



CHORÓPREV



Julho a Setembro de 2018



<p>Patrimônio</p> <p>R\$ 4.174.473,85</p>	<p>Rentabilidade</p> <table border="0"> <tr> <td>Mês</td> <td>Acum.</td> </tr> <tr> <td>0,79%</td> <td>1,82%</td> </tr> </table>	Mês	Acum.	0,79%	1,82%	<p>Meta</p> <table border="0"> <tr> <td>Mês</td> <td>Acum.</td> </tr> <tr> <td>0,97%</td> <td>2,20%</td> </tr> </table>	Mês	Acum.	0,97%	2,20%	<p>Gap</p> <table border="0"> <tr> <td>Mês</td> <td>Acum.</td> </tr> <tr> <td>-0,17p.p.</td> <td>-0,38p.p.</td> </tr> </table>	Mês	Acum.	-0,17p.p.	-0,38p.p.	<p>VaR_{1,252}</p> <p>0,13%</p>
Mês	Acum.															
0,79%	1,82%															
Mês	Acum.															
0,97%	2,20%															
Mês	Acum.															
-0,17p.p.	-0,38p.p.															

Evolução do Patrimônio

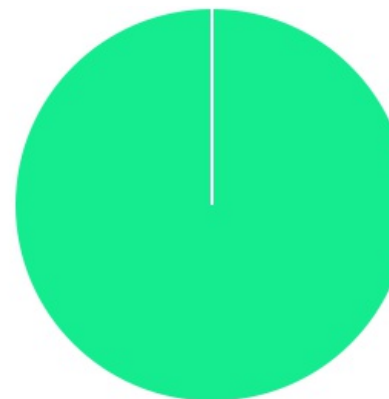




Comparativo (Rentabilidades | Metas)

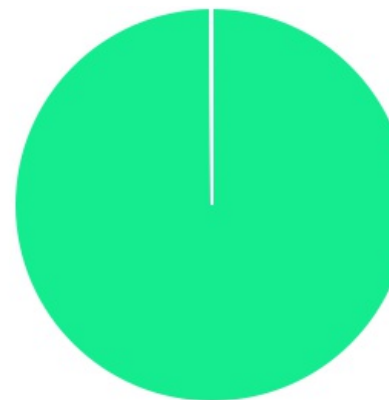


ATIVO	SALDO	CARTEIRA(%)	RESG.	3.922	RETORNO (R\$)	(%)	TX ADM
BB IRF-M TP FI RF PREVID	R\$ 459.156,39	11,00%	D+1	7, I "b"	R\$ 7.420,78	1,04%	0,20%
BB IRF-M 1 TP FIC RF PREVID	R\$ 2.993.589,09	71,71%	D+0	7, I "b"	R\$ 49.072,01	1,26%	0,10%
BB IDKA 2 TP FI RF PREVID	R\$ 717.139,22	17,18%	D+1	7, I "b"	R\$ 15.838,87	1,45%	0,20%
BB FLUXO FIC RF PREVID	R\$ 4.589,15	0,11%	D+0	7, IV "a"	R\$ 3.094,13	1,01%	1,00%
BB FI MULTIMERCADO PREVID LP	R\$ 0,00	0,00%	D+4	8, III	R\$ 208,42	0,66%	0,60%
Total investimentos	R\$ 4.174.473,85	100.00%			R\$ 75.634,21	1,82%	
Disponibilidade	R\$ 0,00	-			-	-	
Total patrimônio	R\$ 4.174.473,85	100.00%			-	-	

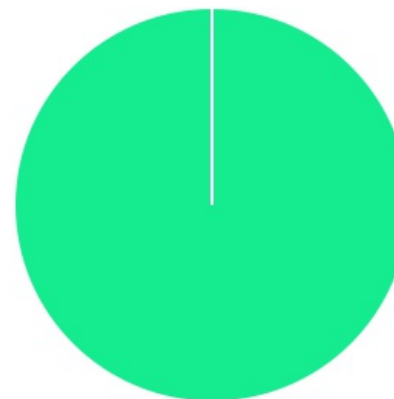
CLASSE	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
Renda Fixa	100,00%	R\$ 4.174.473,85	
Total	100,00%	R\$ 4.174.473,85	



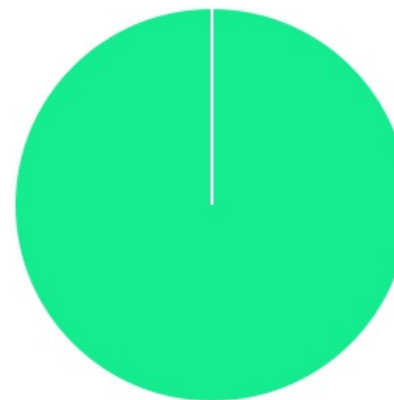
ENQUADRAMENTO	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	99,89%	R\$ 4.169.884,70	
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea "a"	0,11%	R\$ 4.589,15	
Total	100,00%	R\$ 4.174.473,85	







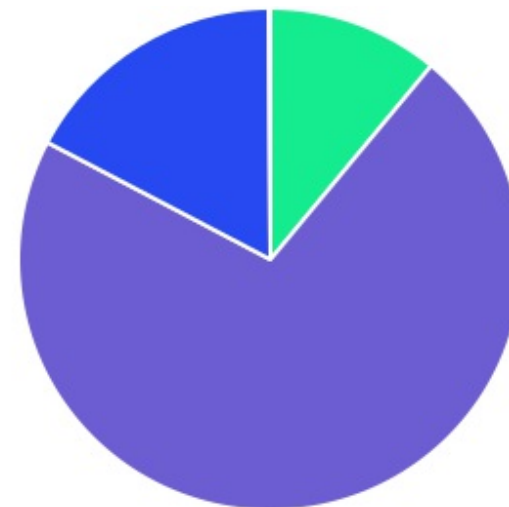
GESTOR	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
BB GESTAO	100,00%	R\$ 4.174.473,85	
Total	100,00%	R\$ 4.174.473,85	



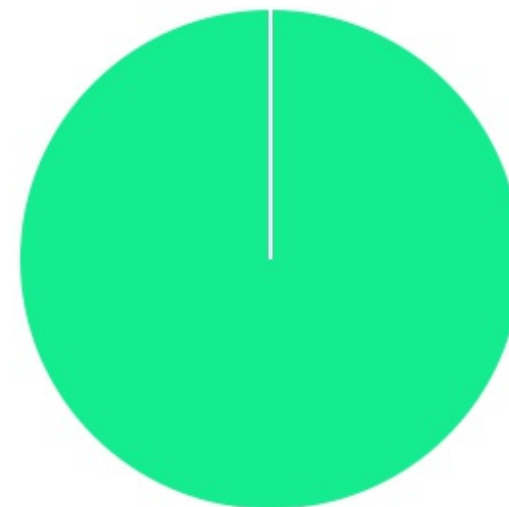
ADMINISTRADOR	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
BB GESTAO	100,00%	R\$ 4.174.473,85	
Total	100,00%	R\$ 4.174.473,85	



BENCHMARK	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
IRF-M 1	71,71%	R\$ 2.993.589,09	
IDKA IPCA 2A	17,18%	R\$ 717.139,22	
IRF-M	11,00%	R\$ 459.156,39	
CDI	0,11%	R\$ 4.589,15	
Total	100,00%	R\$ 4.174.473,85	



LIQUIDEZ	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
0 a 30 dias	100,00%	R\$ 4.174.473,85	
Total	100,00%	R\$ 4.174.473,85	



RENDA FIXA	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
Títulos Tesouro Nacional - SELIC - 7, I "a"	100%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	0,00%
FI Renda Fixa Referenciado 100% títulos TN - 7, I "b"	100%	R\$ 4.169.884,70	99.89%	0,00%	70,00%	100,00%
FI em Índices de Renda Fixa 100% títulos TN - 7, I "c"	100%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	0,00%
Operações Compromissadas - 7, II	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	5,00%
FI Renda Fixa Referenciados - 7, III "a"	60%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	60,00%
FI de Índices Renda Fixa - 7, III "b"	60%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	60,00%
FI de Renda Fixa - 7, IV "a"	40%	R\$ 4.589,15	0.11%	0,00%	0,00%	40,00%
FI de Índices Renda Fixa - 7, IV "b"	40%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	30,00%	40,00%
Letras Imobiliárias Garantidas - 7, V "b"	20%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	20,00%
Certificados de Depósitos Bancários (CDB) - 7, VI "a"	15%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	15,00%
Poupança - 7, VI "b"	15%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	15,00%
FI Direitos Creditórios (FIDC) - sênior - 7, VII "a"	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	5,00%
FI Renda Fixa "Crédito Privado" - 7, VII "b"	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	5,00%
FI Debêntures - 7, VII "c"	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa		R\$ 4.174.473,85	100,00%			

RENDA VARIÁVEL	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	POLÍTICA DE INVESTIMENTO		
				Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
FI Ações Referenciados - 8, I "a"	30%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%
FI de Índices Ações Referenciados - 8, I "b"	30%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%
FI em Ações Livre - 8, II "a"	20%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%
FI de Índices em Ações Livre - 8, II "b"	20%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%
FI Multimercado - 8, III	10%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%
FI em Participações - 8, IV "a"	5%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%
FI Imobiliário - 8, IV "b"	5%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%
Total Renda Variável		R\$ 0,00	0,00%			
INVESTIMENTOS NO EXTERIOR	RESOLUÇÃO(%)	CARTEIRA (R\$)	(%)	Inferior(%)	Alvo(%)	Superior(%)
Renda Fixa - Dívida Externa - 9 - A, I	10%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%
Investimento no Exterior - 9 - A, II	10%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%
Ações - BDR Nível I - 9 - A, III	10%	R\$ 0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%
Total Investimentos no exterior		R\$ 0,00	0,00%			
Total Global		R\$ 4.174.473,85	100,00%			

PERÍODO	SALDO ANTERIOR	SALDO FINAL	META	RENT.(R\$)	RENT.(%)	GAP
2018			IPCA + 6% a.a.			
Julho	R\$ 4.533.000,20	R\$ 4.528.566,37	0,82%	R\$ 38.537,40	0,83%	0,02p.p.
Agosto	R\$ 4.528.566,37	R\$ 4.313.362,72	0,40%	R\$ 8.180,89	0,18%	-0,22p.p.
Setembro	R\$ 4.313.362,72	R\$ 4.174.473,85	0,97%	R\$ 28.915,92	0,79%	-0,17p.p.
Total	R\$ 4.313.362,72	R\$ 4.174.473,85	2,20%	R\$ 75.634,21	1,82%	-0,38p.p.

ATIVO	CNPJ	RENTABILIDADE			
		Jul (%)	Ago (%)	Set (%)	Trimestre (%)
BB IRF-M 1 TP FIC RF...	11.328.882/0001-35	0,68%	0,40%	0,18%	1,26%
BB FLUXO FIC RF PREVID	13.077.415/0001-05	0,34%	0,46%	0,20%	1,01%
BB PERFIL FIC RF REF DI...	13.077.418/0001-49	-	-	-	-
BB IDKA 2 TP FI RF...	13.322.205/0001-35	1,23%	-0,08%	0,29%	1,45%
BB IRF-M TP FI RF PREVID	07.111.384/0001-69	1,48%	-0,96%	0,53%	1,04%
BB FI MULTIMERCADO...	10.418.362/0001-50	1,18%	-0,51%	-	0,66%

TÍTULO	VENC.	COMPRA	QTD.	P.U. COMPRA	ATUAL	MARCAÇÃO	VALOR COMPRA	VALOR ATUAL	RETORNO
Total Públicos							R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00 (0,00%)
Total Privados							R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00 (0,00%)
Total Global							R\$ 0,00	R\$ 0,00	R\$ 0,00 (0,00%)