Relatório de Monitoramento Semanal

25-10-2016

Fundo:	Fechamento				Últimos 5 dias				
LIBRA	jun/16	jul/16	ago/16	set/16	19/10/16	20/10/16	21/10/16	24/10/16	25/10/16
BRL k									
Patrimônio Líquido	**109.795**	**103.569**	**114.454**	**111.988**	**108.125**	**108.333**	**108.499**	**108.619**	**108.813**
Cota Subordinada	47.720	47.100	50.947	47.549	47.539	47.705	47.830	47.908	48.061
Cota Sênior 3	6.425	0	0	0	0	0	0	0	0
Cota Sênior 4	29.120	29.556	30.041	30.491	26.358	26.377	26.395	26.414	26.432
Cota Sênior 5	26.531	26.913	33.466	33.949	34.228	34.251	34.274	34.297	34.320
Ativos	**115.730**	**111.154**	**119.883**	**115.400**	**112.203**	**111.740**	**111.977**	**110.976**	**112.879**
Direitos Creditórios	94.355	93.264	83.559	88.553	90.357	91.164	93.507	93.250	94.604
dc a vencer	87.476	85.992	76.700	82.478	84.765	85.609	88.138	87.018	88.709
dc vencido	6.879	7.271	6.858	6.076	5.592	5.555	5.369	6.232	5.895
Títulos Públicos	20.914	17.735	36.187	26.690	21.640	20.361	18.260	17.432	1.528
compromissada	19.490	16.245	34.725	25.194	20.095	18.815	16.720	15.885	0
ntn [venc 15/8/2050]	0	0	0	0	0	0	124	124	123
ntnb [venc 15/5/2055]	350	366	367	376	388	389	387	389	384
ntnb [venc 15/8/2050]	1.074	1.124	1.095	1.120	1.156	1.157	1.029	1.034	1.022
Conta Corrente	461	155	138	157	206	216	210	295	16.747
tesouraria	461	155	138	157	206	216	210	295	16.747
PDD	**-3.680**	**-4.460**	**-3.687**	**-2.250**	**-2.192**	**-2.193**	**-2.243**	**-2.286**	**-2.271**
Provisões	**-2.252**	**-3.125**	**-1.742**	**-1.162**	**-1.886**	**-1.215**	**-1.235**	**-72**	**-1.796**
Cotas	55	55	55	0	-8	-8	-8	-8	-8
Despesas	-100	-849	-102	-99	-59	-62	-66	-69	-73
Direitos Creditórios conciliação	-2.206	-2.330	-1.696	-1.063	-1.820	-1.145	-1.162	5	-1.715
Rentabilidades									
Cota Subordinada	0,73%	-1,30%	8,17%	5,35%	0,35%	0,35%	0,26%	0,16%	0,32%
Cota Sênior 3	1,34%	0,60%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
Cota Sênior 4	1,57%	1,50%	1,64%	1,50%	0,07%	0,07%	0,07%	0,07%	0,07%
Cota Sênior 5	1,51%	1,44%	1,58%	1,44%	0,07%	0,07%	0,07%	0,07%	0,07%
Rentabilidade (%CDI)									
Cota Subordinada	63%	-117%	673%	483%	658%	676%	508%	316%	619%
Cota Sênior 3	115%	54%	0%	0%	0%	0%	0%	0%	0%
Cota Sênior 4	135%	135%	135%	135%	135%	137%	135%	135%	135%
Cota Sênior 5	130%	130%	130%	130%	130%	132%	130%	130%	130%
Amortizações/Resgates									
Cota Subordinada	0	0	0	6.000	0	0	0	0	0
Cota Sênior 3	6.398	6.464	0	0	0	0	0	0	0
Cota Sênior 4	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Cota Sênior 5	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Aportes									
Cota Subordinada	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Cota Sênior 3	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Cota Sênior 4	0	0	0	0	0	0	0	0	0
Cota Sênior 5	6.048	0	6.076	0	0	0	0	0	0
Indicadores									
Cota Subordinada JR / PL	43%	45%	45%	42%	44%	44%	44%	44%	44%
Cotas Subordinadas / PL	43%	45%	45%	42%	44%	44%	44%	44%	44%
PL / Cotas Seniores	177%	183%	180%	174%	178%	179%	179%	179%	179%
Ativos / PL	105%	107%	105%	103%	104%	103%	103%	102%	104%
DC / PL	86%	90%	73%	79%	84%	84%	86%	86%	87%
Caixa / PL	19%	17%	32%	24%	20%	19%	17%	16%	17%
Vencidos / DC	7%	8%	8%	7%	6%	6%	6%	7%	6%
PDD / DC	-3,9%	-4,8%	-4,4%	-2,5%	-2,4%	-2,4%	-2,4%	-2,5%	-2,4%
Efeito PDD[1]	-0,35%	-1,64%	1,56%	2,83%	0,05%	0,00%	-0,10%	-0,09%	0,03%
Rent. Cota JR sem Efeito PDD[2]	1,08%	0,35%	6,60%	2,53%	0,30%	0,35%	0,37%	0,25%	0,29%
Rent. Cota JR sem Efeito PDD/CDI[3]	93%	31%	544%	228%	567%	681%	711%	490%	560%

[1] Demonstra a variação da PDD em relação a Cota Subordinada Júnior no período.
[2] Demonstra a Rentabilidade da Cota Subordinada Júnior sem o Efeito PDD no período.
[3] Demonstra a Rentabilidade da Cota Subordinada Júnior sem o Efeito PDD em relação ao CDI no período.

RENTABILIDADE PASSADA NÃO REPRESENTA GARANTIA DE RENTABILIDADE FUTURA. A RENTABILIDADE DIVULGADA NÃO É LÍQUIDA DE IMPOSTOS. FUNDOS DE INVESTIMENTO NÃO CONTAM COM GARANTIA DO ADMINISTRADOR, DO GESTOR, DE QUALQUER MECANISMO DE SEGURO OU FUNDO GARANTIDOR DE CRÉDITO – FGC.

ANBIMA A presente instituição aderiu ao Código ANBIMA de Regulação e Melhores Práticas para os Fundos de Investimento.