



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

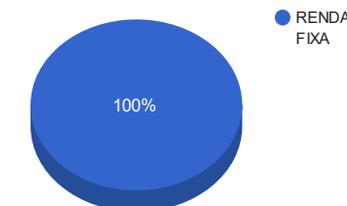
Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			10.298,13	0,02%			Artigo 20
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.061.010,40	7,12%	740	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.679.077,12	8,56%	30	5,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	17.189.590,59	40,00%	1.360	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.539.936,05	3,58%	193	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.120.875,26	7,26%	703	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.740.802,24	6,38%	1.197	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	5.314.962,18	12,37%	774	0,12%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.355.830,22	5,48%	432	0,12%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.087.199,37	2,53%	204	0,32%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	2.877.534,91	6,70%	2.698	0,29%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
		TOTAL -	42.977.116,47				

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

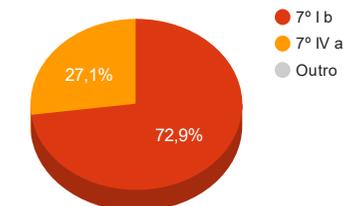
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 20	100,00%	10.298,13	0,02%	0,00%	0,00%	0,00%	-10.298,13
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	31.331.291,66	72,90%	20,00%	80,00%	85,00%	5.199.257,34
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	11.635.526,68	27,07%	5,00%	20,00%	30,00%	1.257.608,26
Total Renda Fixa	100,00%	42.977.116,47	100,00%	25,00	100,00	145,00	-

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Total Renda Variável	30,00%	0,00	0,00%	0,00	0,00	15,00	-

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 20	10.298,13	0,02%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	31.331.291,66	72,90%	30,00%	80,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	5,00%	20,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	11.635.526,68	27,07%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
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%
Total Renda Fixa	42.977.116,47	100,00%	40,00	145,00

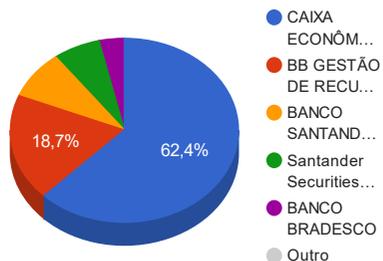
Artigos - Renda Variável	Base: junho / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Total Renda Variável	0,00	0,00%	0,00	15,00

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

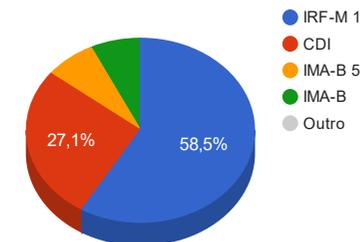
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M 1	0,89%	6,25%	2,69%	6,25%	13,46%	30,44%	-	-	-
BRASESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,90%	6,14%	2,65%	6,14%	13,22%	29,91%	0,20%	0,184%	0,67%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	0,89%	6,13%	2,64%	6,13%	13,18%	29,56%	0,40%	0,178%	0,67%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,87%	6,11%	2,63%	6,11%	13,17%	29,76%	0,10%	0,182%	0,66%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,87%	6,15%	2,65%	6,15%	13,27%	30,05%	0,20%	0,178%	0,66%
CDI	0,81%	5,65%	2,54%	5,65%	12,85%	28,75%	-	-	-
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	0,81%	5,54%	2,43%	5,54%	12,14%	27,35%	0,50%	0,029%	0,34%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO	0,81%	5,71%	2,54%	5,71%	13,04%	28,78%	0,20%	0,026%	0,09%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,81%	5,61%	2,44%	5,61%	12,72%	28,40%	0,20%	0,007%	0,14%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,74%	5,23%	2,34%	5,23%	11,94%	26,64%	0,80%	0,006%	0,07%
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%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,15%	5,36%	-1,38%	5,36%	13,17%	30,39%	0,20%	2,446%	9,80%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	26.814.505,84	62,39%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	8.055.764,42	18,74%
BANCO SANTANDER	3.679.077,12	8,56%
Santander Securities Services	2.877.534,91	6,70%
BANCO BRADESCO	1.539.936,05	3,58%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	10.298,13	0,02%

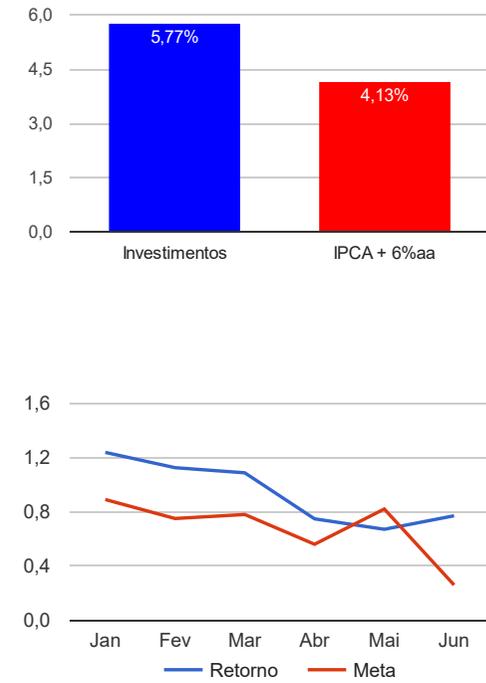


Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	25.149.406,00	58,52%
CDI	11.635.526,68	27,07%
IMA-B 5	3.120.875,26	7,26%
IMA-B	3.061.010,40	7,12%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	10.298,13	0,02%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

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(%)
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.526.234,75	0,00	0,00	1.539.936,05	13.701,30	0,90%	0,18%	0,90%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	3.646.795,22	0,00	0,00	3.679.077,12	32.281,90	0,89%	0,18%	0,89%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.717.265,73	0,00	0,00	2.740.802,24	23.536,51	0,87%	0,18%	0,87%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	17.042.152,72	0,00	0,00	17.189.590,59	147.437,87	0,87%	0,18%	0,87%
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	2.854.302,53	0,00	0,00	2.877.534,91	23.232,38	0,81%	0,03%	0,81%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO	5.272.056,88	0,00	0,00	5.314.962,18	42.905,30	0,81%	0,03%	0,81%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.336.842,51	0,00	0,00	2.355.830,22	18.987,71	0,81%	0,01%	0,81%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.104.979,22	0,00	0,00	3.120.875,26	15.896,04	0,51%	0,93%	0,51%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	644.892,34	1.533.635,55	1.097.190,06	1.087.199,37	5.861,54	0,27%	0,01%	0,74%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.056.432,49	0,00	0,00	3.061.010,40	4.577,91	0,15%	2,45%	0,15%
Total Renda Fixa					328.418,46	0,77%	0,35%	

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 IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	16.745.493,14	0,00	0,00	17.189.590,59	444.097,45	2,65%	2,65%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO	5.183.304,23	0,00	0,00	5.314.962,18	131.657,95	2,54%	2,54%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	3.584.361,69	0,00	0,00	3.679.077,12	94.715,43	2,64%	2,64%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.670.513,62	0,00	0,00	2.740.802,24	70.288,62	2,63%	2,63%
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	2.464.761,11	350.000,00	0,00	2.877.534,91	62.773,80	2,33%	2,43%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.299.619,76	0,00	0,00	2.355.830,22	56.210,46	2,44%	2,44%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.500.147,57	0,00	0,00	1.539.936,05	39.788,48	2,65%	2,65%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.544.350,68	540.728,20	0,00	3.120.875,26	35.796,38	1,28%	1,30%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	1.687.079,87	1.595.098,08	2.221.152,78	1.087.199,37	26.174,20	1,75%	2,34%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.551.159,09	553.771,55	0,00	3.061.010,40	-43.920,24	-1,47%	-1,38%
Total Renda Fixa					917.582,53	2,20%	

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 IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	16.242.455,61	0,00	50.000,00	17.189.590,59	997.134,98	6,15%	6,15%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO	5.028.079,64	0,00	0,00	5.314.962,18	286.882,54	5,71%	5,71%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	4.693.726,65	0,00	1.254.000,00	3.679.077,12	239.350,47	6,09%	6,13%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.583.071,28	0,00	0,00	2.740.802,24	157.730,96	6,11%	6,11%
BNB PLUS FIC RENDA FIXA LP	1.970.231,15	773.337,40	0,00	2.877.534,91	133.966,36	5,37%	5,54%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.230.783,13	0,00	0,00	2.355.830,22	125.047,09	5,61%	5,61%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.717.675,67	1.286.891,80	0,00	3.120.875,26	116.307,79	5,08%	5,40%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.186.750,22	265.265,14	0,00	1.539.936,05	87.920,69	6,06%	6,14%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.746.947,11	1.228.771,55	0,00	3.061.010,40	85.291,74	4,64%	5,36%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	539.159,40	3.813.007,17	3.310.261,96	1.087.199,37	45.294,76	3,40%	5,23%
Total Renda Fixa					2.274.927,38	5,77%	