

# Relatório Analítico dos Investimentos em outubro de 2017



Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (outubro / 2017)

Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	1.958.088,69	56,12%	50,00%	75,00%	100,00%	1.531.234,03
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	30,00%	1.046.796,82
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	15,00%	523.398,41
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	3,00%	5,00%	15,00%	523.398,41
Artigo 8º, Inciso IV	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	174.466,14
DF - Artigo 6º	100,00%	975,69	0,03%	0,00%	0,00%	0,00%	-975,69
<b>Total Carteira</b>		<b>1.959.064,38</b>					

RENDA FIXA	3.490.298,41	178,16%
------------	--------------	---------

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: outubro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	1.958.088,69	56,10%	50,00%	95,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso I	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
DF - Artigo 6º	975,69	0,03%	0,00%	0,00%
<b>Total</b>	<b>1.959.064,38</b>	<b>56,13%</b>	<b>62,00</b>	<b>265,00</b>

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (outubro / 2017)

Artigo 14º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR)

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	3.099.801,57	88,81%	0,00%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	389.521,15	11,16%	0,00%

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (outubro / 2017)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	0,643%	8,72%	2,10%	4,70%	11,08%	26,70%	-	-	-
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	0,63%	8,63%	2,05%	4,69%	10,92%	26,17%	0,20%	0,008%	0,11%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,56%	7,86%	1,83%	4,15%	10,07%	24,57%	1,00%	0,010%	0,12%
IRF-M 1	0,620%	9,81%	2,28%	5,22%	12,29%	28,83%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,61%	9,60%	2,21%	5,11%	12,01%	28,25%	0,10%	0,077%	0,68%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,60%	9,63%	2,21%	5,13%	12,05%	28,29%	0,20%	0,079%	0,68%
IDKA PRÉ 2 ANOS	0,209%	14,22%	2,90%	7,55%	17,38%	43,28%	-	-	-
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	0,17%	13,73%	2,78%	7,23%	16,82%	-	0,20%	0,902%	4,10%
IMA Geral	0,128%	11,83%	2,55%	5,82%	13,93%	38,11%	-	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	0,03%	12,12%	2,50%	5,78%	14,24%	39,00%	0,25%	1,038%	5,27%
IMA-B	-0,382%	12,73%	2,78%	5,80%	14,59%	44,31%	-	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	-0,42%	12,93%	2,81%	5,87%	14,85%	44,26%	0,20%	1,855%	9,91%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,43%	12,72%	2,76%	5,75%	14,57%	43,84%	0,30%	1,830%	9,76%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (outubro / 2017)

Administrador	Valor	%
BANCO BRADESCO	3.099.801,57	88,81%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	389.521,15	11,16%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	975,69	0,03%

Sub-segmento	Valor	%
IDKA PRÉ 2A	1.139.065,01	32,64%
IMA-B	991.770,01	28,42%
IRF-M 1	819.023,68	23,47%
IMA-GERAL	491.523,44	14,08%
CDI	47.940,58	1,37%
DISP. FINANCEIRA	975,69	0,03%

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

**Acumulado no Ano**

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	2.411.785,74	59.435,95	95.085,59	2.402.215,62	26.079,52	1,08%	0,89%	121,24%	0,63%
Fevereiro	2.402.215,62	2.764.200,70	2.634.108,04	2.556.075,35	23.767,07	0,46%	0,75%	61,46%	0,55%
Março	2.556.075,35	274.647,05	60.671,74	2.802.304,55	32.253,89	1,16%	0,78%	148,41%	0,81%
Abril	2.802.304,55	251.578,79	28.129,85	3.041.917,35	16.163,86	0,53%	0,56%	95,80%	0,80%
Maiο	3.041.917,35	102.784,07	103.139,17	3.048.066,88	6.504,63	0,21%	0,82%	26,03%	5,49%
Junho	3.048.066,88	1.307.443,87	1.205.200,02	3.177.109,03	26.798,30	0,85%	0,26%	332,76%	1,34%
Julho	3.177.109,03	229.990,38	103.702,28	3.382.540,72	79.143,59	2,40%	0,73%	329,13%	1,12%
Agosto	3.382.540,72	94.681,64	90.580,08	3.424.232,31	37.590,03	1,11%	0,72%	153,26%	0,92%
Setembro	3.424.232,31	92.003,81	87.158,34	3.476.102,26	47.024,48	1,37%	0,62%	219,67%	0,77%
Outubro	3.476.102,26	100.462,07	90.373,67	3.489.322,72	3.132,06	0,09%	0,91%	9,89%	0,98%
Acumulado no ano					298.457,43	9,65%	7,27%	132,67%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de outubro / 2017

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	814.157,45	0,00	0,00	819.008,41	4.850,96	0,60%	0,08%	0,60%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15,18	0,00	0,00	15,27	0,09	0,59%	0,08%	0,61%
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	87.240,63	30.000,00	76.776,24	41.057,57	593,18	0,51%	0,01%	0,63%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	20.289,52	112,45	13.597,43	6.883,01	78,47	0,38%	0,01%	0,56%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	1.137.152,50	0,00	0,00	1.139.065,01	1.912,51	0,17%	0,90%	0,17%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	421.267,00	70.349,62	0,00	491.523,44	-93,18	-0,02%	1,04%	0,03%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	611.704,41	0,00	0,00	609.147,14	-2.557,27	-0,42%	1,85%	-0,42%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	384.275,57	0,00	0,00	382.622,87	-1.652,70	-0,43%	1,83%	-0,43%
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>3.132,06</b>	<b>0,09%</b>	<b>0,98%</b>	