

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



Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	13.601.653,02	16,23%	293	0,85%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	77.371,60	0,09%	604	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	13.922.486,45	16,61%	740	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	1.231.828,00	1,47%	26	0,87%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	397.523,07	0,47%	57	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.997.018,80	2,38%	706	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.773.495,57	2,12%	599	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	17/08/2020	2.004.420,00	2,39%	20	3,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	679.348,32	0,81%	1.360	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.104.636,53	2,51%	1.197	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.560.586,44	4,25%	79	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	2.932.182,78	3,50%	307	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	2.986.272,58	3,56%	77	1,07%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	57.359,56	0,07%	87	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
INFINITY IMA-B 5+ TIGER FI RENDA FIXA	D+1	Não há	679.476,47	0,81%	20	2,47%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	9.877.135,30	11,78%	326	0,40%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	2.539.825,91	3,03%	475	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	7.366.100,85	8,79%	757	0,13%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	58.046,88	0,07%	62	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.618.177,16	4,32%	774	0,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	930.634,79	1,11%	137	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	667.627,00	0,80%	100	0,31%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "

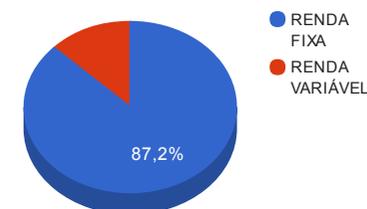
Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.043.791,05	1,25%	4.084	1,38%	Artigo 8º, Inciso III
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIAÇÕES	D+24	Não há	1.425.902,74	1,70%	24	0,74%	Artigo 8º, Inciso III
BRADESCO DIVIDENDOS FIAÇÕES	D+4	Não há	1.085.422,46	1,29%	474	0,22%	Artigo 8º, Inciso III
BB GOVERNANÇA FIAÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	809.458,18	0,97%	84	0,62%	Artigo 8º, Inciso III
ITAÚ DIVIDENDOS FIAÇÕES	D+4	Não há	190.466,20	0,23%	297	0,13%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	1.310.606,65	1,56%	2.816	0,26%	Artigo 8º, Inciso IV
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	1.325.372,90	1,58%	48	2,51%	Artigo 8º, Inciso IV
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	1.361.733,27	1,62%	53	0,60%	Artigo 8º, Inciso IV
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se aplica	Não se aplica	2.140.000,00	2,55%		1,27%	Artigo 8º, Inciso VI
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	Término do fundo	Não há	71.134,15	0,08%	750	0,63%	Desenquadrado - RF
		TOTAL -	83.827.094,68				

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

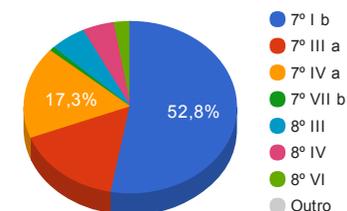
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	44.282.550,58	52,83%	30,00%	35,00%	70,00%	14.396.415,70
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	13.600.243,91	16,22%	15,00%	20,00%	60,00%	36.696.012,90
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	14.512.785,59	17,31%	5,00%	5,00%	30,00%	10.635.342,81
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	12.574.064,20
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	4.191.354,73
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	667.627,00	0,80%	0,00%	2,50%	5,00%	3.523.727,73
Desenquadrado - RF	0,00%	71.134,15	0,08%	0,00%	0,00%	0,00%	-71.134,15
Total Renda Fixa	100,00%	73.134.341,23	87,24%	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 III	15,00%	4.555.040,63	5,43%	5,00%	10,00%	15,00%	8.019.023,57
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	3.997.712,82	4,77%	2,00%	5,00%	5,00%	193.641,91
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	4.191.354,73
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	2.140.000,00	2,55%	2,00%	5,00%	5,00%	2.051.354,73
Total Renda Variável	30,00%	10.692.753,45	12,76%	11,00	25,00	30,00	-

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 "	44.282.550,58	52,83%	30,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	13.600.243,91	16,22%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	14.512.785,59	17,31%	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 "	667.627,00	0,80%	0,00%	5,00%
Desenquadrado - RF	71.134,15	0,08%	0,00%	0,00%
Total Renda Fixa	73.134.341,23	87,24%	55,00	185,00

Artigos - Renda Variável	Base: junho / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso III	4.555.040,63	5,43%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	3.997.712,82	4,77%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	2.140.000,00	2,55%	2,00%	5,00%
Total Renda Variável	10.692.753,45	12,76%	11,00	30,00

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%	-	-	-
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,90%	6,14%	2,65%	6,14%	13,25%	29,99%	0,20%	0,185%	0,67%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,90%	6,11%	2,65%	6,11%	13,15%	29,74%	0,20%	0,180%	0,65%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,87%	6,11%	2,63%	6,11%	13,17%	29,76%	0,10%	0,182%	0,66%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,87%	6,15%	2,65%	6,15%	13,27%	30,05%	0,20%	0,178%	0,66%
Selic	0,81%	5,65%	2,54%	5,65%	12,87%	28,79%	-	-	-
BRADESCO 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%	-	-	-
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	0,87%	6,90%	3,25%	6,90%	15,32%	33,02%	0,75%	2,484%	9,31%
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%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	0,80%	5,66%	2,54%	5,66%	12,91%	28,95%	0,18%	0,008%	0,08%
IDKA IPCA 2 Anos	0,79%	6,38%	2,18%	6,38%	12,88%	32,07%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,62%	5,73%	1,84%	5,73%	12,10%	30,86%	0,20%	0,733%	2,80%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,61%	5,71%	1,78%	5,71%	12,09%	30,65%	0,20%	0,756%	2,89%
IMA-B 5	0,52%	5,47%	1,32%	5,47%	11,91%	30,87%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	0,52%	5,28%	1,24%	5,28%	11,49%	29,82%	0,40%	0,912%	3,58%

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

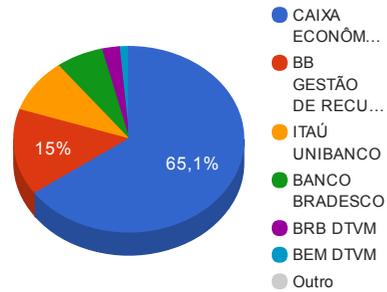
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	0,48%	5,52%	1,19%	5,52%	11,86%	30,02%	0,20%	1,009%	3,86%
IMA-B	0,16%	5,46%	-1,34%	5,46%	13,32%	32,28%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,57%	3,33%	1,29%	3,33%	7,07%	18,05%	0,20%	0,999%	6,05%
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,15%	3,32%	-0,15%	3,32%	7,29%	17,85%	0,20%	1,819%	8,65%
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%
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%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	0,12%	5,27%	-1,37%	5,27%	13,21%	30,77%	0,20%	2,279%	9,37%
IPCA	-0,23%	1,18%	0,22%	1,18%	3,00%	12,11%	-	-	-
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%	-	-	-
INFINITY IMA-B 5+ TIGER FI RENDA FIXA	0,65%	7,64%	1,78%	7,64%	25,49%	61,05%	0,50%	0,980%	7,70%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,07%	5,40%	-2,55%	5,40%	14,20%	32,72%	0,20%	3,268%	12,71%
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%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	-18,78%	-27,02%	-17,07%	-27,02%	30,93%	73,04%	2,00%	27,102%	68,37%

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

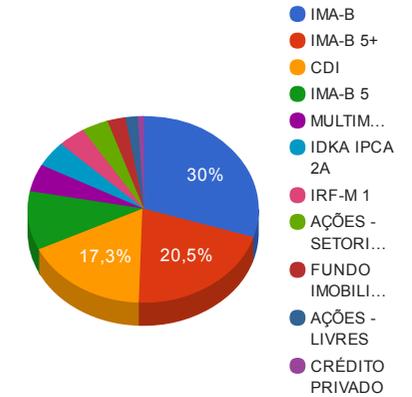
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFNC	1,98%	7,84%	-4,35%	7,84%	24,02%	27,95%	-	-	-
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	1,83%	6,86%	-4,85%	6,86%	22,17%	25,45%	1,00%	8,721%	25,85%
IFIX	0,88%	11,27%	2,07%	11,27%	26,62%	42,05%	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	5,94%	4,90%	1,90%	4,90%	15,05%	35,44%	1,20%	9,780%	21,16%
CDI	0,81%	5,65%	2,54%	5,65%	12,85%	28,75%	-	-	-
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	0,88%	6,81%	2,92%	6,81%	14,42%	36,31%	1,00%	1,310%	14,68%
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	0,83%	4,84%	1,58%	4,84%	12,01%	27,73%	0,35%	0,054%	0,85%
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	0,71%	5,43%	2,05%	5,43%	12,50%	31,38%	0,70%	0,077%	0,63%
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%
Ibovespa	0,30%	4,44%	-3,21%	4,44%	22,07%	18,50%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FI AÇÕES	0,31%	10,16%	-2,79%	10,16%	-	-	2,50%	4,997%	19,97%
IDIV	-1,22%	7,20%	-5,99%	7,20%	36,68%	31,17%	-	-	-
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	0,74%	11,21%	-3,85%	11,21%	26,42%	24,76%	1,50%	5,777%	21,17%
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	-1,26%	0,72%	-9,96%	0,72%	29,66%	22,24%	1,50%	7,927%	26,12%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	54.574.701,16	65,10%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	12.582.636,10	15,01%
ITAÚ UNIBANCO	7.866.846,51	9,38%
BANCO BRADESCO	5.583.458,05	6,66%
BRB DTVM	2.062.896,25	2,46%
BEM DTVM	1.085.422,46	1,29%
ICLA Trust	71.134,15	0,08%



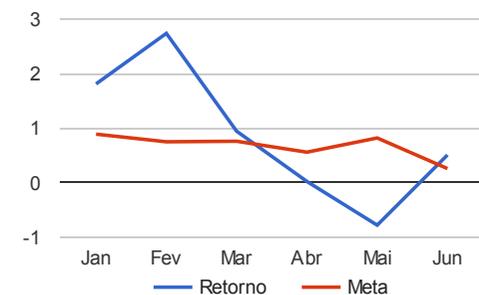
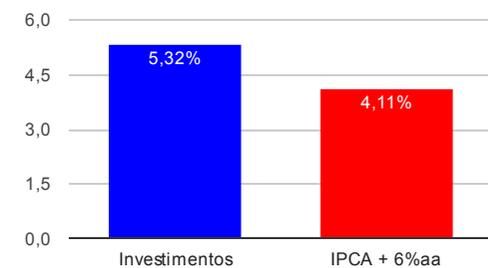
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	25.108.821,35	29,95%
IMA-B 5+	17.213.312,27	20,53%
CDI	14.512.785,59	17,31%
IMA-B 5	8.551.279,02	10,20%
MULTIMERCADO	3.997.712,82	4,77%
IDKA IPCA 2A	3.770.514,37	4,50%
IRF-M 1	3.238.867,48	3,86%
AÇÕES - SETORIAIS	3.129.137,89	3,73%
FUNDO IMOBILIÁRIO	2.140.000,00	2,55%
AÇÕES - LIVRES	1.425.902,74	1,70%
CRÉDITO PRIVADO	738.761,15	0,88%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	75.102.528,80	1.059.200,80	414.015,02	77.118.447,26	1.370.732,68	1,81%	0,89%	203,33%	2,63%
Fevereiro	77.118.447,26	1.331.834,76	609.909,46	79.968.658,81	2.128.286,25	2,73%	0,75%	364,56%	1,91%
Março	79.968.658,81	6.468.003,91	5.118.485,98	82.085.798,00	767.621,26	0,94%	0,76%	123,48%	2,09%
Abril	82.085.798,00	8.589.696,50	8.007.337,06	82.688.115,68	19.958,24	0,02%	0,56%	4,33%	1,93%
Mai	82.688.115,68	847.141,68	749.900,00	82.143.176,79	-642.180,57	-0,78%	0,82%	-94,42%	9,80%
Junho	82.143.176,79	8.093.997,48	6.834.477,61	83.827.094,68	424.398,02	0,51%	0,26%	199,05%	2,14%
Acumulado no ano					4.068.815,88	5,32%	4,11%	129,55%	

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(%)
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	87.581,51	0,00	17.532,95	71.134,15	1.085,59	1,24%	27,10%	-18,78%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	56.849,76	0,00	0,00	57.359,56	509,80	0,90%	0,19%	0,90%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	393.993,40	0,00	0,00	397.523,07	3.529,67	0,90%	0,18%	0,90%
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	57.544,86	0,00	0,00	58.046,88	502,02	0,87%	2,48%	0,87%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.104.311,04	0,00	17.901,71	2.104.636,53	18.227,20	0,87%	0,18%	0,87%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	673.521,44	0,00	0,00	679.348,32	5.826,88	0,87%	0,18%	0,87%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.518.847,70	0,00	0,00	2.539.825,91	20.978,21	0,83%	0,01%	0,83%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	923.223,37	0,00	0,00	930.634,79	7.411,42	0,80%	0,01%	0,80%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.512.315,45	104.902,97	28.000,00	3.618.177,16	28.958,74	0,80%	0,03%	0,81%
INFINITY IMA-B 5+ TIGER FI RENDA FIXA	675.061,17	0,00	0,00	679.476,47	4.415,30	0,65%	0,98%	0,65%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	663.532,00	0,00	0,00	667.627,00	4.095,00	0,62%	0,38%	0,62%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.984.881,88	0,00	0,00	1.997.018,80	12.136,92	0,61%	0,76%	0,61%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.993.095,00	0,00	0,00	2.004.420,00	11.325,00	0,57%	1,00%	0,57%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	3.542.243,74	0,00	0,00	3.560.586,44	18.342,70	0,52%	0,91%	0,52%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	3.570.689,89	0,00	600.000,00	2.986.272,58	15.582,69	0,44%	1,01%	0,48%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	746.311,67	6.589.094,51	0,00	7.366.100,85	30.694,67	0,42%	0,02%	0,82%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.108.005,77	0,00	5.355.042,95	1.773.495,57	20.532,75	0,29%	0,73%	0,62%
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.229.922,00	0,00	0,00	1.231.828,00	1.906,00	0,15%	1,82%	0,15%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	13.901.664,59	0,00	0,00	13.922.486,45	20.821,86	0,15%	2,45%	0,15%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	77.258,17	0,00	0,00	77.371,60	113,43	0,15%	2,45%	0,15%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	9.865.716,58	0,00	0,00	9.877.135,30	11.418,72	0,12%	2,28%	0,12%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	13.611.373,42	0,00	0,00	13.601.653,02	-9.720,40	-0,07%	3,27%	-0,07%

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 IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.934.710,61	0,00	0,00	2.932.182,78	-2.527,83	-0,09%	3,29%	-0,09%
Total Renda Fixa					226.166,34	0,31%	1,75%	

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	2.020.000,00	0,00	16.000,00	2.140.000,00	136.000,00	6,73%	9,78%	5,94%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIAÇÕES	0,00	1.400.000,00	0,00	1.425.902,74	25.902,74	1,85%	5,00%	0,31%
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	1.025.075,17	0,00	0,00	1.043.791,05	18.715,88	1,83%	8,72%	1,83%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	1.313.833,81	0,00	0,00	1.325.372,90	11.539,09	0,88%	1,31%	0,88%
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	1.350.494,71	0,00	0,00	1.361.733,27	11.238,56	0,83%	0,05%	0,83%
BRADESCO DIVIDENDOS FIAÇÕES	1.077.486,69	0,00	0,00	1.085.422,46	7.935,77	0,74%	5,78%	0,74%
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	1.301.369,69	0,00	0,00	1.310.606,65	9.236,96	0,71%	0,08%	0,71%
BB GOVERNANÇA FIAÇÕES PREVIDENCIÁRIO	805.891,82	0,00	0,00	809.458,18	3.566,36	0,44%	6,11%	0,44%
ITAÚ DIVIDENDOS FIAÇÕES	1.016.369,88	0,00	800.000,00	190.466,20	-25.903,68	-2,55%	7,93%	-1,26%
Total Renda Variável					198.231,68	1,89%	4,84%	

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 IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.100.513,62	0,00	6.442.042,95	1.773.495,57	115.024,90	1,48%	1,84%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.571.673,47	104.902,97	147.637,06	3.618.177,16	89.237,78	2,51%	2,54%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	3.148.411,39	0,00	680.280,00	2.539.825,91	71.694,52	2,66%	2,70%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.068.105,16	0,00	17.901,71	2.104.636,53	54.433,08	2,63%	2,63%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	3.517.107,84	0,00	0,00	3.560.586,44	43.478,60	1,24%	1,24%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	733.603,40	6.589.094,51	0,00	7.366.100,85	43.402,94	2,16%	2,57%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	3.545.757,01	0,00	600.000,00	2.986.272,58	40.515,57	1,14%	1,19%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.962.170,58	0,00	0,00	1.997.018,80	34.848,22	1,78%	1,78%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.978.906,50	0,00	0,00	2.004.420,00	25.513,50	1,29%	1,29%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	907.565,42	0,00	0,00	930.634,79	23.069,37	2,54%	2,54%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	661.797,18	0,00	0,00	679.348,32	17.551,14	2,65%	2,65%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	654.443,00	0,00	0,00	667.627,00	13.184,00	2,01%	2,01%
INFINITY IMA-B 5+ TIGER FI RENDA FIXA	667.589,15	0,00	0,00	679.476,47	11.887,32	1,78%	1,78%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	387.256,07	0,00	0,00	397.523,07	10.267,00	2,65%	2,65%
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	85.776,91	0,00	17.532,95	71.134,15	2.890,19	3,37%	-17,07%
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	56.222,24	0,00	0,00	58.046,88	1.824,64	3,25%	3,25%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	54.339,61	1.562,53	0,00	57.359,56	1.457,42	2,63%	2,65%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	78.464,55	0,00	0,00	77.371,60	-1.092,95	-1,39%	-1,39%
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.233.703,00	0,00	0,00	1.231.828,00	-1.875,00	-0,15%	-0,15%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.932.957,97	84.718,41	0,00	2.932.182,78	-85.493,60	-2,86%	-2,84%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	14.577.052,70	372.448,82	4.928.000,00	9.877.135,30	-144.366,22	-1,24%	-1,37%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	14.117.639,03	0,00	0,00	13.922.486,45	-195.152,58	-1,38%	-1,38%

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	7.544.015,20	6.386.108,42	0,00	13.601.653,02	-328.470,60	-2,38%	-2,55%
				Total Renda Fixa	-156.170,76	-0,22%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	2.100.000,00	0,00	46.600,00	2.140.000,00	86.600,00	4,22%	1,90%
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	3.243.810,79	0,00	1.911.720,00	1.361.733,27	29.642,48	1,54%	1,58%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIAÇÕES	0,00	1.400.000,00	0,00	1.425.902,74	25.902,74	1,85%	-2,79%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	0,00	1.300.000,00	0,00	1.325.372,90	25.372,90	1,95%	2,92%
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	0,00	1.292.000,00	0,00	1.310.606,65	18.606,65	1,44%	2,05%
BB GOVERNANÇA FIAÇÕES PREVIDENCIÁRIO	816.515,60	0,00	0,00	809.458,18	-7.057,42	-0,86%	-0,86%
BRADESCO DIVIDENDOS FIAÇÕES	1.128.928,87	0,00	0,00	1.085.422,46	-43.506,41	-3,85%	-3,85%
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	1.096.949,38	0,00	0,00	1.043.791,05	-53.158,33	-4,85%	-4,85%
ITAÚ DIVIDENDOS FIAÇÕES	1.114.522,36	0,00	800.000,00	190.466,20	-124.056,16	-11,13%	-9,96%
Total Renda Variável					-41.653,55	-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 NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	13.241.711,96	789.055,12	4.928.000,00	9.877.135,30	774.368,22	5,40%	5,27%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	13.214.590,24	0,00	0,00	13.922.486,45	707.896,21	5,36%	5,36%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.802.260,56	0,00	6.442.042,95	1.773.495,57	413.277,96	5,36%	5,73%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.630.863,33	104.902,97	316.938,08	3.618.177,16	199.348,94	5,66%	5,71%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	3.400.019,63	0,00	600.000,00	2.986.272,58	186.252,95	5,48%	5,52%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	3.382.172,86	0,00	0,00	3.560.586,44	178.413,58	5,28%	5,28%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	3.055.281,28	0,00	680.280,00	2.539.825,91	164.824,63	5,79%	5,83%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	3.544.953,01	6.589.094,51	2.903.808,08	7.366.100,85	135.861,41	4,82%	5,70%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.592.802,76	1.097.052,42	1.718.957,36	2.104.636,53	133.738,71	5,82%	6,11%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.939.803,00	0,00	53.431,31	2.004.420,00	118.048,31	6,17%	3,33%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.889.138,45	0,00	0,00	1.997.018,80	107.880,35	5,71%	5,71%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.112.135,11	1.813.965,21	1.097.052,42	2.932.182,78	103.134,88	4,67%	5,09%
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.192.267,00	0,00	33.113,21	1.231.828,00	72.674,21	6,12%	3,32%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	880.752,11	0,00	0,00	930.634,79	49.882,68	5,66%	5,66%
INFINITY IMA-B 5+ TIGER FI RENDA FIXA	631.271,68	0,00	0,00	679.476,47	48.204,79	7,64%	7,64%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	640.275,48	0,00	272,26	679.348,32	39.345,10	6,15%	6,15%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	634.550,50	0,00	0,00	667.627,00	33.076,50	5,21%	5,21%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	374.637,03	0,00	0,00	397.523,07	22.886,04	6,11%	6,11%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	73.441,59	0,00	0,00	77.371,60	3.930,01	5,35%	5,35%
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	54.299,98	0,00	0,00	58.046,88	3.746,90	6,90%	6,90%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	50.602,93	3.541,22	0,00	57.359,56	3.215,41	6,11%	6,14%
CARTÃO DE COMPRAS SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	74.769,29	0,00	76.981,09	0,00	2.211,80	2,96%	6,54%

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 (%)
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	97.464,90	0,00	17.532,95	71.134,15	-8.797,80	-9,03%	-27,02%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.713.532,30	12.000.263,68	0,00	13.601.653,02	-112.142,96	3,59%	5,40%
				Total Renda Fixa	3.381.278,83	4,99%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	2.040.000,00	0,00	153.995,42	2.140.000,00	253.995,42	12,84%	4,90%
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	3.143.161,34	0,00	1.911.720,00	1.361.733,27	130.291,93	4,79%	4,84%
BRADESCO DIVIDENDOS FIAÇÕES	975.975,46	0,00	0,00	1.085.422,46	109.447,00	11,21%	11,21%
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	976.770,46	0,00	0,00	1.043.791,05	67.020,59	6,86%	6,86%
BB GOVERNANÇA FIAÇÕES PREVIDENCIÁRIO	746.646,84	0,00	0,00	809.458,18	62.811,34	8,41%	8,41%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIAÇÕES	0,00	1.400.000,00	0,00	1.425.902,74	25.902,74	1,85%	10,16%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	0,00	1.300.000,00	0,00	1.325.372,90	25.372,90	1,95%	6,81%
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	0,00	1.292.000,00	0,00	1.310.606,65	18.606,65	1,44%	5,43%
ITAÚ DIVIDENDOS FIAÇÕES	996.377,72	0,00	800.000,00	190.466,20	-5.911,52	-0,59%	0,72%
Total Renda Variável					687.537,05	7,66%	