

# Relatório Analítico dos Investimentos em agosto de 2017



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

Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	1.928.695,62	56,32%	50,00%	75,00%	100,00%	1.495.536,69
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	30,00%	1.027.269,69
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	15,00%	513.634,85
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	0,00	0,00%	3,00%	5,00%	15,00%	513.634,85
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	171.211,62
DF - Artigo 6º	100,00%	52,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-52,00
Total Carteira		1.928.747,62					

RENDA FIXA	3.424.284,31	177,54%
------------	--------------	---------

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: agosto / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	1.928.695,62	56,32%	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%
<b>Total</b>	<b>1.928.747,62</b>	<b>56,33%</b>	<b>62,00</b>	<b>265,00</b>

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	1,343%	11,14%	5,57%	5,06%	15,49%	44,95%	-	-	-
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	1,39%	11,37%	5,66%	5,12%	15,97%	44,82%	0,20%	1,866%	10,01%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,33%	11,15%	5,59%	5,01%	15,58%	44,34%	0,30%	1,812%	9,85%
IDKA PRÉ 2 ANOS	1,163%	12,29%	4,91%	8,15%	18,92%	40,32%	-	-	-
BRDESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	1,08%	11,86%	4,82%	7,77%	18,30%	-	0,20%	0,777%	4,13%
IMA Geral	1,071%	10,21%	4,28%	5,86%	15,03%	37,79%	-	-	-
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	1,08%	10,57%	4,46%	5,93%	15,76%	38,62%	0,25%	0,969%	5,33%
IRF-M 1	0,901%	8,33%	2,86%	5,88%	13,15%	29,98%	-	-	-
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,88%	8,21%	2,86%	5,81%	12,95%	29,38%	0,20%	0,081%	0,68%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,88%	8,17%	2,83%	5,78%	12,88%	29,36%	0,10%	0,081%	0,68%
CDI	0,801%	7,34%	2,43%	5,28%	12,05%	27,88%	-	-	-
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	0,78%	7,28%	2,45%	5,26%	11,84%	27,33%	0,20%	0,001%	0,45%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,70%	6,67%	2,16%	4,76%	11,07%	25,76%	1,00%	0,003%	0,10%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

Administrador	Valor	%
BANCO BRADESCO	3.031.745,87	88,54%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	392.486,44	11,46%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	52,00	0,00%

Sub-segmento	Valor	%
IDKA PRÉ 2A	1.120.288,14	32,72%
IMA-B	976.558,94	28,52%
IRF-M 1	808.407,48	23,61%
IMA-GERAL	415.559,68	12,14%
CDI	103.418,07	3,02%
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%
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%
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%
Agosto	3.382.540,72	94.681,64	90.580,08	3.424.232,31	37.590,03	1,11%	0,72%	153,26%	0,92%
Acumulado no ano					248.300,89	8,07%	5,65%	142,88%	

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	592.506,88	0,00	0,00	600.737,72	8.230,84	1,39%	1,87%	1,39%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	366.157,05	4.776,11	0,00	375.821,22	4.888,06	1,32%	1,81%	1,33%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	411.100,96	0,00	0,00	415.559,68	4.458,72	1,08%	0,97%	1,08%
BRDESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	1.108.303,51	0,00	0,00	1.120.288,14	11.984,63	1,08%	0,78%	1,08%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14,94	0,00	0,00	15,07	0,13	0,87%	0,08%	0,88%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	711.827,54	89.905,53	0,00	808.392,41	6.659,34	0,83%	0,08%	0,88%
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	176.096,19	0,00	90.580,08	86.767,92	1.251,81	0,71%	0,00%	0,78%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	16.533,65	0,00	0,00	16.650,15	116,50	0,70%	0,00%	0,70%
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>37.590,03</b>	<b>1,11%</b>	<b>0,92%</b>	