

Relatório Analítico dos Investimentos em agosto 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 (agosto / 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	1.242.932,97	3,79%	192	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	681.407,84	2,08%	711	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	5.459.161,15	16,65%	113	0,71%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	D+1	Não há	507.507,98	1,55%	49	0,36%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	471.766,50	1,44%	276	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.340.208,88	4,09%	601	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.523.822,31	7,70%	1.381	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1461	Não há	3.464.484,68	10,57%	9	13,15%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	D+1471	Não há	280.452,34	0,86%	29	0,24%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	4.701.343,24	14,34%	77	1,53%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	1.026.429,30	3,13%	34	0,18%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	4.317.527,72	13,17%	534	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	2.274.723,28	6,94%	258	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	1.646.492,06	5,02%	34	0,53%	Artigo 7º, Inciso VI
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	268.844,78	0,82%	70	0,35%	Artigo 7º, Inciso VI
TOTAL MIX FIC AÇÕES	D+64	Não há	826.849,50	2,52%	41	8,37%	Artigo 8º, Inciso III
MULTINVEST FI MULTIMERCADO	D+31	Não há	474.083,05	1,45%	29	2,05%	Artigo 8º, Inciso IV
ELLEVEN II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	1.282.602,11	3,91%	4	4,11%	Desenquadrado - RF
Total			32.790.639,69				

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

Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	12.226.807,63	37,29%	0,00%	0,00%	0,00%	-12.226.807,63
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	12.226.807,63	37,29%	30,00%	50,00%	70,00%	10.726.640,15
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	9.472.709,56	28,89%	15,00%	20,00%	60,00%	10.201.674,25
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	80,00%	9.472.709,56	28,89%	0,00%	0,00%	0,00%	-9.472.709,56
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	6.592.251,00	20,10%	0,00%	0,00%	0,00%	-6.592.251,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30,00%	6.592.251,00	20,10%	5,00%	5,00%	30,00%	3.244.940,91
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	1.915.336,84	5,84%	0,00%	0,00%	0,00%	-1.915.336,84
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	1.915.336,84	5,84%	5,00%	10,00%	15,00%	3.003.259,11
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	826.849,50	2,52%	0,00%	0,00%	0,00%	-826.849,50
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	826.849,50	2,52%	5,00%	10,00%	15,00%	4.091.746,45
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	474.083,05	1,45%	0,00%	0,00%	0,00%	-474.083,05
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	474.083,05	1,45%	2,00%	5,00%	5,00%	1.165.448,93
Desenquadrado - RF	0,00%	1.282.602,11	3,91%	0,00%	0,00%	0,00%	-1.282.602,11
Desenquadrado - RF	0,00%	1.282.602,11	3,91%	0,00%	0,00%	0,00%	-1.282.602,11
Total Carteira		65.581.279,38					

RENTA FIXA	31.489.707,14	48,02%
RENTA VARIÁVEL	1.300.932,55	1,98%

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: agosto / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	12.226.807,63	37,29%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	12.226.807,63	37,29%	30,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	9.472.709,56	28,89%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	9.472.709,56	28,89%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	6.592.251,00	20,10%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	6.592.251,00	20,10%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	1.915.336,84	5,84%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso VI	1.915.336,84	5,84%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso III	826.849,50	2,52%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso III	826.849,50	2,52%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	474.083,05	1,45%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso IV	474.083,05	1,45%	2,00%	5,00%
Desenquadrado - RF	1.282.602,11	3,91%	0,00%	0,00%
Desenquadrado - RF	1.282.602,11	3,91%	0,00%	0,00%
Total	65.581.279,38	200,00%	62,00	195,00

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5+	1,36%	11,93%	6,04%	4,21%	16,45%	51,77%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,33%	11,73%	5,93%	4,17%	16,18%	50,38%	0,20%	2,644%	12,76%

IMA-B	1,34%	11,14%	5,57%	5,06%	15,49%	44,95%	-	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1,31%	10,68%	5,33%	4,73%	15,02%	43,63%	0,20%	1,815%	9,84%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	1,20%	10,65%	4,94%	5,10%	14,67%	41,56%	0,20%	1,441%	8,18%

IMA-B 5	1,25%	9,83%	4,68%	6,98%	13,91%	34,53%	-	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	1,33%	10,06%	4,80%	7,07%	14,11%	34,25%	0,20%	0,783%	3,93%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,24%	9,71%	4,63%	6,90%	13,72%	33,75%	0,20%	0,717%	3,64%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1,21%	6,19%	3,89%	4,67%	9,96%	10,62%	0,70%	0,593%	4,54%
ELLEVEN II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1,20%	8,98%	4,42%	6,20%	12,61%	3,88%	0,70%	0,792%	4,02%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1,09%	9,18%	4,21%	6,51%	14,35%	28,61%	0,70%	0,459%	4,06%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	0,20%	6,44%	2,07%	3,97%	9,88%	-	0,70%	1,064%	7,23%

IDKA IPCA 2 Anos	0,97%	10,12%	4,34%	7,49%	14,33%	34,57%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,96%	9,32%	4,05%	6,79%	13,26%	33,40%	0,20%	0,491%	2,83%

IRF-M 1	0,90%	8,33%	2,86%	5,88%	13,15%	29,98%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,89%	8,21%	2,82%	5,81%	12,96%	29,61%	0,20%	0,081%	0,67%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,88%	8,21%	2,86%	5,81%	12,95%	29,38%	0,20%	0,081%	0,68%

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (agosto / 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%	6,31%	1,96%	4,43%	9,60%	27,80%	-	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1,59%	-46,10%	-47,66%	-45,11%	-61,77%	-78,88%	0,00%	8,285%	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	-0,21%	2,65%	-0,41%	1,09%	6,15%	23,00%	1,65%	1,254%	1,98%
Selic	0,80%	7,35%	2,43%	5,29%	12,06%	27,92%	-	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIA DO DI	0,99%	7,74%	2,65%	5,65%	12,68%	28,66%	0,20%	0,074%	0,12%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIA DO DI	0,79%	7,34%	2,47%	5,30%	11,95%	27,47%	0,15%	0,001%	0,09%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	7,46%	17,61%	12,95%	6,26%	22,34%	51,93%	-	-	-
TOTAL MIX FIC AÇÕES	5,37%	20,06%	11,05%	6,61%	22,66%	45,35%	1,90%	5,393%	17,88%

CDI	0,80%	7,34%	2,43%	5,28%	12,05%	27,88%	-	-	-
MULTINVEST FI MULTIMERCADO	1,15%	8,87%	3,44%	5,51%	13,55%	27,64%	1,00%	0,408%	2,63%

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

Administrador	Valor	%
BANCO BRADESCO	17.995.688,36	54,88%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	5.017.205,53	15,30%
BRIDGE ADMINISTRADORA DE RECURSOS	3.464.484,68	10,57%
RJI CORRETORA DE VALORES	3.063.566,80	9,34%
CM Capital Markets DTVM	1.646.492,06	5,02%
Única Administradora	826.849,50	2,52%
Santander Securities Services	507.507,98	1,55%
Orla DTVM	268.844,78	0,82%

Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5	11.436.719,51	34,88%
CDI	6.592.251,00	20,10%
IMA-B	5.966.669,13	18,20%
IRF-M 1	3.766.755,28	11,49%
FIDC	1.915.336,84	5,84%
IDKA IPCA 2A	1.340.208,88	4,09%
AÇÕES - LIVRES	826.849,50	2,52%
MULTIMERCADO - MODERADO	474.083,05	1,45%
IMA-B 5+	471.766,50	1,44%

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%
Maiο	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%
Agosto	32.418.624,67	0,00	0,00	32.790.639,69	372.015,02	1,15%	0,72%	158,44%	0,91%
Acumulado no ano					2.314.620,86	7,88%	5,65%	139,63%	

Acumulado no Ano

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	264.625,96	0,00	0,00	268.844,78	4.218,82	1,59%	8,28%	1,59%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	465.573,19	0,00	0,00	471.766,50	6.193,31	1,33%	2,64%	1,33%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	4.639.811,84	0,00	0,00	4.701.343,24	61.531,40	1,33%	0,78%	1,33%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	5.388.711,84	0,00	0,00	5.459.161,15	70.449,31	1,31%	1,82%	1,31%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	673.064,23	0,00	0,00	681.407,84	8.343,61	1,24%	0,72%	1,24%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.014.129,41	0,00	0,00	1.026.429,30	12.299,89	1,21%	0,59%	1,21%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	501.470,55	0,00	0,00	507.507,98	6.037,43	1,20%	1,44%	1,20%
ELLEVEN II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.267.424,93	0,00	0,00	1.282.602,11	15.177,18	1,20%	0,79%	1,20%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	3.427.262,24	0,00	0,00	3.464.484,68	37.222,44	1,09%	0,46%	1,09%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	4.275.289,92	0,00	0,00	4.317.527,72	42.237,80	0,99%	0,07%	0,99%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.327.412,89	0,00	0,00	1.340.208,88	12.795,99	0,96%	0,49%	0,96%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.501.566,76	0,00	0,00	2.523.822,31	22.255,55	0,89%	0,08%	0,89%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.232.079,92	0,00	0,00	1.242.932,97	10.853,05	0,88%	0,08%	0,88%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	2.256.941,85	0,00	0,00	2.274.723,28	17.781,43	0,79%	0,00%	0,79%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	279.878,66	0,00	0,00	280.452,34	573,68	0,20%	1,06%	0,20%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1.650.002,52	0,00	0,00	1.646.492,06	-3.510,46	-0,21%	1,25%	-0,21%
				Total Renda Fixa	324.460,43	1,04%	0,80%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
TOTAL MIX FIC AÇÕES	784.689,63	0,00	0,00	826.849,50	42.159,87	5,37%	5,39%	5,37%
MULTINVEST FI MULTIMERCADO	468.688,33	0,00	0,00	474.083,05	5.394,72	1,15%	0,41%	1,15%
Total Renda Variável					47.554,59	3,79%	3,58%	