

# Relatório Analítico dos Investimentos em junho, 2º Trimestre e 1º semestre 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 (junho / 2016)

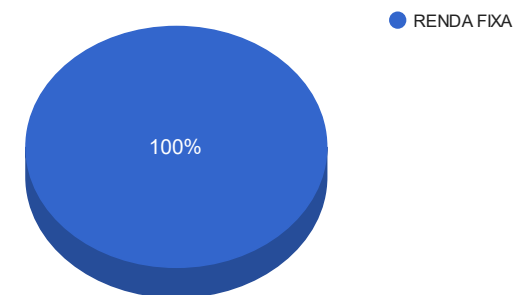
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.461.059,05	5,10%	738	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.372.044,35	8,29%	232	0,25%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
PIATÁ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO LP	D+1 ou D+1081	Não há	24.796.074,19	86,61%	22	11,56%	Desenquadrado - RF
		<b>TOTAL -</b>	<b>28.629.177,59</b>				

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

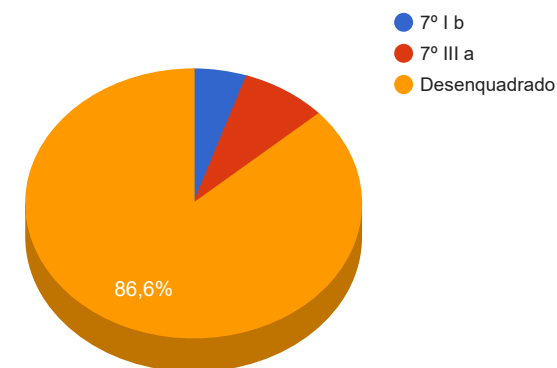
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	70,00%	1.461.059,05	5,10%	18.579.365,26
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	30,00%	2.372.044,35	8,29%	6.216.708,93
<b>Desenquadrado - RF</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>24.796.074,19</b>	<b>86,61%</b>	<b>-24.796.074,19</b>
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	80,00%	10,00%	0,00	0,00%	2.862.917,76
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	0,00	0,00%	8.588.753,28
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	30,00%	10,00%	0,00	0,00%	2.862.917,76
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.431.458,88
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.431.458,88
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.431.458,88
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>165,00</b>	<b>28.629.177,59</b>	<b>100,00%</b>	

Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	0,00	0,00%	4.294.376,64
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>15,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	

**Distribuição por Segmento**



**Distribuição por Artigo / Resolução**



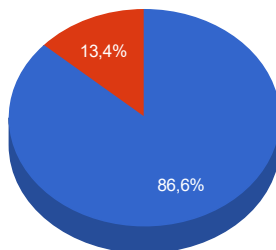
Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (junho / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	1,93%	16,15%	5,83%	16,15%	16,73%	32,26%	-	-	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,84%	15,68%	5,64%	15,68%	16,13%	31,42%	0,30%	2,313%	9,70%
CDI	1,16%	6,72%	3,36%	6,72%	14,09%	27,57%	-	-	-
PIATÃ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO LP	0,41%	1,78%	1,35%	1,78%	10,72%	11,76%	1,40%	0,187%	5,68%
IDKA IPCA 2 Anos	0,93%	8,58%	3,25%	8,58%	17,00%	31,47%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,82%	8,36%	3,26%	8,36%	16,56%	30,05%	0,20%	1,178%	3,23%

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

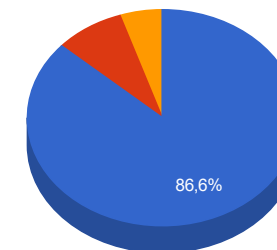
Administrador	Valor	%
Intrader DTVM	24.796.074,19	86,61%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	3.833.103,40	13,39%

- Intrader DTVM
- BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM



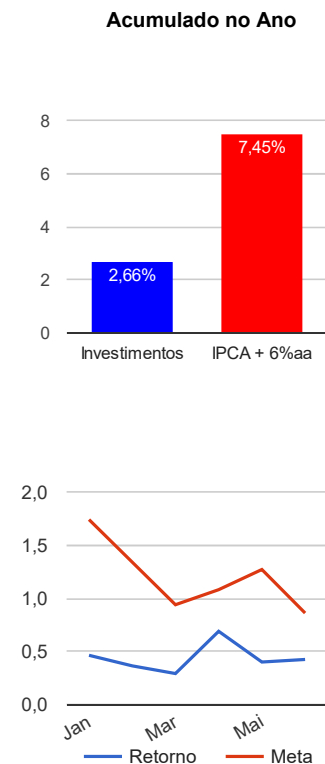
Sub-segmento	Valor	%
CRÉDITO PRIVADO	24.796.074,19	86,61%
IMA-B	2.372.044,35	8,29%
IDKA IPCA 2A	1.461.059,05	5,10%

- CRÉDITO PRIVADO
- IMA-B
- IDKA IPCA 2A



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%
Acumulado no ano					758.148,59	2,66%	7,45%	35,71%	



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

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	1.844.980,75	0,00	400.000,00	1.461.059,05	16.078,30	0,87%	1,18%	0,82%
PIATÁ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO LP	24.694.031,72	0,00	0,00	24.796.074,19	102.042,47	0,41%	0,19%	0,41%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	2.369.000,00	0,00	2.372.044,35	3.044,35	0,13%	2,31%	1,84%
Total Renda Fixa					121.165,12	0,43%	0,41%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre / 2016

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
PIATÁ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO LP	24.466.509,40	0,00	0,00	24.796.074,19	329.564,79	1,35%	1,35%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.358.547,36	0,00	3.000.000,00	1.461.059,05	102.511,69	2,88%	3,26%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	2.369.000,00	0,00	2.372.044,35	3.044,35	0,13%	5,64%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>435.120,83</b>	<b>1,52%</b>	



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre / 2016

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
PIATÁ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO LP	24.362.542,55	0,00	0,00	24.796.074,19	433.531,64	1,78%	1,78%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.539.486,45	0,00	3.400.000,00	1.461.059,05	321.572,60	7,97%	8,36%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	2.369.000,00	0,00	2.372.044,35	3.044,35	0,13%	15,68%
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>758.148,59</b>	<b>2,66%</b>	

