

Relatório Analítico dos Investimentos em março e 1º Trimestre de 2017

Rec

Crédito & Mercado
Consultoria em Investimentos

RRP *CR* *R* *Q*

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 (março / 2017)

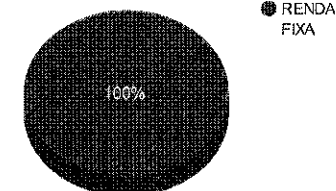
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.536.877,15	8,51%	257	0,19%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea "a"
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	1.913.169,54	6,42%	14.943	0,02%	Desenquadrado - RF
PIATÁ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO LP	D+1 ou D+1081	Não há	25.346.595,90	85,07%	22	11,56%	Desenquadrado - RF
TOTAL -			29.796.642,59				

(Handwritten signatures and initials)

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

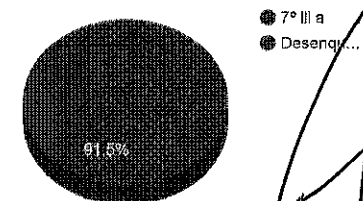
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	0,00	0,00%	1,00%	5,00%	70,00%	20.857.649,81
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	2.536.877,15	8,51%	1,00%	10,00%	60,00%	15.341.108,40
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	30,00%	8.938.992,78
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	1.489.832,13
Desenquadrado - RF	0,00%	27.259.765,44	91,49%	0,00%	0,00%	0,00%	-27.259.765,44
Total Renda Fixa	100,00%	29.796.642,59	100,00%	2,00	25,00	165,00	-

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Total Renda Variável	30,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00	0,00	-

Distribuição por Artigo / Resolução



Handwritten signatures and initials are present in the bottom right area of the page, including names like 'de', 'Ferreira', 'Rafael', and others.

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: março / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	0,00	0,00%	1,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	2.536.877,15	8,51%	1,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Desenquadrado - RF	27.259.765,44	91,48%	0,00%	0,00%
Total Renda Fixa	29.796.642,59	100,00%	2,00	165,00

Artigos - Renda Variável	Base: março / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Total Renda Variável	0,00	0,00%	0,00	0,00

Handwritten signatures and initials, including names like 'Bene', 'Luis', and others, along with various initials and marks.

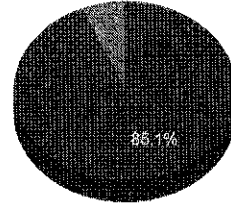
Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (março / 2017)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	1,05%	3,03%	3,03%	6,37%	13,75%	29,37%	-	-	-
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,59%	1,76%	1,76%	3,77%	8,20%	17,08%	5,00%	0,000%	0,04%
PIATÁ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO LP	0,39%	1,15%	1,15%	1,82%	3,60%	15,50%	1,40%	0,290%	0,75%
IMA-B	1,04%	6,89%	6,89%	9,36%	21,56%	40,51%	-	-	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,05%	6,96%	6,96%	9,42%	21,57%	40,08%	0,30%	2,060%	6,13%

[Handwritten signatures and initials]

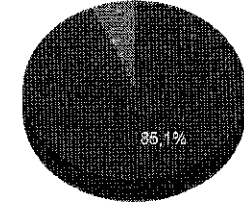
Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (março / 2017)

Administrador	Valor	%
Intrader DTVM	25.346.595,90	85,07%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	2.536.877,15	8,51%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	1.913.169,54	6,42%



- Intrader DTVM
- BB GESTÃO DE RECURS... DE
- CAIXA ECONÔM...

Sub-segmento	Valor	%
CRÉDITO PRIVADO	25.346.595,90	85,07%
IMA-B	2.536.877,15	8,51%
CDI	1.913.169,54	6,42%

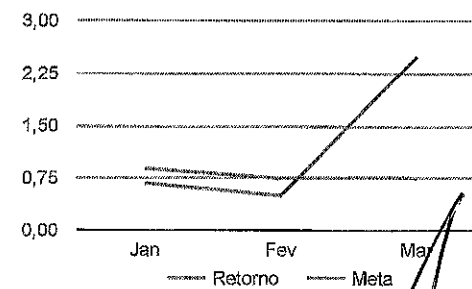
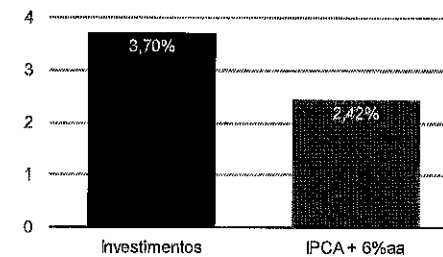


- CRÉDITO PRIVADO
- IMA-B
- CDI

[Handwritten signatures and initials]

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Acumulado no Ano



Handwritten signatures and initials are present in the lower right quadrant of the page, including several large, stylized signatures and smaller initials.

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.510.627,26	0,00	0,00	2.536.877,15	26.249,89	1,05%	2,06%	1,05%
PIATÃ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO LP	25.247.873,07	0,00	0,00	25.346.595,90	98.722,83	0,39%	0,29%	0,39%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	1.852.213,36	3.437.931,46	3.288.850,62	1.913.169,54	-88.124,86	-1,67%	0,00%	0,59%
Total Renda Fixa					36.848,06	0,12%	0,42%	

Handwritten signatures and initials, including the name 'D. S. S.', are present in the bottom right corner of the page.

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre / 2017

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
PIATÁ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO LP	25.058.290,97	0,00	0,00	25.346.595,90	288.304,93	1,15%	1,15%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.365.616,39	6.564,42	0,00	2.536.877,15	164.696,34	6,95%	6,96%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	223.898,93	19.447.955,53	17.686.858,32	1.913.169,54	-71.826,60	-1,43%	1,76%
Total Renda Fixa					381.174,67	1,31%	

[Handwritten signatures and initials]

Handwritten signatures and initials are present in the bottom right corner of the page, including a large signature that appears to be "P. de" and several other scribbled marks.