

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



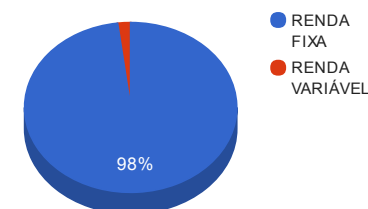
Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.865.437,01	17,69%	675	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	3.987.143,49	24,61%	604	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	229.704,25	1,42%	1.197	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	182.313,99	1,13%	706	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	2.275.085,89	14,04%	307	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.030.283,99	6,36%	108	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	4.617.078,98	28,50%	331	0,25%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	473.793,95	2,92%	615	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	220.168,83	1,36%	774	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	320.301,07	1,98%	80	0,37%	Artigo 8º, Inciso IV
		TOTAL -	16.201.311,45				

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

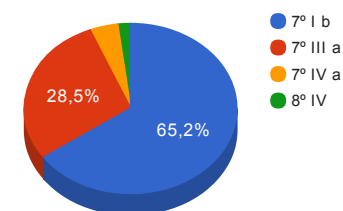
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	10.569.968,62	65,24%	30,00%	50,00%	70,00%	770.949,39
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	4.617.078,98	28,50%	15,00%	20,00%	60,00%	5.103.707,89
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	693.962,78	4,28%	5,00%	5,00%	30,00%	4.166.430,66
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	15,00%	2.430.196,72
Total Renda Fixa	100,00%	15.881.010,38	98,02%	50,00	85,00	175,00	-

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%	5,00%	10,00%	15,00%	2.430.196,72
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	320.301,07	1,98%	2,00%	5,00%	5,00%	489.764,50
Total Renda Variável	30,00%	320.301,07	1,98%	7,00	15,00	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 "	10.569.968,62	65,24%	30,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	4.617.078,98	28,50%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	693.962,78	4,28%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Total Renda Fixa	15.881.010,38	98,02%	50,00	175,00

Artigos - Renda Variável	Base: junho / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	320.301,07	1,98%	2,00%	5,00%
Total Renda Variável	320.301,07	1,98%	7,00	20,00

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

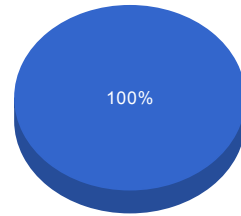
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M	1,35%	8,24%	2,20%	8,24%	16,77%	36,01%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,32%	8,09%	2,08%	8,09%	16,54%	35,39%	0,20%	1,370%	4,86%
IRF-M 1	0,89%	6,25%	2,69%	6,25%	13,46%	30,44%	-	-	-
BB 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%
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 PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,81%	5,71%	2,54%	5,71%	13,04%	28,78%	0,20%	0,026%	0,09%
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%	-	-	-
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%
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%
IMA-B 5+	-0,06%	5,50%	-2,63%	5,50%	14,42%	34,03%	-	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,09%	5,09%	-2,84%	5,09%	13,85%	32,59%	0,20%	3,287%	12,82%

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%	-	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1,00%	6,25%	3,56%	6,25%	13,35%	28,77%	0,60%	0,716%	4,70%

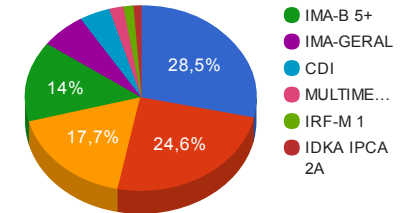
Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (junho / 2017)

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	16.201.311,45	100,00%



● BB GESTÃO DE RECURS...
DE RECURS...

Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5	4.617.078,98	28,50%
IMA-B	3.987.143,49	24,61%
IRF-M	2.865.437,01	17,69%
IMA-B 5+	2.275.085,89	14,04%
IMA-GERAL	1.030.283,99	6,36%
CDI	693.962,78	4,28%
MULTIMERCADO	320.301,07	1,98%
IRF-M 1	229.704,25	1,42%
IDKA IPCA 2A	182.313,99	1,13%

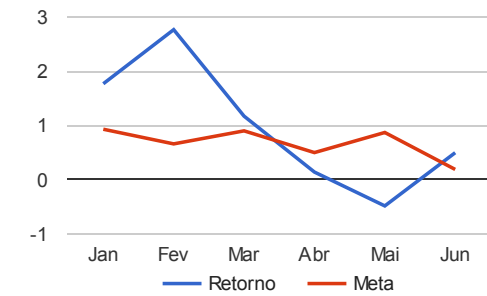
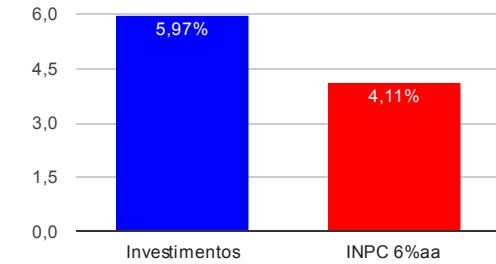


● IMA-B 5
● IMA-B
● IRF-M
● IMA-B 5+
● IMA-GERAL
● CDI
● MULTIME...
● IRF-M 1
● IDKA IPCA 2A

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	12.819.874,85	466.152,46	0,00	13.520.800,55	234.773,24	1,77%	0,93%	190,01%	2,34%
Fevereiro	13.520.800,55	700.000,00	0,00	14.613.645,32	392.844,77	2,76%	0,66%	418,56%	1,29%
Março	14.613.645,32	2.350.000,00	2.100.000,00	15.037.644,55	173.999,23	1,17%	0,90%	130,77%	1,47%
Abril	15.037.644,55	230.000,00	0,00	15.289.257,23	21.612,68	0,14%	0,50%	28,46%	1,28%
Mai	15.289.257,23	215.000,00	0,00	15.429.588,51	-74.668,72	-0,48%	0,87%	-55,24%	8,94%
Junho	15.429.588,51	540.000,00	320.000,00	15.727.517,50	77.928,99	0,50%	0,19%	268,74%	1,68%
Acumulado no ano					826.490,19	5,97%	4,11%	145,32%	

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 IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.828.011,06	0,00	0,00	2.865.437,01	37.425,95	1,32%	1,37%	1,32%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	227.731,68	0,00	0,00	229.704,25	1.972,57	0,87%	0,18%	0,87%
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	1.021.647,17	0,00	0,00	1.030.283,99	8.636,82	0,85%	1,24%	0,85%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	458.618,21	67.438,95	55.582,74	473.793,95	3.319,53	0,63%	0,01%	0,73%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	181.205,97	0,00	0,00	182.313,99	1.108,02	0,61%	0,76%	0,61%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	4.912.647,13	0,00	320.000,00	4.617.078,98	24.431,85	0,50%	0,93%	0,51%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.981.298,27	0,00	0,00	3.987.143,49	5.845,22	0,15%	2,45%	0,15%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	220.000,00	0,00	220.168,83	168,83	0,08%	0,03%	0,81%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.277.047,23	0,00	0,00	2.275.085,89	-1.961,34	-0,09%	3,29%	-0,09%
Total Renda Fixa					80.947,45	0,51%	1,70%	

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(%)
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,00	320.000,00	0,00	320.301,07	301,07	0,09%	0,72%	1,00%
Total Renda Variável					301,07	0,09%	0,72%	

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 (%)
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	4.645.342,96	230.000,00	320.000,00	4.617.078,98	61.736,02	1,27%	1,30%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.806.915,48	0,00	0,00	2.865.437,01	58.521,53	2,08%	2,08%
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	1.018.323,50	0,00	0,00	1.030.283,99	11.960,49	1,17%	1,17%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	439.117,54	202.433,46	178.020,50	473.793,95	10.263,45	2,01%	2,29%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	223.813,43	0,00	0,00	229.704,25	5.890,82	2,63%	2,63%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	179.132,59	0,00	0,00	182.313,99	3.181,40	1,78%	1,78%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	220.000,00	0,00	220.168,83	168,83	0,08%	2,54%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.043.465,66	0,00	0,00	3.987.143,49	-56.322,17	-1,39%	-1,39%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.120.650,93	215.000,00	0,00	2.275.085,89	-60.565,04	-2,67%	-2,84%
Total Renda Fixa					34.835,33	0,22%	

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 (%)
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,00	320.000,00	0,00	320.301,07	301,07	0,09%	3,56%
				Total Renda Variável	301,07		

Microsoft
VBScript runtime
error '800a000d'
Type mismatch:
'FormatNumber'

/plataforma/relatorios/uRetornoTriRV.asp,
line 143