

Relatório Analítico dos Investimentos em maio de 2017



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

Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	1.086.283,95	35,64%	50,00%	75,00%	100,00%	1.961.782,93
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	30,00%	914.420,06
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	15,00%	457.210,03
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	0,00	0,00%	3,00%	5,00%	15,00%	457.210,03
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	152.403,34
DF - Artigo 6º	100,00%	51,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-51,00
Total Carteira		1.086.334,95					

RENDA FIXA	3.048.117,88	280,59%
------------	--------------	---------

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: maio / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	1.086.283,95	35,64%	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	51,00	0,00%	0,00%	0,00%
Total	1.086.334,95	35,64%	62,00	265,00

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDKA PRÉ 2 ANOS	1,396%	8,54%	3,02%	8,54%	17,61%	37,08%	-	-	-
BRDESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	0,62%	6,71%	2,81%	8,74%	-	-	0,20%	5,521%	-
IRF-M 1	0,886%	6,25%	2,69%	6,25%	13,46%	30,44%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,89%	5,20%	2,87%	6,42%	13,36%	29,82%	0,10%	0,964%	0,66%
BRDESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,88%	5,20%	2,86%	6,43%	13,43%	29,97%	0,20%	0,982%	0,67%
CDI	0,808%	5,65%	2,54%	5,65%	12,85%	28,75%	-	-	-
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	0,91%	4,71%	2,74%	5,85%	12,94%	28,42%	0,20%	0,005%	0,44%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,82%	4,42%	2,54%	5,52%	12,44%	27,01%	1,00%	0,007%	0,10%
IMA-B	0,164%	5,46%	-1,34%	5,46%	13,32%	32,28%	-	-	-
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	-1,18%	5,40%	-0,52%	8,57%	15,71%	31,29%	0,20%	13,476%	9,95%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,24%	5,27%	-0,55%	8,31%	15,34%	31,14%	0,30%	13,329%	9,78%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

Administrador	Valor	%
BANCO BRADESCO	2.687.198,82	88,16%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	360.868,06	11,84%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	51,00	0,00%

Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	1.139.797,71	37,39%
IDKA PRÉ 2A	1.068.766,49	35,06%
IMA-B	725.281,99	23,79%
CDI	114.220,69	3,75%
DISP. FINANCEIRA	51,00	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%
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%
Mai	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%
Acumulado no ano					104.768,97	3,50%	3,86%	90,58%	

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	113.281,93	0,00	16.635,15	97.645,34	998,56	0,88%	0,01%	0,91%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1.168.114,50	0,00	56.098,55	1.122.280,25	10.264,30	0,88%	0,98%	0,88%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	16.828,00	0,00	388,93	16.575,35	136,28	0,81%	0,01%	0,82%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	1.062.214,96	0,00	0,00	1.068.766,49	6.551,53	0,62%	5,52%	0,62%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.489,89	11.960,21	0,00	17.517,46	67,36	0,39%	0,96%	0,89%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	403.284,55	0,00	0,00	398.506,74	-4.777,81	-1,18%	13,48%	-1,18%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	272.703,52	90.823,86	30.016,54	326.775,25	-6.735,59	-1,85%	13,33%	-1,24%
				Total Renda Fixa	6.504,63	0,21%	5,49%	