

Relatório Analítico dos Investimentos em julho de 2017



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

Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	1.820.145,99	53,81%	50,00%	75,00%	100,00%	1.562.394,73
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	30,00%	1.014.762,22
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	15,00%	507.381,11
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	0,00	0,00%	3,00%	5,00%	15,00%	507.381,11
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	169.127,04
DF - Artigo 6º	100,00%	52,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-52,00
Total Carteira		1.820.197,99					

RENDA FIXA	3.382.592,72	185,84%
------------	--------------	---------

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: julho / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	1.820.145,99	53,81%	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	52,00	0,00%	0,00%	0,00%
Total	1.820.197,99	53,81%	62,00	265,00

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	3,998%	9,67%	2,93%	7,66%	14,97%	38,57%	-	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	4,06%	9,85%	2,98%	7,77%	15,43%	38,22%	0,20%	2,320%	10,02%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4,01%	9,69%	2,91%	7,66%	15,18%	38,09%	0,30%	2,271%	9,85%
IMA Geral	2,339%	9,05%	3,19%	7,11%	14,99%	34,75%	-	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	2,51%	9,38%	3,20%	7,33%	15,80%	35,29%	0,25%	1,122%	5,34%
IDKA PRÉ 2 ANOS	2,272%	11,00%	4,51%	8,67%	18,95%	37,55%	-	-	-
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	2,24%	10,66%	4,34%	8,37%	18,38%	-	0,20%	0,882%	4,12%
IRF-M 1	1,049%	7,36%	2,87%	5,99%	13,48%	30,14%	-	-	-
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,06%	7,26%	2,87%	5,94%	13,28%	29,62%	0,20%	0,192%	0,67%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,06%	7,23%	2,83%	5,89%	13,20%	29,51%	0,10%	0,212%	0,67%
CDI	0,797%	6,49%	2,55%	5,35%	12,51%	28,27%	-	-	-
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	0,79%	6,45%	2,58%	5,33%	12,30%	27,72%	0,20%	0,010%	0,44%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,71%	5,92%	2,28%	4,86%	11,57%	26,18%	1,00%	0,009%	0,09%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

Administrador	Valor	%
BANCO BRADESCO	2.999.835,08	88,68%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	382.705,64	11,31%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	52,00	0,00%

Sub-segmento	Valor	%
IDKA PRÉ 2A	1.108.303,51	32,76%
IMA-B	958.663,93	28,34%
IRF-M 1	711.842,48	21,04%
IMA-GERAL	411.100,96	12,15%
CDI	192.629,84	5,69%
DISP. FINANCEIRA	52,00	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%
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%
Acumulado no ano					210.710,86	6,88%	4,89%	140,81%	

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	569.401,48	0,00	0,00	592.506,88	23.105,40	4,06%	2,32%	4,06%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	327.392,99	25.408,45	0,00	366.157,05	13.355,61	3,79%	2,27%	4,01%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	401.017,40	0,00	0,00	411.100,96	10.083,56	2,51%	1,12%	2,51%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	1.084.063,60	0,00	0,00	1.108.303,51	24.239,91	2,24%	0,88%	2,24%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	501.134,93	204.580,94	0,00	711.827,54	6.111,67	0,87%	0,19%	1,06%
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	254.099,96	0,00	79.979,02	176.096,19	1.975,25	0,78%	0,01%	0,79%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	21.388,06	0,00	21.522,26	14,94	149,14	0,70%	0,21%	1,06%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	18.610,60	0,99	2.201,00	16.533,65	123,06	0,66%	0,01%	0,71%
Total Renda Fixa					79.143,60	2,40%	1,12%	