

# 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
ITAÚ INSTITUCIONAL PRÉ-FIXADO FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.441.979,12	1,73%	317	0,48%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	5.012.136,32	6,03%	675	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	269.831,09	0,32%	1.898	0,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	5.876.180,20	7,07%	307	0,32%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	7.523.233,01	9,05%	360	0,57%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.118.614,91	7,36%	204	0,47%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.500.221,31	4,21%	703	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.569.383,03	5,50%	599	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	7.855.804,51	9,45%	706	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	304.842,78	0,37%	13	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	84.541,83	0,10%	193	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	560.617,33	0,67%	107	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	480.722,08	0,58%	1.360	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	D+1	Não há	1.529.024,63	1,84%	14	0,44%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	1.708.837,57	2,06%	77	0,61%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	4.209.954,65	5,06%	98	0,27%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.605.026,33	7,94%	326	0,27%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	301.777,22	0,36%	55	0,04%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	1.291.184,00	1,55%	38	0,74%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	3.008.404,12	3,62%	475	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	695.570,94	0,84%	615	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	D+5	Não há	3.179.079,07	3,82%	50	0,85%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "

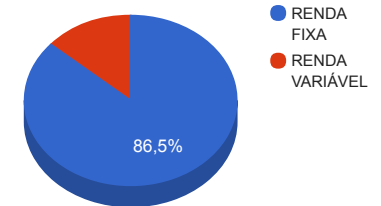
Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	3.831.666,56	4,61%	1.334	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.433.916,23	1,72%	62	0,10%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	392.941,86	0,47%	143	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	107.541,07	0,13%	774	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	D+15	Não há	3.829.483,39	4,61%	250	13,22%	Artigo 8º, Inciso I
SAFRA SELECTION FIC AÇÕES	D+4	Não há	2.795.281,83	3,36%	610	6,14%	Artigo 8º, Inciso III
VINCI SELECTION EQUITIES FI AÇÕES	D+63	Não há	4.634.293,83	5,57%	56	5,99%	Artigo 8º, Inciso III
		<b>TOTAL -</b>	<b>83.152.090,82</b>				

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

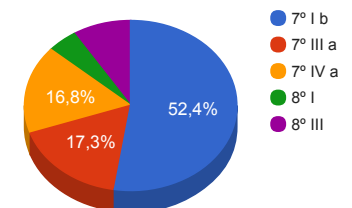
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	43.598.107,52	52,43%	50,00%	53,90%	100,00%	39.553.983,30
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	14.354.620,40	17,26%	15,00%	17,19%	80,00%	52.167.052,26
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	13.940.303,85	16,76%	14,00%	14,44%	30,00%	11.005.323,40
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>71.893.031,77</b>	<b>86,46%</b>	<b>79,00</b>	<b>85,53</b>	<b>210,00</b>	<b>-</b>

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	3.829.483,39	4,61%	4,00%	4,87%	30,00%	21.116.143,86
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	7.429.575,66	8,93%	8,00%	9,60%	30,00%	17.516.051,59
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>11.259.059,05</b>	<b>13,54%</b>	<b>12,00</b>	<b>14,47</b>	<b>60,00</b>	<b>-</b>

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 "	43.598.107,52	52,43%	50,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	14.354.620,40	17,26%	15,00%	80,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	13.940.303,85	16,76%	14,00%	30,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>71.893.031,77</b>	<b>86,46%</b>	<b>79,00</b>	<b>210,00</b>

Artigos - Renda Variável	Base: junho / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I	3.829.483,39	4,61%	4,00%	30,00%
Artigo 8º, Inciso III	7.429.575,66	8,93%	8,00%	30,00%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>11.259.059,05</b>	<b>13,54%</b>	<b>12,00</b>	<b>60,00</b>

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%	-	-	-
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,36%	8,99%	2,18%	8,99%	18,52%	39,64%	0,10%	1,389%	5,46%
ITAÚ INSTITUCIONAL PRÉ-FIXADO FIC RENDA FIXA LP	1,33%	8,01%	2,09%	8,01%	16,27%	34,82%	0,40%	1,367%	4,83%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,32%	8,09%	2,08%	8,09%	16,54%	35,39%	0,20%	1,370%	4,86%
IRF-M 1	0,89%	6,25%	2,69%	6,25%	13,46%	30,44%	-	-	-
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	0,96%	6,31%	2,48%	6,31%	13,69%	29,77%	0,50%	0,347%	1,16%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,87%	6,15%	2,65%	6,15%	13,27%	30,05%	0,20%	0,178%	0,66%
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%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	0,80%	6,70%	0,95%	6,70%	14,86%	32,64%	0,25%	1,338%	5,32%
Selic	0,81%	5,65%	2,54%	5,65%	12,87%	28,79%	-	-	-
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,83%	5,83%	2,70%	5,83%	13,30%	29,29%	0,20%	0,007%	0,10%
CDI	0,81%	5,65%	2,54%	5,65%	12,85%	28,75%	-	-	-
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,86%	5,76%	2,61%	5,76%	13,02%	29,00%	0,20%	0,017%	0,07%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,81%	5,71%	2,54%	5,71%	13,04%	28,78%	0,20%	0,026%	0,09%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,73%	5,17%	2,29%	5,17%	11,95%	26,67%	1,00%	0,013%	0,08%
IDKA IPCA 2 Anos	0,79%	6,38%	2,18%	6,38%	12,88%	32,07%	-	-	-

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 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%
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%
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%
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%
BRADERCO 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%
IPCA + 6,00% ao ano	0,26%	4,13%	1,64%	4,13%	9,15%	25,94%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,50%	4,66%	2,01%	4,66%	9,98%	27,66%	0,20%	0,226%	0,28%
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,48%	1,43%	1,95%	1,43%	3,42%	13,07%	0,20%	0,228%	3,97%
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%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	0,15%	5,56%	-1,42%	5,56%	13,68%	31,83%	0,20%	2,485%	9,95%
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%
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%
IPCA	-0,23%	1,18%	0,22%	1,18%	3,00%	12,11%	-	-	-

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
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%	-
IMA-B 5+	-0,06%	5,50%	-2,63%	5,50%	14,42%	34,03%	-	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,09%	5,09%	-2,84%	5,09%	13,85%	32,59%	0,20%	3,287%	12,82%

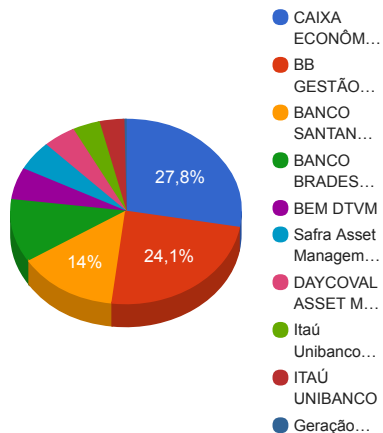


Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (junho / 2017)

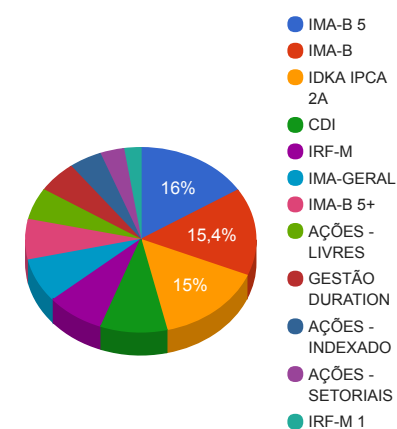
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	0,30%	4,44%	-3,21%	4,44%	22,07%	18,50%	-	-	-
VINCI SELECTION EQUITIES FI AÇÕES	0,45%	6,62%	-0,62%	6,62%	14,73%	33,03%	0,97%	4,581%	13,73%
SAFRA SELECTION FIC AÇÕES	-0,93%	1,56%	-7,71%	1,56%	17,80%	13,36%	3,50%	7,411%	21,81%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	-1,28%	7,83%	-1,66%	7,83%	22,72%	11,50%	2,80%	6,454%	21,65%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	23.125.768,99	27,81%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	20.024.716,73	24,08%
BANCO SANTANDER	11.659.742,35	14,02%
BANCO BRADESCO	9.228.973,56	11,10%
BEM DTVM	4.634.293,83	5,57%
Safra Asset Management	4.324.306,46	5,20%
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT ADMINISTRAÇÃO DE RECURSOS	3.829.483,39	4,61%
Itaú Unibanco S.A.	3.179.079,07	3,82%
ITAÚ UNIBANCO	2.875.895,35	3,46%
Geração Futuro	269.831,09	0,32%



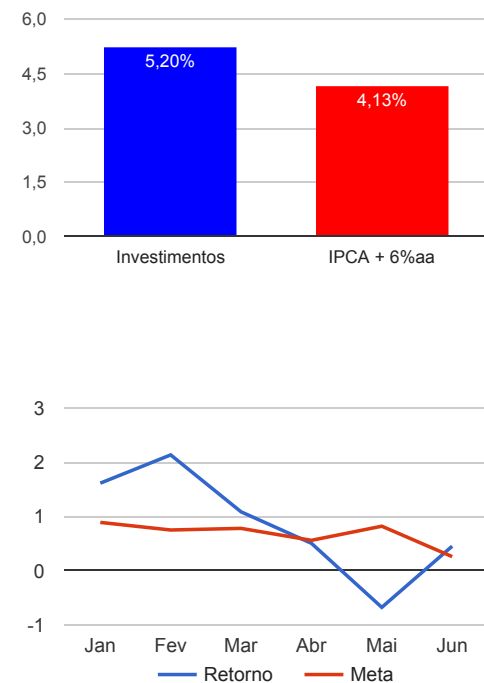
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5	13.292.909,22	15,99%
IMA-B	12.768.937,93	15,36%
IDKA IPCA 2A	12.509.729,37	15,04%
CDI	7.643.182,69	9,19%
IRF-M	6.758.958,22	8,13%
IMA-GERAL	6.420.392,13	7,72%
IMA-B 5+	5.876.180,20	7,07%
AÇÕES - LIVRES	4.634.293,83	5,57%
GESTÃO DURATION	4.612.995,30	5,55%
AÇÕES - INDEXADO	3.829.483,39	4,61%
AÇÕES - SETORIAIS	2.795.281,83	3,36%
IRF-M 1	2.009.746,71	2,42%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	67.951.422,31	8.619.964,09	6.709.026,07	70.988.739,43	1.126.379,10	1,61%	0,89%	181,16%	1,90%
Fevereiro	70.988.739,43	4.200.318,35	197.726,73	76.590.337,33	1.599.006,28	2,13%	0,75%	284,30%	1,46%
Março	76.590.337,33	15.758.377,91	14.181.686,88	79.014.844,77	847.816,41	1,08%	0,78%	138,24%	1,97%
Abril	79.014.844,77	4.769.323,85	3.193.028,63	80.998.066,87	406.926,88	0,50%	0,56%	90,54%	1,81%
Mai	80.998.066,87	3.367.681,33	1.647.652,49	82.160.869,59	-557.226,12	-0,67%	0,82%	-81,99%	8,30%
Junho	82.160.869,59	820.010,01	203.162,07	83.152.090,82	374.373,29	0,45%	0,26%	176,92%	1,88%
Acumulado no ano					3.797.275,84	5,20%	4,13%	125,93%	

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(%)
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	300.762,33	0,00	0,00	304.842,78	4.080,45	1,36%	1,39%	1,36%
ITAÚ INSTITUCIONAL PRÉ-FIXADO FIC RENDA FIXA LP	1.423.079,73	0,00	0,00	1.441.979,12	18.899,39	1,33%	1,37%	1,33%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.946.671,96	0,00	0,00	5.012.136,32	65.464,36	1,32%	1,37%	1,32%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1.420.121,54	0,00	0,00	1.433.916,23	13.794,69	0,97%	0,83%	0,97%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	3.148.634,81	0,00	0,00	3.179.079,07	30.444,26	0,97%	0,82%	0,97%
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	1.514.428,39	0,00	0,00	1.529.024,63	14.596,24	0,96%	0,35%	0,96%
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	3.799.173,92	0,00	0,00	3.831.666,56	32.492,64	0,86%	0,02%	0,86%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.068.807,72	0,00	0,00	6.118.614,91	49.807,19	0,82%	1,21%	0,82%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	299.370,99	0,00	0,00	301.777,22	2.406,23	0,80%	1,34%	0,80%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	108.997,44	0,00	2.331,91	107.541,07	875,54	0,80%	0,03%	0,81%
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.552.631,28	433.159,39	0,00	3.008.404,12	22.613,45	0,76%	0,01%	0,83%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.540.042,46	976,17	0,00	4.569.383,03	28.364,40	0,62%	0,73%	0,62%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	677.348,13	8,42	200.830,16	480.722,08	4.195,69	0,62%	0,18%	0,87%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.808.060,75	0,00	0,00	7.855.804,51	47.743,76	0,61%	0,76%	0,61%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	557.426,29	0,00	0,00	560.617,33	3.191,04	0,57%	1,00%	0,57%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	84.066,19	0,00	0,00	84.541,83	475,64	0,57%	0,51%	0,57%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	483.831,56	207.870,32	0,00	695.570,94	3.869,06	0,56%	0,01%	0,73%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.482.393,10	0,00	0,00	3.500.221,31	17.828,21	0,51%	0,93%	0,51%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	7.485.147,42	0,00	0,00	7.523.233,01	38.085,59	0,51%	0,93%	0,51%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	390.987,53	0,00	0,00	392.941,86	1.954,33	0,50%	0,23%	0,50%
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	1.700.669,60	0,00	0,00	1.708.837,57	8.167,97	0,48%	1,01%	0,48%
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.285.067,00	0,00	0,00	1.291.184,00	6.117,00	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(%)
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	4.203.578,67	0,00	0,00	4.209.954,65	6.375,98	0,15%	2,49%	0,15%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	6.597.390,41	0,00	0,00	6.605.026,33	7.635,92	0,12%	2,28%	0,12%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	269.525,00	0,00	0,00	269.831,09	306,09	0,11%	2,54%	0,11%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.881.246,04	0,00	0,00	5.876.180,20	-5.065,84	-0,09%	3,29%	-0,09%
Total Renda Fixa					424.719,28	0,59%	1,24%	

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(%)
VINCI SELECTION EQUITIES FI AÇÕES	4.534.754,97	77.995,71	0,00	4.634.293,83	21.543,15	0,47%	4,58%	0,44%
SAFRA SELECTION FIC AÇÕES	2.821.448,57	0,00	0,00	2.795.281,83	-26.166,74	-0,93%	7,41%	-0,93%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	3.775.205,79	100.000,00	0,00	3.829.483,39	-45.722,40	-1,18%	6,45%	-1,28%
<b>Total Renda Variável</b>					<b>-50.345,99</b>	<b>-0,45%</b>	<b>5,92%</b>	

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.717.276,33	0,00	3.000.000,00	7.855.804,51	138.528,18	1,57%	1,78%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.909.772,21	0,00	0,00	5.012.136,32	102.364,11	2,08%	2,08%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	7.183.155,90	248.033,44	0,00	7.523.233,01	92.043,67	1,24%	1,26%
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	3.261.719,78	480.000,00	0,00	3.831.666,56	89.946,78	2,51%	2,61%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.485.154,56	1.880,84	0,00	4.569.383,03	82.347,63	1,84%	1,84%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.045.200,98	0,00	0,00	6.118.614,91	73.413,93	1,21%	1,21%
BRASESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.031.165,75	916.431,39	0,00	3.008.404,12	60.806,98	2,47%	2,70%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.455.382,52	0,00	0,00	3.500.221,31	44.838,79	1,30%	1,30%
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	1.018.459,46	480.000,00	0,00	1.529.024,63	30.565,17	2,28%	2,48%
ITAÚ INSTITUCIONAL PRÉ-FIXADO FIC RENDA FIXA LP	1.114.140,95	300.000,00	0,00	1.441.979,12	27.838,17	1,97%	2,09%
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.266.527,00	0,00	0,00	1.291.184,00	24.657,00	1,95%	1,95%
BRASESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	1.688.794,40	0,00	0,00	1.708.837,57	20.043,17	1,19%	1,19%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.052.955,27	1.363,38	591.982,27	480.722,08	18.385,70	2,11%	2,65%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	385.186,42	0,00	0,00	392.941,86	7.755,44	2,01%	2,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	2.131.241,51	1.443.272,00	695.570,94	7.601,43	0,75%	2,29%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	553.413,37	0,00	0,00	560.617,33	7.203,96	1,30%	1,30%
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	300.000,00	0,00	304.842,78	4.842,78	1,61%	2,18%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	113.083,83	35,20	8.314,73	107.541,07	2.736,77	2,48%	2,54%
BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	0,00	300.000,00	0,00	301.777,22	1.777,22	0,59%	0,95%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	82.821,21	0,00	0,00	84.541,83	1.720,62	2,08%	2,08%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1.433.129,40	0,00	0,00	1.433.916,23	786,83	0,05%	0,05%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	2.878.520,65	300.000,00	0,00	3.179.079,07	558,42	0,02%	0,05%

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 PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	274,05	0,00	274,19	0,00	0,14	0,05%	1,31%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	275.561,09	0,00	0,00	269.831,09	-5.730,00	-2,08%	-2,08%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	4.270.495,03	0,00	0,00	4.209.954,65	-60.540,38	-1,42%	-1,42%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	6.696.967,55	0,00	0,00	6.605.026,33	-91.941,22	-1,37%	-1,37%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.693.525,56	3.320.033,72	0,00	5.876.180,20	-137.379,08	-2,28%	-2,84%
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>545.172,21</b>	<b>0,77%</b>	



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 (%)
VINCI SELECTION EQUITIES FI AÇÕES	4.583.740,03	77.995,71	0,00	4.634.293,83	-27.441,91	-0,61%	-0,62%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	3.789.714,84	100.000,00	0,00	3.829.483,39	-60.231,45	-1,56%	-1,66%
SAFRA SELECTION FIC AÇÕES	3.028.706,63	0,00	0,00	2.795.281,83	-233.424,80	-7,71%	-7,71%
Total Renda Variável					-321.098,16	-2,81%	

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 (%)
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.793.817,94	530.720,17	3.000.000,00	7.855.804,51	531.266,40	5,44%	5,71%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	8.477.098,65	1.586.268,35	2.999.980,00	7.523.233,01	459.846,01	5,10%	5,37%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.755.941,13	1.265.000,00	357.966,60	5.012.136,32	349.161,79	7,39%	8,09%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	6.272.488,40	500.000,00	500.000,00	6.605.026,33	332.537,93	5,23%	5,27%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.772.153,06	1.015.000,00	0,00	6.118.614,91	331.461,85	6,33%	6,55%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.283.143,11	4.539,87	1.000.000,00	4.569.383,03	281.700,05	5,68%	5,73%
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	4.328.299,51	2.084.192,40	2.800.000,00	3.831.666,56	219.174,65	5,29%	5,76%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.802.914,17	0,00	500.000,00	3.500.221,31	197.307,14	5,36%	5,40%
BRASESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	3.139.296,47	916.431,39	1.200.000,00	3.008.404,12	152.676,26	5,46%	5,83%
BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	2.263.091,40	1.801.181,42	0,00	4.209.954,65	145.681,83	4,62%	5,56%
BRASESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	1.619.381,73	0,00	0,00	1.708.837,57	89.455,84	5,52%	5,52%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1.350.663,26	0,00	0,00	1.433.916,23	83.252,97	6,16%	6,16%
ITAÚ INSTITUCIONAL PRÉ-FIXADO FIC RENDA FIXA LP	798.935,31	565.000,00	0,00	1.441.979,12	78.043,81	7,88%	8,01%
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	458.420,83	1.009.400,00	0,00	1.529.024,63	61.203,80	5,45%	6,31%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.684.731,89	515.593,05	1.771.289,86	480.722,08	51.687,00	4,92%	6,15%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.241.761,37	3.585.033,72	0,00	5.876.180,20	49.385,11	5,23%	5,09%
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.272.950,00	0,00	0,00	1.291.184,00	18.234,00	1,43%	1,43%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	386.385,03	0,00	11.080,62	392.941,86	17.637,45	4,65%	4,66%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	543.187,26	0,00	0,00	560.617,33	17.430,07	3,21%	3,21%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	257.632,03	0,00	0,00	269.831,09	12.199,06	4,74%	4,74%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	0,00	3.167.509,39	0,00	3.179.079,07	11.569,68	0,40%	6,15%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	115.518,07	5.887.879,39	5.905.264,43	107.541,07	9.408,04	2,79%	5,71%

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 (%)
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	2.131.241,51	1.443.272,00	695.570,94	7.601,43	0,75%	5,17%
SANTANDER IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	300.000,00	0,00	304.842,78	4.842,78	1,61%	8,99%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	82.470,41	0,00	2.356,79	84.541,83	4.428,21	5,47%	5,48%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	0,00	300.000,00	0,00	301.777,22	1.777,22	0,59%	6,70%
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES LP	0,00	1.399.969,20	1.400.599,27	0,00	630,07	0,05%	5,65%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,00	1.264.229,67	1.264.553,85	0,00	324,18	0,08%	3,09%
Total Renda Fixa					3.519.924,63	5,28%	

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 (%)
VINCI SELECTION EQUITIES FI AÇÕES	1.884.338,71	2.617.807,87	0,00	4.634.293,83	132.147,25	5,30%	6,62%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	1.124.946,62	2.633.812,16	0,00	3.829.483,39	70.724,61	5,35%	7,83%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	1.089.729,05	0,00	1.134.214,64	0,00	44.485,59	4,08%	-1,23%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	808.557,62	0,00	841.704,81	0,00	33.147,19	4,10%	-2,23%
SAFRA SELECTION FIC AÇÕES	343.569,28	2.454.865,98	0,00	2.795.281,83	-3.153,43	19,39%	1,56%
Total Renda Variável					277.351,21	6,91%	