

# Relatório Analítico dos Investimentos em fevereiro 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 (fevereiro / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.254.969,66	4,27%	611	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.385.211,51	8,11%	1.341	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	D+1	Não há	482.893,11	1,64%	40	0,38%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	637.419,41	2,17%	712	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	5.212.838,68	17,72%	117	0,66%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.179.178,90	4,01%	194	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	980.609,58	3,33%	36	0,18%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	3.871.860,70	13,16%	70	1,50%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1461	Não há	3.252.863,45	11,06%	6	24,77%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	D+1471	Não há	269.730,87	0,92%	32	0,24%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	3.165.300,55	10,76%	411	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	2.160.141,40	7,34%	239	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	506.574,70	1,72%	70	0,36%	Artigo 7º, Inciso VI
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	1.628.767,12	5,54%			Artigo 7º, Inciso VI
TOTAL MIX FIC AÇÕES	D+64	Não há	775.602,77	2,64%	49	7,98%	Artigo 8º, Inciso III
MULTINVEST FI MULTIMERCADO	D+31	Não há	449.346,07	1,53%	30	1,62%	Artigo 8º, Inciso IV
ELLEVEN II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	1.207.708,30	4,10%	4	4,11%	Desenquadrado - RF
<b>Total</b>			<b>29.421.016,78</b>				

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

Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	11.152.511,27	37,91%	0,00%	0,00%	0,00%	-11.152.511,27
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	11.152.511,27	37,91%	30,00%	50,00%	70,00%	9.442.200,48
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	8.375.064,60	28,47%	15,00%	20,00%	60,00%	9.277.545,47
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	8.375.064,60	28,47%	0,00%	0,00%	0,00%	-8.375.064,60
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	5.325.441,95	18,10%	0,00%	0,00%	0,00%	-5.325.441,95
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	5.325.441,95	18,10%	5,00%	5,00%	30,00%	3.500.863,08
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	2.135.341,82	7,26%	0,00%	0,00%	0,00%	-2.135.341,82
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	2.135.341,82	7,26%	5,00%	10,00%	15,00%	2.277.810,70
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	775.602,77	2,64%	0,00%	0,00%	0,00%	-775.602,77
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	775.602,77	2,64%	5,00%	10,00%	15,00%	3.637.549,75
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	449.346,07	1,53%	0,00%	0,00%	0,00%	-449.346,07
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	449.346,07	1,53%	2,00%	5,00%	5,00%	1.021.704,77
Desenquadrado - RF	0,00%	1.207.708,30	4,10%	0,00%	0,00%	0,00%	-1.207.708,30
Desenquadrado - RF	0,00%	1.207.708,30	4,10%	0,00%	0,00%	0,00%	-1.207.708,30
<b>Total Carteira</b>		<b>58.842.033,56</b>					

RENDA FIXA	28.196.067,94	47,92%
RENDA VARIÁVEL	1.224.948,84	2,08%

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: fevereiro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	11.152.511,27	37,91%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	11.152.511,27	37,91%	30,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	8.375.064,60	28,47%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	8.375.064,60	28,47%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	5.325.441,95	18,10%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	5.325.441,95	18,10%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	2.135.341,82	7,26%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso VI	2.135.341,82	7,26%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso III	775.602,77	2,64%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso III	775.602,77	2,64%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	449.346,07	1,53%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso IV	449.346,07	1,53%	2,00%	5,00%
Desenquadrado - RF	1.207.708,30	4,10%	0,00%	0,00%
Desenquadrado - RF	1.207.708,30	4,10%	0,00%	0,00%
<b>Total</b>	<b>58.842.033,56</b>	<b>200,00%</b>	<b>62,00</b>	<b>195,00</b>

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	3,85%	5,79%	8,86%	9,92%	26,69%	38,66%	-	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	3,81%	5,69%	8,74%	9,83%	26,39%	37,57%	0,20%	1,861%	7,40%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	3,47%	5,28%	8,11%	9,11%	23,72%	36,06%	0,20%	1,626%	6,54%
IMA-B 5	1,49%	2,67%	4,10%	6,47%	13,40%	32,51%	-	-	-
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1,80%	2,51%	4,13%	7,36%	13,02%	-	0,70%	0,839%	2,60%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	1,60%	2,79%	4,26%	6,58%	13,40%	31,65%	0,20%	0,794%	2,59%
ELLEVEN II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1,56%	2,61%	3,96%	6,04%	-8,00%	2,03%	0,70%	0,838%	17,81%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,48%	2,63%	4,05%	6,38%	13,17%	31,63%	0,20%	0,715%	2,39%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1,14%	1,45%	3,00%	5,05%	11,07%	9,24%	0,70%	0,510%	9,70%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	-0,31%	2,38%	3,49%	5,68%	-	-	0,70%	2,156%	-
IDKA IPCA 2 Anos	1,35%	2,45%	3,77%	6,37%	12,42%	33,17%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,29%	2,37%	3,63%	6,06%	12,84%	31,83%	0,20%	0,596%	2,15%
IRF-M 1	1,01%	2,31%	3,53%	6,86%	14,23%	30,27%	-	-	-
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,01%	2,27%	3,47%	6,75%	14,02%	29,82%	0,20%	0,075%	0,31%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,99%	2,27%	3,47%	6,76%	14,05%	29,83%	0,20%	0,083%	0,30%
Selic	0,87%	1,96%	3,11%	6,44%	13,90%	29,39%	-	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,87%	1,98%	3,12%	6,65%	14,17%	29,75%	0,20%	0,006%	0,05%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	0,86%	1,94%	3,05%	6,31%	13,58%	28,80%	0,15%	0,005%	0,02%
IPCA + 7,00% ao ano	0,82%	1,80%	2,71%	4,95%	12,09%	32,29%	-	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	0,60%	1,54%	2,41%	5,00%	12,52%	30,55%	1,65%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-16,37%	-1,80%	-1,02%	-30,35%	-61,90%	-58,31%	0,00%	-	-

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	3,08%	10,68%	7,68%	15,13%	55,78%	29,23%	-	-	-
TOTAL MIX FIC AÇÕES	4,95%	12,62%	10,39%	15,06%	44,66%	21,87%	1,90%	5,610%	18,30%
CDI	0,86%	1,96%	3,10%	6,43%	13,88%	29,35%	-	-	-
MULTINVEST FI MULTIMERCADO	1,68%	3,19%	4,82%	7,62%	14,81%	29,10%	1,00%	0,369%	1,19%

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

Administrador	Valor	%
BANCO BRADESCO	15.589.320,23	52,99%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	4.277.600,58	14,54%
BRIDGE ADMINISTRADORA DE RECURSOS	3.252.863,45	11,06%
RJI Corretora de Valores	2.907.394,82	9,88%
CM Capital Markets DTVM	1.628.767,12	5,54%
Única Administradora	775.602,77	2,64%
Orla DTVM	506.574,70	1,72%
Santander Securities Services	482.893,11	1,64%

Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5	10.220.192,31	34,74%
IMA-B	5.695.731,79	19,36%
CDI	5.325.441,95	18,10%
IRF-M 1	3.564.390,41	12,12%
FIDC	2.135.341,82	7,26%
IDKA IPCA 2A	1.254.969,66	4,27%
AÇÕES - LIVRES	775.602,77	2,64%
MULTIMERCADO - MODERADO	449.346,07	1,53%

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	27.569.477,24	478.000,00	0,00	28.417.895,70	370.418,46	1,32%	0,89%	148,07%	2,05%
Fevereiro	28.417.895,70	488.000,00	0,00	29.421.016,78	515.121,08	1,78%	0,75%	238,10%	0,89%
Acumulado no ano					885.539,54	3,13%	1,65%	189,81%	

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)	
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	5.021.606,93	0,00	0,00	5.212.838,68	191.231,75	3,81%	1,86%	3,81%	
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	466.678,96	0,00	0,00	482.893,11	16.214,15	3,47%	1,63%	3,47%	
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	3.195.413,67	0,00	0,00	3.252.863,45	57.449,78	1,80%	0,84%	1,80%	
ELLEVEN II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.189.181,32	0,00	0,00	1.207.708,30	18.526,98	1,56%	0,84%	1,56%	
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	628.137,78	0,00	0,00	637.419,41	9.281,63	1,48%	0,72%	1,48%	
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	3.327.988,83	488.000,00	0,00	3.871.860,70	55.871,87	1,46%	0,79%	1,60%	
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.238.960,33	0,00	0,00	1.254.969,66	16.009,33	1,29%	0,60%	1,29%	
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	969.560,65	0,00	0,00	980.609,58	11.048,93	1,14%	0,51%	1,14%	
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	501.001,76	0,00	0,00	506.574,70	5.572,94	1,11%	-	-16,37%	
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.167.421,69	0,00	0,00	1.179.178,90	11.757,21	1,01%	0,08%	1,01%	
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.361.727,45	0,00	0,00	2.385.211,51	23.484,06	0,99%	0,08%	0,99%	
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	3.137.912,82	0,00	0,00	3.165.300,55	27.387,73	0,87%	0,01%	0,87%	
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	2.141.766,14	0,00	0,00	2.160.141,40	18.375,26	0,86%	0,00%	0,86%	
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1.619.050,31	0,00	0,00	1.628.767,12	9.716,81	0,60%	-	-	
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	270.556,81	0,00	0,00	269.730,87	-825,94	-0,31%	2,16%	-0,31%	
Total Renda Fixa						471.102,49	1,70%	0,76%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
TOTAL MIX FIC AÇÕES	739.027,27	0,00	0,00	775.602,77	36.575,50	4,95%	5,61%	4,95%
MULTINVEST FI MULTIMERCADO	441.902,98	0,00	0,00	449.346,07	7.443,09	1,68%	0,37%	1,68%
Total Renda Variável					44.018,59	3,73%	3,69%	