

Relatório Analítico dos Investimentos em julho 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 (julho / 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	1.094.738,49	4,55%	191	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.169.064,38	4,86%	604	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.848.820,51	16,01%	115	0,71%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.208.333,71	9,19%	1.325	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	D+1	Não há	437.915,03	1,82%	40	0,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	2.687.274,81	11,18%	61	1,18%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	922.132,57	3,84%	39	0,20%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1461	Não há	2.314.195,86	9,63%	5	22,16%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	D+1471	Não há	252.539,74	1,05%			Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	3.077.820,50	12,80%	382	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	2.007.991,90	8,35%	251	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	688.780,84	2,86%	71	0,35%	Artigo 7º, Inciso VI
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	1.534.030,24	6,38%	33	0,58%	Artigo 7º, Inciso VI
TOTAL MIX FIC AÇÕES	D+64	Não há	670.985,70	2,79%	59	7,15%	Artigo 8º, Inciso III
ELLEVEN II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	1.126.602,28	4,69%	4	4,11%	Desenquadrado - RF
Total			24.041.226,56				

Enquadramentos na Resolução 3.922 / 4.392 / 4.604 e Política de Investimentos - base (julho / 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%	24.041.226,56
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	100,00%	8.758.872,12	36,43%	15.282.354,44
Artigo 7º, Inciso II	15,00%	15,00%	0,00	0,00%	3.606.183,98
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	80,00%	80,00%	6.176.142,98	25,69%	13.056.838,27
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	30,00%	30,00%	5.085.812,40	21,15%	2.126.555,57
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'	20,00%	20,00%	0,00	0,00%	4.808.245,31
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	13,00%	2.222.811,08	9,25%	902.548,37
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'	5,00%	2,00%	0,00	0,00%	480.824,53
Desenquadrado - RF	0,00%	0,00%	1.126.602,28	4,69%	-1.126.602,28
Total Renda Fixa	100,00%	360,00	23.370.240,86	97,21%	

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	30,00%	0,00	0,00%	7.212.367,97
Artigo 8º, Inciso II	20,00%	20,00%	0,00	0,00%	4.808.245,31
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	670.985,70	2,79%	2.935.198,28
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.202.061,33
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.202.061,33
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.202.061,33
Total	30,00%	80,00	670.985,70	2,79%	

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	2,51%	19,06%	4,38%	16,82%	20,53%	34,07%	-	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	2,53%	18,86%	4,24%	16,69%	19,92%	32,78%	0,20%	1,907%	9,62%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	2,27%	17,15%	3,88%	14,71%	18,52%	31,62%	0,20%	1,803%	8,80%

IMA-B 5	1,21%	10,15%	2,97%	6,97%	16,28%	31,52%	-	-	-
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1,46%	4,02%	3,70%	1,15%	-1,35%	8,98%	0,70%	0,700%	13,03%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	1,16%	10,06%	2,81%	6,88%	15,53%	-	0,20%	0,753%	3,59%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,54%	-	1,59%	5,10%	12,03%	-	0,70%	2,023%	1,44%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	-5,31%	-	-2,90%	-	-	-	0,70%	-	-
ELLEVEN II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-16,90%	-10,81%	-15,94%	-13,05%	-9,19%	1,05%	0,70%	28,989%	18,14%

Selic	1,11%	7,91%	3,42%	6,78%	14,03%	27,87%	-	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIA DO DI	1,13%	7,93%	3,47%	6,80%	14,06%	28,07%	0,20%	0,015%	0,02%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIA DO DI	1,09%	7,72%	3,36%	6,61%	13,75%	27,32%	0,15%	0,000%	0,01%

IPCA + 7,00% ao ano	1,09%	9,13%	3,42%	7,18%	16,29%	36,36%	-	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1,92%	-47,23%	-0,29%	-47,12%	-45,55%	-36,25%	0,00%	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1,07%	9,05%	3,59%	7,56%	15,73%	-	1,65%	0,097%	0,75%

IRF-M 1	1,04%	8,53%	3,22%	6,78%	14,68%	27,91%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,03%	8,49%	3,17%	6,75%	14,55%	27,44%	0,20%	0,110%	0,47%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,01%	8,44%	3,15%	6,69%	14,43%	27,35%	0,20%	0,110%	0,77%
IDKA IPCA 2 Anos	0,91%	9,56%	2,49%	5,59%	15,90%	31,44%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,11%	9,61%	2,80%	6,55%	16,02%	30,88%	0,20%	0,697%	3,03%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	11,22%	32,20%	6,30%	41,83%	12,67%	2,65%	-	-	-
TOTAL MIX FIC AÇÕES	10,63%	22,46%	8,69%	28,08%	8,47%	-2,29%	1,90%	5,245%	18,57%

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

Administrador	Valor	%
BANCO BRADESCO	12.716.646,21	52,90%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	3.377.398,09	14,05%
BRIDGE ADMINISTRADORA DE RECURSOS	2.314.195,86	9,63%
RJI CORRETORA DE VALORES	2.301.274,59	9,57%
CM Capital Markets DTVM	1.534.030,24	6,38%
Orla DTVM	688.780,84	2,86%
Única Administradora	670.985,70	2,79%
Santander Securities Services	437.915,03	1,82%

Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5	7.302.745,26	30,38%
CDI	5.085.812,40	21,15%
IMA-B	4.286.735,54	17,83%
IRF-M 1	3.303.072,20	13,74%
FIDC	2.222.811,08	9,25%
IDKA IPCA 2A	1.169.064,38	4,86%
AÇÕES - LIVRES	670.985,70	2,79%

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%
Maiο	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%
Julho	23.526.924,49	433.000,00	0,00	24.041.226,56	81.302,07	0,34%	1,01%	33,62%	2,30%
Acumulado no ano					769.161,76	3,65%	8,54%	42,80%	

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	428.176,94	0,00	0,00	437.915,03	9.738,09	2,27%	1,80%	2,27%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	3.330.324,03	433.000,00	0,00	3.848.820,51	85.496,48	2,27%	1,91%	2,53%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	674.327,71	0,00	0,00	688.780,84	14.453,13	2,14%	-	-
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	908.837,10	0,00	0,00	922.132,57	13.295,47	1,46%	0,70%	1,46%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	2.656.388,12	0,00	0,00	2.687.274,81	30.886,69	1,16%	0,75%	1,16%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	3.043.297,31	0,00	0,00	3.077.820,50	34.523,19	1,13%	0,01%	1,13%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.156.275,93	0,00	0,00	1.169.064,38	12.788,45	1,11%	0,70%	1,11%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	1.986.293,47	0,00	0,00	2.007.991,90	21.698,43	1,09%	0,00%	1,09%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1.517.763,28	0,00	0,00	1.534.030,24	16.266,96	1,07%	0,10%	1,07%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.185.787,39	0,00	0,00	2.208.333,71	22.546,32	1,03%	0,11%	1,03%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.083.816,47	0,00	0,00	1.094.738,49	10.922,02	1,01%	0,11%	1,01%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2.326.644,03	0,00	0,00	2.314.195,86	-12.448,17	-0,54%	2,02%	-0,54%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	266.705,58	0,00	0,00	252.539,74	-14.165,84	-5,31%	-	-
ELLEVEN II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.355.785,23	0,00	0,00	1.126.602,28	-229.182,95	-16,90%	28,99%	-16,90%
Total Renda Fixa					16.818,27	0,07%	2,21%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
TOTAL MIX FIC AÇÕES	606.501,90	0,00	0,00	670.985,70	64.483,80	10,63%	5,24%	10,63%
Total Renda Variável					64.483,80	10,63%	5,24%	