

Relatório Analítico dos Investimentos em abril de 2017



Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

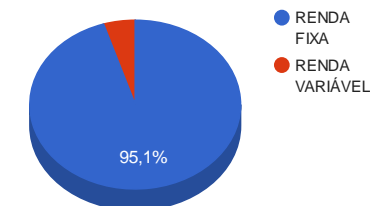
Carteira consolidada de investimentos - base (abril / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			158.742,39	0,89%			Artigo 20
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	723.120,22	4,07%	1.168	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	808.981,09	4,56%	118	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.726.734,43	15,36%	627	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	38.758,41	0,22%	269	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
LEME IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1009	Não há	1.757.419,20	9,90%	26	2,23%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
AUSTRO IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+4 ou D+1473	Não há	4.242.038,30	23,90%	27	3,55%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CATÂNIA FI RENDA FIXA LP	D+30 ou D+2521	Não há	2.654.120,80	14,95%	10	3,32%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	14.462,25	0,08%	608	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
LEME IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	955.936,81	5,39%	70	0,65%	Artigo 7º, Inciso VI
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	D+90 ou D+150 a D+450	18 meses	685.484,21	3,86%	14	6,28%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BRS PARTICIPAÇÕES FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+1	4 anos	857.114,38	4,83%	34	0,98%	Artigo 8º, Inciso IV
RHODES FIC RENDA FIXA LP	D+30 a D+1008	Não há	2.126.146,73	11,98%	6	3,77%	Desenquadrado - RF
		TOTAL -	17.749.059,22				

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

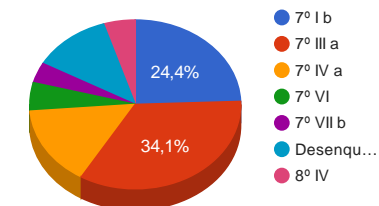
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	4.297.594,15	24,21%	30,00%	45,00%	70,00%	8.126.747,30
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	5.999.457,50	33,80%	15,00%	20,00%	60,00%	4.649.978,03
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	2.668.583,05	15,04%	5,00%	5,00%	30,00%	2.656.134,72
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	955.936,81	5,39%	0,00%	10,00%	15,00%	1.706.422,07
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	685.484,21	3,86%	0,00%	5,00%	5,00%	201.968,75
Desenquadrado - RF	0,00%	2.126.146,73	11,98%	0,00%	0,00%	0,00%	-2.126.146,73
Total Renda Fixa	100,00%	16.733.202,45	94,28%	50,00	85,00	180,00	-

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	2.662.358,88
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	857.114,38	4,83%	2,00%	5,00%	5,00%	30.338,58
Total Renda Variável	30,00%	857.114,38	4,83%	7,00	15,00	20,00	-

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 7º, Inciso I, Alínea " b "	4.297.594,15	24,21%	30,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	5.999.457,50	33,80%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	2.668.583,05	15,04%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	955.936,81	5,39%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	685.484,21	3,86%	0,00%	5,00%
Desenquadrado - RF	2.126.146,73	11,98%	0,00%	0,00%
Total Renda Fixa	16.733.202,45	94,28%	50,00	180,00

Artigos - Renda Variável	Base: abril / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	857.114,38	4,83%	2,00%	5,00%
Total Renda Variável	857.114,38	4,83%	7,00	20,00

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
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%
IMA-S	0,80%	3,87%	2,75%	6,10%	13,41%	29,04%	-	-	-
CATÂNIA FI RENDA FIXA LP	-0,17%	-1,42%	-1,23%	-2,42%	-4,36%	0,01%	0,90%	0,034%	5,33%
CDI	0,79%	3,84%	2,72%	6,09%	13,45%	29,16%	-	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,73%	3,57%	2,53%	5,68%	12,72%	27,15%	1,00%	0,014%	0,09%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	0,37%	1,88%	1,32%	2,96%	6,48%	-26,19%	1,00%	0,045%	0,11%
IPCA + 7,00% ao ano	0,63%	3,33%	2,33%	5,00%	11,34%	30,12%	-	-	-
LEME IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	0,44%	2,97%	-12,30%	5,43%	-25,49%	-57,72%	1,50%	-	-
IRF-M	0,53%	6,48%	4,10%	8,79%	17,62%	36,41%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,47%	6,38%	3,98%	8,60%	17,47%	35,61%	0,20%	1,154%	3,10%
IMA-B	-0,32%	6,55%	4,60%	8,31%	16,59%	36,72%	-	-	-
RHODES FIC RENDA FIXA LP	0,06%	0,99%	0,62%	0,92%	1,42%	6,78%	0,30%	0,292%	3,83%
LEME IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,12%	-12,50%	-14,72%	-26,45%	-21,85%	-26,56%	1,50%	2,469%	17,94%
AUSTRO IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	-0,20%	2,31%	1,54%	3,73%	10,58%	26,34%	0,30%	0,845%	4,82%
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	-0,34%	6,40%	4,51%	8,18%	16,22%	35,59%	0,20%	1,902%	5,85%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,34%	6,47%	4,54%	8,17%	16,36%	35,97%	0,20%	1,900%	5,85%

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

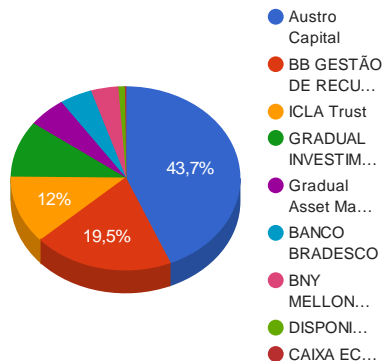
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

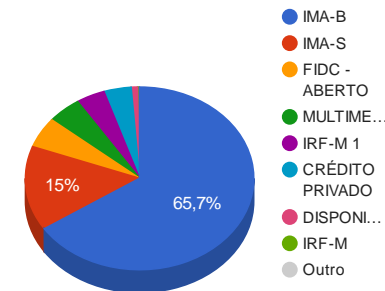
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA	0,14%	1,10%	0,72%	1,59%	4,08%	13,74%	-	-	-
BRS PARTICIPAÇÕES FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-0,16%	-0,70%	-0,51%	-6,48%	13,31%	25,27%	1,50%	0,104%	22,88%

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

Administrador	Valor	%
Austro Capital	7.753.273,48	43,68%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	3.464.316,90	19,52%
ICLA Trust	2.126.146,73	11,98%
GRADUAL INVESTIMENTOS	1.757.419,20	9,90%
Gradual Asset Management	955.936,81	5,39%
BANCO BRADESCO	808.981,09	4,56%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	685.484,21	3,86%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	158.742,39	0,89%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	38.758,41	0,22%

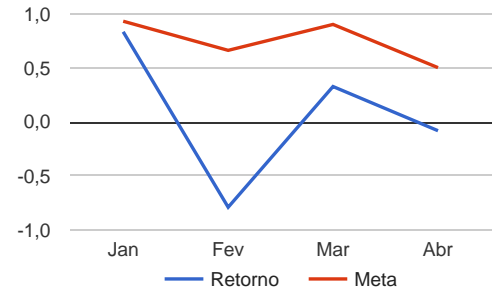
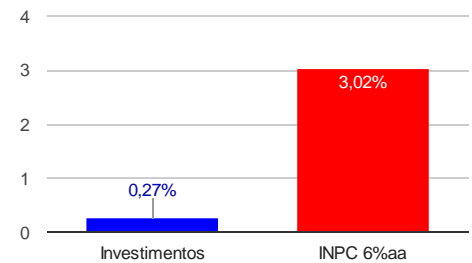


Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	11.661.319,75	65,70%
IMA-S	2.654.120,80	14,95%
FIDC - ABERTO	955.936,81	5,39%
MULTIMERCADO	857.114,38	4,83%
IRF-M 1	723.120,22	4,07%
CRÉDITO PRIVADO	685.484,21	3,86%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	158.742,39	0,89%
IRF-M	38.758,41	0,22%
CDI	14.462,25	0,08%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

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(%)	
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	38.575,86	0,00	0,00	38.758,41	182,55	0,47%	1,15%	0,47%	
LEME IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	951.786,37	0,00	0,00	955.936,81	4.150,44	0,44%	-	-	
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.339,77	35.922,90	27.969,75	14.462,25	169,33	0,40%	0,01%	0,73%	
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	682.952,72	0,00	0,00	685.484,21	2.531,49	0,37%	0,04%	0,37%	
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	370,26	720.967,14	0,00	723.120,22	1.782,82	0,25%	0,16%	0,86%	
LEME IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.755.710,62	0,00	0,00	1.757.419,20	1.708,58	0,10%	2,47%	-0,12%	
RHODES FIC RENDA FIXA LP	2.124.772,91	0,00	0,00	2.126.146,73	1.373,82	0,06%	0,29%	0,06%	
CATÂNIA FI RENDA FIXA LP	2.658.549,89	0,00	0,00	2.654.120,80	-4.429,09	-0,17%	0,03%	-0,17%	
AUSTRO IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	4.250.344,00	0,00	0,00	4.242.038,30	-8.305,70	-0,20%	0,84%	-0,20%	
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.566.691,84	0,00	830.000,00	2.726.734,43	-9.957,41	-0,28%	1,90%	-0,34%	
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	811.730,03	0,00	0,00	808.981,09	-2.748,94	-0,34%	1,90%	-0,34%	
Total Renda Fixa						-13.542,11	-0,08%	0,99%	

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(%)
BRS PARTICIPAÇÕES FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	858.464,50	0,00	0,00	857.114,38	-1.350,12	-0,16%	0,10%	-0,16%
Total Renda Variável					-1.350,12	-0,16%	0,10%	

