

Relatório Analítico dos Investimentos em dezembro de 2015



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 (dezembro / 2015)

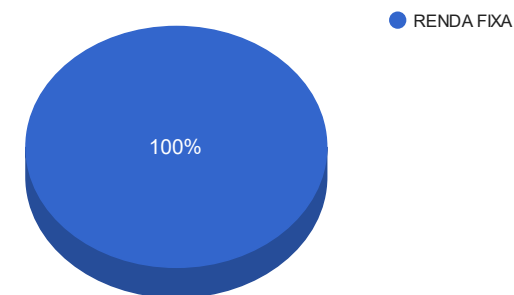
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	4.539.486,45	15,71%	647	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
PIATÁ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO LP	D+1 ou D+1081	Não há	24.362.542,55	84,29%	22	11,56%	Desenquadrado - RF
TOTAL -			28.902.029,00				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (dezembro / 2015)

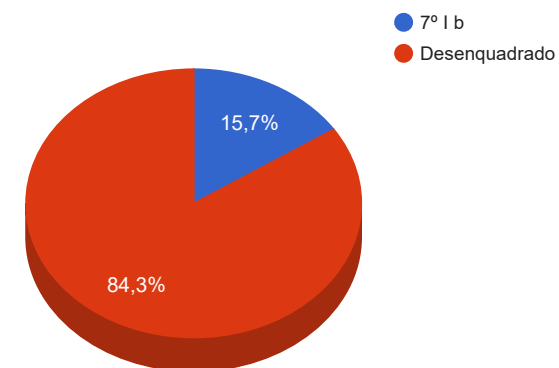
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	70,00%	4.539.486,45	15,71%	15.691.933,85
Desenquadrado - RF	0,00%	0,00%	24.362.542,55	84,29%	-24.362.542,55
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	15,00%	0,00	0,00%	4.335.304,35
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	0,00	0,00%	8.670.608,70
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.445.101,45
Total Renda Fixa	100,00%	120,00	28.902.029,00	100,00%	

Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	0,00	0,00%	4.335.304,35
Total Renda Variável	30,00%	15,00	0,00	0,00%	

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



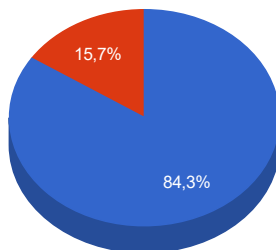
Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (dezembro / 2015)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDKA IPCA 2 Anos	1,89%	16,38%	5,14%	7,75%	16,38%	29,73%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,98%	15,38%	5,20%	7,57%	15,38%	28,34%	0,20%	0,781%	2,87%
CDI	1,16%	13,24%	3,36%	6,91%	13,24%	25,48%	-	-	-
PIATÃ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO LP	1,06%	6,25%	6,28%	8,79%	6,25%	16,20%	1,40%	1,311%	9,26%

Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (dezembro / 2015)

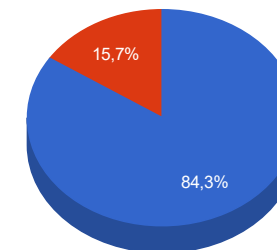
Administrador	Valor	%
Intrader DTVM	24.362.542,55	84,29%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	4.539.486,45	15,71%

- Intrader DTVM
- BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM



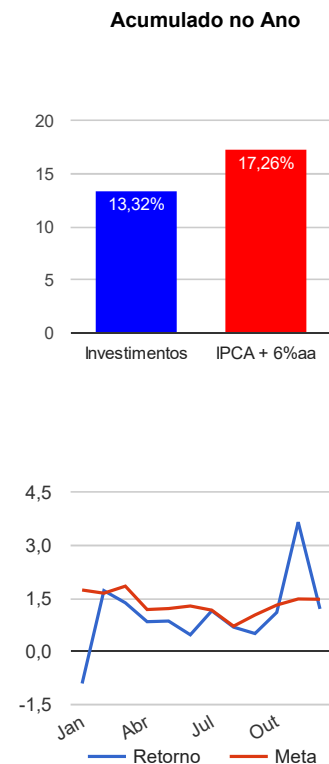
Sub-segmento	Valor	%
CRÉDITO PRIVADO	24.362.542,55	84,29%
IDKA IPCA 2A	4.539.486,45	15,71%

- CRÉDITO PRIVADO
- IDKA IPCA 2A



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2015

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	22.930.435,50	0,00	1.456.330,41	21.266.011,07	-208.094,02	-0,91%	1,73%	-52,37%	11,28%
Fevereiro	21.266.011,07	0,00	0,00	21.629.832,02	363.820,95	1,71%	1,64%	104,18%	2,48%
Março	21.629.832,02	3.596.330,41	0,00	25.571.630,75	345.468,32	1,37%	1,84%	74,56%	2,01%
Abril	25.571.630,75	0,00	0,00	25.785.971,16	214.340,41	0,84%	1,18%	71,23%	1,61%
Mai	25.785.971,16	0,00	0,00	26.007.797,34	221.826,18	0,86%	1,21%	71,28%	0,70%
Junho	26.007.797,34	0,00	0,00	26.130.438,36	122.641,02	0,47%	1,28%	36,82%	0,40%
Julho	26.130.438,36	0,00	0,00	26.428.963,36	298.525,00	1,14%	1,16%	98,78%	5,33%
Agosto	26.428.963,36	0,00	0,00	26.608.880,62	179.917,26	0,68%	0,71%	96,18%	0,96%
Setembro	26.608.880,62	0,00	0,00	26.743.234,70	134.354,08	0,50%	1,03%	49,05%	1,18%
Outubro	26.743.234,70	0,00	0,00	27.037.181,32	293.946,62	1,10%	1,31%	83,86%	1,14%
Novembro	27.037.181,32	1.295.106,96	780.000,00	28.558.444,41	1.006.156,13	3,65%	1,48%	247,04%	6,03%
Dezembro	28.558.444,41	0,00	0,00	28.902.029,00	343.584,59	1,20%	1,47%	81,57%	1,23%
Acumulado no ano					3.316.486,54	13,32%	17,26%	77,15%	



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de dezembro / 2015

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.451.280,39	0,00	0,00	4.539.486,45	88.206,06	1,98%	0,78%	1,98%
PIATÁ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO LP	24.107.164,02	0,00	0,00	24.362.542,55	255.378,53	1,06%	1,31%	1,06%
				Total Renda Fixa	343.584,59	1,20%	1,23%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre / 2015

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
PIATÁ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO LP	22.923.660,28	0,00	0,00	24.362.542,55	1.438.882,27	6,28%	6,28%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.819.574,42	1.295.106,96	780.000,00	4.539.486,45	204.805,07	5,00%	5,20%
Total Renda Fixa					1.643.687,34	6,05%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no Ano de 2015

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
PIATÁ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO LP	22.930.435,50	0,00	1.456.330,41	24.362.542,55	2.888.437,46	13,52%	6,25%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	4.891.437,37	780.000,00	4.539.486,45	428.049,08	11,52%	15,38%
Total Renda Fixa					3.316.486,54	13,32%	

