

# Relatório Analítico dos Investimentos em junho, 2º Trimestre e 1º semestre de 2017



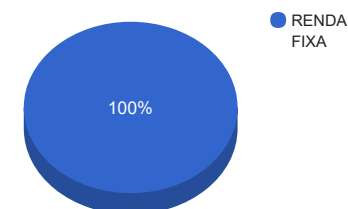
Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.431.731,10	13,51%	604	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	9.349.697,98	51,93%	703	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.724.302,58	9,58%	706	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	3.863.074,08	21,46%	108	0,83%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	635.279,27	3,53%	615	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
<b>TOTAL -</b>			<b>18.004.085,01</b>				

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

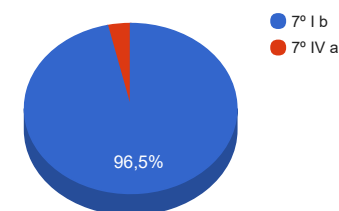
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	100,00%	0,00%	0,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	17.368.805,74	96,47%	0,00%	100,00%	0,00%	-17.368.805,74
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	0,00	0,00%	0,00%	60,00%	0,00%	0,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	80,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	0,00%	0,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	635.279,27	3,53%	0,00%	20,00%	0,00%	-635.279,27
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	0,00%	0,00
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>18.004.085,01</b>	<b>100,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>300,00</b>	<b>0,00</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%	10,00%	0,00%	0,00
Artigo 8º, Inciso II	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	0,00%	0,00
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	15,00%	0,00%	0,00
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>35,00</b>	<b>0,00</b>	<b>-</b>

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: junho / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	17.368.805,74	96,47%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	635.279,27	3,53%	0,00%	0,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>18.004.085,01</b>	<b>100,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>

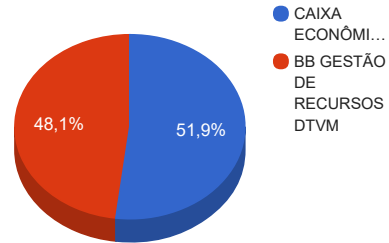
Artigos - Renda Variável	Base: junho / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Total Renda Variável	0,00	0,00%	0,00	0,00

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

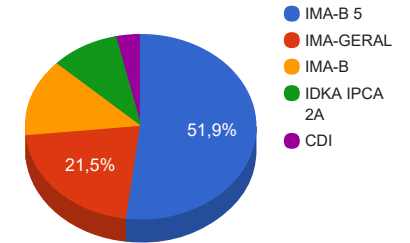
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA Geral ex-C	0,86%	6,67%	1,28%	6,67%	14,64%	32,51%	-	-	-
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,85%	6,55%	1,17%	6,55%	14,39%	31,94%	0,20%	1,244%	4,94%
CDI	0,81%	5,65%	2,54%	5,65%	12,85%	28,75%	-	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,73%	5,17%	2,29%	5,17%	11,95%	26,67%	1,00%	0,013%	0,08%
IDKA IPCA 2 Anos	0,79%	6,38%	2,18%	6,38%	12,88%	32,07%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,61%	5,71%	1,78%	5,71%	12,09%	30,65%	0,20%	0,756%	2,89%
IMA-B 5	0,52%	5,47%	1,32%	5,47%	11,91%	30,87%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,51%	5,40%	1,30%	5,40%	11,73%	30,08%	0,20%	0,925%	3,57%
IMA-B	0,16%	5,46%	-1,34%	5,46%	13,32%	32,28%	-	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,15%	5,35%	-1,39%	5,35%	13,12%	31,49%	0,20%	2,448%	9,79%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	9.349.697,98	51,93%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	8.654.387,03	48,07%



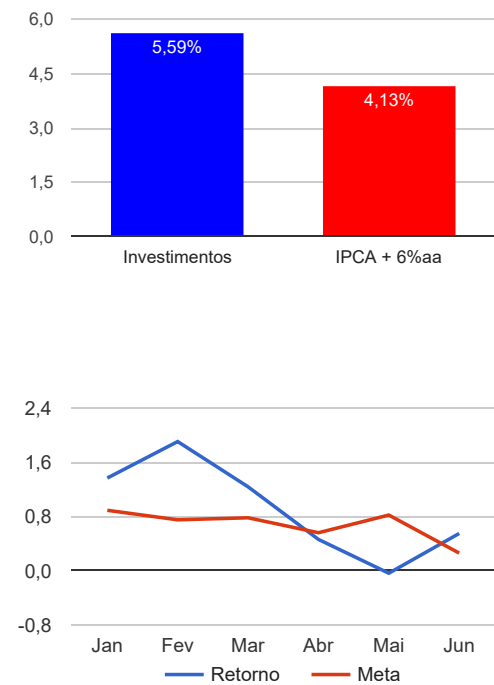
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5	9.349.697,98	51,93%
IMA-GERAL	3.863.074,08	21,46%
IMA-B	2.431.731,10	13,51%
IDKA IPCA 2A	1.724.302,58	9,58%
CDI	635.279,27	3,53%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	16.477.667,12	144,48	7.063,80	16.695.708,18	224.960,38	1,37%	0,89%	153,07%	1,53%
Fevereiro	16.695.708,18	287.455,25	79.531,15	17.225.198,98	321.566,70	1,90%	0,75%	254,17%	0,86%
Março	17.225.198,98	460.864,26	81.381,70	17.822.278,47	217.596,93	1,24%	0,78%	157,54%	0,95%
Abril	17.822.278,47	463.073,62	306.084,53	18.062.258,59	82.991,03	0,46%	0,56%	82,77%	0,78%
Mai	18.062.258,59	408.042,96	479.481,36	17.984.259,65	-6.560,54	-0,04%	0,82%	-4,42%	6,12%
Junho	17.984.259,65	0,00	78.887,98	18.004.085,01	98.713,34	0,55%	0,26%	214,71%	1,15%
Acumulado no ano					939.267,84	5,59%	4,13%	135,46%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	3.830.690,12	0,00	0,00	3.863.074,08	32.383,96	0,85%	1,24%	0,85%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	709.504,60	0,00	78.887,98	635.279,27	4.662,65	0,66%	0,01%	0,73%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.713.823,11	0,00	0,00	1.724.302,58	10.479,47	0,61%	0,76%	0,61%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.302.075,67	0,00	0,00	9.349.697,98	47.622,31	0,51%	0,93%	0,51%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.428.166,15	0,00	0,00	2.431.731,10	3.564,95	0,15%	2,45%	0,15%
Total Renda Fixa					98.713,34	0,55%	1,15%	



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre / 2017

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.371.039,34	870.721,04	5.487,44	9.349.697,98	113.425,04	1,26%	1,30%
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	3.818.227,94	0,00	0,00	3.863.074,08	44.846,14	1,17%	1,17%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.694.213,30	0,00	0,00	1.724.302,58	30.089,28	1,78%	1,78%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.472.716,29	395,54	858.966,43	635.279,27	21.133,87	1,92%	2,29%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.466.081,60	0,00	0,00	2.431.731,10	-34.350,50	-1,39%	-1,39%
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>175.143,83</b>	<b>0,98%</b>	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre / 2017

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.840.625,95	1.082.189,20	5.487,44	9.349.697,98	432.370,27	5,31%	5,40%
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	3.625.532,27	0,00	0,00	3.863.074,08	237.541,81	6,55%	6,55%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.308.213,97	0,00	0,00	2.431.731,10	123.517,13	5,35%	5,35%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.631.154,55	0,00	0,00	1.724.302,58	93.148,03	5,71%	5,71%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.072.140,38	537.391,37	1.026.943,08	635.279,27	52.690,60	4,49%	5,17%
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>939.267,84</b>	<b>5,59%</b>	