

# Relatório Analítico dos Investimentos em janeiro de 2017



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

| Artigos                            | Resolução % | Carteira \$         | Carteira % | Estratégia de Alocação |        |            | GAP Superior |
|------------------------------------|-------------|---------------------|------------|------------------------|--------|------------|--------------|
|                                    |             |                     |            | Inferior %             | Alvo % | Superior % |              |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '  | 100,00%     | 1.848.535,99        | 76,95%     | 50,00%                 | 75,00% | 100,00%    | 553.679,63   |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' | 30,00%      | 0,00                | 0,00%      | 5,00%                  | 10,00% | 30,00%     | 720.664,69   |
| Artigo 8º, Inciso I                | 30,00%      | 0,00                | 0,00%      | 0,00%                  | 5,00%  | 15,00%     | 360.332,34   |
| Artigo 8º, Inciso III              | 15,00%      | 0,00                | 0,00%      | 3,00%                  | 5,00%  | 15,00%     | 360.332,34   |
| Artigo 8º, Inciso IV               | 5,00%       | 0,01                | 0,00%      | 2,00%                  | 5,00%  | 5,00%      | 120.110,77   |
| DF - Artigo 6º                     | 100,00%     | 50,00               | 0,00%      | 0,00%                  | 0,00%  | 0,00%      | -50,00       |
| <b>Total Carteira</b>              |             | <b>1.848.586,00</b> |            |                        |        |            |              |

|                |              |         |
|----------------|--------------|---------|
| RENDA FIXA     | 2.402.265,61 | 129,95% |
| RENDA VARIÁVEL | 0,01         | 0,00%   |

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

| Artigos                             | Base: janeiro / 2017 |               | Limite Inferior (%) | Limite Superior (%) |
|-------------------------------------|----------------------|---------------|---------------------|---------------------|
|                                     | Carteira (\$)        | Carteira (%)  |                     |                     |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   | 1.848.535,99         | 76,95%        | 50,00%              | 95,00%              |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' | 0,00                 | 0,00%         | 0,00%               | 60,00%              |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '  | 0,00                 | 0,00%         | 5,00%               | 30,00%              |
| Artigo 7º, Inciso VI                | 0,00                 | 0,00%         | 0,00%               | 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%               |
| 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                | 0,01                 | 0,00%         | 2,00%               | 5,00%               |
| Artigo 8º, Inciso V                 | 0,00                 | 0,00%         | 0,00%               | 5,00%               |
| Artigo 8º, Inciso VI                | 0,00                 | 0,00%         | 0,00%               | 5,00%               |
| DF - Artigo 6º                      | 50,00                | 0,00%         | 0,00%               | 0,00%               |
| <b>Total</b>                        | <b>1.848.586,00</b>  | <b>76,95%</b> | <b>62,00</b>        | <b>265,00</b>       |

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 |
|--|--------|-------|---------|---------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| IRF-M 1  | 1,289% | 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%                   |
| IMA-B 5  | 1,156% | 1,16% | 2,97%   | 6,05%   | 13,45%   | 32,16%   | -        | -         | -                       |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP                | 1,14%  | 1,14% | 2,91%   | 5,97%   | 13,25%   | 31,31%   | 0,20%    | 1,255%    | 2,49%                   |
| IDKA IPCA 2 Anos   | 1,087% | 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%                   |
| CDI  | 1,085% | 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 SIMPLES PREVIDENCIÁRIO             | 1,01%  | 1,01% | 3,08%   | 6,40%   | 13,15%   | 27,30%   | 1,00%    | 0,011%    | 0,08%                   |
| 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%                   |

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

| Administrador              | Valor        | %       |
|----------------------------|--------------|---------|
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM | 2.402.215,62 | 100,00% |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA | 50,00        | 0,00%   |

| Sub-segmento               | Valor        | %      |
|----------------------------|--------------|--------|
| IRF-M 1                    | 1.035.889,78 | 43,12% |
| IDKA IPCA 2A               | 812.646,21   | 33,83% |
| CDI                        | 308.897,82   | 12,86% |
| IMA-B 5                    | 244.781,80   | 10,19% |
| DISP. FINANCEIRA           | 50,00        | 0,00%  |
| MULTIMERCADO - CONSERVADOR | 0,01         | 0,00%  |

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

**Acumulado no Ano**

| Mês              | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates  | Saldo Atual  | Retorno (\$) | Retorno (%) | Meta (%) | Gap (%) | VaR (%) |
|------------------|----------------|------------|-----------|--------------|--------------|-------------|----------|---------|---------|
| Janeiro          | 2.411.785,74   | 59.435,95  | 95.085,59 | 2.402.215,62 | 26.079,52    | 1,08%       | 0,89%    | 121,24% | 0,63%   |
| Acumulado no ano |                |            |           |              | 26.079,52    | 1,08%       | 0,89%    | 121,24% |         |

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 IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO  | 1.022.999,96  | 0,00       | 0,00      | 1.035.889,78 | 12.889,82        | 1,26%        | 0,30%         | 1,26%          |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP                | 242.027,78    | 0,00       | 0,00      | 244.781,80   | 2.754,02         | 1,14%        | 1,26%         | 1,14%          |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO    | 803.938,05    | 0,00       | 0,00      | 812.646,21   | 8.708,16         | 1,08%        | 1,09%         | 1,08%          |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO             | 184.864,81    | 0,00       | 11.633,22 | 175.090,92   | 1.859,33         | 1,01%        | 0,01%         | 1,01%          |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP | 73.822,26     | 59.435,95  | 261,07    | 133.806,90   | 809,76           | 0,61%        | 0,02%         | 1,10%          |
| <b>Total Renda Fixa</b>                                    |               |            |           |              | <b>27.021,09</b> | <b>1,14%</b> | <b>0,63%</b>  |                |

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(%) |
|--------------------------------------|---------------|------------|-----------|----------------------|---------------|-------------|---------------|----------------|
| BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP | 84.132,88     | 0,00       | 83.191,30 | 0,01                 | -941,57       | -1,12%      | 3,08%         | -0,12%         |
|                                      |               |            |           |                      |               |             |               |                |
|                                      |               |            |           | Total Renda Variável | -941,57       | -1,12%      | 3,08%         |                |