

# Relatório Analítico dos Investimentos em abril de 2017



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

Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	1.067.704,85	35,10%	50,00%	75,00%	100,00%	1.974.212,50
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	30,00%	912.575,21
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	15,00%	456.287,60
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	0,00	0,00%	3,00%	5,00%	15,00%	456.287,60
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	152.095,87
DF - Artigo 6º	100,00%	139,94	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-139,94
Total Carteira		1.067.844,79					

RENDA FIXA	3.042.057,29	284,88%
------------	--------------	---------

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: abril / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	1.067.704,85	35,10%	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	139,94	0,00%	0,00%	0,00%
<b>Total</b>	<b>1.067.844,79</b>	<b>35,10%</b>	<b>62,00</b>	<b>265,00</b>

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M 1	0,874%	4,36%	3,04%	6,72%	13,86%	30,56%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,86%	4,27%	2,97%	6,56%	13,53%	29,85%	0,10%	0,162%	0,29%
BRDESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,85%	4,28%	2,99%	6,59%	13,64%	29,96%	0,20%	0,162%	0,29%
IDKA PRÉ 2 ANOS	0,807%	6,21%	3,97%	9,15%	17,40%	36,28%	-	-	-
BRDESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	0,74%	6,06%	3,87%	8,94%	-	-	0,20%	0,875%	-
CDI	0,785%	3,84%	2,72%	6,09%	13,45%	29,16%	-	-	-
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	0,77%	3,77%	2,68%	5,95%	13,13%	28,49%	0,20%	0,015%	0,44%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,73%	3,57%	2,53%	5,68%	12,72%	27,15%	1,00%	0,014%	0,09%
IMA-B	-0,322%	6,55%	4,60%	8,31%	16,59%	36,72%	-	-	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,35%	6,59%	4,61%	8,34%	16,62%	36,21%	0,30%	1,889%	5,82%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	-0,39%	6,67%	4,65%	8,48%	16,92%	36,35%	0,20%	1,972%	6,03%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

Administrador	Valor	%
BANCO BRADESCO	2.746.895,94	90,30%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	295.021,41	9,70%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	139,94	0,00%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	1.173.604,39	38,58%
IDKA PRÉ 2A	1.062.214,96	34,92%
IMA-B	675.988,07	22,22%
CDI	130.109,93	4,28%
DISP. FINANCEIRA	139,94	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%
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%
Acumulado no ano					98.264,34	3,28%	3,02%	108,68%	

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1.158.273,53	0,00	0,00	1.168.114,50	9.840,97	0,85%	0,16%	0,85%
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	131.425,96	0,00	19.120,77	113.281,93	976,74	0,74%	0,01%	0,77%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	1.054.404,87	0,00	0,00	1.062.214,96	7.810,09	0,74%	0,87%	0,74%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	16.331,46	722,37	343,65	16.828,00	117,82	0,69%	0,01%	0,73%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.767,58	7.303,58	8.665,43	5.489,89	84,16	0,60%	0,16%	0,86%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	180.169,42	93.552,84	0,00	272.703,52	-1.018,74	-0,37%	1,89%	-0,35%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	254.931,73	150.000,00	0,00	403.284,55	-1.647,18	-0,41%	1,97%	-0,39%
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>16.163,86</b>	<b>0,53%</b>	<b>0,80%</b>	