

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



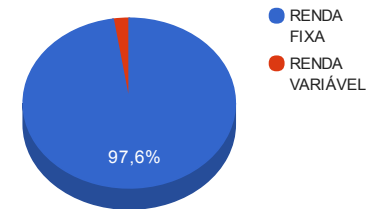
Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	316.693,43	3,67%	178	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.035.936,59	12,02%	599	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	37.019,98	0,43%	1.197	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.789.578,09	32,36%	1.360	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	183.812,41	2,13%	204	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	623.435,29	7,23%	706	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	90.827,80	1,05%	98	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	1.372.333,16	15,92%	331	0,07%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	45.422,30	0,53%	204	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	D+3	Não há	980.145,46	11,37%	353	0,47%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	933.890,40	10,83%	115	0,28%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	210.377,30	2,44%	1.319	0,61%	Artigo 8º, Inciso IV
TOTAL -			8.619.472,21				

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

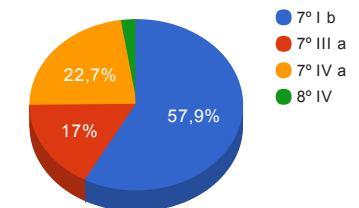
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	4.986.475,79	57,85%	30,00%	50,00%	75,00%	1.478.128,37
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	1.463.160,96	16,98%	15,00%	30,00%	60,00%	3.708.522,37
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	1.959.458,16	22,73%	5,00%	7,50%	30,00%	626.383,50
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	430.973,61
Total Renda Fixa	100,00%	8.409.094,91	97,56%	50,00	90,00	170,00	-

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%	0,00%	5,00%	15,00%	1.292.920,83
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	210.377,30	2,44%	0,00%	5,00%	5,00%	220.596,31
Total Renda Variável	30,00%	210.377,30	2,44%	0,00	10,00	20,00	-

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 7º, Inciso I, Alínea " b "	4.986.475,79	57,85%	30,00%	75,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	1.463.160,96	16,98%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	1.959.458,16	22,73%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	8.409.094,91	97,56%	50,00	170,00

Artigos - Renda Variável	Base: junho / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	210.377,30	2,44%	0,00%	5,00%
Total Renda Variável	210.377,30	2,44%	0,00	20,00

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+	1,51%	8,97%	2,02%	8,97%	18,13%	39,00%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,49%	8,81%	1,92%	8,81%	17,98%	38,93%	0,20%	1,814%	6,47%
IRF-M 1	0,89%	6,25%	2,69%	6,25%	13,46%	30,44%	-	-	-
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%
IMA Geral	0,82%	6,55%	1,12%	6,55%	14,23%	32,35%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,82%	6,55%	1,21%	6,55%	14,43%	31,83%	0,20%	1,213%	4,77%
CDI	0,81%	5,65%	2,54%	5,65%	12,85%	28,75%	-	-	-
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,81%	5,59%	2,43%	5,59%	12,69%	28,32%	0,20%	0,019%	0,15%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,74%	5,23%	2,34%	5,23%	11,94%	26,64%	0,80%	0,006%	0,07%
IDKA IPCA 2 Anos	0,79%	6,38%	2,18%	6,38%	12,88%	32,07%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,62%	5,73%	1,84%	5,73%	12,10%	30,86%	0,20%	0,733%	2,80%
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%	-	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,51%	5,41%	1,30%	5,41%	11,74%	30,22%	0,20%	0,929%	3,58%
IPCA + 6,00% ao ano	0,26%	4,13%	1,64%	4,13%	9,15%	25,94%	-	-	-
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	0,59%	5,99%	1,73%	5,99%	13,17%	29,68%	0,30%	0,486%	2,57%

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

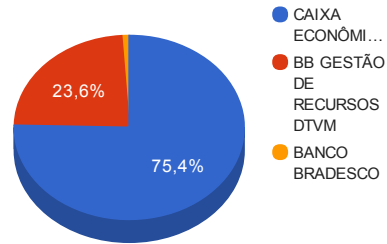
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	0,16%	5,46%	-1,34%	5,46%	13,32%	32,28%	-	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	0,15%	5,56%	-1,42%	5,56%	13,68%	31,83%	0,20%	2,485%	9,95%

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

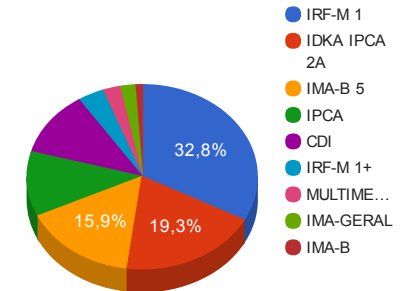
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	0,81%	5,65%	2,54%	5,65%	12,85%	28,75%	-	-	-
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	0,81%	4,07%	-0,19%	4,07%	13,80%	-	1,00%	1,433%	6,84%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	6.495.855,98	75,36%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	2.032.788,43	23,58%
BANCO BRADESCO	90.827,80	1,05%



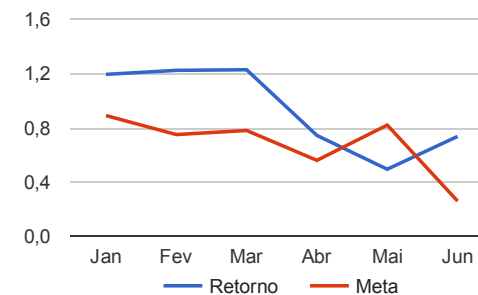
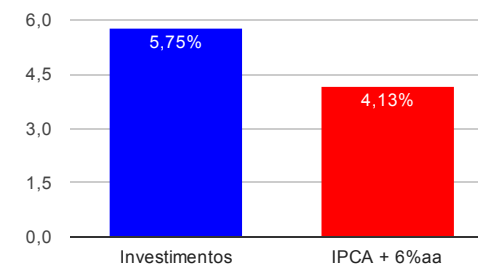
Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	2.826.598,07	32,79%
IDKA IPCA 2A	1.659.371,88	19,25%
IMA-B 5	1.372.333,16	15,92%
IPCA	980.145,46	11,37%
CDI	979.312,70	11,36%
IRF-M 1+	316.693,43	3,67%
MULTIMERCADO	210.377,30	2,44%
IMA-GERAL	183.812,41	2,13%
IMA-B	90.827,80	1,05%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	7.238.944,76	668.654,72	437.235,69	7.559.525,48	89.161,69	1,19%	0,89%	134,11%	0,70%
Fevereiro	7.559.525,48	805.474,43	666.874,48	7.792.287,39	94.161,96	1,22%	0,75%	163,09%	0,43%
Março	7.792.287,39	849.339,62	685.939,45	8.053.354,15	97.666,59	1,23%	0,78%	156,47%	0,54%
Abril	8.053.354,15	715.602,68	564.963,95	8.264.987,28	60.994,40	0,74%	0,56%	133,32%	0,43%
Mai	8.264.987,28	277.960,20	92.481,40	8.492.257,85	41.791,77	0,49%	0,82%	60,20%	2,89%
Junho	8.492.257,85	781.046,41	716.847,95	8.619.472,21	63.015,90	0,74%	0,26%	288,09%	0,56%
Acumulado no ano					446.792,31	5,75%	4,13%	139,30%	

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(%)
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	361.761,38	0,00	50.000,00	316.693,43	4.932,05	1,36%	1,81%	1,49%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	36.702,07	0,00	0,00	37.019,98	317,91	0,87%	0,18%	0,87%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.701.992,05	63.834,48	0,00	2.789.578,09	23.751,56	0,86%	0,18%	0,87%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	182.316,12	0,00	0,00	183.812,41	1.496,29	0,82%	1,21%	0,82%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	926.421,62	0,00	0,00	933.890,40	7.468,78	0,81%	0,02%	0,81%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.029.506,35	0,00	0,00	1.035.936,59	6.430,24	0,62%	0,73%	0,62%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	619.646,35	0,00	0,00	623.435,29	3.788,94	0,61%	0,76%	0,61%
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	974.444,61	0,00	0,00	980.145,46	5.700,85	0,59%	0,49%	0,59%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.365.387,50	0,00	0,00	1.372.333,16	6.945,66	0,51%	0,93%	0,51%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	85.386,05	626.282,58	666.847,95	45.422,30	601,62	0,08%	0,01%	0,74%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	0,00	90.929,35	0,00	90.827,80	-101,55	-0,11%	2,49%	0,15%
Total Renda Fixa					61.332,35	0,73%	0,54%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	208.693,75	0,00	0,00	210.377,30	1.683,55	0,81%	1,43%	0,81%
Total Renda Variável					1.683,55	0,81%	1,43%	

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	2.585.686,86	133.947,36	0,00	2.789.578,09	69.943,87	2,64%	2,65%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	911.712,52	0,00	0,00	933.890,40	22.177,88	2,43%	2,43%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	980.563,44	36.996,48	0,00	1.035.936,59	18.376,67	1,83%	1,84%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.168.303,30	187.149,29	0,00	1.372.333,16	16.880,57	1,26%	1,30%
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	963.516,21	0,00	0,00	980.145,46	16.629,25	1,73%	1,73%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	612.556,27	0,00	0,00	623.435,29	10.879,02	1,78%	1,78%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	360.217,36	0,00	50.000,00	316.693,43	6.476,07	1,80%	1,92%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	181.606,94	0,00	0,00	183.812,41	2.205,47	1,21%	1,21%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	46.369,14	1.272.949,34	1.275.655,22	45.422,30	1.759,04	0,54%	2,34%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	36.070,59	0,00	0,00	37.019,98	949,39	2,63%	2,63%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	48.617,95	48.638,08	0,00	20,13	0,04%	2,29%
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	0,00	90.929,35	0,00	90.827,80	-101,55	-0,11%	-1,42%
Total Renda Fixa					166.195,81	2,04%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	206.751,52	4.019,52	0,00	210.377,30	-393,74	-0,19%	-0,19%
				Total Renda Variável	-393,74	-0,19%	

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	3.323.759,23	133.947,36	835.000,00	2.789.578,09	166.871,50	6,01%	6,15%
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	790.755,98	134.340,93	0,00	980.145,46	55.048,55	5,95%	5,99%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	847.483,39	135.056,06	0,00	1.035.936,59	53.397,14	5,60%	5,73%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	570.879,61	751.145,86	0,00	1.372.333,16	50.307,69	4,87%	5,41%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	884.430,18	0,00	0,00	933.890,40	49.460,22	5,59%	5,59%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	589.756,88	0,00	0,00	623.435,29	33.678,41	5,71%	5,71%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	345.112,12	50.000,00	316.693,43	21.581,31	6,27%	8,81%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	167.822,60	4.942,35	0,00	183.812,41	11.047,46	6,51%	6,55%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	29.167,38	2.141.635,47	2.128.708,27	45.422,30	3.327,72	1,15%	5,23%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	34.889,51	0,00	0,00	37.019,98	2.130,47	6,11%	6,11%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	150.559,68	150.634,65	0,00	74,97	0,17%	5,17%
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	0,00	90.929,35	0,00	90.827,80	-101,55	-0,11%	5,56%
Total Renda Fixa					446.823,89	5,85%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	0,00	210.408,88	0,00	210.377,30	-31,58	-0,07%	4,07%
				Total Renda Variável	-31,58		

Microsoft
VBScript runtime
error '800a000d'
Type mismatch:
'FormatNumber'
/plataforma/relatorios/uRetornoSemRV.as
line 143