

Relatório Analítico dos Investimentos em maio 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 (maio / 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	1.208.316,27	3,92%	191	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	651.249,90	2,11%	716	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	5.182.774,18	16,79%	114	0,63%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	D+1	Não há	483.622,37	1,57%	45	0,36%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	445.366,93	1,44%	291	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.288.098,63	4,17%	609	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.454.515,73	7,95%	1.348	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1461	Não há	3.324.651,97	10,77%	6	24,77%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	D+1471	Não há	274.774,48	0,89%	29	0,24%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	4.486.037,79	14,54%	77	1,60%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	987.996,83	3,20%	32	0,19%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	3.257.730,21	10,56%	452	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' '
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	2.219.936,20	7,19%	244	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' '
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	1.653.220,42	5,36%			Artigo 7º, Inciso VI
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	513.653,59	1,66%	70	0,35%	Artigo 7º, Inciso VI
TOTAL MIX FIC AÇÕES	D+64	Não há	744.596,06	2,41%	46	8,14%	Artigo 8º, Inciso III
MULTINVEST FI MULTIMERCADO	D+31	Não há	458.331,08	1,49%	35	1,90%	Artigo 8º, Inciso IV
ELLEVEN II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	1.228.266,08	3,98%	4	4,11%	Desenquadrado - RF
Total			30.863.138,72				

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

Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	11.713.944,01	37,95%	0,00%	0,00%	0,00%	-11.713.944,01
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	11.713.944,01	37,95%	30,00%	50,00%	70,00%	9.890.253,09
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	9.073.461,07	29,40%	15,00%	20,00%	60,00%	9.444.422,16
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	9.073.461,07	29,40%	0,00%	0,00%	0,00%	-9.073.461,07
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	5.477.666,41	17,75%	0,00%	0,00%	0,00%	-5.477.666,41
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	5.477.666,41	17,75%	5,00%	5,00%	30,00%	3.781.275,21
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	2.166.874,01	7,02%	0,00%	0,00%	0,00%	-2.166.874,01
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	2.166.874,01	7,02%	5,00%	10,00%	15,00%	2.462.596,80
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	744.596,06	2,41%	0,00%	0,00%	0,00%	-744.596,06
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	744.596,06	2,41%	5,00%	10,00%	15,00%	3.884.874,75
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	458.331,08	1,49%	0,00%	0,00%	0,00%	-458.331,08
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	458.331,08	1,49%	2,00%	5,00%	5,00%	1.084.825,86
Desenquadrado - RF	0,00%	1.228.266,08	3,98%	0,00%	0,00%	0,00%	-1.228.266,08
Desenquadrado - RF	0,00%	1.228.266,08	3,98%	0,00%	0,00%	0,00%	-1.228.266,08
Total Carteira		61.726.277,44					

RENTA FIXA	29.660.211,58	48,05%
RENTA VARIÁVEL	1.202.927,14	1,95%

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: maio / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	11.713.944,01	37,95%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	11.713.944,01	37,95%	30,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	9.073.461,07	29,40%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	9.073.461,07	29,40%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	5.477.666,41	17,75%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	5.477.666,41	17,75%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	2.166.874,01	7,02%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso VI	2.166.874,01	7,02%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso III	744.596,06	2,41%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso III	744.596,06	2,41%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	458.331,08	1,49%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso IV	458.331,08	1,49%	2,00%	5,00%
Desenquadrado - RF	1.228.266,08	3,98%	0,00%	0,00%
Desenquadrado - RF	1.228.266,08	3,98%	0,00%	0,00%
Total	61.726.277,44	200,00%	62,00	195,00

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M 1	0,89%	6,25%	2,69%	6,25%	13,46%	30,44%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,90%	5,24%	2,91%	6,48%	13,48%	30,10%	0,20%	0,955%	0,65%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,88%	5,20%	2,86%	6,43%	13,40%	29,88%	0,20%	0,973%	0,66%
Selic	0,81%	5,65%	2,54%	5,65%	12,87%	28,79%	-	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,93%	4,95%	2,92%	6,13%	13,69%	29,60%	0,20%	0,008%	0,09%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	0,92%	4,76%	2,77%	5,90%	13,04%	28,55%	0,15%	0,003%	0,06%
IDKA IPCA 2 Anos	0,79%	6,38%	2,18%	6,38%	12,88%	32,07%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,41%	5,07%	2,64%	6,36%	12,38%	31,14%	0,20%	3,767%	2,85%
IMA-B 5	0,52%	5,47%	1,32%	5,47%	11,91%	30,87%	-	-	-
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	0,13%	4,29%	1,87%	5,42%	4,40%	-	0,70%	2,946%	8,02%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,12%	4,77%	2,21%	6,43%	12,02%	26,92%	0,70%	5,288%	4,16%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,08%	4,86%	2,17%	6,30%	12,18%	30,41%	0,20%	4,893%	3,58%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	0,04%	5,02%	2,17%	6,52%	12,31%	30,40%	0,20%	5,231%	3,87%
ELLEVEN II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,09%	4,36%	1,70%	5,72%	-8,83%	1,21%	0,70%	5,340%	18,06%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,11%	2,22%	0,75%	3,78%	10,28%	6,95%	0,70%	6,294%	4,51%
IPCA + 7,00% ao ano	0,33%	4,61%	1,87%	4,61%	10,18%	28,32%	-	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	0,01%	2,98%	4,87%	3,79%	-26,47%	-58,17%	0,00%	0,675%	-

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	-0,32%	3,07%	1,50%	3,95%	10,27%	27,93%	1,65%	-	-
IMA-B	0,16%	5,46%	-1,34%	5,46%	13,32%	32,28%	-	-	-
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	-0,72%	5,44%	0,15%	8,27%	14,85%	29,78%	0,20%	10,799%	8,21%
BRABESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	-1,24%	5,08%	-0,58%	8,11%	14,99%	30,47%	0,20%	13,329%	9,78%
IMA-B 5+	-0,06%	5,50%	-2,63%	5,50%	14,42%	34,03%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,67%	5,47%	-1,66%	9,38%	17,23%	31,89%	0,20%	16,974%	12,71%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	0,81%	5,65%	2,54%	5,65%	12,85%	28,75%	-	-	-
MULTINVEST FI MULTIMERCADO	0,30%	5,25%	2,00%	6,92%	13,58%	26,49%	1,00%	3,641%	2,56%
Ibovespa	-4,12%	4,12%	-5,93%	1,30%	29,38%	18,86%	-	-	-
TOTAL MIX FIC AÇÕES	-3,80%	8,12%	-4,00%	5,98%	27,32%	16,04%	1,90%	17,129%	18,89%

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

Administrador	Valor	%
BANCO BRADESCO	16.354.794,65	52,99%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	4.839.231,19	15,68%
BRIDGE ADMINISTRADORA DE RECURSOS	3.324.651,97	10,77%
RJI CORRETORA DE VALORES	2.949.368,47	9,56%
CM Capital Markets DTVM	1.653.220,42	5,36%
Única Administradora	744.596,06	2,41%
Orla DTVM	513.653,59	1,66%
Santander Securities Services	483.622,37	1,57%

Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5	10.952.977,05	35,49%
IMA-B	5.666.396,55	18,36%
CDI	5.477.666,41	17,75%
IRF-M 1	3.662.832,00	11,87%
FIDC	2.166.874,01	7,02%
IDKA IPCA 2A	1.288.098,63	4,17%
AÇÕES - LIVRES	744.596,06	2,41%
MULTIMERCADO - MODERADO	458.331,08	1,49%
IMA-B 5+	445.366,93	1,44%

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%
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%
Mai	30.879.890,86	0,00	0,00	30.863.138,72	-16.752,14	-0,05%	0,82%	-6,60%	5,58%
Acumulado no ano					1.347.661,48	4,71%	3,86%	121,97%	

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	3.227.656,96	0,00	0,00	3.257.730,21	30.073,25	0,93%	0,01%	0,93%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	2.199.638,42	0,00	0,00	2.219.936,20	20.297,78	0,92%	0,00%	0,92%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.432.588,33	0,00	0,00	2.454.515,73	21.927,40	0,90%	0,96%	0,90%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.197.758,57	0,00	0,00	1.208.316,27	10.557,70	0,88%	0,97%	0,88%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.282.795,88	0,00	0,00	1.288.098,63	5.302,75	0,41%	3,77%	0,41%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	274.418,61	0,00	0,00	274.774,48	355,87	0,13%	2,95%	0,13%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	3.320.705,93	0,00	0,00	3.324.651,97	3.946,04	0,12%	5,29%	0,12%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	650.698,73	0,00	0,00	651.249,90	551,17	0,08%	4,89%	0,08%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	4.484.053,76	0,00	0,00	4.486.037,79	1.984,03	0,04%	5,23%	0,04%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	513.611,32	0,00	0,00	513.653,59	42,27	0,01%	0,67%	0,01%
ELLEVEN II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.229.397,69	0,00	0,00	1.228.266,08	-1.131,61	-0,09%	5,34%	-0,09%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	989.078,99	0,00	0,00	987.996,83	-1.082,16	-0,11%	6,29%	-0,11%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1.658.504,24	0,00	0,00	1.653.220,42	-5.283,82	-0,32%	-	-
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	487.146,06	0,00	0,00	483.622,37	-3.523,69	-0,72%	10,80%	-0,72%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	5.247.871,61	0,00	0,00	5.182.774,18	-65.097,43	-1,24%	13,33%	-1,24%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	452.945,63	0,00	0,00	445.366,93	-7.578,70	-1,67%	16,97%	-1,67%
				Total Renda Fixa	11.340,85	0,04%	5,30%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
MULTINVEST FI MULTIMERCADO	456.973,36	0,00	0,00	458.331,08	1.357,72	0,30%	3,64%	0,30%
TOTAL MIX FIC AÇÕES	774.046,77	0,00	0,00	744.596,06	-29.450,71	-3,80%	17,13%	-3,80%
Total Renda Variável					-28.092,99	-2,28%	11,99%	