

Relatório Analítico dos Investimentos em janeiro de 2017



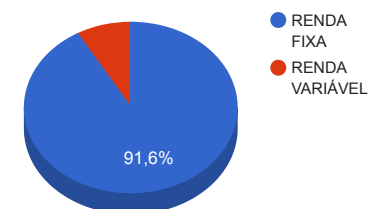
Carteira consolidada de investimentos - base (janeiro / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			14.125,80	0,03%			Artigo 20
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.652.564,63	10,49%	619	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	4.266.956,63	9,62%	100	1,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	8.357.223,83	18,84%	1.181	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.631.636,97	5,93%	728	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	6.148.944,69	13,86%	244	0,52%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	4.528.528,91	10,21%	786	0,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	645.989,98	1,46%	596	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	5.133.405,03	11,57%	116	1,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP	Não se aplica	Não há	4.275.082,97	9,64%	19	6,88%	Artigo 7º, Inciso VI
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	1.684.370,59	3,80%	85	1,41%	Artigo 8º, Inciso IV
JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII - JTPR11	Não se aplica	Não se aplica	2.019.611,12	4,55%		14,55%	Artigo 8º, Inciso VI
		TOTAL -	44.358.441,15				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (janeiro / 2017)

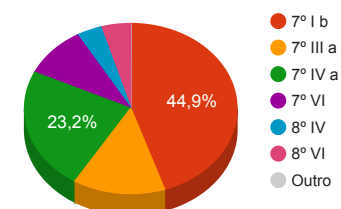
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 20	100,00%	14.125,80	0,03%	0,00%	0,00%	0,00%	-14.125,80
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	19.908.382,06	44,88%	50,00%	50,00%	80,00%	15.578.370,86
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	6.148.944,69	13,86%	0,00%	0,00%	60,00%	20.466.120,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	10.307.923,92	23,24%	5,00%	10,00%	30,00%	2.999.608,43
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	4.275.082,97	9,64%	5,00%	10,00%	15,00%	2.378.683,20
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	2.217.922,06
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	2.217.922,06
Total Renda Fixa	100,00%	40.654.459,44	91,65%	60,00	75,00	215,00	-

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	15,00%	6.653.766,17
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	0,00	0,00%	3,00%	5,00%	15,00%	6.653.766,17
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	1.684.370,59	3,80%	2,00%	5,00%	5,00%	533.551,47
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	2.217.922,06
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	2.019.611,12	4,55%	0,00%	5,00%	5,00%	198.310,94
Total Renda Variável	30,00%	3.703.981,71	8,35%	5,00	25,00	45,00	-

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: janeiro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 20	14.125,80	0,03%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	19.908.382,06	44,88%	50,00%	80,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	6.148.944,69	13,86%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	10.307.923,92	23,24%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	4.275.082,97	9,64%	5,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	40.654.459,44	91,65%	60,00	195,00

Artigos - Renda Variável	Base: janeiro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	1.684.370,59	3,80%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	2.019.611,12	4,55%	0,00%	5,00%
Total Renda Variável	3.703.981,71	8,35%	7,00	55,00

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (janeiro / 2017)

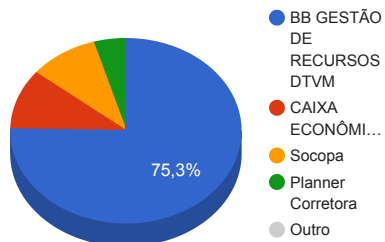
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	1,87%	1,87%	3,55%	6,79%	24,76%	34,25%	-	-	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,89%	1,89%	3,56%	6,99%	24,48%	33,61%	0,30%	3,336%	7,42%
IMA Geral ex-C	1,77%	1,77%	3,80%	7,59%	20,78%	31,88%	-	-	-
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,78%	1,78%	3,75%	7,53%	20,66%	31,44%	0,20%	1,607%	3,72%
125% do CDI	1,36%	1,36%	4,11%	8,57%	17,84%	37,86%	-	-	-
INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP	1,36%	1,36%	4,12%	8,57%	17,86%	37,90%	0,20%	0,012%	-
IRF-M 1	1,29%	1,29%	3,58%	7,06%	14,32%	29,93%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,26%	1,26%	3,49%	6,90%	14,07%	29,23%	0,10%	0,297%	0,32%
IDKA IPCA 2 Anos	1,09%	1,09%	2,97%	6,30%	12,25%	32,94%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,08%	1,08%	2,89%	6,06%	12,74%	31,45%	0,20%	1,089%	2,32%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,06%	1,06%	2,89%	5,98%	12,92%	31,70%	0,20%	1,042%	2,26%
CDI	1,08%	1,08%	3,28%	6,80%	14,03%	29,29%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,10%	1,10%	3,32%	6,91%	13,93%	29,41%	0,20%	0,020%	0,17%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,01%	1,01%	3,08%	6,40%	13,15%	27,30%	1,00%	0,011%	0,08%
IPCA + 6,00% ao ano	0,89%	0,89%	2,37%	4,70%	11,70%	30,99%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,91%	0,91%	2,37%	4,94%	12,42%	31,82%	0,20%	0,041%	0,34%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (janeiro / 2017)

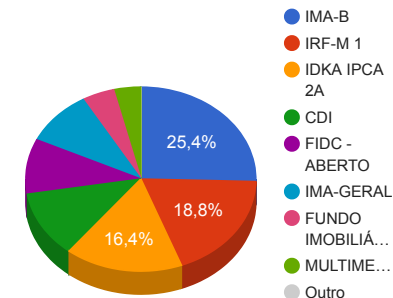
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	1,08%	1,08%	3,28%	6,80%	14,03%	29,29%	-	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	-0,12%	-0,12%	1,32%	4,90%	12,77%	27,29%	0,60%	3,083%	3,80%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII - JTPR11	-	-	-	-	-	-	1,80%	-	-

Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (janeiro / 2017)

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	33.397.056,63	75,29%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	4.652.564,63	10,49%
Socopa	4.275.082,97	9,64%
Planner Corretora	2.019.611,12	4,55%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	14.125,80	0,03%



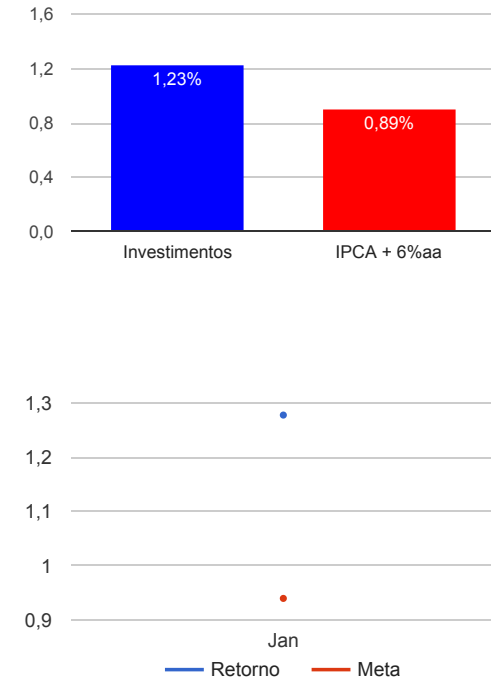
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	11.282.349,72	25,43%
IRF-M 1	8.357.223,83	18,84%
IDKA IPCA 2A	7.284.201,60	16,42%
CDI	5.174.518,89	11,67%
FIDC - ABERTO	4.275.082,97	9,64%
IMA-GERAL	4.266.956,63	9,62%
FUNDO IMOBILIÁRIO	2.019.611,12	4,55%
MULTIMERCADO	1.684.370,59	3,80%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	14.125,80	0,03%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	44.243.747,03	92.154,35	534.644,26	44.344.315,35	543.058,23	1,23%	0,89%	137,61%	1,02%
Acumulado no ano					543.058,23	1,23%	0,89%	137,61%	

Acumulado no Ano



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de janeiro / 2017

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.034.831,09	0,00	0,00	6.148.944,69	114.113,60	1,89%	3,34%	1,89%
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	4.192.189,96	0,00	0,00	4.266.956,63	74.766,67	1,78%	1,61%	1,78%
INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP	4.217.689,27	0,00	0,00	4.275.082,97	57.393,70	1,36%	0,01%	1,36%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.253.232,96	0,00	0,00	8.357.223,83	103.990,87	1,26%	0,30%	1,26%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	4.479.352,11	0,00	0,00	4.528.528,91	49.176,80	1,10%	0,02%	1,10%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.603.436,84	0,00	0,00	2.631.636,97	28.200,13	1,08%	1,09%	1,08%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.603.589,49	0,00	0,00	4.652.564,63	48.975,14	1,06%	1,04%	1,06%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.087.145,56	0,00	0,00	5.133.405,03	46.259,47	0,91%	0,04%	0,91%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.077.995,74	92.154,35	534.644,26	645.989,98	10.484,15	0,90%	0,01%	1,01%
Total Renda Fixa					533.360,53	1,32%	0,93%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de janeiro / 2017

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII - JTPR11	2.007.900,26	0,00	0,00	2.019.611,12	11.710,86	0,58%	-	0,59%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1.686.383,75	0,00	0,00	1.684.370,59	-2.013,16	-0,12%	3,08%	-0,12%
Total Renda Variável					9.697,70	0,26%	3,08%	