

Relatório Analítico dos Investimentos em julho 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 (julho / 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	1.232.079,92	3,80%	193	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	673.064,23	2,08%	703	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	5.388.711,84	16,62%	112	0,72%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	D+1	Não há	501.470,55	1,55%	47	0,36%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	465.573,19	1,44%	292	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.327.412,89	4,09%	594	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.501.566,76	7,72%	1.367	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1461	Não há	3.427.262,24	10,57%	8	14,86%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	D+1471	Não há	279.878,66	0,86%	29	0,24%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	4.639.811,84	14,31%	75	1,68%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	1.014.129,41	3,13%	33	0,18%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	4.275.289,92	13,19%	493	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	2.256.941,85	6,96%	259	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	1.650.002,52	5,09%			Artigo 7º, Inciso VI
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	264.625,96	0,82%	70	0,35%	Artigo 7º, Inciso VI
TOTAL MIX FIC AÇÕES	D+64	Não há	784.689,63	2,42%	41	8,37%	Artigo 8º, Inciso III
MULTINVEST FI MULTIMERCADO	D+31	Não há	468.688,33	1,45%	28	2,06%	Artigo 8º, Inciso IV
ELLEVEN II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	1.267.424,93	3,91%	4	4,11%	Desenquadrado - RF
		Total	32.418.624,67				

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

Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	12.089.879,38	37,29%	0,00%	0,00%	0,00%	-12.089.879,38
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	12.089.879,38	37,29%	30,00%	50,00%	70,00%	10.603.157,89
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	9.361.082,15	28,88%	15,00%	20,00%	60,00%	10.090.092,65
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	9.361.082,15	28,88%	0,00%	0,00%	0,00%	-9.361.082,15
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	6.532.231,77	20,15%	0,00%	0,00%	0,00%	-6.532.231,77
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	6.532.231,77	20,15%	5,00%	5,00%	30,00%	3.193.355,63
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	1.914.628,48	5,91%	0,00%	0,00%	0,00%	-1.914.628,48
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	1.914.628,48	5,91%	5,00%	10,00%	15,00%	2.948.165,22
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	784.689,63	2,42%	0,00%	0,00%	0,00%	-784.689,63
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	784.689,63	2,42%	5,00%	10,00%	15,00%	4.078.104,07
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	468.688,33	1,45%	0,00%	0,00%	0,00%	-468.688,33
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	468.688,33	1,45%	2,00%	5,00%	5,00%	1.152.242,90
Desenquadrado - RF	0,00%	1.267.424,93	3,91%	0,00%	0,00%	0,00%	-1.267.424,93
Desenquadrado - RF	0,00%	1.267.424,93	3,91%	0,00%	0,00%	0,00%	-1.267.424,93
Total Carteira		64.837.249,34					

RENDA FIXA	31.165.246,71	48,07%
RENDA VARIÁVEL	1.253.377,96	1,93%

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: julho / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	12.089.879,38	37,29%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	12.089.879,38	37,29%	30,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	9.361.082,15	28,88%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	9.361.082,15	28,88%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	6.532.231,77	20,15%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	6.532.231,77	20,15%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	1.914.628,48	5,91%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso VI	1.914.628,48	5,91%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso III	784.689,63	2,42%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso III	784.689,63	2,42%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	468.688,33	1,45%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso IV	468.688,33	1,45%	2,00%	5,00%
Desenquadrado - RF	1.267.424,93	3,91%	0,00%	0,00%
Desenquadrado - RF	1.267.424,93	3,91%	0,00%	0,00%
Total	64.837.249,34	200,00%	62,00	195,00

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5+	4,67%	10,43%	2,76%	8,01%	15,89%	42,86%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4,61%	10,26%	2,79%	7,91%	15,61%	41,52%	0,20%	2,937%	12,75%
IMA-B	4,00%	9,67%	2,93%	7,66%	14,97%	38,57%	-	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	3,97%	9,25%	2,68%	7,31%	14,48%	37,29%	0,20%	2,281%	9,85%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	3,41%	9,33%	2,94%	7,46%	14,51%	35,72%	0,20%	1,815%	8,20%
IMA-B 5	2,85%	8,47%	3,47%	7,23%	13,72%	32,24%	-	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	2,93%	8,62%	3,47%	7,36%	13,82%	31,50%	0,20%	1,297%	3,93%
ELLEVEN II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2,85%	7,69%	3,09%	6,58%	12,50%	2,17%	0,70%	1,286%	4,03%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,82%	8,37%	3,44%	7,15%	13,53%	31,44%	0,20%	1,220%	3,64%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2,61%	8,01%	3,21%	7,26%	14,55%	28,33%	0,70%	1,151%	4,08%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2,21%	4,92%	2,53%	4,60%	9,98%	8,49%	0,70%	1,088%	4,55%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	1,43%	6,23%	1,99%	3,45%	10,83%	-	0,70%	0,826%	7,21%
IDKA IPCA 2 Anos	2,53%	9,07%	3,80%	7,90%	14,69%	32,93%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,41%	8,28%	3,48%	7,14%	13,54%	31,73%	0,20%	0,943%	2,85%
IRF-M 1	1,05%	7,36%	2,87%	5,99%	13,48%	30,14%	-	-	-
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,06%	7,26%	2,87%	5,94%	13,28%	29,62%	0,20%	0,192%	0,67%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,04%	7,25%	2,84%	5,92%	13,28%	29,76%	0,20%	0,199%	0,66%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA + 7,00% ao ano	0,81%	5,45%	2,06%	4,44%	9,87%	27,76%	-	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	0,96%	-46,95%	-48,48%	-54,82%	-61,50%	-79,03%	0,00%	17,497%	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	-1,11%	2,87%	-0,51%	1,91%	7,56%	24,48%	1,65%	-	-
Selic	0,80%	6,50%	2,56%	5,35%	12,52%	28,31%	-	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIA DO DI	0,81%	6,68%	2,60%	5,53%	12,94%	28,82%	0,20%	0,008%	0,11%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIA DO DI	0,80%	6,51%	2,61%	5,38%	12,40%	27,85%	0,15%	0,010%	0,07%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	4,80%	9,45%	0,79%	1,93%	15,03%	29,60%	-	-	-
TOTAL MIX FIC AÇÕES	4,79%	13,94%	1,37%	6,18%	16,95%	26,85%	1,90%	4,111%	18,05%
CDI	0,80%	6,49%	2,55%	5,35%	12,51%	28,27%	-	-	-
MULTINVEST FI MULTIMERCADO	1,67%	7,63%	2,56%	6,06%	13,52%	27,46%	1,00%	0,562%	2,62%

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

Administrador	Valor	%
BANCO BRADESCO	17.792.835,37	54,88%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	4.967.617,07	15,32%
BRIDGE ADMINISTRADORA DE RECURSOS	3.427.262,24	10,57%
RJI CORRETORA DE VALORES	3.030.121,33	9,35%
CM Capital Markets DTVM	1.650.002,52	5,09%
Única Administradora	784.689,63	2,42%
Santander Securities Services	501.470,55	1,55%
Orla DTVM	264.625,96	0,82%

Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5	11.301.571,31	34,86%
CDI	6.532.231,77	20,15%
IMA-B	5.890.182,39	18,17%
IRF-M 1	3.733.646,68	11,52%
FIDC	1.914.628,48	5,91%
IDKA IPCA 2A	1.327.412,89	4,09%
AÇÕES - LIVRES	784.689,63	2,42%
MULTIMERCADO - MODERADO	468.688,33	1,45%
IMA-B 5+	465.573,19	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%
Junho	30.863.138,72	0,00	0,00	30.771.121,72	-92.017,00	-0,30%	0,26%	-116,63%	1,85%
Julho	30.771.121,72	960.541,59	0,00	32.418.624,67	686.961,36	2,16%	0,73%	297,41%	1,25%
Acumulado no ano					1.942.605,84	6,66%	4,89%	136,29%	

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	445.048,88	0,00	0,00	465.573,19	20.524,31	4,61%	2,94%	4,61%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	5.183.117,39	0,00	0,00	5.388.711,84	205.594,45	3,97%	2,28%	3,97%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	484.926,70	0,00	0,00	501.470,55	16.543,85	3,41%	1,81%	3,41%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	4.507.583,33	0,00	0,00	4.639.811,84	132.228,51	2,93%	1,30%	2,93%
ELLEVEN II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.232.272,31	0,00	0,00	1.267.424,93	35.152,62	2,85%	1,29%	2,85%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	654.584,00	0,00	0,00	673.064,23	18.480,23	2,82%	1,22%	2,82%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	3.340.051,10	0,00	0,00	3.427.262,24	87.211,14	2,61%	1,15%	2,61%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.296.144,03	0,00	0,00	1.327.412,89	31.268,86	2,41%	0,94%	2,41%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	992.236,38	0,00	0,00	1.014.129,41	21.893,03	2,21%	1,09%	2,21%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	275.924,11	0,00	0,00	279.878,66	3.954,55	1,43%	0,83%	1,43%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.219.163,56	0,00	0,00	1.232.079,92	12.916,36	1,06%	0,19%	1,06%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.475.750,64	0,00	0,00	2.501.566,76	25.816,12	1,04%	0,20%	1,04%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	262.118,89	0,00	0,00	264.625,96	2.507,07	0,96%	17,50%	0,96%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	2.238.996,96	0,00	0,00	2.256.941,85	17.944,89	0,80%	0,01%	0,80%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	3.284.862,19	960.541,59	0,00	4.275.289,92	29.886,14	0,70%	0,01%	0,81%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1.668.527,33	0,00	0,00	1.650.002,52	-18.524,81	-1,11%	-	-
Total Renda Fixa					643.397,32	2,11%	1,19%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
TOTAL MIX FIC AÇÕES	748.830,58	0,00	0,00	784.689,63	35.859,05	4,79%	4,11%	4,79%
MULTINVEST FI MULTIMERCADO	460.983,34	0,00	0,00	468.688,33	7.704,99	1,67%	0,56%	1,67%
				Total Renda Variável	43.564,04	3,60%	2,78%	