

Relatório Analítico dos Investimentos em janeiro de 2017



Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

Carteira consolidada de investimentos - base (janeiro / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.167.421,69	4,11%	193	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	D+1	Não há	466.678,96	1,64%	40	0,39%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.361.727,45	8,31%	1.347	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	628.137,78	2,21%	714	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	5.021.606,93	17,67%	114	0,70%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.238.960,33	4,36%	619	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	969.560,65	3,41%	37	0,17%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	3.327.988,83	11,71%	70	1,20%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1461	Não há	3.195.413,67	11,24%	6	24,77%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	D+1471	Não há	270.556,81	0,95%	33	0,23%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	3.137.912,82	11,04%	410	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	2.141.766,14	7,54%	244	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	1.619.050,31	5,70%	33	0,58%	Artigo 7º, Inciso VI
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	501.001,76	1,76%	70	0,30%	Artigo 7º, Inciso VI
TOTAL MIX FIC AÇÕES	D+64	Não há	739.027,27	2,60%	49	7,98%	Artigo 8º, Inciso III
MULTINVEST FI MULTIMERCADO	D+31	Não há	441.902,98	1,56%	28	2,58%	Artigo 8º, Inciso IV
ELLEVEN II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	1.189.181,32	4,18%	4	4,11%	Desenquadrado - RF
Total			28.417.895,70				

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

Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	10.884.533,14	38,30%	0,00%	0,00%	0,00%	-10.884.533,14
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	10.884.533,14	38,30%	30,00%	50,00%	70,00%	9.007.993,85
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	7.763.519,96	27,32%	15,00%	20,00%	60,00%	9.287.217,46
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	7.763.519,96	27,32%	0,00%	0,00%	0,00%	-7.763.519,96
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	5.279.678,96	18,58%	0,00%	0,00%	0,00%	-5.279.678,96
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	5.279.678,96	18,58%	5,00%	5,00%	30,00%	3.245.689,75
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	2.120.052,07	7,46%	0,00%	0,00%	0,00%	-2.120.052,07
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	2.120.052,07	7,46%	5,00%	10,00%	15,00%	2.142.632,29
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	739.027,27	2,60%	0,00%	0,00%	0,00%	-739.027,27
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	739.027,27	2,60%	5,00%	10,00%	15,00%	3.523.657,09
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	441.902,98	1,56%	0,00%	0,00%	0,00%	-441.902,98
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	441.902,98	1,56%	2,00%	5,00%	5,00%	978.991,81
Desenquadrado - RF	0,00%	1.189.181,32	4,18%	0,00%	0,00%	0,00%	-1.189.181,32
Desenquadrado - RF	0,00%	1.189.181,32	4,18%	0,00%	0,00%	0,00%	-1.189.181,32
Total Carteira		56.835.791,40					

RENTA FIXA	27.236.965,45	47,92%
RENTA VARIÁVEL	1.180.930,25	2,08%

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: janeiro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	10.884.533,14	38,30%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	10.884.533,14	38,30%	30,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	7.763.519,96	27,32%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	7.763.519,96	27,32%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	5.279.678,96	18,58%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	5.279.678,96	18,58%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	2.120.052,07	7,46%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso VI	2.120.052,07	7,46%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso III	739.027,27	2,60%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso III	739.027,27	2,60%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	441.902,98	1,56%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso IV	441.902,98	1,56%	2,00%	5,00%
Desenquadrado - RF	1.189.181,32	4,18%	0,00%	0,00%
Desenquadrado - RF	1.189.181,32	4,18%	0,00%	0,00%
Total	56.835.791,40	200,00%	62,00	195,00

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	1,87%	1,87%	3,55%	6,79%	24,76%	34,25%	-	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1,81%	1,81%	3,51%	6,68%	24,49%	33,16%	0,20%	3,355%	7,50%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	1,74%	1,74%	3,38%	6,57%	22,25%	32,09%	0,20%	2,957%	6,65%

IRF-M 1	1,29%	1,29%	3,58%	7,06%	14,32%	29,93%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,26%	1,26%	3,50%	6,95%	14,17%	29,47%	0,20%	0,288%	0,31%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,25%	1,25%	3,48%	6,93%	14,08%	29,39%	0,20%	0,297%	0,32%

IMA-B 5	1,16%	1,16%	2,97%	6,05%	13,45%	32,16%	-	-	-
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	2,69%	2,69%	2,80%	7,13%	-	-	0,70%	3,442%	-
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	1,17%	1,17%	2,94%	6,02%	13,31%	30,99%	0,20%	1,335%	2,68%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,14%	1,14%	2,92%	5,95%	13,21%	31,19%	0,20%	1,254%	2,49%
ELLEVEN II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1,04%	1,04%	2,55%	5,55%	-8,22%	1,57%	0,70%	1,450%	17,78%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,70%	0,70%	2,39%	6,80%	12,25%	-	0,70%	1,363%	2,54%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,31%	0,31%	2,06%	5,14%	6,35%	9,06%	0,70%	2,077%	10,73%

IDKA IPCA 2 Anos	1,09%	1,09%	2,97%	6,30%	12,25%	32,94%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,06%	1,06%	2,89%	5,98%	12,92%	31,70%	0,20%	1,042%	2,26%

Selic	1,09%	1,09%	3,28%	6,81%	14,05%	29,34%	-	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,09%	1,09%	3,37%	7,02%	14,30%	29,71%	0,20%	0,015%	0,05%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	1,07%	1,07%	3,22%	6,66%	13,71%	28,74%	0,15%	0,008%	0,02%
IPCA + 7,00% ao ano	0,97%	0,97%	2,61%	5,20%	12,76%	33,46%	-	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	17,42%	17,42%	20,22%	-14,78%	-54,94%	-49,37%	0,00%	27,916%	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	0,94%	0,94%	2,72%	5,54%	13,52%	31,29%	1,65%	-	-

Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (janeiro / 2017)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	7,38%	7,38%	-0,39%	12,85%	60,05%	37,87%	-	-	-
TOTAL MIX FIC AÇÕES	7,31%	7,31%	-0,89%	10,14%	41,07%	23,94%	1,90%	7,639%	18,50%

CDI	1,08%	1,08%	3,28%	6,80%	14,03%	29,29%	-	-	-
MULTINVEST FI MULTIMERCADO	1,48%	1,48%	3,69%	7,03%	13,88%	27,91%	1,00%	0,815%	1,16%

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

Administrador	Valor	%
BANCO BRADESCO	14.796.696,41	52,07%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	4.228.825,56	14,88%
BRIDGE ADMINISTRADORA DE RECURSOS	3.195.413,67	11,24%
RJI Corretora de Valores	2.871.201,76	10,10%
CM Capital Markets DTVM	1.619.050,31	5,70%
Única Administradora	739.027,27	2,60%
Orla DTVM	501.001,76	1,76%
Santander Securities Services	466.678,96	1,64%

Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5	9.580.839,06	33,71%
IMA-B	5.488.285,89	19,31%
CDI	5.279.678,96	18,58%
IRF-M 1	3.529.149,14	12,42%
FIDC	2.120.052,07	7,46%
IDKA IPCA 2A	1.238.960,33	4,36%
AÇÕES - LIVRES	739.027,27	2,60%
MULTIMERCADO - MODERADO	441.902,98	1,56%

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	27.569.477,24	478.000,00	0,00	28.417.895,70	370.418,46	1,32%	0,89%	148,07%	2,05%
Acumulado no ano					370.418,46	1,32%	0,89%	148,07%	

Acumulado no Ano

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	263.472,19	0,00	0,00	270.556,81	7.084,62	2,69%	3,44%	2,69%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	4.932.249,19	0,00	0,00	5.021.606,93	89.357,74	1,81%	3,35%	1,81%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	458.680,24	0,00	0,00	466.678,96	7.998,72	1,74%	2,96%	1,74%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.332.369,46	0,00	0,00	2.361.727,45	29.357,99	1,26%	0,29%	1,26%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.153.012,24	0,00	0,00	1.167.421,69	14.409,45	1,25%	0,30%	1,25%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	621.072,64	0,00	0,00	628.137,78	7.065,14	1,14%	1,25%	1,14%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	3.103.966,16	0,00	0,00	3.137.912,82	33.946,66	1,09%	0,01%	1,09%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	2.119.085,31	0,00	0,00	2.141.766,14	22.680,83	1,07%	0,01%	1,07%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.225.918,44	0,00	0,00	1.238.960,33	13.041,89	1,06%	1,04%	1,06%
ELLEVEN II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.176.960,24	0,00	0,00	1.189.181,32	12.221,08	1,04%	1,45%	1,04%
BRADESCO INSTITUCIONAL L FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	2.815.953,94	478.000,00	0,00	3.327.988,83	34.034,89	1,03%	1,34%	1,17%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1.604.024,61	0,00	0,00	1.619.050,31	15.025,70	0,94%	-	-
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	3.173.221,58	0,00	0,00	3.195.413,67	22.192,09	0,70%	1,36%	0,70%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	498.794,25	0,00	0,00	501.001,76	2.207,51	0,44%	27,92%	17,42%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	966.563,41	0,00	0,00	969.560,65	2.997,24	0,31%	2,08%	0,31%
Total Renda Fixa					313.621,55	1,16%	1,91%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
TOTAL MIX FIC AÇÕES	688.674,32	0,00	0,00	739.027,27	50.352,95	7,31%	7,64%	7,31%
MULTINVEST FI MULTIMERCADO	435.459,02	0,00	0,00	441.902,98	6.443,96	1,48%	0,82%	1,48%
Total Renda Variável					56.796,91	5,05%	5,09%	