

Relatório Analítico dos Investimentos em março e 1º Trimestre de 2017



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

Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	1.061.172,45	37,87%	50,00%	75,00%	100,00%	1.741.132,10
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	30,00%	840.691,37
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	15,00%	420.345,68
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	0,00	0,00%	3,00%	5,00%	15,00%	420.345,68
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	140.115,23
DF - Artigo 6º	100,00%	1,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-1,00
Total Carteira		1.061.173,45					

RENDA FIXA	2.802.305,55	264,08%
------------	--------------	---------

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: março / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	1.061.172,45	37,87%	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	1,00	0,00%	0,00%	0,00%
Total	1.061.173,45	37,87%	62,00	265,00

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDKA PRÉ 2 ANOS	1,469%	5,36%	5,36%	9,38%	19,88%	36,40%	-	-	-
BRDESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	1,43%	5,28%	5,28%	9,19%	-	-	0,20%	1,151%	-
IRF-M 1	1,124%	3,46%	3,46%	6,79%	14,08%	30,52%	-	-	-
BRDESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1,11%	3,40%	3,40%	6,70%	13,89%	30,14%	0,20%	0,130%	0,30%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,10%	3,39%	3,39%	6,65%	13,82%	29,85%	0,10%	0,130%	0,30%
CDI	1,050%	3,03%	3,03%	6,37%	13,75%	29,37%	-	-	-
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	1,03%	2,97%	2,97%	6,21%	13,42%	28,69%	0,20%	0,000%	0,44%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,97%	2,82%	2,82%	5,95%	12,94%	27,36%	1,00%	0,000%	0,09%
IMA-B	1,045%	6,89%	6,89%	9,36%	21,56%	40,51%	-	-	-
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	1,06%	7,08%	7,08%	9,67%	22,16%	40,35%	0,20%	2,130%	6,37%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,05%	6,96%	6,96%	9,42%	21,57%	40,08%	0,30%	2,060%	6,13%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

Administrador	Valor	%
BANCO BRADESCO	2.599.036,09	92,75%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	203.268,46	7,25%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	1,00	0,00%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	1.165.041,11	41,57%
IDKA PRÉ 2A	1.054.404,87	37,63%
IMA-B	435.101,15	15,53%
CDI	147.757,42	5,27%
DISP. FINANCEIRA	1,00	0,00%

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%
Acumulado no ano					82.100,48	2,73%	2,44%	111,62%	

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	1.039.527,74	0,00	0,00	1.054.404,87	14.877,13	1,43%	1,15%	1,43%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1.101.408,48	45.455,80	1.212,18	1.158.273,53	12.621,43	1,10%	0,13%	1,11%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	252.245,63	0,00	0,00	254.931,73	2.686,10	1,06%	2,13%	1,06%
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	146.766,63	0,00	16.823,98	131.425,96	1.483,31	1,01%	0,00%	1,03%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	15.486,82	4.590,80	3.893,33	16.331,46	147,17	0,73%	0,00%	0,97%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	640,05	11.619,00	5.525,41	6.767,58	33,94	0,28%	0,13%	1,10%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	212.981,45	33.216,84	180.169,42	404,81	0,19%	2,06%	1,05%
				Total Renda Fixa	32.253,89	1,16%	0,81%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre / 2017

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.022.999,96	18.922,58	1.056.545,91	6.767,58	21.390,95	2,36%	3,39%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	803.938,05	0,00	820.308,50	0,00	16.370,45	2,04%	3,87%
BRADERCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	0,00	1.040.068,40	0,00	1.054.404,87	14.336,47	1,38%	5,28%
BRADERCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,00	1.145.455,80	1.212,18	1.158.273,53	14.029,91	1,23%	3,40%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	242.027,78	0,00	247.444,82	0,00	5.417,04	2,24%	4,05%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	0,00	250.790,72	0,00	254.931,73	4.141,01	1,65%	7,08%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	184.864,81	4.682,00	176.129,76	16.331,46	2.914,41	2,27%	2,82%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	73.822,26	266.141,82	342.149,28	0,00	2.185,20	1,01%	3,09%
BRADERCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	0,00	159.240,93	29.666,78	131.425,96	1.851,81	1,24%	2,97%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	212.981,45	33.216,84	180.169,42	404,81	0,19%	6,96%
Total Renda Fixa					83.042,06	3,28%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre / 2017

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	84.132,88	0,00	83.191,30	0,00	-941,58	-1,12%	2,59%
			Total Renda Variável		-941,58	-1,12%	