

# Relatório Analítico dos Investimentos em setembro e 3º Trimestre de 2017



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

Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	1.951.325,13	56,14%	50,00%	75,00%	100,00%	1.524.777,13
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	30,00%	1.042.830,68
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	15,00%	521.415,34
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	0,00	0,00%	3,00%	5,00%	15,00%	521.415,34
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	173.805,11
DF - Artigo 6º	100,00%	52,00	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-52,00
Total Carteira		1.951.377,13					

RENDA FIXA	3.476.154,26	178,14%
------------	--------------	---------

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: setembro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	1.951.325,13	56,13%	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>1.951.377,13</b>	<b>56,14%</b>	<b>62,00</b>	<b>265,00</b>

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	1,811%	13,16%	7,30%	5,86%	15,76%	48,59%	-	-	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,84%	13,20%	7,34%	5,84%	15,81%	47,99%	0,30%	1,357%	9,80%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	1,83%	13,41%	7,43%	5,91%	16,15%	48,50%	0,20%	1,376%	9,96%
IDKA PRÉ 2 ANOS	1,507%	13,99%	5,02%	8,19%	18,34%	44,72%	-	-	-
BRDESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	1,51%	13,54%	4,90%	7,85%	17,76%	-	0,20%	0,793%	4,10%
IMA Geral	1,334%	11,68%	4,82%	5,99%	14,81%	40,15%	-	-	-
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	1,37%	12,09%	5,05%	6,04%	15,38%	41,26%	0,25%	0,817%	5,29%
IRF-M 1	0,745%	9,14%	2,72%	5,49%	12,65%	29,70%	-	-	-
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,71%	8,98%	2,68%	5,40%	12,45%	29,47%	0,20%	0,077%	0,68%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,71%	8,94%	2,67%	5,37%	12,38%	29,13%	0,10%	0,074%	0,68%
CDI	0,638%	8,03%	2,25%	4,85%	11,53%	27,29%	-	-	-
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	0,63%	7,95%	2,22%	4,84%	11,35%	26,74%	0,20%	0,011%	0,45%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,56%	7,26%	1,99%	4,33%	10,54%	25,16%	1,00%	0,013%	0,11%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

Administrador	Valor	%
BANCO BRADESCO	3.071.521,99	88,36%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	404.580,27	11,64%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	52,00	0,00%

Sub-segmento	Valor	%
IDKA PRÉ 2A	1.137.152,50	32,71%
IMA-B	995.979,98	28,65%
IRF-M 1	814.172,63	23,42%
IMA-GERAL	421.267,00	12,12%
CDI	107.530,15	3,09%
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%
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%
Setembro	3.424.232,31	92.003,81	87.158,34	3.476.102,26	47.024,48	1,37%	0,62%	219,67%	0,77%
Acumulado no ano					295.325,37	9,55%	6,30%	151,44%	

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	375.821,22	1.521,28	0,00	384.275,57	6.933,07	1,84%	1,36%	1,84%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	600.737,72	0,00	0,00	611.704,41	10.966,69	1,83%	1,38%	1,83%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	1.120.288,14	0,00	0,00	1.137.152,50	16.864,36	1,51%	0,79%	1,51%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	415.559,68	0,00	0,00	421.267,00	5.707,32	1,37%	0,82%	1,37%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15,07	0,00	0,00	15,18	0,11	0,73%	0,07%	0,71%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	808.392,41	0,00	0,00	814.157,45	5.765,04	0,71%	0,08%	0,71%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	16.650,15	3.546,84	0,00	20.289,52	92,53	0,46%	0,01%	0,56%
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	86.767,92	86.935,69	87.158,34	87.240,63	695,36	0,40%	0,01%	0,63%
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>47.024,48</b>	<b>1,37%</b>	<b>0,77%</b>	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre / 2017

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	1.084.063,60	0,00	0,00	1.137.152,50	53.088,90	4,90%	4,90%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	569.401,48	0,00	0,00	611.704,41	42.302,93	7,43%	7,43%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	327.392,99	31.705,84	0,00	384.275,57	25.176,74	7,09%	7,34%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	401.017,40	0,00	0,00	421.267,00	20.249,60	5,05%	5,05%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	501.134,93	294.486,47	0,00	814.157,45	18.536,05	2,43%	2,68%
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	254.099,96	86.935,69	257.717,44	87.240,63	3.922,42	1,90%	2,22%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	18.610,60	3.547,83	2.201,00	20.289,52	332,09	1,83%	1,99%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	21.388,06	0,00	21.522,26	15,18	149,38	2,31%	2,67%
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>163.758,11</b>	<b>4,95%</b>	