



CHORÓPREV

 Outubro a Dezembro de 2017



<p>Patrimônio</p> <p>R\$ 5.160.055,39</p>	<p>Rentabilidade</p> <table border="0"> <tr> <td>Mês</td> <td>Acum.</td> </tr> <tr> <td>0,68%</td> <td>1,76%</td> </tr> </table>	Mês	Acum.	0,68%	1,76%	<p>Meta</p> <table border="0"> <tr> <td>Mês</td> <td>Acum.</td> </tr> <tr> <td>0,93%</td> <td>2,63%</td> </tr> </table>	Mês	Acum.	0,93%	2,63%	<p>Gap</p> <table border="0"> <tr> <td>Mês</td> <td>Acum.</td> </tr> <tr> <td>-0,24p.p.</td> <td>-0,87p.p.</td> </tr> </table>	Mês	Acum.	-0,24p.p.	-0,87p.p.	<p>VaR_{1,252}</p> <p>0,16%</p>
Mês	Acum.															
0,68%	1,76%															
Mês	Acum.															
0,93%	2,63%															
Mês	Acum.															
-0,24p.p.	-0,87p.p.															



Evolução do Patrimônio

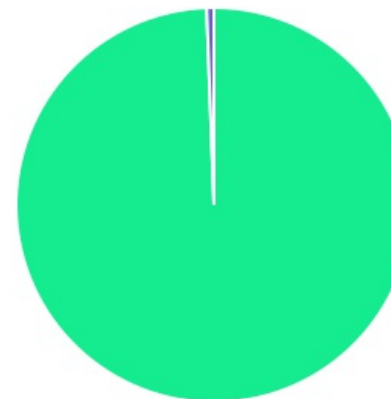





Comparativo (Rentabilidades | Metas)

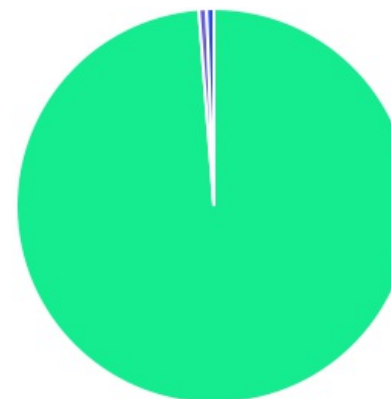


ATIVO	SALDO	CARTEIRA(%)	RESG.	3.922	RETORNO (R\$)	(%)	TX ADM
BB IRF-M TP FI RF PREVID	R\$ 590.231,10	11,44%	D+1	7, I "b"	R\$ 7.969,07	1,37%	0,20%
BB IRF-M 1 TP FIC RF PREVID	R\$ 3.672.480,95	71,17%	D+0	7, I "b"	R\$ 63.838,23	1,77%	0,10%
BB IDKA 2 TP FI RF PREVID	R\$ 834.314,23	16,17%	D+1	7, I "b"	R\$ 15.670,69	1,91%	0,20%
BB FLUXO FIC RF PREVID	R\$ 25.349,00	0,49%	D+0	7, IV "a"	R\$ 68,57	0,13%	1,00%
BB PERFIL FIC RF REF DI PREVIDENC	R\$ 7.270,30	0,14%	D+0	7, IV "a"	R\$ 8.390,25	1,83%	0,20%
BB FI MULTIMERCADO PREVID LP	R\$ 30.409,81	0,59%	D+4	8, III	R\$ 667,60	2,24%	0,60%
Total investimentos	R\$ 5.160.055,39	100,00%			R\$ 96.604,41	1,76%	
Disponibilidade	R\$ 0,00	-			-	-	
Total patrimônio	R\$ 5.160.055,39	100,00%			-	-	

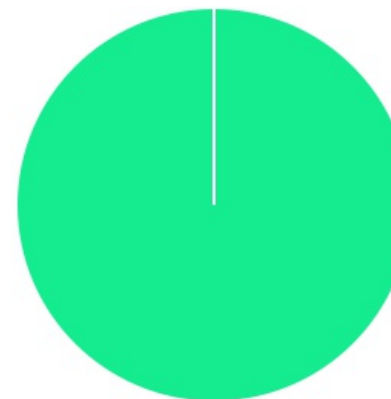
CLASSE	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
Renda Fixa	99,41%	R\$ 5.129.645,58	
Renda Variável	0,59%	R\$ 30.409,81	
Total	100,00%	R\$ 5.160.055,39	



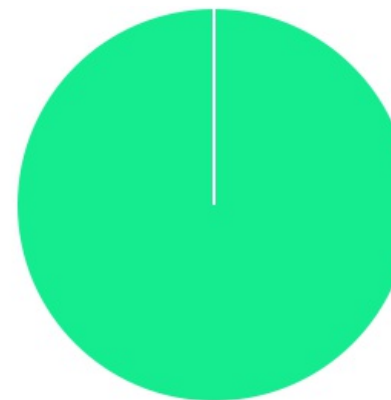
ENQUADRAMENTO	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	98,78%	R\$ 5.097.026,28	
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea "a"	0,63%	R\$ 32.619,30	
Artigo 8º, Inciso III	0,59%	R\$ 30.409,81	
Total	100,00%	R\$ 5.160.055,39	







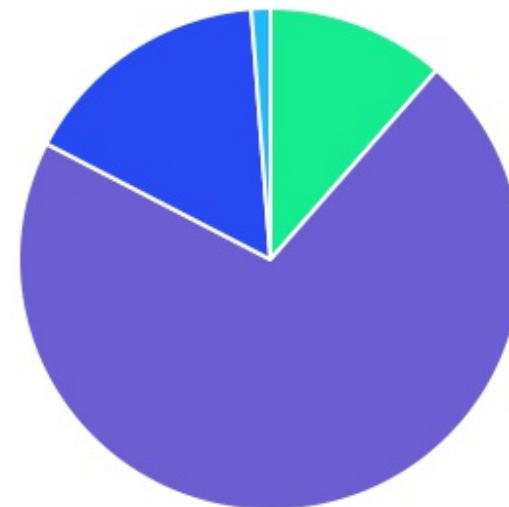
GESTOR	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
BB GESTAO	100,00%	R\$ 5.160.055,39	
Total	100,00%	R\$ 5.160.055,39	




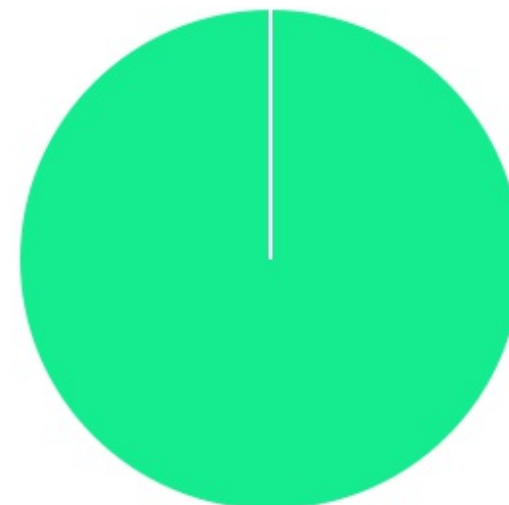
ADMINISTRADOR	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
BB GESTAO	100,00%	R\$ 5.160.055,39	
Total	100,00%	R\$ 5.160.055,39	



BENCHMARK	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
IRF-M 1	71,17%	R\$ 3.672.480,95	
IDKA IPCA 2A	16,17%	R\$ 834.314,23	
IRF-M	11,44%	R\$ 590.231,10	
CDI	1,22%	R\$ 63.029,11	
Total	100,00%	R\$ 5.160.055,39	



LIQUIDEZ	PERCENTUAL	VALOR	LEG.
0 a 30 dias	100,00%	R\$ 5.160.055,39	
Total	100,00%	R\$ 5.160.055,39	



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\$ 5.097.026,28	98.78%	50,00%	98,00%	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%	60,00%
FI Renda Fixa Referenciados - 7, III "a"	60%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	20,00%
FI de Índices Renda Fixa - 7, III "b"	60%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	1,00%	30,00%
FI de Renda Fixa - 7, IV "a"	40%	R\$ 32.619,30	0.63%	0,00%	0,00%	0,00%
FI de Índices Renda Fixa - 7, IV "b"	40%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	0,00%
Letras Imobiliárias Garantidas - 7, V "b"	20%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	0,00%
Certificados de Depósitos Bancários (CDB) - 7, VI "a"	15%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	0,00%
Poupança - 7, VI "b"	15%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	0,00%
FI Direitos Creditórios (FIDC) - sênior - 7, VII "a"	5%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	15,00%
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\$ 5.129.645,58	99,41%			

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%	15,00%
FI de Índices Ações Referenciados - 8, I "b"	30%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	0,00%
FI em Ações Livre - 8, II "a"	20%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	0,00%	15,00%
FI de Índices em Ações Livre - 8, II "b"	20%	R\$ 0,00	0.00%	0,00%	1,00%	5,00%
FI Multimercado - 8, III	10%	R\$ 30.409,81	0.59%	0,00%	0,00%	5,00%
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\$ 30.409,81	0,59%			
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\$ 5.160.055,39	100,00%			

PERÍODO	SALDO ANTERIOR	SALDO FINAL	META	RENT.(R\$)	RENT.(%)	GAP
2017			IPCA + 6% a.a.			
Outubro	R\$ 5.868.213,47	R\$ 5.604.155,81	0,91%	R\$ 33.360,48	0,58%	-0,32p.p.
Novembro	R\$ 5.604.155,81	R\$ 5.390.698,28	0,77%	R\$ 27.061,74	0,49%	-0,28p.p.
Dezembro	R\$ 5.390.698,28	R\$ 5.160.055,39	0,93%	R\$ 36.182,19	0,68%	-0,24p.p.
Total	R\$ 5.390.698,28	R\$ 5.160.055,39	2,63%	R\$ 96.604,41	1,76%	-0,87p.p.

ATIVO	CNPJ	RENTABILIDADE			
		Out (%)	Nov (%)	Dez (%)	Trimestre (%)
BB IRF-M 1 TP FIC RF...	11.328.882/0001-35	0,61%	0,59%	0,56%	1,77%
BB FLUXO FIC RF PREVID	13.077.415/0001-05	0,05%	0,05%	0,03%	0,13%
BB PERFIL FIC RF REF DI...	13.077.418/0001-49	0,68%	0,56%	0,58%	1,83%
BB IDKA 2 TP FI RF...	13.322.205/0001-35	0,76%	0,28%	0,86%	1,91%
BB IRF-M TP FI RF PREVID	07.111.384/0001-69	0,08%	0,07%	1,22%	1,37%
BB FI MULTIMERCADO...	10.418.362/0001-50	0,48%	0,93%	0,81%	2,24%

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%)