

Relatório Analítico dos Investimentos em setembro e 3º Trimestre 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 (setembro / 2016)

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	2.260.449,40	8,90%	1.331	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	D+1	Não há	449.143,23	1,77%	43	0,41%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	4.364.990,03	17,19%	116	0,73%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.117.478,22	4,40%	188	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.199.030,56	4,72%	639	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	944.981,92	3,72%	38	0,20%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	2.753.927,64	10,84%	65	0,88%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1461	Não há	2.373.987,85	9,35%	5	22,16%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	D+1471	Não há	257.932,95	1,02%	34	0,23%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	3.633.755,41	14,31%	385	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	2.053.859,59	8,09%	240	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	590.836,13	2,33%	71	0,31%	Artigo 7º, Inciso VI
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	1.564.340,26	6,16%		0,58%	Artigo 7º, Inciso VI
TOTAL MIX FIC AÇÕES	D+64	Não há	677.482,68	2,67%	55	7,15%	Artigo 8º, Inciso III
ELLEVEN II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	1.154.379,32	4,55%	4	4,11%	Desenquadrado - RF
Total			25.396.575,19				

Enquadramentos na Resolução 3.922 / 4.392 / 4.604 e Política de Investimentos - base (setembro / 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%	25.396.575,19
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	100,00%	9.391.091,44	36,98%	16.005.483,75
Artigo 7º, Inciso II	15,00%	15,00%	0,00	0,00%	3.809.486,28
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	80,00%	80,00%	6.330.830,36	24,93%	13.986.429,79
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	30,00%	30,00%	5.687.615,00	22,40%	1.931.357,56
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'	20,00%	20,00%	0,00	0,00%	5.079.315,04
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	13,00%	2.155.176,39	8,49%	1.146.378,38
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'	5,00%	2,00%	0,00	0,00%	507.931,50
Desenquadrado - RF	0,00%	0,00%	1.154.379,32	4,55%	-1.154.379,32
Total Renda Fixa	100,00%	360,00	24.719.092,51	97,33%	

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	30,00%	0,00	0,00%	7.618.972,56
Artigo 8º, Inciso II	20,00%	20,00%	0,00	0,00%	5.079.315,04
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	677.482,68	2,67%	3.132.003,60
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.269.828,76
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.269.828,76
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.269.828,76
Total	30,00%	80,00	677.482,68	2,67%	

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	1,57%	22,00%	5,04%	11,16%	28,36%	35,87%	-	-	-
BRABESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1,57%	21,73%	5,01%	10,97%	27,76%	34,50%	0,20%	2,339%	7,09%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	1,49%	20,16%	4,90%	10,27%	26,36%	33,90%	0,20%	1,879%	6,35%

IDKA IPCA 2 Anos	1,50%	12,64%	3,74%	7,11%	18,43%	33,53%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,33%	12,42%	3,70%	7,14%	18,28%	32,52%	0,20%	0,545%	2,55%

IMA-B 5	1,41%	12,92%	3,76%	7,19%	18,83%	33,03%	-	-	-
BRABESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	1,40%	12,79%	3,67%	7,11%	18,62%	31,79%	0,20%	0,834%	2,81%
ELLEV EN II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1,36%	-8,61%	-14,86%	-12,59%	-4,51%	2,46%	0,70%	0,931%	17,83%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1,30%	-	2,03%	5,12%	12,58%	-	0,70%	0,781%	1,59%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1,23%	6,60%	3,98%	8,26%	1,38%	10,35%	0,70%	0,819%	12,74%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	1,06%	-	-3,29%	-	-	-	0,70%	0,846%	-

IRF-M 1	1,19%	11,14%	3,46%	6,82%	15,14%	28,83%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,17%	11,05%	3,42%	6,78%	14,99%	28,37%	0,20%	0,075%	0,40%
BRABESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,17%	11,00%	3,39%	6,71%	15,14%	28,28%	0,20%	0,075%	0,53%

Selic	1,11%	10,44%	3,47%	6,95%	14,15%	28,56%	-	-	-
BRABESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,10%	10,44%	3,49%	6,99%	14,15%	28,71%	0,20%	0,005%	0,02%
BRABESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	1,08%	10,18%	3,40%	6,81%	13,84%	27,99%	0,15%	0,009%	0,01%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA + 7,00% ao ano	0,65%	11,00%	2,82%	6,41%	16,07%	35,98%	-	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	0,85%	11,21%	3,07%	6,67%	15,78%	32,39%	1,65%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-6,01%	-49,25%	-1,98%	-41,86%	-48,61%	-39,75%	0,00%	-	-

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	0,80%	34,64%	13,28%	16,61%	29,53%	7,86%	-	-	-
TOTAL MIX FIC AÇÕES	0,50%	23,64%	11,70%	16,71%	20,84%	1,12%	1,90%	8,746%	18,22%

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

Administrador	Valor	%
BANCO BRADESCO	13.924.010,89	54,83%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	3.459.479,96	13,62%
BRIDGE ADMINISTRADORA DE RECURSOS	2.373.987,85	9,35%
RJI CORRETORA DE VALORES	2.357.294,19	9,28%
CM Capital Markets DTVM	1.564.340,26	6,16%
Única Administradora	677.482,68	2,67%
Orla DTVM	590.836,13	2,33%
Santander Securities Services	449.143,23	1,77%

Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5	7.485.209,68	29,47%
CDI	5.687.615,00	22,40%
IMA-B	4.814.133,26	18,96%
IRF-M 1	3.377.927,62	13,30%
FIDC	2.155.176,39	8,49%
IDKA IPCA 2A	1.199.030,56	4,72%
AÇÕES - LIVRES	677.482,68	2,67%

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%
Mai	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%
Setembro	24.671.324,25	482.000,00	0,00	25.396.575,19	243.250,94	0,97%	0,57%	170,52%	1,04%
Acumulado no ano					1.225.510,39	5,57%	10,22%	54,49%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de setembro / 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	4.297.418,44	0,00	0,00	4.364.990,03	67.571,59	1,57%	2,34%	1,57%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	442.566,39	0,00	0,00	449.143,23	6.576,84	1,49%	1,88%	1,49%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	2.715.922,66	0,00	0,00	2.753.927,64	38.004,98	1,40%	0,83%	1,40%
ELLEVEN II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.138.941,94	0,00	0,00	1.154.379,32	15.437,38	1,36%	0,93%	1,36%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.183.279,97	0,00	0,00	1.199.030,56	15.750,59	1,33%	0,55%	1,33%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2.343.421,39	0,00	0,00	2.373.987,85	30.566,46	1,30%	0,78%	1,30%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	933.461,63	0,00	0,00	944.981,92	11.520,29	1,23%	0,82%	1,23%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.234.280,62	0,00	0,00	2.260.449,40	26.168,78	1,17%	0,08%	1,17%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.104.603,61	0,00	0,00	1.117.478,22	12.874,61	1,17%	0,08%	1,17%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	2.031.931,74	0,00	0,00	2.053.859,59	21.927,85	1,08%	0,01%	1,08%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	255.229,04	0,00	0,00	257.932,95	2.703,91	1,06%	0,85%	1,06%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	3.115.308,70	482.000,00	0,00	3.633.755,41	36.446,71	1,01%	0,01%	1,10%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1.551.164,17	0,00	0,00	1.564.340,26	13.176,09	0,85%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	649.689,02	0,00	0,00	590.836,13	-58.852,89	-9,06%	-	-
Total Renda Fixa					239.873,19	0,98%	0,81%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
TOTAL MIX FIC AÇÕES	674.104,93	0,00	0,00	677.482,68	3.377,75	0,50%	8,75%	0,50%
Total Renda Variável					3.377,75	0,50%	8,75%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º 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	3.330.324,03	853.000,00	0,00	4.364.990,03	181.666,00	4,58%	5,01%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	3.043.297,31	482.000,00	0,00	3.633.755,41	108.458,10	3,40%	3,49%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	2.656.388,12	0,00	0,00	2.753.927,64	97.539,52	3,67%	3,67%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.185.787,39	0,00	0,00	2.260.449,40	74.662,01	3,42%	3,42%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	1.986.293,47	0,00	0,00	2.053.859,59	67.566,12	3,40%	3,40%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2.326.644,03	0,00	0,00	2.373.987,85	47.343,82	2,03%	2,03%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1.517.763,28	0,00	0,00	1.564.340,26	46.576,98	3,07%	3,07%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.156.275,93	0,00	0,00	1.199.030,56	42.754,63	3,70%	3,70%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.083.816,47	0,00	3.000,00	1.117.478,22	36.661,75	3,39%	3,39%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	908.837,10	0,00	0,00	944.981,92	36.144,82	3,98%	3,98%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	428.176,94	0,00	0,00	449.143,23	20.966,29	4,90%	4,90%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	266.705,58	0,00	0,00	257.932,95	-8.772,63	-3,29%	-3,29%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	674.327,71	0,00	0,00	590.836,13	-83.491,58	-12,38%	-1,98%
ELLEVEN II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.355.785,23	0,00	0,00	1.154.379,32	-201.405,91	-14,86%	-14,86%
Total Renda Fixa					466.669,92	1,94%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre / 2016

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
TOTAL MIX FIC AÇÕES	606.501,90	0,00	0,00	677.482,68	70.980,78	11,70%	11,70%
Total Renda Variável					70.980,78	11,70%	