

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
BRDESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	D+1	16/05/2019	17.230.171,62	3,31%	11	22,61%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	14.643.160,17	2,82%	72	1,54%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	10.933.857,21	2,10%	23	2,52%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	13.268.173,23	2,55%	740	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	19.746.452,58	3,80%	223	0,62%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	37.562.206,37	7,22%	167	3,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.068.251,09	0,97%	1.360	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	18/08/2018	44.482.376,80	8,55%	100	3,78%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	12.260.121,95	2,36%	145	1,33%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2018	8.293.348,00	1,59%	54	2,96%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	11.019.474,00	2,12%	6	24,52%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	2.692.737,16	0,52%	1.898	2,76%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	17.636.399,90	3,39%	34	3,55%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	46.461.441,38	8,93%	115	5,67%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	21.173.223,38	4,07%	706	0,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	17.936.966,16	3,45%	245	1,57%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	D+1	Não há	21.099.564,24	4,06%	14	6,04%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	14.339.368,28	2,76%	1.334	0,23%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	58.940.487,08	11,33%	757	1,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	821.213,76	0,16%	774	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	49.682.564,07	9,55%	475	0,56%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	10.183.099,41	1,96%	62	0,71%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "

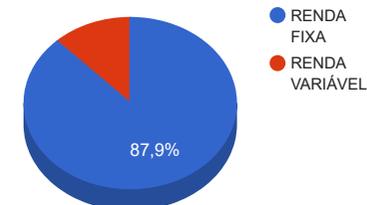
Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	1.582.265,34	0,30%	98	1,53%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	6.605.651,24	1,27%	39	1,34%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ FOF RPI 30 IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+25	Não há	2.142.409,79	0,41%	15	2,26%	Artigo 8º, Inciso I
BRDESCO H REGIMES DE PREVIDÊNCIA IBOVESPA FIC AÇÕES	D+5	Não há	5.835.699,21	1,12%	10	7,65%	Artigo 8º, Inciso I
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	5.619.280,57	1,08%	208	1,12%	Artigo 8º, Inciso III
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	6.740.638,92	1,30%	84	5,15%	Artigo 8º, Inciso III
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou D+33	Não há	4.823.772,14	0,93%	413	1,48%	Artigo 8º, Inciso III
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	5.510.570,67	1,06%	1.010	2,39%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	D+5	Não há	8.913.431,38	1,71%	33	3,62%	Artigo 8º, Inciso IV
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	13.905.288,29	2,67%	766	2,14%	Artigo 8º, Inciso IV
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	2.995.494,55	0,58%	19	3,21%	Artigo 8º, Inciso V
		TOTAL -	520.149.159,94				

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

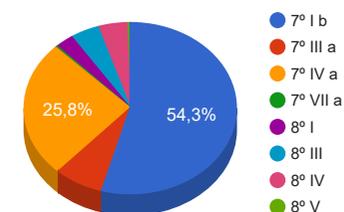
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	0,00	0,00%	3,00%	3,00%	3,00%	15.604.474,80
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	282.471.394,84	54,31%	60,00%	65,00%	70,00%	81.633.017,12
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	39.036.530,40	7,50%	10,00%	15,00%	20,00%	64.993.301,59
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	133.966.732,60	25,76%	20,00%	27,00%	30,00%	22.078.015,38
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	1.582.265,34	0,30%	1,00%	3,00%	3,00%	14.022.209,46
Total Renda Fixa	100,00%	457.056.923,18	87,87%	94,00	113,00	126,00	-

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	14.583.760,24	2,80%	0,00%	4,00%	10,00%	37.431.155,75
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	22.694.262,30	4,36%	5,00%	5,00%	10,00%	29.320.653,69
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	22.818.719,67	4,39%	3,00%	4,00%	5,00%	3.188.738,33
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	2.995.494,55	0,58%	2,00%	3,00%	3,00%	12.608.980,25
Total Renda Variável	30,00%	63.092.236,76	12,13%	10,00	16,00	28,00	-

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 " a "	0,00	0,00%	3,00%	3,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	282.471.394,84	54,31%	60,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	39.036.530,40	7,50%	10,00%	20,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	133.966.732,60	25,76%	20,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	1.582.265,34	0,30%	1,00%	3,00%
Total Renda Fixa	457.056.923,18	87,87%	94,00	126,00

Artigos - Renda Variável	Base: junho / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I	14.583.760,24	2,80%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso III	22.694.262,30	4,36%	5,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV	22.818.719,67	4,39%	3,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	2.995.494,55	0,58%	2,00%	3,00%
Total Renda Variável	63.092.236,76	12,13%	10,00	28,00

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%	-	-	-
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	0,96%	6,31%	2,48%	6,31%	13,69%	29,77%	0,50%	0,347%	1,16%
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%
Selic	0,81%	5,65%	2,54%	5,65%	12,87%	28,79%	-	-	-
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,83%	5,83%	2,70%	5,83%	13,30%	29,29%	0,20%	0,007%	0,10%
CDI	0,81%	5,65%	2,54%	5,65%	12,85%	28,75%	-	-	-
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,86%	5,76%	2,61%	5,76%	13,02%	29,00%	0,20%	0,017%	0,07%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,82%	5,70%	2,57%	5,70%	12,90%	28,87%	0,20%	0,015%	0,09%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,81%	5,71%	2,54%	5,71%	13,04%	28,78%	0,20%	0,026%	0,09%
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%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,56%	5,49%	2,08%	5,49%	-	-	0,20%	0,511%	-
101,50% do IPCA + 5,75% ao ano	0,22%	3,94%	1,55%	3,94%	8,77%	25,12%	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,63%	-3,09%	-1,80%	-3,09%	-12,76%	-16,55%	0,25%	0,633%	2,03%
IMA-B	0,16%	5,46%	-1,34%	5,46%	13,32%	32,28%	-	-	-
BRDESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	0,68%	3,29%	-0,76%	3,29%	3,37%	-	0,20%	0,815%	6,84%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,57%	2,57%	2,08%	2,57%	5,52%	15,76%	0,20%	0,514%	4,51%

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

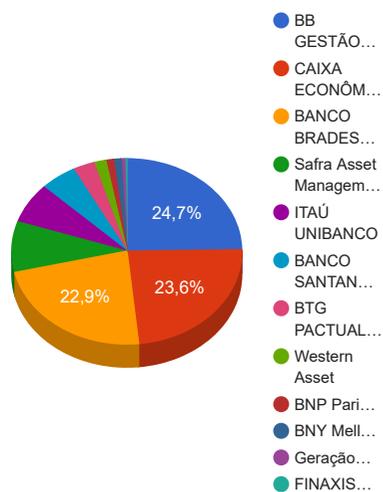
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,53%	5,81%	1,45%	5,81%	11,99%	29,92%	0,20%	0,776%	3,55%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,19%	5,47%	-1,39%	5,47%	13,47%	31,77%	0,30%	2,447%	9,78%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA	0,16%	5,22%	-1,45%	5,22%	12,78%	31,05%	0,40%	2,430%	9,76%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,16%	3,28%	-0,15%	3,28%	7,08%	17,19%	0,20%	1,819%	8,71%
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%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP	0,15%	5,39%	-1,36%	5,39%	13,15%	31,92%	0,20%	2,449%	9,82%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	0,11%	4,74%	-2,08%	4,74%	12,67%	31,30%	0,15%	2,538%	10,31%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	0,10%	4,81%	-1,86%	4,81%	12,26%	32,03%	0,45%	2,472%	10,14%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	0,01%	5,09%	-1,57%	5,09%	12,90%	30,88%	0,20%	2,511%	9,81%
IPCA	-0,23%	1,18%	0,22%	1,18%	3,00%	12,11%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,97%	6,16%	0,05%	6,16%	14,12%	35,07%	0,40%	0,825%	6,27%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL 2018 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,56%	2,57%	2,08%	2,57%	5,69%	16,14%	0,20%	0,514%	4,44%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,51%	3,06%	0,40%	3,06%	6,87%	-	0,15%	1,474%	7,25%

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

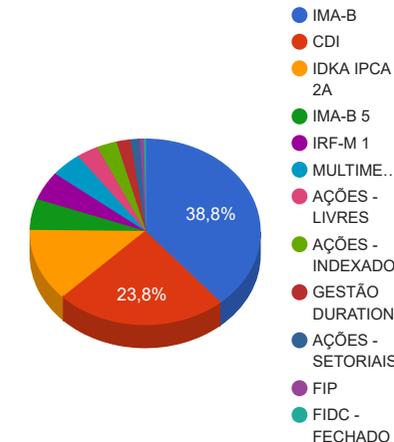
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	0,81%	5,65%	2,54%	5,65%	12,85%	28,75%	-	-	-
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	1,05%	5,54%	1,91%	5,54%	12,64%	29,05%	0,50%	0,384%	1,66%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	0,84%	4,33%	0,78%	4,33%	14,26%	32,95%	2,00%	0,456%	1,95%
IGC	0,53%	8,85%	-0,71%	8,85%	21,63%	18,82%	-	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	0,44%	8,41%	-0,86%	8,41%	20,90%	17,92%	1,00%	6,110%	20,17%
SMLL	0,38%	19,24%	2,71%	19,24%	33,53%	30,90%	-	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	-0,68%	9,85%	-3,64%	9,85%	19,79%	31,02%	2,00%	6,218%	20,91%
Ibovespa	0,30%	4,44%	-3,21%	4,44%	22,07%	18,50%	-	-	-
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2,08%	10,81%	2,34%	10,81%	9,40%	15,75%	3,00%	5,279%	17,23%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	0,87%	6,64%	-2,11%	6,64%	18,22%	21,30%	1,50%	5,643%	19,52%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	0,73%	7,98%	1,60%	7,98%	24,34%	37,21%	2,00%	4,403%	9,37%
ITAÚ FOF RPI 30 IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	0,59%	6,60%	-2,18%	6,60%	18,27%	24,26%	1,50%	5,311%	18,27%
BRDESCO H REGIMES DE PREVIDÊNCIA IBOVESPA FIC AÇÕES	-0,14%	5,48%	-2,96%	5,48%	18,69%	15,03%	1,00%	5,373%	18,74%
Não Possui	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTIELSTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,50%	0,008%	23,04%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	128.716.625,39	24,75%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	122.955.366,70	23,64%
BANCO BRADESCO	119.209.876,28	22,92%
Safra Asset Management	45.938.709,74	8,83%
ITAÚ UNIBANCO	36.567.560,34	7,03%
BANCO SANTANDER	26.599.490,23	5,11%
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS	15.843.246,14	3,05%
Western Asset	8.913.431,38	1,71%
BNP Paribas	5.619.280,57	1,08%
BNY Mellon Serviços Financeiros	5.510.570,67	1,06%
Geração Futuro	2.692.737,16	0,52%
FINAXIS Corretora	1.582.265,34	0,30%



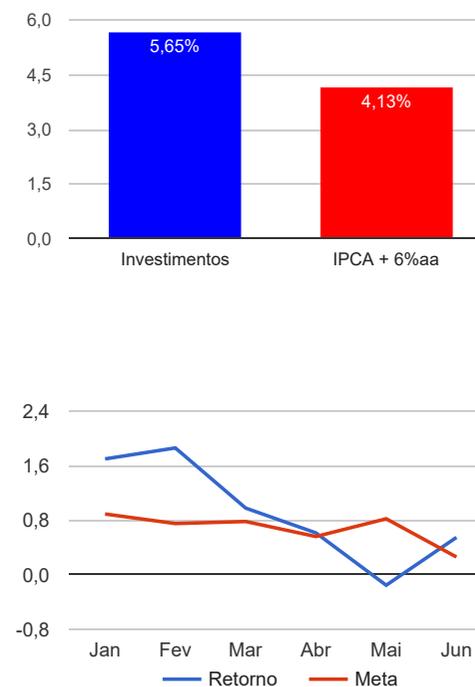
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	201.644.709,15	38,77%
CDI	123.783.633,19	23,80%
IDKA IPCA 2A	65.655.600,18	12,62%
IMA-B 5	28.039.800,58	5,39%
IRF-M 1	26.167.815,33	5,03%
MULTIMERCADO	22.818.719,67	4,39%
AÇÕES - LIVRES	15.953.623,38	3,07%
AÇÕES - INDEXADO	14.583.760,24	2,80%
GESTÃO DURATION	10.183.099,41	1,96%
AÇÕES - SETORIAIS	6.740.638,92	1,30%
FIP	2.995.494,55	0,58%
FIDC - FECHADO	1.582.265,34	0,30%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	493.641.105,99	18.071.369,17	12.464.392,56	507.717.797,54	8.469.714,94	1,70%	0,89%	190,20%	1,68%
Fevereiro	507.717.797,54	14.946.396,47	15.100.992,32	516.991.834,67	9.428.632,98	1,86%	0,75%	248,12%	1,59%
Março	516.991.834,67	22.850.873,14	23.326.907,92	521.565.248,22	5.049.448,33	0,98%	0,78%	124,49%	1,32%
Abril	521.565.248,22	24.337.468,33	25.940.899,73	523.160.967,65	3.199.150,83	0,61%	0,56%	109,99%	1,32%
Mai	523.160.967,65	12.652.575,65	13.400.984,62	521.611.115,81	-801.442,87	-0,15%	0,82%	-18,65%	5,99%
Junho	521.611.115,81	8.668.524,15	12.986.143,69	520.149.159,94	2.855.663,67	0,55%	0,26%	214,16%	1,29%
Acumulado no ano					28.201.167,88	5,65%	4,13%	136,94%	

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(%)
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	10.085.135,08	0,00	0,00	10.183.099,41	97.964,33	0,97%	0,83%	0,97%
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	20.898.145,41	0,00	0,00	21.099.564,24	201.418,83	0,96%	0,35%	0,96%
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	14.217.770,04	0,00	0,00	14.339.368,28	121.598,24	0,86%	0,02%	0,86%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.253.617,29	0,00	230.000,00	5.068.251,09	44.633,80	0,85%	0,18%	0,87%
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	49.272.200,78	0,00	0,00	49.682.564,07	410.363,29	0,83%	0,01%	0,83%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	63.313.920,54	7.852.298,38	12.750.000,00	58.940.487,08	524.268,16	0,74%	0,02%	0,82%
BRADERCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	17.113.071,60	0,00	0,00	17.230.171,62	117.100,02	0,68%	0,82%	0,68%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	21.044.542,83	0,00	0,00	21.173.223,38	128.680,55	0,61%	0,76%	0,61%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	816.225,77	0,00	821.213,76	4.987,99	0,61%	0,03%	0,81%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	19.635.511,31	0,00	0,00	19.746.452,58	110.941,27	0,57%	0,51%	0,57%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	44.232.486,37	0,00	0,00	44.482.376,80	249.890,43	0,56%	0,51%	0,56%
CAIXA BRASIL 2018 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.246.840,00	0,00	0,00	8.293.348,00	46.508,00	0,56%	0,51%	0,56%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	37.365.284,60	0,00	0,00	37.562.206,37	196.921,77	0,53%	0,78%	0,53%
BGT PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.963.074,60	0,00	0,00	11.019.474,00	56.399,40	0,51%	1,47%	0,51%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	17.903.121,93	0,00	0,00	17.936.966,16	33.844,23	0,19%	2,45%	0,19%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA	17.607.348,38	0,00	0,00	17.636.399,90	29.051,52	0,16%	2,43%	0,16%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	14.620.198,51	0,00	0,00	14.643.160,17	22.961,66	0,16%	1,82%	0,16%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	13.248.329,94	0,00	0,00	13.268.173,23	19.843,29	0,15%	2,45%	0,15%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIX...	12.242.165,97	0,00	0,00	12.260.121,95	17.955,98	0,15%	2,45%	0,15%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	2.689.682,55	0,00	0,00	2.692.737,16	3.054,61	0,11%	2,54%	0,11%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	10.922.800,92	0,00	0,00	10.933.857,21	11.056,29	0,10%	2,47%	0,10%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	46.458.365,05	0,00	0,00	46.461.441,38	3.076,33	0,01%	2,51%	0,01%

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(%)
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.592.337,78	0,00	6.143,69	1.582.265,34	-3.928,75	-0,25%	0,63%	-0,63%
				Total Renda Fixa	2.448.591,24	0,53%	1,00%	

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(%)
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4.725.593,15	0,00	0,00	4.823.772,14	98.178,99	2,08%	5,28%	2,08%
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	13.760.695,71	0,00	0,00	13.905.288,29	144.592,58	1,05%	0,38%	1,05%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	6.548.430,12	0,00	0,00	6.605.651,24	57.221,12	0,87%	5,64%	0,87%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	8.839.416,89	0,00	0,00	8.913.431,38	74.014,49	0,84%	0,46%	0,84%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	5.578.450,74	0,00	0,00	5.619.280,57	40.829,83	0,73%	4,40%	0,73%
ITAÚ FOF RPI 30 IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	2.129.914,50	0,00	0,00	2.142.409,79	12.495,29	0,59%	5,31%	0,59%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	6.710.940,61	0,00	0,00	6.740.638,92	29.698,31	0,44%	6,11%	0,44%
BRADESCO H REGIMES DE PREVIDÊNCIA IBOVESPA FIC AÇÕES	5.843.916,91	0,00	0,00	5.835.699,21	-8.217,70	-0,14%	5,37%	-0,14%
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTISTRATÉGIA FIP	2.999.729,70	0,00	0,00	2.995.494,55	-4.235,15	-0,14%	0,01%	-0,14%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	5.548.076,00	0,00	0,00	5.510.570,67	-37.505,33	-0,68%	6,22%	-0,68%
Total Renda Variável					407.072,43	0,65%	3,41%	

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 FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	69.442.092,19	31.018.147,76	43.190.000,00	58.940.487,08	1.670.247,13	2,23%	2,57%
BRASESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	52.348.281,29	0,00	4.000.000,00	49.682.564,07	1.334.282,78	2,68%	2,70%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	43.577.172,34	0,00	0,00	44.482.376,80	905.204,46	2,08%	2,08%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	37.024.674,72	0,00	0,00	37.562.206,37	537.531,65	1,45%	1,45%
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	23.074.441,11	0,00	2.500.000,00	21.099.564,24	525.123,13	2,46%	2,48%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	19.344.414,68	0,00	0,00	19.746.452,58	402.037,90	2,08%	2,08%
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	15.464.940,33	0,00	1.500.000,00	14.339.368,28	374.427,95	2,60%	2,61%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	20.803.748,18	0,00	0,00	21.173.223,38	369.475,20	1,78%	1,78%
BRASESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	17.361.916,07	0,00	474.846,74	17.230.171,62	343.102,29	1,99%	-0,76%
CAIXA BRASIL 2018 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.124.746,00	0,00	0,00	8.293.348,00	168.602,00	2,08%	2,08%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.572.642,66	0,00	645.000,00	5.068.251,09	140.608,43	2,62%	2,65%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.975.294,80	0,00	0,00	11.019.474,00	44.179,20	0,40%	0,40%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	10.177.511,67	0,00	0,00	10.183.099,41	5.587,74	0,05%	0,05%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	816.225,77	0,00	821.213,76	4.987,99	0,61%	2,54%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.611.229,72	0,00	18.181,30	1.582.265,34	-10.783,08	-0,67%	-1,80%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	14.664.565,91	0,00	0,00	14.643.160,17	-21.405,74	-0,15%	-0,15%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	2.749.918,69	0,00	0,00	2.692.737,16	-57.181,53	-2,08%	-2,08%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIX...	10.928.303,48	1.500.000,00	0,00	12.260.121,95	-168.181,53	-1,35%	-1,36%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.451.416,38	5.000.000,00	0,00	13.268.173,23	-183.243,15	-1,36%	-1,38%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	8.631.958,46	2.500.000,00	0,00	10.933.857,21	-198.101,25	-1,78%	-1,86%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	17.840.233,26	349.347,86	0,00	17.936.966,16	-252.614,96	-1,39%	-1,39%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA	17.895.638,32	0,00	0,00	17.636.399,90	-259.238,42	-1,45%	-1,45%

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 (%)
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	42.735.896,78	4.474.846,74	0,00	46.461.441,38	-749.302,14	-1,59%	-1,57%
				Total Renda Fixa	4.925.346,05	1,08%	

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 INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTISTRATÉGIA FIP	2.560.859,05	0,00	0,00	2.995.494,55	434.635,50	16,97%	-
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	13.644.694,16	0,00	0,00	13.905.288,29	260.594,13	1,91%	1,91%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4.713.280,76	0,00	0,00	4.823.772,14	110.491,38	2,34%	2,34%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	5.530.701,46	0,00	0,00	5.619.280,57	88.579,11	1,60%	1,60%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	8.844.320,61	0,00	0,00	8.913.431,38	69.110,77	0,78%	0,78%
ITAÚ FOF RPI 30 IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	2.190.079,80	0,00	0,00	2.142.409,79	-47.670,01	-2,18%	-2,18%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	6.799.408,48	0,00	0,00	6.740.638,92	-58.769,56	-0,86%	-0,86%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	6.748.356,01	0,00	0,00	6.605.651,24	-142.704,77	-2,11%	-2,11%
BRDESCO H REGIMES DE PREVIDÊNCIA IBOVESPA FIC AÇÕES	6.013.600,70	0,00	0,00	5.835.699,21	-177.901,49	-2,96%	-2,96%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	5.718.910,15	0,00	0,00	5.510.570,67	-208.339,48	-3,64%	-3,64%
Total Renda Variável					328.025,58	0,52%	

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 FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	65.409.416,10	67.605.238,07	77.863.912,32	58.940.487,08	3.789.745,23	4,96%	5,70%
BRASESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	50.799.817,36	0,00	4.000.000,00	49.682.564,07	2.882.746,71	5,81%	5,83%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	43.401.438,02	0,00	1.252.012,33	44.482.376,80	2.332.951,11	5,47%	5,49%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	36.533.020,51	0,00	1.055.211,72	37.562.206,37	2.084.397,58	5,79%	5,81%
BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	40.029.612,29	4.474.846,74	0,00	46.461.441,38	1.956.982,35	5,06%	5,09%
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	22.243.308,88	0,00	2.500.000,00	21.099.564,24	1.356.255,36	6,29%	6,31%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	20.029.431,14	0,00	0,00	21.173.223,38	1.143.792,24	5,71%	5,71%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	19.251.505,51	0,00	541.708,89	19.746.452,58	1.036.655,96	5,48%	2,57%
BRASESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	16.680.592,97	0,00	474.846,74	17.230.171,62	1.024.425,39	6,16%	3,29%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA	16.760.885,78	0,00	0,00	17.636.399,90	875.514,12	5,22%	5,22%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	14.178.658,11	0,00	401.202,31	14.643.160,17	865.704,37	6,14%	3,28%
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	15.005.234,29	0,00	1.500.000,00	14.339.368,28	834.133,99	5,74%	5,76%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.566.750,49	3.637.510,43	0,00	17.936.966,16	732.705,24	5,34%	5,47%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.692.395,10	0,00	292.097,93	11.019.474,00	619.176,83	5,84%	3,06%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	9.591.870,13	0,00	0,00	10.183.099,41	591.229,28	6,16%	6,16%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIX...	10.228.774,85	1.500.000,00	0,00	12.260.121,95	531.347,10	5,39%	5,39%
CAIXA BRASIL 2018 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.085.434,00	0,00	226.919,47	8.293.348,00	434.833,47	5,47%	2,57%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	8.082.487,18	2.500.000,00	0,00	10.933.857,21	351.370,03	4,90%	4,81%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.238.564,19	4.954.556,31	1.425.000,00	5.068.251,09	300.130,59	5,39%	6,15%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.077.548,73	0,00	9.295.397,94	0,00	217.849,21	2,79%	5,73%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.754.688,80	1.380.582,30	2.368.915,73	821.213,76	54.858,39	2,84%	5,71%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	547.506,00	2.116.201,69	0,00	2.692.737,16	29.029,47	2,61%	4,74%

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 (%)
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.632.751,62	0,00	23.095,46	1.582.265,34	-27.390,82	-1,68%	-3,09%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	13.358.271,37	0,00	13.268.173,23	-90.098,14	0,87%	5,36%
				Total Renda Fixa	23.928.345,06	5,44%	

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 (%)
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	13.175.682,62	0,00	0,00	13.905.288,29	729.605,67	5,54%	5,54%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	6.217.587,16	0,00	0,00	6.740.638,92	523.051,76	8,41%	8,41%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	5.016.639,12	0,00	0,00	5.510.570,67	493.931,55	9,85%	9,85%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4.353.189,63	0,00	0,00	4.823.772,14	470.582,51	10,81%	10,81%
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTIESTRATÉGIA FIP	2.571.488,86	0,00	0,00	2.995.494,55	424.005,69	16,49%	-
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	5.204.209,10	0,00	0,00	5.619.280,57	415.071,47	7,98%	7,98%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	6.194.419,44	0,00	0,00	6.605.651,24	411.231,80	6,64%	6,64%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	8.543.722,48	0,00	0,00	8.913.431,38	369.708,90	4,33%	4,33%
BRADESCO H REGIMES DE PREVIDÊNCIA IBOVESPA FIC AÇÕES	5.532.686,02	0,00	0,00	5.835.699,21	303.013,19	5,48%	5,48%
ITAÚ FOF RPI 30 IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	2.009.789,51	0,00	0,00	2.142.409,79	132.620,28	6,60%	6,60%
Total Renda Variável					4.272.822,82	7,26%	