

Relatório Analítico dos Investimentos em março e 1º Trimestre 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 (março / 2016)

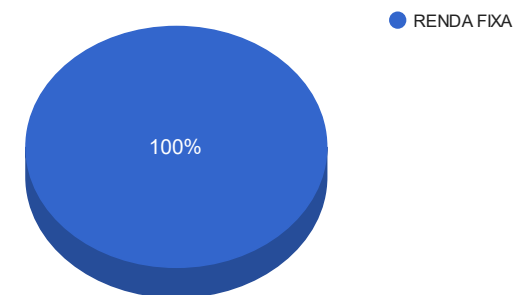
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	4.358.547,36	15,12%	721	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
PIATÁ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO LP	D+1 ou D+1081	Não há	24.466.509,40	84,88%	22	11,56%	Desenquadrado - RF
		TOTAL -	28.825.056,76				

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

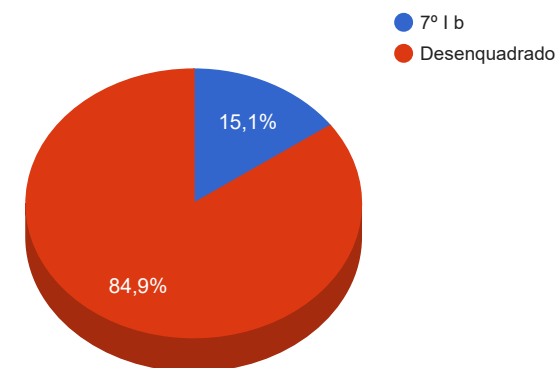
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	70,00%	4.358.547,36	15,12%	15.818.992,37
Desenquadrado - RF	0,00%	0,00%	24.466.509,40	84,88%	-24.466.509,40
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	30,00%	0,00	0,00%	8.647.517,03
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	80,00%	10,00%	0,00	0,00%	2.882.505,68
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	0,00	0,00%	8.647.517,03
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	30,00%	10,00%	0,00	0,00%	2.882.505,68
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.441.252,84
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.441.252,84
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.441.252,84
Total Renda Fixa	100,00%	165,00	28.825.056,76	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%	4.323.758,51
Total Renda Variável	30,00%	15,00	0,00	0,00%	

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



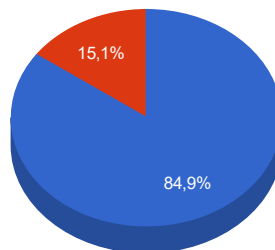
Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (março / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	1,16%	3,25%	3,25%	6,72%	13,73%	26,53%	-	-	-
PIATÃ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO LP	0,25%	0,43%	0,43%	6,73%	11,49%	12,65%	1,40%	0,050%	5,80%
IDKA IPCA 2 Anos	0,15%	5,16%	5,16%	10,57%	17,31%	32,68%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,53%	4,93%	4,93%	10,39%	16,25%	31,02%	0,20%	1,837%	3,20%

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

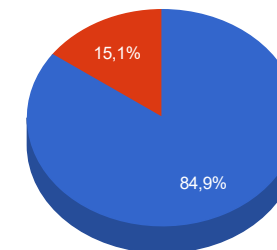
Administrador	Valor	%
Intrader DTVM	24.466.509,40	84,88%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	4.358.547,36	15,12%

- Intrader DTVM
- BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM



Sub-segmento	Valor	%
CRÉDITO PRIVADO	24.466.509,40	84,88%
IDKA IPCA 2A	4.358.547,36	15,12%

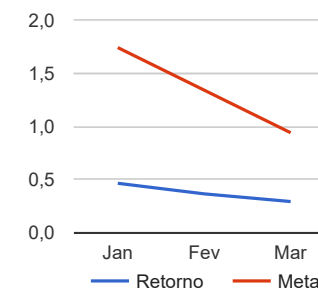
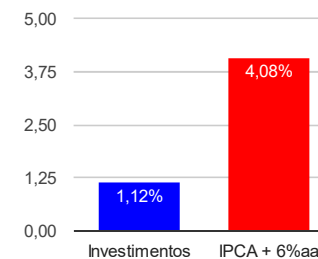
- CRÉDITO PRIVADO
- IDKA IPCA 2A



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%
Acumulado no ano					323.027,76	1,12%	4,08%	27,57%	

Acumulado no Ano



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de março / 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	4.434.897,11	0,00	100.000,00	4.358.547,36	23.650,25	0,53%	1,84%	0,53%
PIATÁ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO LP	24.405.678,43	0,00	0,00	24.466.509,40	60.830,97	0,25%	0,05%	0,25%
				Total Renda Fixa	84.481,22	0,29%	0,32%	

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.539.486,45	0,00	400.000,00	4.358.547,36	219.060,91	4,95%	4,93%
PIATÁ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO LP	24.362.542,55	0,00	0,00	24.466.509,40	103.966,85	0,43%	0,43%
Total Renda Fixa					323.027,76	1,12%	

