

Relatório Analítico dos Investimentos em abril 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 (abril / 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	1.197.758,57	3,88%	193	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	650.698,73	2,11%	720	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	5.247.871,61	16,99%	118	0,62%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	D+1	Não há	487.146,06	1,58%	44	0,36%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	452.945,63	1,47%	284	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.282.795,88	4,15%	609	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.432.588,33	7,88%	1.339	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1461	Não há	3.320.705,93	10,75%	6	24,77%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	D+1471	Não há	274.418,61	0,89%	29	0,24%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	4.484.053,76	14,52%	75	1,65%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	989.078,99	3,20%	32	0,19%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	3.227.656,96	10,45%	432	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	2.199.638,42	7,12%	245	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	1.658.504,24	5,37%			Artigo 7º, Inciso VI
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	513.611,32	1,66%	70	0,35%	Artigo 7º, Inciso VI
TOTAL MIX FIC AÇÕES	D+64	Não há	774.046,77	2,51%	48	8,05%	Artigo 8º, Inciso III
MULTINVEST FI MULTIMERCADO	D+31	Não há	456.973,36	1,48%	36	1,64%	Artigo 8º, Inciso IV
ELLEVEN II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	1.229.397,69	3,98%	4	4,11%	Desenquadrado - RF
Total			30.879.890,86				

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

Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	11.751.804,81	38,06%	0,00%	0,00%	0,00%	-11.751.804,81
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	11.751.804,81	38,06%	30,00%	50,00%	70,00%	9.864.118,79
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	9.068.257,29	29,37%	15,00%	20,00%	60,00%	9.459.677,23
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	9.068.257,29	29,37%	0,00%	0,00%	0,00%	-9.068.257,29
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	5.427.295,38	17,58%	0,00%	0,00%	0,00%	-5.427.295,38
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	5.427.295,38	17,58%	5,00%	5,00%	30,00%	3.836.671,88
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	2.172.115,56	7,03%	0,00%	0,00%	0,00%	-2.172.115,56
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	2.172.115,56	7,03%	5,00%	10,00%	15,00%	2.459.868,07
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	774.046,77	2,51%	0,00%	0,00%	0,00%	-774.046,77
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	774.046,77	2,51%	5,00%	10,00%	15,00%	3.857.936,86
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	456.973,36	1,48%	0,00%	0,00%	0,00%	-456.973,36
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	456.973,36	1,48%	2,00%	5,00%	5,00%	1.087.021,18
Desenquadrado - RF	0,00%	1.229.397,69	3,98%	0,00%	0,00%	0,00%	-1.229.397,69
Desenquadrado - RF	0,00%	1.229.397,69	3,98%	0,00%	0,00%	0,00%	-1.229.397,69
Total Carteira		61.759.781,72					

RENTA FIXA	29.648.870,73	48,01%
RENTA VARIÁVEL	1.231.020,13	1,99%

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: abril / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	11.751.804,81	38,06%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	11.751.804,81	38,06%	30,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	9.068.257,29	29,37%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	9.068.257,29	29,37%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	5.427.295,38	17,58%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	5.427.295,38	17,58%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	2.172.115,56	7,03%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso VI	2.172.115,56	7,03%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso III	774.046,77	2,51%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso III	774.046,77	2,51%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	456.973,36	1,48%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso IV	456.973,36	1,48%	2,00%	5,00%
Desenquadrado - RF	1.229.397,69	3,98%	0,00%	0,00%
Desenquadrado - RF	1.229.397,69	3,98%	0,00%	0,00%
Total	61.759.781,72	200,00%	62,00	195,00

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDKA IPCA 2 Anos	0,92%	5,08%	3,95%	7,03%	13,24%	34,55%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,79%	4,64%	3,54%	6,53%	12,81%	33,04%	0,20%	0,465%	1,76%
IRF-M 1	0,87%	4,36%	3,04%	6,72%	13,86%	30,56%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,86%	4,30%	3,00%	6,61%	13,65%	30,13%	0,20%	0,157%	0,29%
BRABESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,85%	4,28%	2,99%	6,58%	13,60%	29,86%	0,20%	0,162%	0,29%
Selic	0,79%	3,84%	2,73%	6,10%	13,47%	29,20%	-	-	-
BRABESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIA DO DI	0,91%	3,98%	2,86%	6,33%	13,90%	29,69%	0,20%	0,070%	0,07%
BRABESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIA DO DI	0,78%	3,80%	2,70%	6,01%	13,22%	28,62%	0,15%	0,014%	0,04%
IMA-B 5	0,71%	4,83%	3,63%	6,72%	13,17%	33,32%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,70%	4,77%	3,59%	6,62%	12,96%	32,50%	0,20%	0,516%	2,06%
BRABESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	0,66%	4,97%	3,76%	6,80%	13,09%	42,49%	0,20%	0,586%	2,27%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	0,60%	4,15%	1,43%	4,27%	5,51%	-	0,70%	1,152%	7,87%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,60%	4,65%	3,92%	6,40%	12,75%	27,94%	0,70%	0,572%	2,65%
ELLEVEN II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,45%	4,46%	3,38%	6,01%	-8,27%	2,90%	0,70%	0,768%	17,81%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,37%	2,33%	2,01%	4,11%	11,23%	8,89%	0,70%	0,831%	2,52%
IPCA + 7,00% ao ano	0,63%	3,33%	2,33%	5,00%	11,34%	30,12%	-	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	0,76%	3,40%	2,44%	5,22%	12,00%	29,60%	1,65%	-	-

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	0,44%	2,97%	-12,30%	5,43%	-25,49%	-57,72%	0,00%	-	-
IMA-B 5+	-0,82%	7,46%	5,11%	9,18%	18,67%	39,79%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,82%	7,27%	4,99%	8,96%	18,27%	38,38%	0,20%	2,560%	7,99%
IMA-B	-0,32%	6,55%	4,60%	8,31%	16,59%	36,72%	-	-	-
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	-0,17%	6,21%	4,39%	7,91%	15,56%	34,01%	0,20%	1,610%	5,24%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	-0,34%	6,40%	4,51%	8,18%	16,22%	35,59%	0,20%	1,902%	5,85%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	0,79%	3,84%	2,72%	6,09%	13,45%	29,16%	-	-	-
MULTINVEST FI MULTIMERCADO	0,55%	4,94%	3,41%	7,22%	14,38%	27,65%	1,00%	0,609%	1,27%
Ibovespa	0,64%	8,59%	1,13%	0,74%	21,32%	16,32%	-	-	-
TOTAL MIX FIC AÇÕES	1,17%	12,40%	4,74%	3,81%	25,39%	16,92%	1,90%	6,559%	16,53%

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

Administrador	Valor	%
BANCO BRADESCO	16.356.979,32	52,97%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	4.819.028,57	15,61%
BRIDGE ADMINISTRADORA DE RECURSOS	3.320.705,93	10,75%
RJI CORRETORA DE VALORES	2.949.868,65	9,55%
CM Capital Markets DTVM	1.658.504,24	5,37%
Única Administradora	774.046,77	2,51%
Orla DTVM	513.611,32	1,66%
Santander Securities Services	487.146,06	1,58%

Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5	10.948.353,71	35,45%
IMA-B	5.735.017,67	18,57%
CDI	5.427.295,38	17,58%
IRF-M 1	3.630.346,90	11,76%
FIDC	2.172.115,56	7,03%
IDKA IPCA 2A	1.282.795,88	4,15%
AÇÕES - LIVRES	774.046,77	2,51%
MULTIMERCADO - MODERADO	456.973,36	1,48%
IMA-B 5+	452.945,63	1,47%

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%
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%
Março	29.421.016,78	525.000,00	0,00	30.267.884,80	321.868,02	1,07%	0,78%	137,00%	1,17%
Abril	30.267.884,80	455.000,00	0,00	30.879.890,86	157.006,06	0,51%	0,56%	91,64%	0,89%
Acumulado no ano					1.364.413,62	4,77%	3,02%	158,08%	

Acumulado no Ano

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	3.198.580,29	0,00	0,00	3.227.656,96	29.076,67	0,91%	0,07%	0,91%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.411.789,00	0,00	0,00	2.432.588,33	20.799,33	0,86%	0,16%	0,86%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.187.663,11	0,00	0,00	1.197.758,57	10.095,46	0,85%	0,16%	0,85%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.272.781,01	0,00	0,00	1.282.795,88	10.014,87	0,79%	0,46%	0,79%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	2.182.586,40	0,00	0,00	2.199.638,42	17.052,02	0,78%	0,01%	0,78%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1.645.933,07	0,00	0,00	1.658.504,24	12.571,17	0,76%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	646.198,59	0,00	0,00	650.698,73	4.500,14	0,70%	0,52%	0,70%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	4.454.713,35	0,00	0,00	4.484.053,76	29.340,41	0,66%	0,59%	0,66%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	272.770,14	0,00	0,00	274.418,61	1.648,47	0,60%	1,15%	0,60%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	3.300.881,47	0,00	0,00	3.320.705,93	19.824,46	0,60%	0,57%	0,60%
ELLEVEN II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.223.935,77	0,00	0,00	1.229.397,69	5.461,92	0,45%	0,77%	0,45%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	511.381,41	0,00	0,00	513.611,32	2.229,91	0,44%	-	0,44%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	985.452,48	0,00	0,00	989.078,99	3.626,51	0,37%	0,83%	0,37%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	487.963,24	0,00	0,00	487.146,06	-817,18	-0,17%	1,61%	-0,17%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	5.265.704,05	0,00	0,00	5.247.871,61	-17.832,44	-0,34%	1,90%	-0,34%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	455.000,00	0,00	452.945,63	-2.054,37	-0,45%	2,56%	-0,82%
				Total Renda Fixa	145.537,35	0,49%	0,74%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
TOTAL MIX FIC AÇÕES	765.065,23	0,00	0,00	774.046,77	8.981,54	1,17%	6,56%	1,17%
MULTINVEST FI MULTIMERCADO	454.486,19	0,00	0,00	456.973,36	2.487,17	0,55%	0,61%	0,55%
Total Renda Variável					11.468,71	0,94%	4,35%	