RELATÓRIO DE GESTÃO DE INVESTIMENTOS JUNHO DE 2017





As informações utilizadas neste relatório de gestão de investimento são obtidas pelos extratos oficiais das instituições financeiras em que o RPPS aloca seus recursos.

Este Relatório visa a fornecer informações resumidas aos órgãos fiscalizadores, aos segurados e pensionistas da Guarujá Previdência e à população, em geral.

Este relatório contém, a composição atual da carteira do Instituto relatando a sua rentabilidade consolidada e detalhada por ativo, a comparação com a meta atuarial e seu enquadramento em relação à Resolução 3.922/2010 do Conselho Monetário Nacional.



• Composição da Carteira da Guarujá Previdência – Junho de 2017

CAIXA BRASIL IRF-M TITULOS PUBLICOS FI RENDA FIXA LP 4.028.340.08 0 0 4.028.340.08 0 1.000.000 0 3.141.370.33 3.41.39.39 1.1.34% 3.43.39.39 1.1.34% 3.43.39.39 1.1.34% 3.43.39.39 1.1.34% 3.43.39.39 1.1.34% 3.43.39.39 1.1.34% 3.43.39.39 1.1.34% 3.43.39.39 1.1.34% 3.43.39.39 1.1.34% 3.43.39.39 1.1.34% 3.43.39.39 1.1.34% 3.43.39.39 1.1.34% 3.43.39.39 1.1.34% 3.43.39.39 1.1.34% 3.43.39.39 1.1.34% 3.43.39.39 1.1.34% 3.43.39.39 3.43.39.39 3.43.39.39 3.43.39.39 3.43.39.39 3.43.39.39 3.43.39.39 3.43.39.39 3.43.39.39 3.43.39.30 3.43.39.39 3.43.39.39 3.43.39.30 3.43.39.39 3.43.39.30 3.43.30							RETORNO	VAR - MËS	
BB PCA BIF RENDA FIXA PREVIDENCIARIO CREDITO PRIVADO 1.707.230.90 1.400.000.00 0 1.401.700.83 34.139.93 1.10% 1.17% 0.95% 1.740 1.74	ATIVOS DE RENDA FIXA	SADO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO (R\$)	(%)	(%)	INST.(%)
ITAU INSTITUCIONNAL ALDCAÇÃO DINAMICA FIG RENDA FIXA			, and the second	×	, -		,		
TAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA II FIC RENDA FIXA 2.882.896.14 0 0 2.910.770.96 27.874.82 0.97% 0.82% 0.97% 0.82% 0.97% 0.82% 0.97% 0.82% 0.97% 0.82% 0.92				_			,		
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP 1.705.343,19 0 0 1.719.402.20 14.059.01 0.82% 0.02			_	_	,				
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS FUBLICOS FI RENDA FIXA 9 228.047,71 0 0 9.302.219,19 74.171,48 0.80% 1,34% 0.80% 17AU INSTITUCIONAL TITULOS PUBLICOS FI RENDA FIXA 9.228.047,71 0 0 9.302.219,19 74.171,48 0.80% 0.				·					
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA 9.228.047.71 0 0 9.302.219.19 74.171.48 0.89% 1.34% 0.89% 0.82% 0.69% 1.74 INDIVIDIONAL TITULOS PUBLICOS FI RENDA FIXA 5.538.069.195 0 0 5.575.096.68 38.134.73 0.69% 0.82% 0.62% 0.73% 0.62% 0.62% 0.73% 0.62% 0.62% 0.73% 0.62% 0.62% 0.73% 0.69% 0.62% 0.73% 0.62% 0.62% 0.73% 0.69% 0.62% 0.73% 0.69% 0.62% 0.73% 0.62% 0.62% 0.73% 0.62% 0.62% 0.73% 0.62% 0.62% 0.73% 0.62% 0.62% 0.73% 0.62% 0.62% 0.73% 0.62% 0.62% 0.73% 0.62% 0.62% 0.73% 0.62% 0.62% 0.73% 0.62% 0.62% 0.73% 0.62% 0.62% 0.73% 0.62% 0.62% 0.73% 0.62% 0.62% 0.73% 0.62% 0.62% 0.73% 0.62% 0.62% 0.73% 0.62% 0.62% 0.73% 0.62% 0.62% 0.73% 0.62% 0.62% 0.73% 0.62% 0.62% 0.73% 0.62% 0.62% 0.62% 0.73% 0.62% 0.									
ITAU INSTITUCIONAL TITULOS PUBLICOS FI RENDA FIXA 5.536.961.95 0 0 5.575.096.68 38.134.73 0.69% 0.62% 0.69% 0.62X				-					
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS FI RENDA FIXA LP 6.162.290.71 0 0.20.0780.03 38.489.32 0.62% 0.73% 0.62% 0.75% 0.62% 0.75% 0.62% 0.75% 0.62% 0.75% 0.62% 0.75% 0.62% 0.75% 0.65% 0.75% 0.67% 0.67% 0.57% 0.67% 0.57% 0.67% 0.57% 0.67% 0.57% 0.67% 0.57% 0.67% 0.57% 0.67% 0.57% 0.67% 0.57% 0.67% 0.57% 0.67% 0.57% 0.67% 0.67% 0.57% 0.67		,		·					
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CREDITO PRIVADO 2.388.715,20 0 0. 2.03.467,20 1.4742,00 0.62% 0.75% 0.7			0	0					
CAIXA BRASIL 2020 IV TITULOS PUBLICOS FI RENDA FIXA 2238.822.83 0 0 2.251.639.19 12.816.36 0,57% BB TITULOS PUBLICOS IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIARIO 1.971.130.81 0 0 1.892.405.33 1.1727, 2 0.57% BB TITULOS PUBLICOS IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIARIO 2.456.078.64 0 0 2.471.986.18 13.907.54 0.57% 0.5	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.162.290,71	0	0			0,62%		
BB TITLUOS PUBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO			0	0					
BB TITULOS PUBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO 2.458.078.64 0 0 2.471.986.18 13.907.54 0.57% 0.57	CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.238.822,83	0	0	2.251.639,19	12.816,36	0,57%	1,00%	0,57%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PUBLICOS FI RENDA FIXA 12.318.780.76 0 0 12.388.382.26 86.601.50 0.57% 0.57% 0.57% 0.57% 0.57% 0.57% 0.57% 0.57% 0.57% 0.57% 0.57% 0.57% 0.57% 0.57% 0.57% 0.57% 0.57% 0.57% 0.57% 0.58% 0.51% 0.56% 0.56% 0.51% 0.56% 0.51% 0.56% 0.51% 0.56% 0.51% 0.56% 0.51% 0.56% 0.51% 0.56% 0.51% 0.57% 0.53% 0.01% 0.73%	BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.971.130,81	0	0	1.982.403,53	11.272,72	0,57%	0,67%	0,57%
BB TITULOS PUBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.458.078,64	0	0	2.471.986,18	13.907,54	0,57%	0,51%	0,57%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.318.780,76	0	0	12.388.382,26	69.601,50	0,57%	0,51%	0,57%
BB TITULOS PUBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.552.144,54	0	0	10.611.758,64	59.614,10	0,56%	0,51%	0,56%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TĪTULOS PUBLICOS FI RENDA FIXA 20.242.866,53 0 0 1.872.478,98 105.303,66 0.51% 0.93% 0.51% 0.93% 0.51% 0.93% 0.51% 0.93% 0.51% 0.93% 0.51% 0.93% 0.51% 0.93% 0.51% 0.93% 0.51% 0.93% 0.94% 0.93% 0.94% 0.93% 0.94% 0.93% 0.94%	BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.253.126,51	0	1.400.000,00	2.875.780,15	22.653,64	0,53%	0,01%	0,73%
SANTANDER IMA B 5 TÎTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA 20.242.856.53 0 0 0 20.345.855.18 102.998.65 0.51% 0.93% 0.51%	BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.884.514,01	0	0	14.962.958,08	78.444,07	0,53%	0,78%	0,53%
DAYCOVAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	20.568.977,33	0	0	20.674.280,99	105.303,66	0,51%	0,93%	0,51%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA 5.318.077,94 6.358.759,10 6.548.195,33 5.184.543,95 55.902,24 0,48% 0,01% 0,74% CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA 1.941.882,00 0 0 1.951.144,50 9.262,50 0,48% 0,23% 0,48% 0,23% 0,48% BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO 1.284.521,79 0 0 1.290.589,52 6.067,73 0,47% 0,23% 0,47% 0,23% 0,47% 0,23% 0,47% SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI 2.593.387,93 4.046.145,23 698.424,70 5.971.702,21 30.593,75 0,46% 0,02% 0,86% BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO 3.177.105,70 0 0 3.188.121,96 11.016,26 0,35% 11.41% 0,34% 0,35% BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO 6.347.498,56 0 0 0 3.422.406,76 10.131,81 0,30% 2,74% 0,30% CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA 1.406.747,48 0 0 1.410.897,82 4.150,34 0,30% 2,74% 0,30% CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA 1.406.747,48 0 0 1.407.497,92 4.150,34 0,30% 2,74% 0,30% CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA 1.406.747,48 0 0 1.408.492,74 5.013,47 0,17% 1.70% 0,17% 1.70% 0,17% CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA 6.369.376,51 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0	SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	20.242.856,53	0	0	20.345.855,18	102.998,65	0,51%	0,93%	0,51%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	DAYCOVAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.863.280,82	0	0	1.872.478,98	9.198,16	0,49%	0,93%	0,49%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO 1.284.521,79 0 0 1.290.589,52 6.067,73 0.47% 0.23% 0.47% SANTANDER CORPORATE FIG RENDA FIXA REFERENCIADO DI 2.593.87,93 4.046.145,23 698.424,70 5.971.702,21 30.593,75 0.46% 0.02% 0.086% BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO 3.177.105,70 0 0 0 3.188.121,96 11.016,26 0.35% 11.43% 0.35% BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO 6.347.498,56 0 0 0 6.369.214,33 21.715,77 0,34% 1,41% 0,34% CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA 3.412.274,95 0 0 0 3.422.406,76 10.131,81 0,30% 2,74% 0,30% BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA 1.406.747,48 0 0 0 1.410.897,82 4.150,34 0,30% 2,74% 0,30% BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA 3.029.910,27 0 0 3.034.923,74 5.013,47 0,17% 1,70% 0,17% CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA 6.369.376,51 0 0 0 1.637.939,90 1.003,39 0,16% 18.28% 0,16% BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA 18.068,737,79 0 0 0 18.091.57,95 17.40 IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA 18.068,737,79 0 0 0 18.091.57,95 17.40 IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA 18.068,737,79 0 0 0 18.091.57,95 17.40 IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA 18.068,737,79 0 0 0 18.091.57,95 17.40 IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA 18.068,737,79 0 0 0 18.091.57,75 17.40 IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA 18.068,737,79 0 0 0 18.091.57,95 17.40 IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA 18.068,737,79 0 0 0 18.091.57,95 17.40 IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA 18.068,737,79 0 0 0 18.091.57,95 17.40 IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA 18.068,737,79 0 0 0 0 18.091.57,95 17.40 IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA 18.068,737,79 0 0 0 18.091.57,95 17.40 IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA 18.068,737,79 0 0 0 18.091.57,95 17.40 IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA 18.068,737,79 0 0 0 18.091.57,95 17.40 IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA 18.068,737,79 0 0 0 18.091.57,95 17.40 IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA 18.068,737,79 0 0 0 18.091.57,95 17.40 IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA 18.068,737,79 0 0 0 18.091.57,95 17.40 IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA 18.068,737,79 0 0 0 18.091.57,95 17.40 IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA 18.068,737,79 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0	CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	5.318.077,94	6.358.759,10	6.548.195,33	5.184.543,95	55.902,24	0,48%	0,01%	0,74%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO 1.284.521,79 0 0 1.290.589,52 6.067,73 0.47% 0.23% 0.47% SANTANDER CORPORATE FIG RENDA FIXA REFERENCIADO DI 2.593.87,93 4.046.145,23 698.424,70 5.971.702,21 30.593,75 0.46% 0.02% 0.086% BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO 3.177.105,70 0 0 0 3.188.121,96 11.016,26 0.35% 11.43% 0.35% BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO 6.347.498,56 0 0 0 6.369.214,33 21.715,77 0,34% 1,41% 0,34% CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA 3.412.274,95 0 0 0 3.422.406,76 10.131,81 0,30% 2,74% 0,30% BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA 1.406.747,48 0 0 0 1.410.897,82 4.150,34 0,30% 2,74% 0,30% BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA 3.029.910,27 0 0 3.034.923,74 5.013,47 0,17% 1,70% 0,17% CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA 6.369.376,51 0 0 0 1.637.939,90 1.003,39 0,16% 18.28% 0,16% BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA 18.068,737,79 0 0 0 18.091.57,95 17.40 IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA 18.068,737,79 0 0 0 18.091.57,95 17.40 IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA 18.068,737,79 0 0 0 18.091.57,95 17.40 IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA 18.068,737,79 0 0 0 18.091.57,95 17.40 IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA 18.068,737,79 0 0 0 18.091.57,75 17.40 IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA 18.068,737,79 0 0 0 18.091.57,95 17.40 IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA 18.068,737,79 0 0 0 18.091.57,95 17.40 IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA 18.068,737,79 0 0 0 18.091.57,95 17.40 IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA 18.068,737,79 0 0 0 0 18.091.57,95 17.40 IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA 18.068,737,79 0 0 0 18.091.57,95 17.40 IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA 18.068,737,79 0 0 0 18.091.57,95 17.40 IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA 18.068,737,79 0 0 0 18.091.57,95 17.40 IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA 18.068,737,79 0 0 0 18.091.57,95 17.40 IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA 18.068,737,79 0 0 0 18.091.57,95 17.40 IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA 18.068,737,79 0 0 0 18.091.57,95 17.40 IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA 18.068,737,79 0 0 0 18.091.57,95 17.40 IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA 18.068,737,79 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0 0	CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.941.882,00	0	0	1.951.144,50	9.262,50	0,48%	0,23%	0,48%
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI 2.593.387,93 4.046.145,23 698.424,70 5.971.702,21 30.593,75 0,46% 0,02% 0,86% BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO 3.177.105,70 0 0 3.188.121,96 11.016,26 0,35% 1,43% 0,35% 0,	BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.284.521,79	0	0	1.290.589,52	6.067,73	0,47%	0,23%	0,47%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO 3.177.105,70 0 0 3.188.121,96 11.016,26 0,35% 1,43% 0,35% BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO 6.347.488,56 0 0 6.369.214,33 21.715,77 0,34% 1,41% 0,34% CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA 3.412.274,95 0 0 3.422.406,76 10.131,81 0,30% 2,74% 0,30% BB TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA 1.406.747,48 0 0 0 1.410.897,82 4.150,34 0,30% 2,74% 0,30% BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO 3.029.910,27 0 0 3.034.923,74 5.013,47 0,17% 1,70% 0,17% CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA 6.369.376,51 0 0 6.379.379,90 10.003,39 0,16% 1,82% 0,16% BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO 11.254.896,05 0 0 11.271.420,13 16.524,08 0,15% 2,49% 0,15% ITAU IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO 11.254.896,05 0 0 11.271.420,13 16.524,08 0,15% 2,45% 0,15% ITAU IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA 18.068.737,79 0 0 0 18.091.517,95 22.780,16 0,13% 2,47% 0,13% GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA 2.392.156,92 0 0 2.394.873,65 2.716,73 0,11% 2,54% 0,11% ITAU IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA 5.098.372,13 0 0 0 5.094.012,77 4.359,36 -0,09% 3,28% -0,09% BB IMA-B 5+ TÎTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA 3.933.082,43 0 0 3.929.669,20 -3.413,23 -0,09% 3,29% -0,09% BB IDKA 20 TÎTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA 12.000.219,18 0 0 11.989.780,61 -10.438,57 -0,09% 3,29% -0,09% BB IDKA 20 TÎTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO 5.985.953,27 0 0 5.962.707,71 -23.245,56 -0,09% 5,16% -0,09% BB IDKA 20 TÎTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO 5.985.953,27 0 0 5.962.707,71 -23.245,56 -0,09% 5,16% -0,09% BB IDKA 20 TÎTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO 5.985.953,27 0 0 5.962.707,71 -23.245,56 -0,09% 5,16% -0,09% BB IDKA 20 TÎTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO 5.985.953,27 0 0 5.962.707,71 -23.245,56 -0,09% 5,16% -0,09% BB IDKA 20 TÎTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO 5.985.953,27 0 0 5.962.707,71 -23.245,56 -0,09% 5,16% -0,09% 5,16% -0,09% 5,16% -0,09% 5,16% -0,09% 5,16% -0,09% 5,16% -0,09% 5,16% -0,09% 5,16% -0,09% 5,16% -0,0	SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI		4.046.145,23	698.424,70		30.593,75	0,46%		0,86%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO 6.347.498,56 0 0 6.369.214,33 21.715,77 0,34% 1,41% 0,34% CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA 3.412.274,95 0 0 3.422.406,76 10.131,81 0,30% 2,74% 0,30% CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA 1.406.747,48 0 0 0 1.410.897,82 4.150,34 0,30% 2,74% 0,30% DB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO 3.029.910,27 0 0 0 3.034.923,74 5.013,47 0,17% 1,70% 0,17% 0.21% 0.21% 0.22% IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO 3.029.910,27 0 0 0 3.304.923,74 5.013,47 0,17% 1,70% 0,17% 0.17% 0.21% 0.22% IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA 0.369.376,51 0 0 0 6.379.379,90 10.003,39 0,16% 1,82% 0,16% 0.22% 0	BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO		0	0	3.188.121,96		0,35%	1,43%	
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA 3.412.274,95 0 0 3.422.406,76 10.131,81 0,30% 2,74% 0,30% CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA 1.406.747,48 0 0 1.410.897,82 4.150,34 0,30% 2,74% 0,30% BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO 3.029.910,27 0 0 3.03.4923,74 5.013,47 0,17% 1,70% 0,17% 1,70% 0,17% CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA 6.369.376,51 0 0 6.379.379,90 10.003,39 10.003,39 0,16% 18.26 0,15% BB IMA-B FIC RENDA FIXA 16.611.832,70 0 0 16.637.029,41 25.196,71 0,15% 2,49% 0,15% BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA 18.068.737,79 0 0 18.091.517,95 22.780,16 0,13% 2,47% 0,13% GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA 18.068.737,79 0 0 18.091.517,95 22.780,16 0,13% 2,47% 0,13% GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA 18.068.737,79 0 0 18.091.517,95 22.780,16 0,11% 17.00% 17.00% 17.00% 18.091.517,95 22.780,16 17.00% 17.00% 17.00% 17.00% 17.00% 17.00% 17.00% 17.00% 17.00% 18.091.517,95 18.00% 18.091.517,95 20.780,16 18.091.517,95 20.780,16 20.780,17 20.800,17 20.800,10 20.	BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO		0	0				1,41%	
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA 1.406.747,48 0 0 1.410.897,82 4.150,34 0,30% 2,74% 0,30% BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO 3.029.910,27 0 0 3.034.923,74 5.013,47 0,17% 1,70% 0,17% CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA 6.369.376,51 0 0 6.379.379,90 10.003,39 0,16% 1,82% 0,16% BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA 16.611.832,70 0 0 16.637.029,41 25.196,71 0,15% 2,49% 0,15% BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO 11.254.896,05 0 0 11.271.420,13 16.524,08 0,15% 2,45% 0,15% ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA 18.068.737,79 0 0 18.091.517,95 22.780,16 0,13% 2,47% 0,13% GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA 2.392.156,92 0 0 2.394.873,65 2.716,73 0,11% 2,54% 0,11% ITAÚ IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA 5.098.372,13 0 0 5.094.012,77 -4.359,36 -0,09% 3,28% -0,09% BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA 3.933.082,43 0 0 15.477.948,28 -13.343,51 -0,09% 3,29% -0,09% BTG PACTUAL TESOURO IPCA LONGO FI RENDA FIXA 12.000.219,18 0 0 11.989.780,61 -10.438,57 -0,09% 3,29% -0,09% BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO 5.985.953,27 0 0 5.996.707,71 -23.245,56 -0,39% 5,16% -0,39%	CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.412.274.95	0	0	3.422.406.76	10.131.81	0.30%	2.74%	
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO 3.029.910,27 0 0 3.034.923,74 5.013,47 0,17% 1,70% 0,17% CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA 6.369.376,51 0 0 6.379.379,90 10.003,39 0,16% 1,82% 0,16% BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA 16.611.832,70 0 0 16.637.029,41 25.196,71 0,15% 2,49% 0,15% BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO 11.254.896,05 0 0 11.271.420,13 16.524,08 0,15% 17.40 IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA 18.068.737,79 0 0 18.091.517,95 22.780,16 0,13% 2,47% 0,13% GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA 2.392.156,92 0 0 0 2.394.873,65 2.716,73 0,11% 2,54% 0,11% 1TAÚ IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA 5.098.372,13 0 0 0 5.094.012,77 4.359,36 -0,09% BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO 15.491.291,79 0 0 15.497.948,28 1-13.343,51 -0,09% BTG PACTUAL TESOURO IPCA LONGO FI RENDA FIXA 12.000.219,18 0 0 11.989.780,61 -10.438,57 -0,09% 3,29% -0,09% BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO 5.985.953,27 0 0 5.962.707,71 -23.245,56 -0,39% 5,16% -0,39%			0	0					
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA 6.369.376,51 0 0 6.379.379,90 10.003,39 0,16% 1,82% 0,16% BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA 16.611.832,70 0 0 16.637.029,41 25.196,71 0,15% 2,49% 0,15% BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO 11.254.896,05 0 0 11.271.420,13 16.524,08 0,15% 2,45% 0,15% ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA 18.068.737,79 0 0 18.091.517,95 22.780,16 0,13% 2,47% 0,13% GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA 2.392.156,92 0 0 2.394.873,65 2.716,73 0,11% 2,54% 0,11% ITAÚ IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA 5.098.372,13 0 0 5.094.012,77 -4.359,36 -0,09% 3,28% -0,09% BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA 3.933.082,43 0 0 15.477.948,28 -13.343,51 -0,09% 3,28% -0,09% BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA 12.000.219,18 0 0 11.989.780,61 -10.438,57 -0,09% 5,16% -0,39% BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO 5.985.953,27 0 5.962.707,71 -23.245,56 -0,39% 5,16% -0,39%	BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.029.910.27	0	0	3.034.923.74	5.013.47	0.17%		
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA 16.611.832,70 0 0 16.637.029,41 25.196,71 0,15% 2,49% 0,15% BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO 11.254.896,05 0 0 11.271.420,13 16.524,08 0,15% 2,45% 0,15% ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA 18.068.737,79 0 0 18.091.517,95 22.780,16 0,13% 2,47% 0,13% GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA 2.392.156,92 0 0 2.394.873,65 2.716,73 0,11% 2,54% 0,11% ITAÚ IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA 5.098.372,13 0 0 5.094.012,77 -4.359,36 -0,09% 3,28% -0,09% BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO 15.491.291,79 0 0 15.477.948,28 -13.343,51 -0,09% 3,28% -0,09% BTG PACTUAL TESOURO IPCA LONGO FI RENDA FIXA 3.933.082,43 0 0 3.929.669,20 -3.413,23 -0,09% 3,28% -0,09% BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA 12.000.219,18 0 <td>CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA</td> <td></td> <td>0</td> <td>0</td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td> <td></td>	CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA		0	0					
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO 11.254.896,05 0 0 11.271.420,13 16.524,08 0,15% 2,45% 0,15% ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA 18.068.737,79 0 0 18.091.517,95 22.780,16 0,13% 2,47% 0,13% GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA 2.392.156,92 0 0 2.394.873,65 2.716,73 0,11% 2,54% 0,11% ITAÚ IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA 5.098.372,13 0 0 5.094.012,77 -4.359,36 -0,09% 3,28% -0,09% BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA 7.099 15.491.291,79 0 0 15.477.948,28 -13.343,51 -0,09% 3,29% -0,09% BTG PACTUAL TESOURO IPCA LONGO FI RENDA FIXA 3.933.082,43 0 0 3.929.669,20 -3.413,23 -0,09% 3,28% -0,09% BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA 12.000.219,18 0 0 11.989.780,61 -10.438,57 -0,09% 3,29% -0,09% BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO 5.985.953,27 0 0 5.962.707,71 -23.245,56 -0,39% 5,16% -0,39%	BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA		0	0					
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA 18.068.737,79 0 0 18.091.517,95 22.780,16 0,13% 2,47% 0,13% GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA 2.392.156,92 0 0 2.394.873,65 2.716,73 0,11% 2,54% 0,11% ITAÚ IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA 5.098.372,13 0 0 5.094.012,77 -4.359,36 -0,09% 3,28% -0,09% BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO 15.491.291,79 0 0 15.477.948,28 -13.343,51 -0,09% 3,29% -0,09% BTG PACTUAL TESOURO IPCA LONGO FI RENDA FIXA 3.933.082,43 0 0 3.929.669,20 -3.413,23 -0,09% 3,28% -0,09% BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA 12.000.219,18 0 0 11.989.780,61 -10.438,57 -0,09% 3,29% -0,09% BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO 5.985.953,27 0 0 5.962.707,71 -23.245,56 -0,39% 5,16% -0,39%	BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO		0	0			,		
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA 2.392.156,92 0 0 2.394.873,65 2.716,73 0,11% 2,54% 0,11% ITAÚ IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA 5.098.372,13 0 0 5.094.012,77 -4.359,36 -0,09% 3,28% -0,09% BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO 15.491.291,79 0 0 15.477.948,28 -13.343,51 -0,09% 3,29% -0,09% BTG PACTUAL TESOURO IPCA LONGO FI RENDA FIXA 3.933.082,43 0 0 3.929.669,20 -3.413,23 -0,09% 3,28% -0,09% BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA 12.000.219,18 0 0 11.989.780,61 -10.438,57 -0,09% 3,29% -0,09% BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO 5.985.953,27 0 0 5.962.707,71 -23.245,56 -0,39% 5,16% -0,39%	ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA		0	0			,		
ITAÚ IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA 5.098.372,13 0 0 5.094.012,77 -4.359,36 -0,09% 3,28% -0,09% BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO 15.491.291,79 0 0 15.477.948,28 -13.343,51 -0,09% 3,29% -0,09% BTG PACTUAL TESOURO IPCA LONGO FI RENDA FIXA 3.933.082,43 0 0 3.929.669,20 -3.413,23 -0,09% 3,28% -0,09% BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA 12.000.219,18 0 0 11.989.780,61 -10.438,57 -0,09% 3,29% -0,09% BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO 5.985.953,27 0 0 5.962.707,71 -23.245,56 -0,39% 5,16% -0,39%				_					
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO 15.491.291,79 0 0 15.477.948,28 -13.343,51 -0,09% 3,29% -0,09% BTG PACTUAL TESOURO IPCA LONGO FI RENDA FIXA 3.933.082,43 0 0 3.929.669,20 -3.413,23 -0,09% 3,28% -0,09% BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA 12.000.219,18 0 0 11.989.780,61 -10.438,57 -0,09% 3,29% -0,09% BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO 5.985.953,27 0 0 5.962.707,71 -23.245,56 -0,39% 5,16% -0,39%				_			,		
BTG PACTUAL TESOURO IPCA LONGO FI RENDA FIXA 3.933.082,43 0 0 3.929.669,20 -3.413,23 -0,09% 3,28% -0,09% BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA 12.000.219,18 0 0 11.989.780,61 -10.438,57 -0,09% 3,29% -0,09% BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO 5.985.953,27 0 0 5.962.707,71 -23.245,56 -0,39% 5,16% -0,39%			_	·	,		,		
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA 12.000.219,18 0 0 11.989.780,61 -10.438,57 -0,09% 3,29% -0,09% BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO 5.985.953,27 0 0 5.962.707,71 -23.245,56 -0,39% 5,16% -0,39%			_			,	•		
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO 5.985.953,27 0 0 5.962.707,71 -23.245,56 -0,39% 5,16% -0,39%									
				-					
	Total Renda Fixa	5.000.000,21			0.002.707,71	1.120.466,12	0,41%	1,59%	0,0070



						RETORNO	VAR - MÊS	
ATIVOS DE RENDA VARIÁVEL	SADO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO (R\$)	(%)	(%)	INST.(%)
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.515.000,00	0	12.000,00	1.605.000,00	102.000,00	6,73%	9,78%	5,94%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	10.687.664,90	660.000,00	0	11.588.481,12	240.816,22	2,12%	5,28%	2,08%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	1.667.971,70	0	0	1.696.284,65	28.312,95	1,70%	5,24%	1,70%
WESTERN ASSET VALUATION FI AÇÕES	1.861.431,54	0	0	1.892.789,00	31.357,46	1,68%	4,62%	1,68%
BB PIPE FIC AÇÕES	1.441.341,77	0	0	1.465.484,36	24.142,59	1,68%	5,67%	1,68%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	7.562.656,46	0	0	7.671.638,33	108.981,87	1,44%	6,03%	1,44%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	1.904.002,89	660.000,00	0	2.597.109,00	33.106,11	1,29%	4,40%	0,73%
CAIXA CAPITAL PROT.IBOVESPA CÍCLICO I FIC MULTIMERCADO	1.006.514,85	0	0	1.014.618,57	8.103,72	0,81%	1,00%	0,81%
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	8.371.183,68	0	0	8.385.716,64	14.532,96	0,17%	6,13%	0,17%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	262.798,22	660.000,00	0	923.492,71	694,49	0,08%	2,95%	1,12%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	1.032.185,89	0	0	1.025.818,69	-6.367,20	-0,62%	-	-
Total Renda	585.681,17	1,49%	5,55%					

• Comparação com a Meta Atuarial – Junho de 2017

MÊS	SALDO ANTERIOR	APLICAÇÕES	RESGATES	SALDO ATUAL	RETORNO (\$)	RETORNO (%)	META (%)	GAP (%)
Janeiro	261.108.868,73	21.089.482,35	10.275.126,48	276.910.825,38	4.987.600,78	1,83%	0,93%	197,23%
Fevereiro	276.910.825,38	13.599.502,76	8.670.949,49	288.966.546,61	7.127.167,96	2,53%	0,66%	383,15%
Março	288.966.546,61	13.233.603,61	8.406.201,94	296.818.508,24	3.024.559,96	1,03%	0,90%	115,01%
Abril	296.818.508,24	11.352.821,18	6.449.644,87	302.193.691,37	472.006,82	0,16%	0,50%	31,45%
Maio	302.193.691,37	12.701.226,88	7.200.816,15	304.904.527,97	-2.789.574,13	-0,91%	0,87%	-103,99%
Junho	304.904.527,97	13.784.904,33	8.658.620,03	311.736.959,56	1.706.147,29	0,55%	0,19%	296,99%
Acumulado no an	10				14.527.908,68	5,27%	4,11%	128,29%



• Enquadramento – Junho de 2017

				ESTRATÉGIA D			
ARTIGOS - RENDA FIXA	RESOLUÇÃO %	CARTEIRA \$	CARTEIRA %				GAP SUPEIOR
				INFERIOR %	ALVO %	SUPERIOR %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	169.160.139,35	54,26%	30,00%	35,00%	70,00%	49.055.732,34
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	56.020.547,16	17,97%	15,00%	20,00%	60,00%	131.021.628,58
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	41.145.011,95	13,20%	5,00%	5,00%	30,00%	52.376.075,92
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	46.760.543,93
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	15.586.847,98
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5.544.828,03	1,78%	0,00%	2,50%	5,00%	10.042.019,95
Total Renda Fixa	100,00%	271.870.526,49	87,21%	55,00%	75,00%	185,00%	

				ESTRATÉGIA DI			
ARTIGOS - RENDA VARIÁVEL	RESOLUÇÃO %	CARTEIRA \$	CARTEIRA %				GAP SUPEIOR
				INFERIOR %	ALVO %	SUPERIOR %	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	8.385.716,64	2,69%	0,00%	0,00%	4,00%	4.083.761,74
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	26.911.786,46	8,63%	5,00%	10,00%	15,00%	19.848.757,47
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	1.938.111,28	0,62%	2,00%	5,00%	5,00%	13.648.736,70
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	1.025.818,69	0,33%	2,00%	5,00%	5,00%	14.561.029,29
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	1.605.000,00	0,51%	2,00%	5,00%	5,00%	13.981.847,98
Total Renda Variável	30,00%	39.866.433,07	12,79%	11,00%	25,00%	34,00%	
Total	•	311.736.959,56					