

# Relatório Analítico dos Investimentos em agosto de 2017



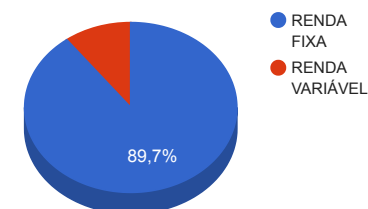
Carteira consolidada de investimentos - base (agosto / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			8.353,75	0,02%			Artigo 20
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.846.882,10	5,95%	707	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	4.617.297,50	9,65%	110	0,98%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	8.927.295,34	18,67%	1.211	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	6.707.976,49	14,03%	256	0,55%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	23.939,06	0,05%	628	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	8.546.063,69	17,87%	766	0,20%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	5.089.205,72	10,64%	116	1,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
RDF FIDC SÊNIOR	D+30	Não há	504.363,44	1,05%	69	1,50%	Artigo 7º, Inciso VI
INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP	Não se aplica	Não há	5.621.481,15	11,75%	16	9,69%	Artigo 7º, Inciso VI
SULAMÉRICA CRÉDITO ATIVO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	D+30	Não há	503.095,12	1,05%	179	0,12%	Artigo 8º, Inciso IV
SULAMÉRICA EVOLUTION FI MULTIMERCADO	D+5	Não há	504.270,58	1,05%	72	0,24%	Artigo 8º, Inciso IV
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	1.834.677,20	3,84%	87	1,51%	Artigo 8º, Inciso IV
JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII - JTPR11	Não se aplica	Não se aplica	2.088.056,75	4,37%		9,32%	Artigo 8º, Inciso VI
		<b>TOTAL -</b>	<b>47.822.957,89</b>				

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

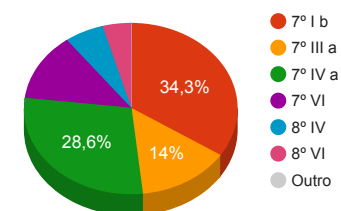
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 20	100,00%	8.353,75	0,02%	0,00%	0,00%	0,00%	-8.353,75
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	16.391.474,94	34,28%	50,00%	50,00%	80,00%	21.866.891,37
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	6.707.976,49	14,03%	0,00%	0,00%	60,00%	21.985.798,24
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	13.659.208,47	28,56%	5,00%	10,00%	30,00%	687.678,90
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	6.125.844,59	12,81%	5,00%	10,00%	15,00%	1.047.599,09
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	2.391.147,89
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	2.391.147,89
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>42.892.858,24</b>	<b>89,69%</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%	7.173.443,68
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	0,00	0,00%	3,00%	5,00%	15,00%	7.173.443,68
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	2.842.042,90	5,94%	2,00%	5,00%	5,00%	-450.895,01
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	2.391.147,89
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	2.088.056,75	4,37%	0,00%	5,00%	5,00%	303.091,14
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>4.930.099,65</b>	<b>10,31%</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: agosto / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 20	8.353,75	0,02%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	16.391.474,94	34,28%	50,00%	80,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	6.707.976,49	14,03%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	13.659.208,47	28,56%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	6.125.844,59	12,81%	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>42.892.858,24</b>	<b>89,69%</b>	<b>60,00</b>	<b>195,00</b>

Artigos - Renda Variável	Base: agosto / 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	2.842.042,90	5,94%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	2.088.056,75	4,37%	0,00%	5,00%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>4.930.099,65</b>	<b>10,31%</b>	<b>7,00</b>	<b>55,00</b>

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	1,34%	11,14%	5,57%	5,06%	15,49%	44,95%	-	-	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,33%	11,15%	5,59%	5,01%	15,58%	44,34%	0,30%	1,812%	9,85%
150% do CDI	1,20%	11,21%	3,66%	8,02%	18,60%	44,61%	-	-	-
RDF FIDC SÊNIOR	1,20%	11,24%	3,67%	8,04%	18,63%	44,65%	0,50%	-	-
IMA Geral ex-C	1,06%	10,29%	4,29%	6,01%	15,40%	37,75%	-	-	-
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,03%	10,14%	4,24%	5,84%	15,16%	37,17%	0,20%	0,869%	4,95%
125% do CDI	1,00%	9,26%	3,04%	6,64%	15,28%	35,99%	-	-	-
INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP	1,00%	9,28%	3,05%	6,66%	15,30%	36,06%	0,20%	-	-
IDKA IPCA 2 Anos	0,97%	10,12%	4,34%	7,49%	14,33%	34,57%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,98%	9,35%	4,08%	6,76%	13,28%	33,34%	0,20%	0,487%	2,90%
IRF-M 1	0,90%	8,33%	2,86%	5,88%	13,15%	29,98%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,88%	8,17%	2,83%	5,78%	12,88%	29,36%	0,10%	0,081%	0,68%
CDI	0,80%	7,34%	2,43%	5,28%	12,05%	27,88%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,79%	7,40%	2,43%	5,30%	12,17%	27,88%	0,20%	0,003%	0,11%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,70%	6,67%	2,16%	4,76%	11,07%	25,76%	1,00%	0,003%	0,10%
IPCA + 6,00% ao ano	0,72%	5,65%	1,72%	3,93%	8,58%	25,42%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,95%	5,88%	1,82%	4,17%	8,92%	25,78%	0,20%	0,182%	0,30%

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

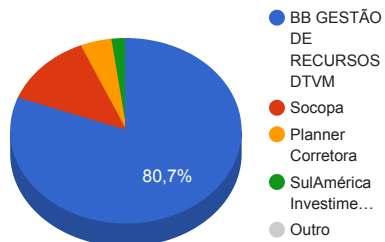
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

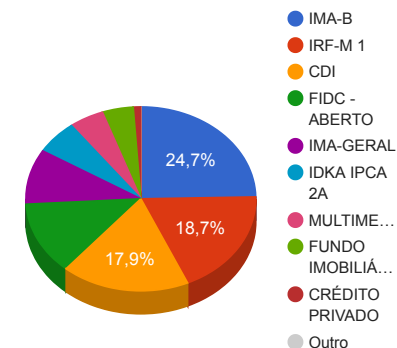
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	0,80%	7,34%	2,43%	5,28%	12,05%	27,88%	-	-	-
SULAMÉRICA EVOLUTION FI MULTIMERCADO	1,07%	9,04%	3,40%	6,32%	13,90%	29,56%	1,00%	0,413%	1,75%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,83%	8,79%	3,42%	8,98%	12,88%	29,24%	0,60%	0,302%	4,71%
SULAMÉRICA CRÉDITO ATIVO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	0,82%	8,36%	2,65%	6,07%	13,90%	29,82%	0,60%	0,032%	0,65%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII - JTPR11	-	-	-	-	-	-	1,80%	-	-

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	38.593.337,10	80,70%
Socopa	6.125.844,59	12,81%
Planner Corretora	2.088.056,75	4,37%
SulAmérica Investimentos	1.007.365,70	2,11%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	8.353,75	0,02%



Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	11.797.182,21	24,67%
IRF-M 1	8.927.295,34	18,67%
CDI	8.570.002,75	17,92%
FIDC - ABERTO	6.125.844,59	12,81%
IMA-GERAL	4.617.297,50	9,65%
IDKA IPCA 2A	2.846.882,10	5,95%
MULTIMERCADO	2.338.947,78	4,89%
FUNDO IMOBILIÁRIO	2.088.056,75	4,37%
CRÉDITO PRIVADO	503.095,12	1,05%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	8.353,75	0,02%

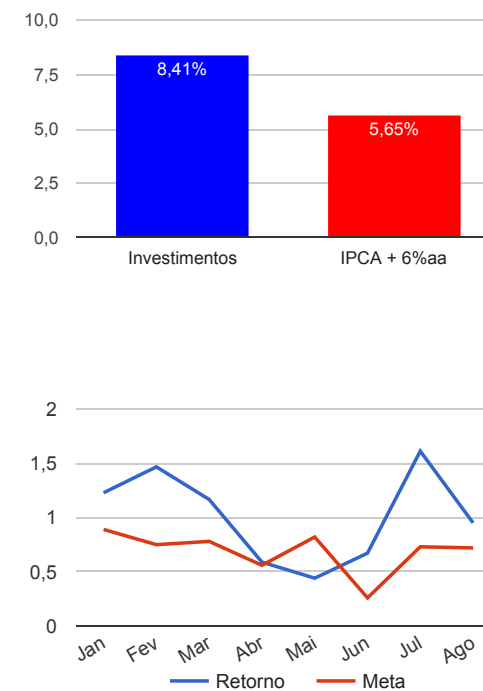




Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

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%
Mai	46.289.008,89	335.356,57	262.436,09	46.566.521,88	204.592,51	0,44%	0,82%	53,71%	3,46%
Junho	46.566.521,88	898.440,54	990.605,95	46.787.163,32	312.806,85	0,67%	0,26%	262,77%	0,69%
Julho	46.787.163,32	7.066.042,23	7.379.872,34	47.226.928,45	753.595,24	1,61%	0,73%	221,27%	0,60%
Agosto	47.226.928,45	5.700.984,94	5.563.660,95	47.814.604,14	450.351,70	0,95%	0,72%	131,28%	0,51%
Acumulado no ano					3.714.385,67	8,41%	5,65%	148,99%	

**Acumulado no Ano**



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.619.879,58	0,00	0,00	6.707.976,49	88.096,91	1,33%	1,81%	1,33%
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	4.570.078,15	0,00	0,00	4.617.297,50	47.219,35	1,03%	0,87%	1,03%
INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP	5.565.670,10	0,00	0,00	5.621.481,15	55.811,05	1,00%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.819.132,88	0,00	0,00	2.846.882,10	27.749,22	0,98%	0,49%	0,98%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.186.634,16	0,00	145.875,84	5.089.205,72	48.447,40	0,93%	0,18%	0,95%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.849.642,05	0,00	0,00	8.927.295,34	77.653,29	0,88%	0,08%	0,88%
RDF FIDC SÊNIOR	250.692,36	250.000,00	0,00	504.363,44	3.671,08	0,73%	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	4.773.072,92	4.000.000,00	285.000,00	8.546.063,69	57.990,77	0,66%	0,00%	0,79%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.193.597,95	950.984,94	5.132.785,11	23.939,06	12.141,28	0,24%	0,00%	0,70%
Total Renda Fixa					418.780,35	0,98%	0,52%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1.819.556,77	0,00	0,00	1.834.677,20	15.120,43	0,83%	0,30%	0,83%
SULAMÉRICA EVOLUTION FI MULTIMERCADO	250.908,89	250.000,00	0,00	504.270,58	3.361,69	0,67%	0,41%	1,07%
SULAMÉRICA CRÉDITO ATIVO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	250.553,51	250.000,00	0,00	503.095,12	2.541,61	0,51%	0,03%	0,82%
JT PREV DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL FII - JTPR11	2.077.509,13	0,00	0,00	2.088.056,75	10.547,62	0,51%	-	1,60%
Total Renda Variável					31.571,35	0,64%	0,27%	