

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 IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	15.477.948,28	4,97%	307	0,85%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	839.498,90	0,27%	204	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	14.962.958,08	4,80%	167	1,33%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
DAYCOVAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+3	Não há	1.872.478,98	0,60%	86	3,74%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	20.345.855,18	6,53%	360	1,55%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	2.251.639,19	0,72%	107	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.200.780,03	1,99%	599	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	6.369.214,33	2,04%	94	1,32%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	20.674.280,99	6,63%	703	0,35%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2020	1.982.403,53	0,64%	122	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	2.394.873,65	0,77%	1.898	2,46%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	6.379.379,90	2,05%	72	0,67%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	5.962.707,71	1,91%	30	13,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	D+2	Não há	5.094.012,77	1,63%	138	1,59%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	11.271.420,13	3,62%	604	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	5.575.096,68	1,79%	11	6,44%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.082.368,20	1,31%	281	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2030	1.410.897,82	0,45%	18	2,73%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	3.188.121,96	1,02%	46	1,87%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	12.388.382,26	3,97%	223	0,39%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	2.471.986,18	0,79%	193	0,70%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	18/08/2018	10.611.758,64	3,40%	100	0,90%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "

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 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2030	3.422.406,76	1,10%	27	1,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BTG PACTUAL TESOURO IPCA LONGO FI RENDA FIXA	D+2	Não há	3.929.669,20	1,26%	579	4,48%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	9.302.219,19	2,98%	55	1,37%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	18.091.517,95	5,80%	68	19,82%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	11.989.780,61	3,85%	59	2,23%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	16.637.029,41	5,34%	98	1,06%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2018	1.951.144,50	0,63%	163	0,15%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	5.971.702,21	1,92%	1.334	0,10%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.184.543,95	1,66%	204	1,52%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	1.290.589,52	0,41%	116	0,26%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.719.402,20	0,55%	757	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	16/05/2023	3.034.923,74	0,97%	52	1,12%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.875.780,15	0,92%	615	0,22%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	16.206.154,72	5,20%	62	1,13%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	D+5	Não há	2.910.770,96	0,93%	50	0,78%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	2.403.457,20	0,77%	100	1,10%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+30 a D+2880	Não há	3.141.370,83	1,01%	62	0,81%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	8.385.716,64	2,69%	20.787	2,04%	Artigo 8º, Inciso I
WESTERN ASSET VALUATION FI AÇÕES	D+4	Não há	1.892.789,00	0,61%	11	2,13%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	D+12	Não há	7.671.638,33	2,46%	353	12,38%	Artigo 8º, Inciso III
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	D+33	Não há	1.696.284,65	0,54%	216	2,48%	Artigo 8º, Inciso III
BB PIPE FIC AÇÕES	D+4	03/06/2018	1.465.484,36	0,47%	43	1,47%	Artigo 8º, Inciso III

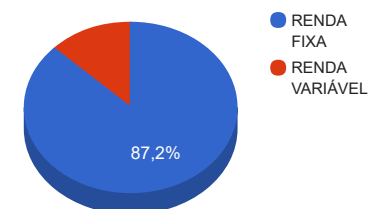
Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	2.597.109,00	0,83%	208	0,52%	Artigo 8º, Inciso III
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou D+33	Não há	11.588.481,12	3,72%	413	3,55%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	923.492,71	0,30%	2.094	0,33%	Artigo 8º, Inciso IV
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IBOVESPA CÍCLICO I FIC MULTIMERCADO	D+2	Não há	1.014.618,57	0,33%	1.364	1,19%	Artigo 8º, Inciso IV
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	1.025.818,69	0,33%			Artigo 8º, Inciso V
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se aplica	Não se aplica	1.605.000,00	0,51%		0,95%	Artigo 8º, Inciso VI
		TOTAL -	311.736.959,56				

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

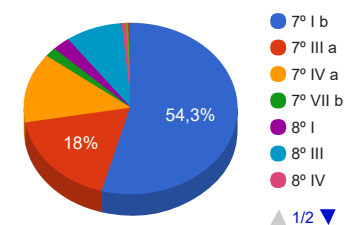
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	169.160.139,35	54,26%	30,00%	35,00%	70,00%	49.055.732,34
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	56.020.547,16	17,97%	15,00%	20,00%	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%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	46.760.543,93
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	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	-

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				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	-

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 "	169.160.139,35	54,26%	30,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	56.020.547,16	17,97%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	41.145.011,95	13,20%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	0,00	0,00%	5,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5.544.828,03	1,78%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	271.870.526,49	87,21%	55,00	185,00

Artigos - Renda Variável	Base: junho / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I	8.385.716,64	2,69%	0,00%	4,00%
Artigo 8º, Inciso III	26.911.786,46	8,63%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	1.938.111,28	0,62%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	1.025.818,69	0,33%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	1.605.000,00	0,51%	2,00%	5,00%
Total Renda Variável	39.866.433,07	12,79%	11,00	34,00

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%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,34%	8,13%	2,13%	8,13%	16,65%	35,30%	0,20%	1,392%	4,89%
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%
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	0,80%	6,70%	0,95%	6,70%	14,86%	32,64%	0,25%	1,338%	5,32%
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%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,74%	5,23%	2,34%	5,23%	11,94%	26,64%	0,80%	0,006%	0,07%
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%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,69%	3,22%	-0,85%	3,22%	6,34%	-	0,20%	0,817%	5,14%
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 TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,57%	5,48%	2,08%	5,48%	11,27%	29,37%	0,20%	0,506%	1,88%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,56%	5,49%	2,08%	5,49%	-	-	0,20%	0,511%	-
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%

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
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	0,51%	5,37%	1,26%	5,37%	11,70%	30,41%	0,10%	0,930%	3,57%
DAYCOVAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,49%	5,38%	1,23%	5,38%	11,44%	-	0,50%	0,927%	3,67%
IDKA IPCA 5 Anos	0,30%	5,97%	0,07%	5,97%	13,32%	33,79%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,35%	5,71%	0,32%	5,71%	13,02%	-	0,20%	1,431%	6,30%
IPCA + 6,00% ao ano	0,26%	4,13%	1,64%	4,13%	9,15%	25,94%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,57%	5,86%	1,71%	5,86%	12,24%	30,90%	0,15%	0,675%	3,04%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,48%	1,56%	1,95%	1,56%	3,58%	13,28%	0,20%	0,228%	3,93%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,47%	4,48%	1,94%	4,48%	9,59%	26,82%	0,20%	0,228%	0,27%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,17%	5,73%	-0,09%	5,73%	13,27%	32,29%	0,15%	1,702%	6,96%
IMA-B	0,16%	5,46%	-1,34%	5,46%	13,32%	32,28%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,57%	3,21%	1,30%	3,21%	6,67%	-	0,20%	1,000%	6,24%
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%
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 TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,34%	6,00%	0,41%	6,00%	13,17%	-	0,20%	1,412%	6,18%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,30%	2,34%	-2,26%	2,34%	6,69%	17,27%	0,20%	2,743%	12,36%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,30%	2,50%	-2,26%	2,50%	7,08%	18,52%	0,20%	2,743%	12,29%

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
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%
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%
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%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	0,13%	5,16%	-1,59%	5,16%	12,87%	31,33%	0,50%	2,471%	10,02%
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%

IDKA IPCA 20 Anos	-0,54%	5,16%	-6,78%	5,16%	16,99%	37,26%	-	-	-
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,39%	4,94%	-5,18%	4,94%	15,52%	35,34%	0,20%	5,156%	18,73%

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%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	0,97%	6,15%	0,05%	6,15%	-	-	0,40%	0,824%	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,95%	7,05%	1,52%	7,05%	15,08%	34,39%	0,20%	1,166%	4,69%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,62%	5,21%	2,01%	5,21%	10,79%	29,94%	0,20%	0,382%	1,70%

IMA-B 5+	-0,06%	5,50%	-2,63%	5,50%	14,42%	34,03%	-	-	-
ITAÚ IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	-0,09%	5,18%	-2,78%	5,18%	13,82%	32,56%	0,40%	3,277%	12,89%
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%
BGT PACTUAL TESOURO IPCA LONGO FI RENDA FIXA	-0,09%	5,36%	-2,69%	5,36%	13,86%	-	0,20%	3,279%	12,92%

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
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	-0,09%	5,38%	-2,76%	5,38%	14,19%	32,74%	0,20%	3,294%	13,06%

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
IFIX	0,88%	11,27%	2,07%	11,27%	26,62%	42,05%	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	5,94%	4,90%	1,90%	4,90%	15,05%	35,44%	1,20%	9,780%	21,16%

S&P 500	0,48%	8,24%	2,57%	8,24%	15,46%	17,46%	-	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	1,12%	13,27%	5,01%	13,27%	29,19%	48,32%	1,00%	2,950%	7,80%

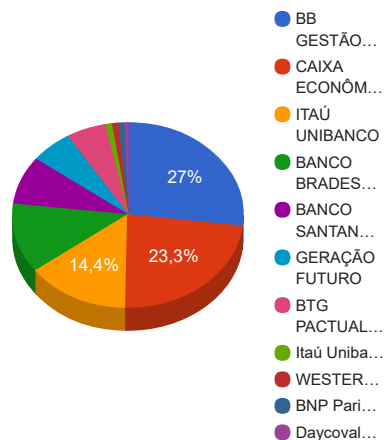
IPCA + 8,00% ao ano	0,41%	5,09%	2,10%	5,09%	11,20%	30,72%	-	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	-	-	-	-	-	-	2,00%	-	-

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%
WESTERN ASSET VALUATION FI AÇÕES	1,68%	7,61%	0,39%	7,61%	28,42%	30,66%	2,50%	4,621%	20,55%
BB PIPE FIC AÇÕES	1,68%	10,11%	2,76%	10,11%	11,33%	20,15%	1,20%	5,670%	16,28%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	1,44%	-1,23%	-5,11%	-1,23%	17,86%	7,41%	2,00%	6,027%	21,64%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IBOVESPA CÍCLICO I FIC MULTIMERCADO	0,81%	1,35%	1,55%	1,35%	16,66%	31,42%	1,60%	0,998%	6,37%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	0,73%	7,98%	1,60%	7,98%	24,34%	37,21%	2,00%	4,403%	9,37%
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	0,17%	-2,61%	-6,96%	-2,61%	16,55%	1,30%	4,00%	6,128%	22,85%

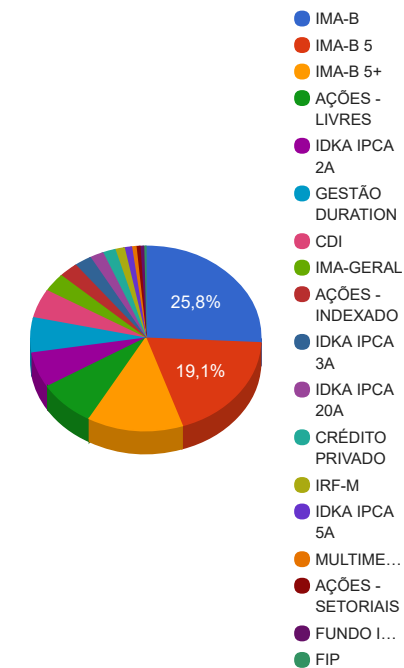
IDIV	-1,22%	7,20%	-5,99%	7,20%	36,68%	31,17%	-	-	-
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	1,70%	7,33%	0,43%	7,33%	5,87%	12,36%	2,50%	5,235%	15,38%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	84.106.667,44	26,98%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	72.553.619,16	23,27%
ITAÚ UNIBANCO	44.966.782,12	14,42%
BANCO BRADESCO	37.929.029,21	12,17%
BANCO SANTANDER	26.317.557,39	8,44%
GERAÇÃO FUTURO	18.452.228,62	5,92%
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS	17.214.434,97	5,52%
Itaú Unibanco S.A.	2.910.770,96	0,93%
WESTERN ASSET	2.816.281,71	0,90%
BNP Paribas	2.597.109,00	0,83%
Daycoval Asset Management	1.872.478,98	0,60%



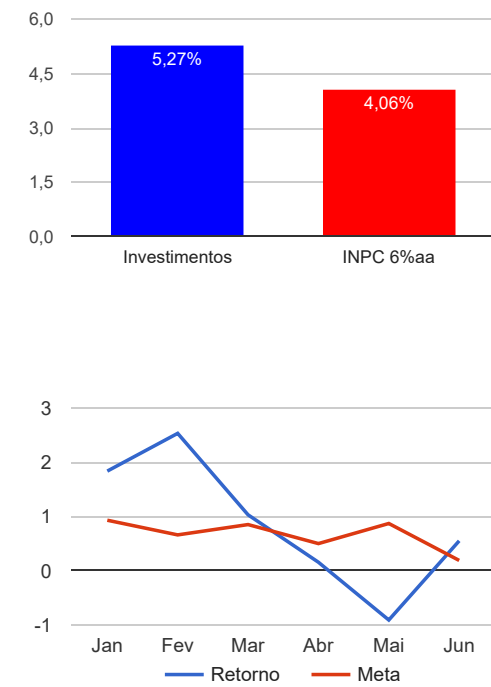
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	80.431.906,71	25,80%
IMA-B 5	59.483.781,10	19,08%
IMA-B 5+	41.324.715,44	13,26%
AÇÕES - LIVRES	25.215.501,81	8,09%
IDKA IPCA 2A	19.284.524,85	6,19%
GESTÃO DURATION	19.116.925,68	6,13%
CDI	15.751.428,51	5,05%
IMA-GERAL	10.141.718,09	3,25%
AÇÕES - INDEXADO	8.385.716,64	2,69%
IDKA IPCA 3A	7.557.500,21	2,42%
IDKA IPCA 20A	5.962.707,71	1,91%
CRÉDITO PRIVADO	5.544.828,03	1,78%
IRF-M	4.082.368,20	1,31%
IDKA IPCA 5A	3.188.121,96	1,02%
MULTIMERCADO	1.938.111,28	0,62%
AÇÕES - SETORIAIS	1.696.284,65	0,54%
FUNDO IMOBILIÁRIO	1.605.000,00	0,51%
FIP	1.025.818,69	0,33%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
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%	2,94%
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%	2,44%
Março	288.966.546,61	13.233.603,61	8.406.201,94	296.818.508,24	3.024.559,96	1,03%	0,85%	120,42%	2,23%
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%	1,88%
Mai	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%	9,60%
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%	2,08%
Acumulado no ano					14.527.908,68	5,27%	4,06%	129,60%	

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 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.028.340,08	0,00	0,00	4.082.368,20	54.028,12	1,34%	1,39%	1,34%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1.707.230,90	1.400.000,00	0,00	3.141.370,83	34.139,93	1,10%	1,17%	0,95%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	16.050.246,87	0,00	0,00	16.206.154,72	155.907,85	0,97%	0,83%	0,97%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	2.882.896,14	0,00	0,00	2.910.770,96	27.874,82	0,97%	0,82%	0,97%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.705.343,19	0,00	0,00	1.719.402,20	14.059,01	0,82%	0,02%	0,82%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	832.665,15	0,00	0,00	839.498,90	6.833,75	0,82%	1,21%	0,82%
BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	9.228.047,71	0,00	0,00	9.302.219,19	74.171,48	0,80%	1,34%	0,80%
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.536.961,95	0,00	0,00	5.575.096,68	38.134,73	0,69%	0,82%	0,69%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.162.290,71	0,00	0,00	6.200.780,03	38.489,32	0,62%	0,73%	0,62%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	2.388.715,20	0,00	0,00	2.403.457,20	14.742,00	0,62%	0,38%	0,62%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.238.822,83	0,00	0,00	2.251.639,19	12.816,36	0,57%	1,00%	0,57%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.971.130,81	0,00	0,00	1.982.403,53	11.272,72	0,57%	0,67%	0,57%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.458.078,64	0,00	0,00	2.471.986,18	13.907,54	0,57%	0,51%	0,57%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.318.780,76	0,00	0,00	12.388.382,26	69.601,50	0,57%	0,51%	0,57%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.552.144,54	0,00	0,00	10.611.758,64	59.614,10	0,56%	0,51%	0,56%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.253.126,51	0,00	1.400.000,00	2.875.780,15	22.653,64	0,53%	0,01%	0,73%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.884.514,01	0,00	0,00	14.962.958,08	78.444,07	0,53%	0,78%	0,53%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	20.568.977,33	0,00	0,00	20.674.280,99	105.303,66	0,51%	0,93%	0,51%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	20.242.856,53	0,00	0,00	20.345.855,18	102.998,65	0,51%	0,93%	0,51%
DAYCOVAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.863.280,82	0,00	0,00	1.872.478,98	9.198,16	0,49%	0,93%	0,49%
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	0,00	0,00	1.951.144,50	9.262,50	0,48%	0,23%	0,48%

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 TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.284.521,79	0,00	0,00	1.290.589,52	6.067,73	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 XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.177.105,70	0,00	0,00	3.188.121,96	11.016,26	0,35%	1,43%	0,35%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.347.498,56	0,00	0,00	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	0,00	0,00	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	0,00	0,00	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	0,00	0,00	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	0,00	0,00	6.379.379,90	10.003,39	0,16%	1,82%	0,16%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	16.611.832,70	0,00	0,00	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	0,00	0,00	11.271.420,13	16.524,08	0,15%	2,45%	0,15%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	18.068.737,79	0,00	0,00	18.091.517,95	22.780,16	0,13%	2,47%	0,13%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	2.392.156,92	0,00	0,00	2.394.873,65	2.716,73	0,11%	2,54%	0,11%
ITAÚ IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	5.098.372,13	0,00	0,00	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	0,00	0,00	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	0,00	0,00	3.929.669,20	-3.413,23	-0,09%	3,28%	-0,09%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	12.000.219,18	0,00	0,00	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	0,00	0,00	5.962.707,71	-23.245,56	-0,39%	5,16%	-0,39%
Total Renda Fixa					1.120.466,12	0,41%	1,59%	

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 RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.515.000,00	0,00	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	0,00	11.588.481,12	240.816,22	2,12%	5,28%	2,08%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	1.667.971,70	0,00	0,00	1.696.284,65	28.312,95	1,70%	5,24%	1,70%
WESTERN ASSET VALUATION FI AÇÕES	1.861.431,54	0,00	0,00	1.892.789,00	31.357,46	1,68%	4,62%	1,68%
BB PIPE FIC AÇÕES	1.441.341,77	0,00	0,00	1.465.484,36	24.142,59	1,68%	5,67%	1,68%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	7.562.656,46	0,00	0,00	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	0,00	2.597.109,00	33.106,11	1,29%	4,40%	0,73%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IBOVESPA CÍCLICO I FIC MULTIMERCADO	1.006.514,85	0,00	0,00	1.014.618,57	8.103,72	0,81%	1,00%	0,81%
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	8.371.183,68	0,00	0,00	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	0,00	923.492,71	694,49	0,08%	2,95%	1,12%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	1.032.185,89	0,00	0,00	1.025.818,69	-6.367,20	-0,62%	-	-
Total Renda Variável					585.681,17	1,49%	5,55%	

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 IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	20.409.437,61	0,00	0,00	20.674.280,99	264.843,38	1,30%	1,30%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	20.092.405,51	0,00	0,00	20.345.855,18	253.449,67	1,26%	1,26%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.136.154,73	0,00	0,00	12.388.382,26	252.227,53	2,08%	2,08%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.395.812,20	0,00	0,00	10.611.758,64	215.946,44	2,08%	2,08%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.748.831,58	0,00	0,00	14.962.958,08	214.126,50	1,45%	1,45%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.104.705,30	0,00	1.400.000,00	2.875.780,15	171.074,85	4,17%	2,29%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	4.712.106,90	19.154.478,21	18.849.918,94	5.184.543,95	167.877,78	1,48%	2,34%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.060.722,67	1.023.464,14	0,00	6.200.780,03	116.593,22	2,05%	1,84%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	9.215.096,89	0,00	0,00	9.302.219,19	87.122,30	0,95%	0,95%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.790.840,28	1.205.866,04	0,00	4.082.368,20	85.661,88	2,17%	2,13%
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.199.925,70	5.647.153,40	1.940.019,08	5.971.702,21	64.642,19	1,56%	2,61%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.421.675,64	0,00	0,00	2.471.986,18	50.310,54	2,08%	2,08%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	2.355.994,80	0,00	0,00	2.403.457,20	47.462,40	2,01%	2,01%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1.697.651,98	1.400.000,00	0,00	3.141.370,83	43.718,85	1,67%	1,52%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.676.304,40	0,00	0,00	1.719.402,20	43.097,80	2,57%	2,57%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.913.823,00	0,00	0,00	1.951.144,50	37.321,50	1,95%	1,95%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.949.051,09	0,00	0,00	1.982.403,53	33.352,44	1,71%	1,71%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.222.705,54	0,00	0,00	2.251.639,19	28.933,65	1,30%	1,30%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.342.959,74	0,00	0,00	6.369.214,33	26.254,59	0,41%	0,41%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.266.072,75	0,00	0,00	1.290.589,52	24.516,77	1,94%	1,94%
DAYCOVAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.849.682,76	0,00	0,00	1.872.478,98	22.796,22	1,23%	1,23%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.177.925,44	0,00	0,00	3.188.121,96	10.196,52	0,32%	0,32%

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 IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	829.426,21	0,00	0,00	839.498,90	10.072,69	1,21%	1,21%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	16.197.261,96	0,00	0,00	16.206.154,72	8.892,76	0,05%	0,05%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.120.492,79	0,00	84.193,03	3.034.923,74	-1.376,02	-0,04%	-0,09%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	1.473.778,77	1.440.000,00	0,00	2.910.770,96	-3.007,81	-0,10%	0,05%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.388.705,43	0,00	0,00	6.379.379,90	-9.325,53	-0,15%	-0,15%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.443.576,93	0,00	0,00	1.410.897,82	-32.679,11	-2,26%	-2,26%
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.622.677,27	0,00	0,00	5.575.096,68	-47.580,59	-0,85%	-0,85%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	2.445.729,93	0,00	0,00	2.394.873,65	-50.856,28	-2,08%	-2,08%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.501.468,60	0,00	0,00	3.422.406,76	-79.061,84	-2,26%	-2,26%
BTG PACTUAL TESOURO IPCA LONGO FI RENDA FIXA	4.038.192,84	0,00	0,00	3.929.669,20	-108.523,64	-2,69%	-2,69%
ITAÚ IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	5.239.827,53	0,00	0,00	5.094.012,77	-145.814,76	-2,78%	-2,78%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.430.639,59	0,00	0,00	11.271.420,13	-159.219,46	-1,39%	-1,39%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	15.628.626,09	1.279.330,20	0,00	16.637.029,41	-270.926,88	-1,63%	-1,42%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	18.383.680,58	0,00	0,00	18.091.517,95	-292.162,63	-1,59%	-1,59%
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.288.193,59	0,00	0,00	5.962.707,71	-325.485,88	-5,18%	-5,18%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	10.135.884,73	2.229.330,20	0,00	11.989.780,61	-375.434,32	-3,12%	-2,76%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.930.104,46	0,00	0,00	15.477.948,28	-452.156,18	-2,84%	-2,84%
Total Renda Fixa					-73.118,46	-0,03%	

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 (%)
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	10.400.988,59	915.866,04	0,00	11.588.481,12	271.626,49	2,48%	2,34%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.575.000,00	0,00	34.950,00	1.605.000,00	64.950,00	4,22%	1,90%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	1.022.854,20	1.515.866,04	0,00	2.597.109,00	58.388,76	2,72%	1,60%
BB PIPE FIC AÇÕES	1.426.083,62	0,00	0,00	1.465.484,36	39.400,74	2,76%	2,76%
WESTERN ASSET VALUATION FI AÇÕES	1.005.815,10	855.866,04	0,00	1.892.789,00	31.107,86	1,84%	0,39%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IBOVESPA CÍCLICO I FIC MULTIMERCADO	999.118,27	0,00	0,00	1.014.618,57	15.500,30	1,55%	1,55%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	0,00	915.866,04	0,00	923.492,71	7.626,67	2,79%	5,01%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	1.689.097,89	0,00	0,00	1.696.284,65	7.186,76	0,43%	0,43%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	1.043.994,00	0,00	0,00	1.025.818,69	-18.175,31	-1,74%	-
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	7.804.779,17	255.866,04	0,00	7.671.638,33	-389.006,88	-4,86%	-5,11%
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	9.012.623,59	0,00	0,00	8.385.716,64	-626.906,95	-6,96%	-6,96%
Total Renda Variável					-538.301,56	-1,47%	

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 (%)
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	19.194.171,51	118.694,07	0,00	20.345.855,18	1.032.989,60	5,37%	5,37%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	17.146.770,34	2.500.000,00	0,00	20.674.280,99	1.027.510,65	5,23%	5,40%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	15.265.227,69	0,00	0,00	16.206.154,72	940.927,03	6,16%	6,16%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.552.980,43	0,00	420.345,08	14.962.958,08	830.322,73	5,79%	5,81%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	15.248.527,91	2.056.082,23	0,00	18.091.517,95	786.907,81	4,85%	5,16%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.728.780,64	0,00	0,00	15.477.948,28	749.167,64	5,09%	5,09%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	11.810.341,85	4.135.412,43	0,00	16.637.029,41	691.275,13	4,96%	5,56%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.077.866,05	0,00	339.853,29	12.388.382,26	650.369,50	5,48%	2,57%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	8.718.059,12	0,00	0,00	9.302.219,19	584.160,07	6,70%	6,70%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.353.888,85	0,00	298.681,27	10.611.758,64	556.551,06	5,47%	5,49%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.364.999,92	356.082,23	0,00	11.271.420,13	550.337,98	5,32%	5,35%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	3.728.152,74	42.928.684,96	41.857.794,76	5.184.543,95	385.501,01	3,25%	5,23%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.177.016,81	0,00	174.786,17	6.379.379,90	377.149,26	6,14%	3,28%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.174.800,07	0,00	171.586,09	6.369.214,33	366.000,35	5,98%	6,00%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	8.017.835,29	3.666.718,35	0,00	11.989.780,61	305.226,97	4,31%	5,38%
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.682.094,81	0,00	0,00	5.962.707,71	280.612,90	4,94%	4,94%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.218.977,41	2.008.746,84	2.626.821,96	2.875.780,15	274.877,86	6,77%	5,17%
CAIXA BRASIL IDKA IPKA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.587.303,24	2.342.158,21	0,00	6.200.780,03	271.318,58	5,59%	5,73%
BIG PACTUAL TESOURO IPKA LONGO FI RENDA FIXA	3.729.730,81	0,00	0,00	3.929.669,20	199.938,39	5,36%	5,36%
ITAÚ IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	2.671.900,04	2.237.388,15	0,00	5.094.012,77	184.724,58	4,06%	5,18%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.100.358,31	0,00	87.143,27	3.188.121,96	174.906,92	5,70%	5,71%
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.401.348,90	0,00	0,00	5.575.096,68	173.747,78	3,22%	3,22%

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 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.344.038,15	0,00	95.266,26	3.422.406,76	173.634,87	5,15%	2,34%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.948.696,88	0,00	84.193,03	3.034.923,74	170.419,89	5,78%	5,73%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	3.918.030,49	0,00	4.082.368,20	164.337,71	5,74%	8,13%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.181.633,82	0,00	63.226,10	2.251.639,19	133.231,47	6,19%	3,21%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1.609.905,41	1.400.000,00	0,00	3.141.370,83	131.465,42	7,21%	7,05%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.411.418,44	0,00	68.912,10	2.471.986,18	129.479,84	5,47%	5,48%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	2.284.381,80	0,00	0,00	2.403.457,20	119.075,40	5,21%	5,21%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.926.953,28	0,00	55.364,22	1.982.403,53	110.814,47	5,84%	5,86%
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	934.243,14	8.047.153,40	3.119.020,28	5.971.702,21	109.325,95	3,52%	5,76%
DAYCOVAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.776.864,69	0,00	0,00	1.872.478,98	95.614,29	5,38%	5,38%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.626.634,71	0,00	0,00	1.719.402,20	92.767,49	5,70%	5,70%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	1.952.906,26	356.082,23	0,00	2.394.873,65	85.885,16	4,60%	4,74%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.921.153,50	0,00	54.522,66	1.951.144,50	84.513,66	4,48%	1,56%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	1.389.132,16	1.440.000,00	0,00	2.910.770,96	81.638,80	5,98%	6,15%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.376.474,15	0,00	37.370,77	1.410.897,82	71.794,44	5,17%	2,50%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.270.799,15	0,00	35.975,08	1.290.589,52	55.765,45	4,47%	4,48%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	787.913,72	0,00	0,00	839.498,90	51.585,18	6,55%	6,55%
				Total Renda Fixa	13.255.873,29	5,41%	

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 (%)
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	9.606.360,84	915.866,04	0,00	11.588.481,12	1.066.254,24	10,95%	10,81%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.530.000,00	0,00	70.496,57	1.605.000,00	145.496,57	9,72%	4,90%
BB PIPE FIC AÇÕES	1.330.934,78	0,00	0,00	1.465.484,36	134.549,58	10,11%	10,11%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	1.203.147,08	395.488,66	0,00	1.696.284,65	97.648,91	7,54%	7,33%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	0,00	2.515.866,04	0,00	2.597.109,00	81.242,96	5,07%	7,98%
WESTERN ASSET VALUATION FI AÇÕES	0,00	1.855.866,04	0,00	1.892.789,00	36.922,96	2,43%	7,61%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IBOVESPA CÍCLICO I FIC MULTIMERCADO	0,00	1.000.000,00	0,00	1.014.618,57	14.618,57	1,46%	1,35%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	0,00	915.866,04	0,00	923.492,71	7.626,67	2,79%	13,27%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	1.023.299,89	0,00	0,00	1.025.818,69	2.518,80	0,25%	-
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	7.110.689,11	651.354,70	0,00	7.671.638,33	-90.405,48	-0,84%	-1,23%
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	8.610.155,03	0,00	0,00	8.385.716,64	-224.438,39	-2,61%	-2,61%
Total Renda Variável					1.272.035,39	4,36%	