	1.355.785,23	8.606,45	0,64%	1,19%	0,64%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	0,00	430.000,00	0,00	428.176,94	-1.823,06	-0,42%	2,27%	1,68%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	699.085,47	0,00	0,00	674.327,71	-24.757,76	-3,54%	9,78%	-3,47%
			Total Renda Fixa		234.016,87	1,03%	1,06%	

LEMA Economia & Finanças
Av. Dom Luís, 609 - Fortaleza - CE - Telefone: (85) 3085-8886

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
TOTAL MIX FIC AÇÕES	584.809,96	0,00	0,00	606.501,90	21.691,94	3,71%	9,58%	3,71%
			Total Renda Variável		21.691,94	3,71%	9,58%	

LEMA Economia & Finanças
Av. Dom Luís, 609 - Fortaleza - CE - Telefone: (85) 3085-8886

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre / 2016

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	2.200.916,06	980.000,00	0,00	3.330.324,03	149.407,97	5,19%	5,68%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.943.743,30	0,00	0,00	3.043.297,31	99.554,01	3,38%	3,38%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	2.571.015,23	0,00	0,00	2.656.388,12	85.372,89	3,32%	3,32%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.117.009,82	0,00	0,00	2.185.787,39	68.777,57	3,25%	3,25%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2.258.263,60	0,00	0,00	2.326.644,03	68.380,43	3,03%	3,03%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	1.922.970,28	0,00	0,00	1.986.293,47	63.323,19	3,29%	3,29%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1.466.500,50	0,00	0,00	1.517.763,28	51.262,78	3,50%	3,50%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.119.074,48	0,00	0,00	1.156.275,93	37.201,45	3,32%	3,32%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	872.884,90	0,00	0,00	908.837,10	35.952,20	4,12%	4,12%
ELLEVEN II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.320.706,67	0,00	0,00	1.355.785,23	35.078,56	2,66%	2,66%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.050.099,08	0,00	0,00	1.083.816,47	33.717,39	3,21%	3,21%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	254.109,21	0,00	0,00	266.705,58	12.596,37	4,96%	-
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	0,00	430.000,00	0,00	428.176,94	-1.823,06	-0,42%	5,12%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1.142.455,71	0,00	0,00	674.327,71	-468.128,00	-40,98%	-40,69%
			Total Renda Fixa		270.673,75	1,19%	

LEMA Economia & Finanças
Av. Dom Luís, 609 - Fortaleza - CE - Telefone: (85) 3085-8886

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre / 2016

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	Instituição (%)
TOTAL MIX FIC AÇÕES	580.470,87	0,00	0,00	606.501,90	26.031,03	4,48%	4,48%
			Total Renda Variável		26.031,03	4,48%	

LEMA Economia & Finanças
Av. Dom Luís, 609 - Fortaleza - CE - Telefone: (85) 3085-8886

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre / 2016

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1.609.910,86	1.405.000,00	0,00	3.330.324,03	315.413,17	14,72%	15,93%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	1.945.858,45	517.000,00	0,00	2.656.388,12	193.529,67	8,52%	8,79%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.851.749,70	0,00	0,00	3.043.297,31	191.547,61	6,72%	6,72%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2.172.814,22	0,00	0,00	2.326.644,03	153.829,81	7,08%	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.035.565,35	0,00	0,00	2.185.787,39	150.222,04	7,38%	7,38%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	1.864.117,37	0,00	0,00	1.986.293,47	122.176,10	6,55%	6,55%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1.406.701,63	0,00	0,00	1.517.763,28	111.061,65	7,90%	7,90%
ELLEVEN II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.263.177,28	0,00	0,00	1.355.785,23	92.607,95	7,33%	7,33%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	1.079.090,50	0,00	1.156.275,93	77.185,43	7,15%	8,41%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.055.005,82	0,00	46.000,00	1.083.816,47	74.810,65	7,32%	7,36%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	0,00	254.109,21	0,00	266.705,58	12.596,37	4,96%	-
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	0,00	430.000,00	0,00	428.176,94	-1.823,06	-0,42%	14,55%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.144.570,32	0,00	0,00	908.837,10	-235.733,22	-20,60%	2,52%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1.302.452,35	0,00	0,00	674.327,71	-628.124,64	-48,23%	-48,23%
			Total Renda Fixa		629.299,53	3,13%	

LEMA Economia & Finanças
Av. Dom Luís, 609 - Fortaleza - CE - Telefone: (85) 3085-8886

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre / 2016

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	Instituição (%)
TOTAL MIX FIC AÇÕES	547.941,74	0,00	0,00	606.501,90	58.560,16	10,69%	10,69%
			Total Renda Variável		58.560,16	10,69%	

LEMA Economia & Finanças
Av. Dom Luís, 609 - Fortaleza - CE - Telefone: (85) 3085-8886

/