

# Relatório Analítico dos Investimentos em fevereiro de 2017



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

Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	1.040.167,79	40,69%	50,00%	75,00%	100,00%	1.515.907,56
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	30,00%	766.822,61
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	15,00%	383.411,30
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	0,00	0,00%	3,00%	5,00%	15,00%	383.411,30
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	127.803,77
DF - Artigo 6º	100,00%	44.298,07	1,73%	0,00%	0,00%	0,00%	-44.298,07
Total Carteira		1.084.465,86					

RENDA FIXA	2.600.373,42	239,78%
------------	--------------	---------

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: fevereiro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	1.040.167,79	40,00%	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	44.298,07	1,70%	0,00%	0,00%
<b>Total</b>	<b>1.084.465,86</b>	<b>41,70%</b>	<b>62,00</b>	<b>265,00</b>

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	3,849%	5,79%	8,86%	9,92%	26,69%	38,66%	-	-	-
BRABESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	3,95%	5,95%	9,14%	10,32%	27,01%	38,37%	0,20%	1,937%	7,54%
IDKA PRÉ 2 ANOS	1,648%	3,83%	5,84%	9,96%	21,57%	34,49%	-	-	-
BRABESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	1,65%	3,80%	5,77%	9,77%	-	-	0,20%	0,796%	-
IRF-M 1	1,007%	2,31%	3,53%	6,86%	14,23%	30,27%	-	-	-
BRABESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1,01%	2,27%	3,47%	6,77%	14,07%	29,93%	0,20%	0,076%	0,30%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,99%	2,26%	3,45%	6,72%	13,95%	29,58%	0,10%	0,083%	0,31%
CDI	0,864%	1,96%	3,10%	6,43%	13,88%	29,35%	-	-	-
BRABESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	0,85%	1,92%	3,02%	6,26%	13,54%	28,68%	0,20%	0,005%	0,44%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,80%	1,83%	2,90%	6,03%	13,03%	27,35%	1,00%	0,007%	0,08%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

Administrador	Valor	%
BANCO BRADESCO	2.539.948,48	97,68%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	44.298,07	1,70%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	16.126,87	0,62%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	1.102.048,53	42,38%
IDKA PRÉ 2A	1.039.527,74	39,98%
IMA-B	252.245,63	9,70%
CDI	162.253,45	6,24%
DISP. FINANCEIRA	44.298,07	1,70%

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%
Acumulado no ano					49.846,59	1,55%	1,65%	93,89%	

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	244.781,80	0,00	247.444,82	0,00	2.663,02	1,09%	0,72%	1,48%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	812.646,21	0,00	820.308,50	0,00	7.662,29	0,94%	0,61%	1,33%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.035.889,78	7.303,58	1.051.020,50	640,05	8.467,19	0,81%	0,08%	0,99%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	0,00	250.790,72	0,00	252.245,63	1.454,91	0,58%	1,94%	3,95%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	175.090,92	91,20	160.603,21	15.486,82	907,91	0,52%	0,01%	0,80%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	133.806,90	206.705,87	341.888,21	0,00	1.375,44	0,40%	0,02%	0,89%
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	0,00	159.240,93	12.842,80	146.766,63	368,50	0,23%	0,00%	0,85%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,00	1.100.000,00	0,00	1.101.408,48	1.408,48	0,13%	0,08%	1,01%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	0,00	1.040.068,40	0,00	1.039.527,74	-540,66	-0,05%	0,80%	1,65%
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>23.767,08</b>	<b>0,94%</b>	<b>0,55%</b>	