

Relatório Analítico dos Investimentos em dezembro, 4º Trimestre e ano de 2016



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 / 2016)

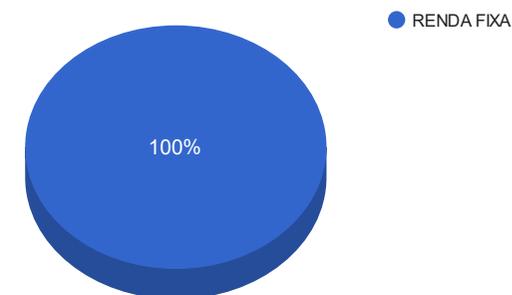
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.365.616,39	8,56%	244	0,21%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	223.898,93	0,81%	14.273	0,00%	Desenquadrado - RF
PIATÃ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO LP	D+1 ou D+1081	Não há	25.058.290,97	90,63%	21	11,56%	Desenquadrado - RF
		TOTAL -	27.647.806,29				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (dezembro / 2016)

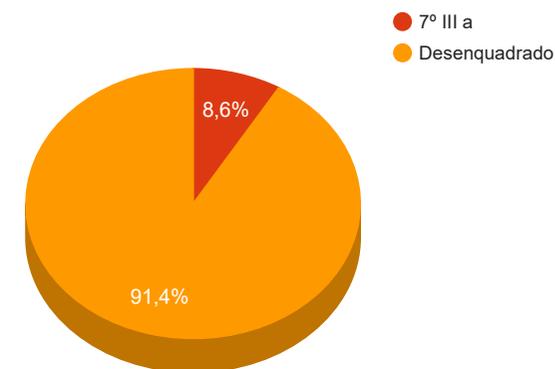
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	70,00%	0,00	0,00%	19.353.464,40
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	30,00%	2.365.616,39	8,56%	5.928.725,50
Desenquadrado - RF	0,00%	0,00%	25.282.189,90	91,44%	-25.282.189,90
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	80,00%	10,00%	0,00	0,00%	2.764.780,63
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	0,00	0,00%	8.294.341,89
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	30,00%	10,00%	0,00	0,00%	2.764.780,63
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.382.390,31
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.382.390,31
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.382.390,31
Total Renda Fixa	100,00%	165,00	27.647.806,29	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%	4.147.170,94
Total Renda Variável	30,00%	15,00	0,00	0,00%	

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



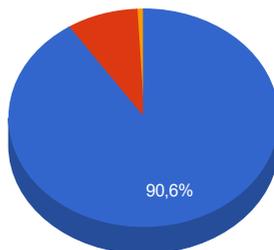
Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (dezembro / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	2,91%	24,81%	2,30%	7,46%	24,81%	35,90%	-	-	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,88%	24,46%	2,30%	7,59%	24,46%	35,19%	0,30%	3,580%	7,27%
CDI	1,12%	14,00%	3,24%	6,82%	14,00%	29,09%	-	-	-
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,68%	8,47%	1,98%	4,17%	8,47%	16,88%	5,00%	0,001%	0,01%
PIATÃ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO LP	0,40%	2,86%	0,66%	1,06%	2,86%	9,28%	1,40%	0,317%	0,65%

Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (dezembro / 2016)

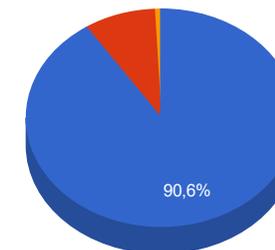
Administrador	Valor	%
Intrader DTVM	25.058.290,97	90,63%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	2.365.616,39	8,56%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	223.898,93	0,81%

- Intrader DTVM
- BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM
- CAIXA ECONÔMICA FEDERAL



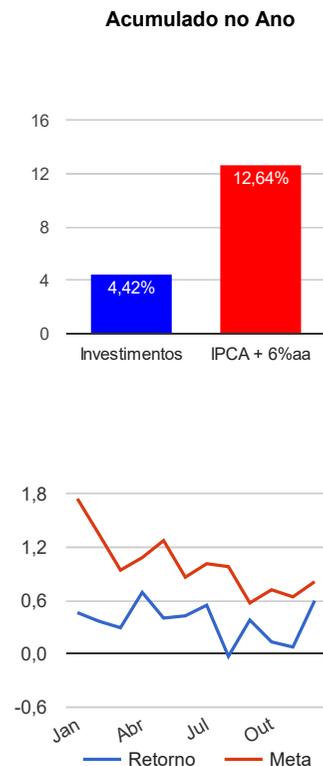
Sub-segmento	Valor	%
CRÉDITO PRIVADO	25.058.290,97	90,63%
IMA-B	2.365.616,39	8,56%
CDI	223.898,93	0,81%

- CRÉDITO PRIVADO
- IMA-B
- CDI



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	28.902.029,00	0,00	300.000,00	28.735.741,24	133.712,24	0,46%	1,74%	26,60%	0,75%
Fevereiro	28.735.741,24	0,00	0,00	28.840.575,54	104.834,30	0,36%	1,34%	27,14%	0,26%
Março	28.840.575,54	0,00	100.000,00	28.825.056,76	84.481,22	0,29%	0,94%	31,09%	0,32%
Abril	28.825.056,76	0,00	100.000,00	28.923.677,54	198.620,78	0,69%	1,08%	64,02%	0,48%
Mai	28.923.677,54	0,00	2.500.000,00	26.539.012,47	115.334,93	0,40%	1,27%	31,38%	0,24%
Junho	26.539.012,47	2.369.000,00	400.000,00	28.629.177,59	121.165,12	0,43%	0,86%	49,32%	0,41%
Julho	28.629.177,59	0,00	500.000,00	28.284.962,38	155.784,79	0,54%	1,01%	53,91%	0,34%
Agosto	28.284.962,38	0,00	500.000,00	27.776.884,97	-8.077,41	-0,03%	0,98%	-2,93%	0,78%
Setembro	27.776.884,97	0,00	350.000,00	27.532.166,03	105.281,06	0,38%	0,57%	66,83%	0,23%
Outubro	27.532.166,03	250.000,00	0,00	27.819.504,75	37.338,72	0,13%	0,72%	18,54%	0,29%
Novembro	27.819.504,75	100.000,00	750.000,00	27.190.590,84	21.086,09	0,08%	0,64%	11,76%	0,44%
Dezembro	27.190.590,84	396.407,68	102.545,30	27.647.806,29	163.353,07	0,59%	0,81%	73,24%	0,59%
Acumulado no ano					1.232.914,91	4,42%	12,64%	34,95%	



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de dezembro / 2016

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.131.553,26	172.508,75	0,00	2.365.616,39	61.554,38	2,67%	3,58%	2,88%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	101.640,39	0,00	102.545,30	0,00	904,91	0,89%	1,06%	1,25%
PIATÃ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO LP	24.957.397,19	0,00	0,00	25.058.290,97	100.893,78	0,40%	0,32%	0,40%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,00	223.898,93	0,00	223.898,93	0,00	0,00%	0,00%	0,68%
Total Renda Fixa					163.353,07	0,59%	0,59%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre / 2016

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
PIATÁ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO LP	24.892.843,12	0,00	0,00	25.058.290,97	165.447,85	0,66%	0,66%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.143.766,11	172.508,75	0,00	2.365.616,39	49.341,53	2,09%	2,30%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	495.556,80	350.000,00	852.545,30	0,00	6.988,50	1,66%	2,22%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,00	223.898,93	0,00	223.898,93	0,00	0,00%	1,98%
Total Renda Fixa					221.777,88	0,81%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no Ano de 2016

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
PIATÃ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO LP	24.362.542,55	0,00	0,00	25.058.290,97	695.748,42	2,86%	2,86%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.539.486,45	350.000,00	5.252.545,30	0,00	363.058,85	13,88%	14,89%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	2.541.508,75	350.000,00	2.365.616,39	174.107,64	7,46%	24,46%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,00	223.898,93	0,00	223.898,93	0,00	0,00%	8,47%
				Total Renda Fixa	1.232.914,91	4,42%	

