Relatório Analítico dos Investimentos em agosto 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 (agosto / 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	1.183.279,97	4,80%	631	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	D+1	Não há	442.566,39	1,79%	41	0,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	4.297.418,44	17,42%	116	0,74%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.234.280,62	9,06%	1.336	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.104.603,61	4,48%	191	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	2.715.922,66	11,01%	67	0,88%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	933.461,63	3,78%	1	0,20%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1461	Não há	2.343.421,39	9,50%	5	22,16%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	D+1471	Não há	255.229,04	1,03%	35	0,23%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	3.115.308,70	12,63%	384	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	2.031.931,74	8,24%	246	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	1.551.164,17	6,29%		0,58%	Artigo 7º, Inciso VI
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	649.689,02	2,63%	71	0,32%	Artigo 7º, Inciso VI
TOTAL MIX FIC AÇÕES	D+64	Não há	674.104,93	2,73%	58	7,14%	Artigo 8º, Inciso III
ELLEVEN II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	1.138.941,94	4,62%	4	4,11%	Desenquadrado - RF
		Total	**24.671.324,25**				

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 (agosto / 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%	24.671.324,25
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	100,00%	9.262.149,03	37,54%	15.409.175,22
Artigo 7º, Inciso II	15,00%	15,00%	0,00	0,00%	3.700.698,64
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	80,00%	6.248.034,72	25,33%	13.489.024,68
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	30,00%	5.147.240,44	20,86%	2.254.156,84
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	20,00%	20,00%	0,00	0,00%	4.934.264,85
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	13,00%	2.200.853,19	8,92%	1.006.418,96
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	2,00%	0,00	0,00%	493.426,49
Desenquadrado - RF	0,00%	0,00%	1.138.941,94	4,62%	-1.138.941,94
Total Renda Fixa	100,00%	360,00	23.997.219,32	97,27%	

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	30,00%	0,00	0,00%	7.401.397,28
Artigo 8º, Inciso II	20,00%	20,00%	0,00	0,00%	4.934.264,85
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	674.104,93	2,73%	3.026.593,71
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.233.566,21
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.233.566,21
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.233.566,21
Total	30,00%	80,00	674.104,93	2,73%	

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

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDKA IPCA 2 Anos	1,29%	10,97%	3,16%	5,69%	17,70%	31,48%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,22%	10,94%	3,23%	6,39%	17,78%	30,85%	0,20%	0,732%	2,94%
Selic	1,22%	9,22%	3,53%	7,01%	14,15%	28,31%	-	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,22%	9,24%	3,57%	7,04%	14,18%	28,51%	0,20%	0,007%	0,02%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	1,19%	9,00%	3,47%	6,84%	13,86%	27,75%	0,15%	0,006%	0,01%
IRF-M 1	1,19%	9,83%	3,35%	6,89%	14,87%	28,36%	-	-	-
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,18%	9,72%	3,27%	6,81%	14,54%	27,78%	0,20%	0,054%	0,75%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,17%	9,76%	3,30%	6,83%	14,74%	27,89%	0,20%	0,051%	0,45%
IMA-B 5	1,09%	11,35%	3,27%	6,50%	18,11%	31,19%	-	-	-
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1,26%	-	2,08%	5,26%	12,47%	-	0,70%	0,810%	1,52%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1,23%	5,30%	4,20%	5,73%	0,60%	8,71%	0,70%	0,776%	12,95%
ELLEVEN II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1,10%	-9,84%	-15,46%	-13,24%	-7,75%	1,14%	0,70%	0,934%	18,06%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	1,07%	11,23%	3,14%	6,40%	17,65%	29,84%	0,20%	0,827%	3,45%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	1,06%	-	-3,02%	-	-	-	0,70%	0,688%	-
IPCA + 7,00% ao ano	1,06%	10,29%	3,13%	6,81%	16,60%	36,69%	-	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	2,32%	-46,01%	0,67%	-45,30%	-44,74%	-35,22%	0,00%	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1,12%	10,27%	3,46%	7,16%	15,87%	-	1,65%	0,390%	0,79%

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

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	0,89%	20,11%	5,41%	15,26%	25,51%	29,04%	-	-	-
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	1,06%	18,40%	5,10%	13,39%	23,45%	27,25%	0,20%	1,668%	8,47%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	0,83%	19,85%	5,30%	15,08%	24,87%	27,69%	0,20%	1,905%	9,30%

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

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	1,03%	33,57%	19,45%	35,30%	24,18%	-5,53%	-	-	-
TOTAL MIX FIC AÇÕES	0,46%	23,02%	15,27%	25,73%	18,50%	-9,21%	1,90%	6,755%	18,10%

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

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

Administrador	Valor	%
BANCO BRADESCO	13.265.185,15	53,77%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	3.417.560,59	13,85%
BRIDGE ADMINISTRADORA DE RECURSOS	2.343.421,39	9,50%
RJI CORRETORA DE VALORES	2.327.632,61	9,43%
CM Capital Markets DTVM	1.551.164,17	6,29%
Única Administradora	674.104,93	2,73%
Orla DTVM	649.689,02	2,63%
Santander Securities Services	442.566,39	1,79%

Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5	7.386.976,66	29,94%
CDI	5.147.240,44	20,86%
IMA-B	4.739.984,83	19,21%
IRF-M 1	3.338.884,23	13,53%
FIDC	2.200.853,19	8,92%
IDKA IPCA 2A	1.183.279,97	4,80%
AÇÕES - LIVRES	674.104,93	2,73%

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%
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%
Agosto	24.041.226,56	420.000,00	3.000,00	24.671.324,25	213.097,69	0,87%	0,98%	89,31%	0,89%
Acumulado no ano					982.259,45	4,56%	9,60%	47,49%	

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 agosto / 2016

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2.314.195,86	0,00	0,00	2.343.421,39	29.225,53	1,26%	0,81%	1,26%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	922.132,57	0,00	0,00	933.461,63	11.329,06	1,23%	0,78%	1,24%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	3.077.820,50	0,00	0,00	3.115.308,70	37.488,20	1,22%	0,01%	1,22%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.169.064,38	0,00	0,00	1.183.279,97	14.215,59	1,22%	0,73%	1,22%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	2.007.991,90	0,00	0,00	2.031.931,74	23.939,84	1,19%	0,01%	1,19%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.094.738,49	0,00	3.000,00	1.104.603,61	12.865,12	1,18%	0,05%	1,18%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.208.333,71	0,00	0,00	2.234.280,62	25.946,91	1,17%	0,05%	1,17%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1.534.030,24	0,00	0,00	1.551.164,17	17.133,93	1,12%	0,39%	1,12%
ELLEVEN II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.126.602,28	0,00	0,00	1.138.941,94	12.339,66	1,10%	0,93%	1,10%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	2.687.274,81	0,00	0,00	2.715.922,66	28.647,85	1,07%	0,83%	1,07%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	252.539,74	0,00	0,00	255.229,04	2.689,30	1,06%	0,69%	1,06%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	437.915,03	0,00	0,00	442.566,39	4.651,36	1,06%	1,67%	1,06%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	3.848.820,51	420.000,00	0,00	4.297.418,44	28.597,93	0,67%	1,91%	0,83%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	688.780,84	0,00	0,00	649.689,02	-39.091,82	-5,68%	-	-
			Total Renda Fixa		209.978,46	0,88%	0,72%	

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 agosto / 2016

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
TOTAL MIX FIC AÇÕES	670.985,70	0,00	0,00	674.104,93	3.119,23	0,46%	6,75%	0,46%
			Total Renda Variável		3.119,23	0,46%	6,75%	

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

/