

Relatório Analítico dos Investimentos em setembro e 3º 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 (setembro / 2016)

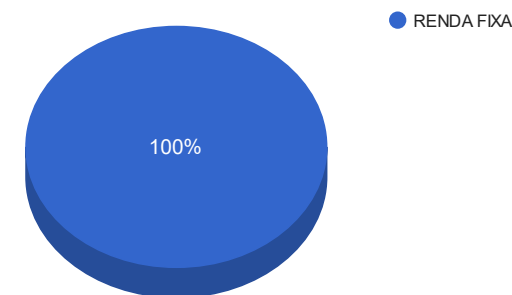
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	495.556,80	1,80%	754	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.143.766,11	7,79%	248	0,18%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
PIATÃ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO LP	D+1 ou D+1081	Não há	24.892.843,12	90,41%	22	11,56%	Desenquadrado - RF
		TOTAL -	27.532.166,03				

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

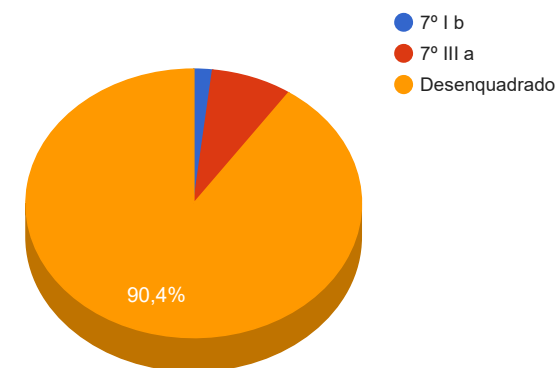
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	70,00%	495.556,80	1,80%	18.776.959,42
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	30,00%	2.143.766,11	7,79%	6.115.883,70
Desenquadrado - RF	0,00%	0,00%	24.892.843,12	90,41%	-24.892.843,12
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	80,00%	10,00%	0,00	0,00%	2.753.216,60
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	0,00	0,00%	8.259.649,81
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	30,00%	10,00%	0,00	0,00%	2.753.216,60
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.376.608,30
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.376.608,30
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	1.376.608,30
Total Renda Fixa	100,00%	165,00	27.532.166,03	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%	4.129.824,90
Total Renda Variável	30,00%	15,00	0,00	0,00%	

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



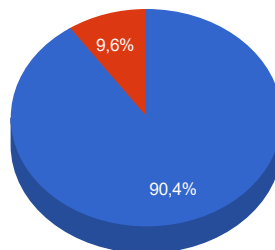
Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (setembro / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	1,57%	22,00%	5,04%	11,16%	28,36%	35,87%	-	-	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,64%	21,66%	5,17%	11,11%	27,79%	35,14%	0,30%	2,270%	6,99%
IDKA IPCA 2 Anos	1,50%	12,64%	3,74%	7,11%	18,43%	33,53%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,35%	12,40%	3,73%	7,12%	18,25%	32,16%	0,20%	0,558%	2,63%
CDI	1,11%	10,42%	3,47%	6,94%	14,13%	28,50%	-	-	-
PIATÃ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO LP	0,24%	2,18%	0,39%	1,74%	8,59%	10,54%	1,40%	0,050%	4,25%

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

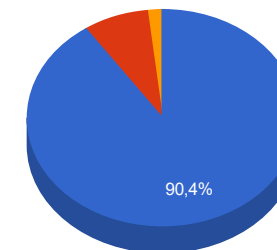
Administrador	Valor	%
Intrader DTVM	24.892.843,12	90,41%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	2.639.322,91	9,59%

- Intrader DTVM
- BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM



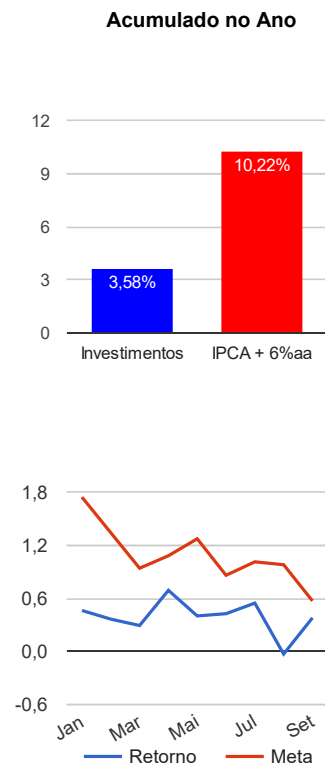
Sub-segmento	Valor	%
CRÉDITO PRIVADO	24.892.843,12	90,41%
IMA-B	2.143.766,11	7,79%
IDKA IPCA 2A	495.556,80	1,80%

- 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%
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%
Acumulado no ano					1.011.137,03	3,58%	10,22%	35,06%	



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.454.372,99	0,00	350.000,00	2.143.766,11	39.393,12	1,61%	2,27%	1,64%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	488.963,67	0,00	0,00	495.556,80	6.593,13	1,35%	0,56%	1,35%
PIATÁ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO LP	24.833.548,31	0,00	0,00	24.892.843,12	59.294,81	0,24%	0,05%	0,24%
Total Renda Fixa					105.281,06	0,38%	0,23%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre / 2016

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.372.044,35	0,00	350.000,00	2.143.766,11	121.721,76	5,13%	5,17%
PIATÁ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO LP	24.796.074,19	0,00	0,00	24.892.843,12	96.768,93	0,39%	0,39%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.461.059,05	0,00	1.000.000,00	495.556,80	34.497,75	3,76%	3,73%
Total Renda Fixa					252.988,44	0,90%	

