

# Relatório Analítico dos Investimentos em abril de 2017



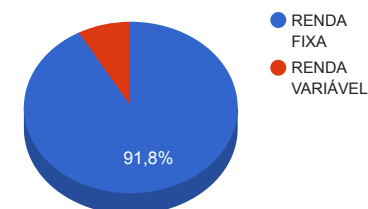
Carteira consolidada de investimentos - base (abril / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			21.234,21	0,05%			Artigo 20
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	4.428.249,53	9,56%	107	1,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.724.699,98	5,88%	717	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	8.605.673,94	18,58%	1.168	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.817.176,61	10,40%	609	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	6.432.380,18	13,89%	258	0,51%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	4.653.780,99	10,05%	754	0,10%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.310.768,72	2,83%	608	0,10%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	5.099.359,75	11,01%	116	1,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP	Não se aplica	Não há	4.421.459,91	9,55%	17	7,80%	Artigo 7º, Inciso VI
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	1.753.360,71	3,79%	77	2,28%	Artigo 8º, Inciso IV
JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII - JTPR11	Não se aplica	Não se aplica	2.042.098,57	4,41%		12,05%	Artigo 8º, Inciso VI
		<b>TOTAL -</b>	<b>46.310.243,10</b>				

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

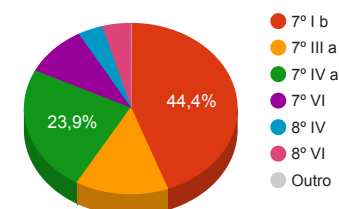
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 20	100,00%	21.234,21	0,05%	0,00%	0,00%	0,00%	-21.234,21
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	20.575.800,06	44,43%	50,00%	50,00%	80,00%	16.472.394,42
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	6.432.380,18	13,89%	0,00%	0,00%	60,00%	21.353.765,68
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	11.063.909,46	23,89%	5,00%	10,00%	30,00%	2.829.163,47
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	4.421.459,91	9,55%	5,00%	10,00%	15,00%	2.525.076,56
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	2.315.512,16
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	2.315.512,16
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>42.514.783,82</b>	<b>91,80%</b>	<b>60,00</b>	<b>75,00</b>	<b>215,00</b>	<b>-</b>

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%	6.946.536,47
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	0,00	0,00%	3,00%	5,00%	15,00%	6.946.536,47
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	1.753.360,71	3,79%	2,00%	5,00%	5,00%	562.151,45
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	2.315.512,16
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	2.042.098,57	4,41%	0,00%	5,00%	5,00%	273.413,59
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>3.795.459,28</b>	<b>8,20%</b>	<b>5,00</b>	<b>25,00</b>	<b>45,00</b>	<b>-</b>

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: abril / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 20	21.234,21	0,05%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	20.575.800,06	44,43%	50,00%	80,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	6.432.380,18	13,89%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	11.063.909,46	23,89%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	4.421.459,91	9,55%	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%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>42.514.783,82</b>	<b>91,80%</b>	<b>60,00</b>	<b>195,00</b>

Artigos - Renda Variável	Base: abril / 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	1.753.360,71	3,79%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	2.042.098,57	4,41%	0,00%	5,00%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>3.795.459,28</b>	<b>8,20%</b>	<b>7,00</b>	<b>55,00</b>

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

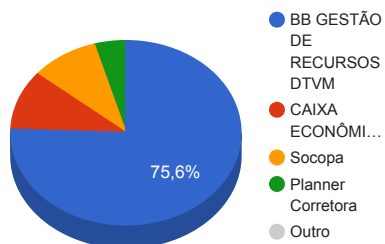
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
125% do CDI	0,98%	4,82%	3,42%	7,67%	17,09%	37,69%	-	-	-
INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP	0,99%	4,83%	3,42%	7,68%	17,11%	37,74%	0,20%	0,017%	-
IDKA IPCA 2 Anos	0,92%	5,08%	3,95%	7,03%	13,24%	34,55%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,79%	4,64%	3,54%	6,53%	12,81%	33,04%	0,20%	0,465%	1,76%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,76%	4,66%	3,54%	6,53%	12,72%	32,84%	0,20%	0,481%	1,83%
IRF-M 1	0,87%	4,36%	3,04%	6,72%	13,86%	30,56%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,86%	4,27%	2,97%	6,56%	13,53%	29,85%	0,10%	0,162%	0,29%
CDI	0,79%	3,84%	2,72%	6,09%	13,45%	29,16%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,78%	3,89%	2,77%	6,17%	13,57%	29,27%	0,20%	0,015%	0,18%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,73%	3,57%	2,53%	5,68%	12,72%	27,15%	1,00%	0,014%	0,09%
IPCA + 6,00% ao ano	0,56%	3,02%	2,11%	4,52%	10,30%	27,71%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,61%	3,12%	2,19%	4,61%	10,72%	28,49%	0,20%	0,027%	0,26%
IMA Geral ex-C	0,34%	5,68%	3,84%	7,78%	16,05%	34,07%	-	-	-
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,30%	5,63%	3,78%	7,67%	15,84%	33,57%	0,20%	1,033%	3,00%
IMA-B	-0,32%	6,55%	4,60%	8,31%	16,59%	36,72%	-	-	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,35%	6,59%	4,61%	8,34%	16,62%	36,21%	0,30%	1,889%	5,82%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

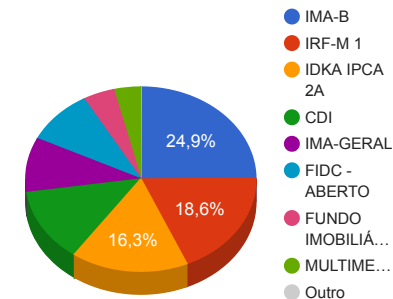
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	0,79%	3,84%	2,72%	6,09%	13,45%	29,16%	-	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1,34%	3,97%	4,10%	5,47%	14,01%	29,15%	0,60%	2,107%	4,65%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII - JTPR11	-	-	-	-	-	-	1,80%	-	-

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	35.008.273,80	75,60%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	4.817.176,61	10,40%
Socopa	4.421.459,91	9,55%
Planner Corretora	2.042.098,57	4,41%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	21.234,21	0,05%



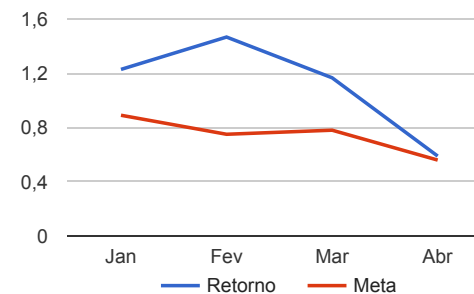
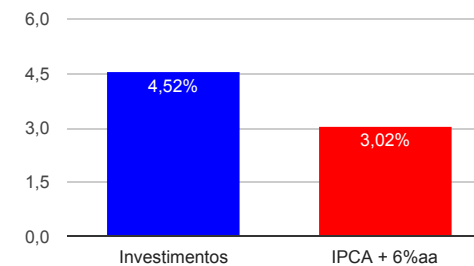
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	11.531.739,93	24,90%
IRF-M 1	8.605.673,94	18,58%
IDKA IPCA 2A	7.541.876,59	16,29%
CDI	5.964.549,71	12,88%
IMA-GERAL	4.428.249,53	9,56%
FIDC - ABERTO	4.421.459,91	9,55%
FUNDO IMOBILIÁRIO	2.042.098,57	4,41%
MULTIMERCADO	1.753.360,71	3,79%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	21.234,21	0,05%



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%
Fevereiro	44.344.315,35	780.091,70	678.211,40	45.097.632,12	651.436,47	1,47%	0,75%	195,83%	0,64%
Março	45.097.632,12	858.634,97	721.914,10	45.761.681,44	527.328,45	1,17%	0,78%	148,59%	0,69%
Abril	45.761.681,44	910.613,90	654.502,67	46.289.008,89	271.216,22	0,59%	0,56%	105,69%	0,58%
Acumulado no ano					1.993.039,37	4,52%	3,02%	149,90%	

**Acumulado no Ano**





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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP	4.378.246,00	0,00	0,00	4.421.459,91	43.213,91	0,99%	0,02%	0,99%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.532.622,09	0,00	0,00	8.605.673,94	73.051,85	0,86%	0,16%	0,86%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.779.568,58	0,00	0,00	4.817.176,61	37.608,03	0,79%	0,46%	0,79%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	4.617.636,64	0,00	0,00	4.653.780,99	36.144,35	0,78%	0,01%	0,78%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.704.083,01	0,00	0,00	2.724.699,98	20.616,97	0,76%	0,48%	0,76%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.068.225,24	0,00	0,00	5.099.359,75	31.134,51	0,61%	0,03%	0,61%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.046.087,23	910.613,90	654.502,67	1.310.768,72	8.570,26	0,44%	0,01%	0,73%
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	4.415.003,29	0,00	0,00	4.428.249,53	13.246,24	0,30%	1,03%	0,30%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.454.806,38	0,00	0,00	6.432.380,18	-22.426,20	-0,35%	1,89%	-0,35%
Total Renda Fixa					241.159,92	0,57%	0,52%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1.730.121,76	0,00	0,00	1.753.360,71	23.238,95	1,34%	2,11%	1,34%
JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII - JTPR11	2.035.281,22	0,00	0,00	2.042.098,57	6.817,35	0,33%	-	0,33%
Total Renda Variável					30.056,30	0,80%	2,11%	