

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



Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
TÍTULOS PÚBLICOS			231.594.621,53	43,83%			Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "
BRABESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	77.513.323,62	14,67%	193	10,96%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	1.346.815,77	0,25%	193	0,38%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	24.840.903,58	4,70%	1.197	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRABESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	D+1	16/05/2019	114.749,23	0,02%	11	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	58.784,80	0,01%	703	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	23.850.680,00	4,51%	223	0,75%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.208.073,51	0,99%	740	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	6.687.611,45	1,27%	706	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	19.529.719,56	3,70%	1.360	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	33.732.135,18	6,38%	604	0,60%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	9.683.880,00	1,83%	38	5,58%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	18/08/2020	6.380.285,00	1,21%	19	5,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2022	9.686.835,00	1,83%	17	12,91%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRABESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.122,46	0,00%	141	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	93.517,10	0,02%	774	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	13.921.235,68	2,63%	95	3,67%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	66.095,58	0,01%	42	3,01%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	5.341.016,00	1,01%	100	2,44%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	3.921.621,14	0,74%	20	15,21%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	4.413.140,88	0,84%	39	0,89%	Artigo 8º, Inciso I
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	2.784.056,74	0,53%	84	2,13%	Artigo 8º, Inciso III

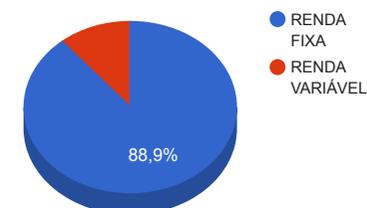
Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	4.672.374,88	0,88%	1.010	2,03%	Artigo 8º, Inciso III
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	D+33	Não há	4.755.894,74	0,90%	216	6,95%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	D+43	5 anos	3.975.465,06	0,75%	53	4,11%	Artigo 8º, Inciso III
BB CONSUMO FIC AÇÕES	D+4	Não há	4.987.825,51	0,94%	2.343	5,25%	Artigo 8º, Inciso III
KINEA PIPE FI AÇÕES	D+363 a D+723 ou D+30 a D+1830	Não há	2.747.260,65	0,52%	23	1,26%	Artigo 8º, Inciso III
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	D+13	Não há	10.665.699,35	2,02%	297	15,65%	Artigo 8º, Inciso III
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	Não se aplica	Não se aplica	5.340.267,93	1,01%		0,22%	Artigo 8º, Inciso VI
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS12	S/Info	Não se aplica	10.470.388,00	1,98%		16,80%	Artigo 8º, Inciso VI
		TOTAL -	528.387.399,93				

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

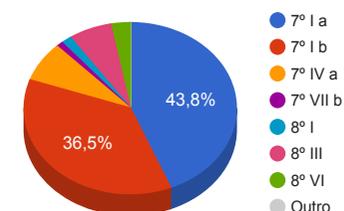
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	231.594.621,53	43,83%	0,00%	46,70%	80,00%	191.115.298,41
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	192.882.796,70	36,50%	0,00%	32,80%	80,00%	229.827.123,24
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	0,00	0,00%	0,00%	8,10%	60,00%	317.032.439,96
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	39.768.875,24	7,53%	0,00%	0,00%	30,00%	118.747.344,74
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	66.095,58	0,01%	0,00%	0,05%	5,00%	26.353.274,42
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5.341.016,00	1,01%	0,00%	1,05%	5,00%	21.078.354,00
Total Renda Fixa	100,00%	469.653.405,05	88,88%	0,00	88,70	280,00	-

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	8.334.762,02	1,58%	0,00%	3,73%	10,00%	44.503.977,97
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	34.588.576,93	6,55%	0,00%	4,56%	15,00%	44.669.533,06
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	15.810.655,93	2,99%	0,00%	3,01%	5,00%	10.608.714,07
Total Renda Variável	30,00%	58.733.994,88	11,12%	0,00	11,30	40,00	-

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: junho / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	231.594.621,53	43,83%	0,00%	80,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	192.882.796,70	36,50%	0,00%	80,00%
Artigo 7º, Inciso II	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	39.768.875,24	7,53%	0,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	66.095,58	0,01%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5.341.016,00	1,01%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	469.653.405,05	88,88%	0,00	280,00

Artigos - Renda Variável	Base: junho / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I	8.334.762,02	1,58%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso III	34.588.576,93	6,55%	0,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	15.810.655,93	2,99%	0,00%	5,00%
Total Renda Variável	58.733.994,88	11,12%	0,00	40,00

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
CDI + 3,50% ao ano	1,10%	7,45%	3,40%	7,45%	16,79%	37,91%	-	-	-
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	0,14%	-62,62%	-3,05%	-62,62%	-41,28%	-60,43%	0,20%	5,324%	120,23%
IRF-M 1	0,89%	6,25%	2,69%	6,25%	13,46%	30,44%	-	-	-
BRADERCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,90%	6,14%	2,65%	6,14%	13,22%	29,91%	0,20%	0,184%	0,67%
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%
CDI	0,81%	5,65%	2,54%	5,65%	12,85%	28,75%	-	-	-
BRADERCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	0,86%	5,61%	2,57%	5,61%	12,62%	28,18%	0,20%	0,013%	0,44%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,81%	5,71%	2,54%	5,71%	13,04%	28,78%	0,20%	0,026%	0,09%
IDKA IPCA 2 Anos	0,79%	6,38%	2,18%	6,38%	12,88%	32,07%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,61%	5,71%	1,78%	5,71%	12,09%	30,65%	0,20%	0,756%	2,89%
BB TÍTULOS PÚBLICOS 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%
IPCA + 6,00% ao ano	0,26%	4,13%	1,64%	4,13%	9,15%	25,94%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,48%	1,51%	1,95%	1,51%	3,50%	13,20%	0,20%	0,228%	3,94%
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%

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 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,47%	1,46%	1,93%	1,46%	3,43%	13,03%	0,20%	0,228%	3,94%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,34%	5,75%	0,27%	5,75%	13,15%	31,58%	0,15%	1,474%	6,45%
IMA-B	0,16%	5,46%	-1,34%	5,46%	13,32%	32,28%	-	-	-
BRDESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	0,68%	3,29%	-0,76%	3,29%	3,37%	-	0,20%	0,815%	6,84%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,57%	2,57%	2,08%	2,57%	5,52%	15,76%	0,20%	0,514%	4,51%
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%
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%

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

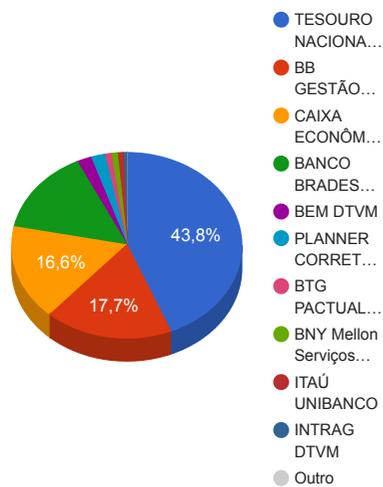
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	0,88%	11,27%	2,07%	11,27%	26,62%	42,05%	-	-	-
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-	-	0,30%	-	-
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS12	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-	0,14%	-	-
IGC	0,53%	8,85%	-0,71%	8,85%	21,63%	18,82%	-	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	0,44%	8,41%	-0,86%	8,41%	20,90%	17,92%	1,00%	6,110%	20,17%
SMLL	0,38%	19,24%	2,71%	19,24%	33,53%	30,90%	-	-	-
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	0,31%	8,25%	-1,20%	8,25%	2,67%	-13,93%	1,72%	3,267%	17,61%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	-0,68%	9,85%	-3,64%	9,85%	19,79%	31,02%	2,00%	6,218%	20,91%
Ibovespa	0,30%	4,44%	-3,21%	4,44%	22,07%	18,50%	-	-	-
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	0,87%	6,64%	-2,11%	6,64%	18,22%	21,30%	1,50%	5,643%	19,52%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	0,18%	4,09%	-3,26%	4,09%	21,42%	18,00%	0,50%	5,904%	21,73%
IBX	0,30%	5,41%	-2,52%	5,41%	22,39%	18,62%	-	-	-
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	1,11%	5,88%	-0,31%	5,88%	11,10%	15,57%	2,00%	4,543%	15,54%
ICON	-2,98%	7,29%	2,68%	7,29%	9,86%	6,43%	-	-	-
BB CONSUMO FIC AÇÕES	-3,10%	6,49%	2,24%	6,49%	8,33%	3,56%	1,00%	5,865%	19,46%
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%

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

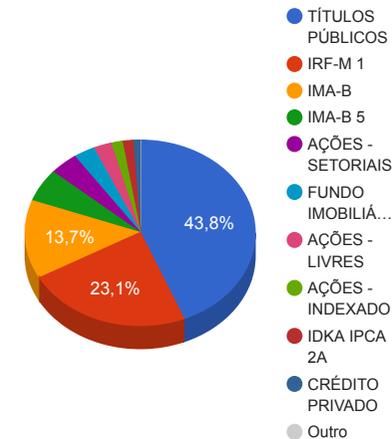
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IVBX-2	-1,22%	4,15%	-0,46%	4,15%	13,16%	17,48%	-	-	-
KINEA PIPE FI AÇÕES	2,28%	16,62%	4,54%	16,62%	19,46%	16,80%	1,50%	6,056%	19,73%

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

Administrador	Valor	%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	231.594.621,53	43,83%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	93.734.368,94	17,74%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	87.636.360,07	16,59%
BANCO BRADESCO	77.631.195,31	14,69%
BEM DTVM	10.665.699,35	2,02%
PLANNER CORRETORA	10.470.388,00	1,98%
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS	4.755.894,74	0,90%
BNY Mellon Serviços Financeiros	4.672.374,88	0,88%
ITAÚ UNIBANCO	4.413.140,88	0,84%
INTRAG DTVM	2.747.260,65	0,52%
Geração Futuro	66.095,58	0,01%



Sub-segmento	Valor	%
TÍTULOS PÚBLICOS	231.594.621,53	43,83%
IRF-M 1	121.883.946,76	23,07%
IMA-B	72.346.908,60	13,69%
IMA-B 5	30.289.749,80	5,73%
AÇÕES - SETORIAIS	21.175.616,93	4,01%
FUNDO IMOBILIÁRIO	15.810.655,93	2,99%
AÇÕES - LIVRES	13.412.960,00	2,54%
AÇÕES - INDEXADO	8.334.762,02	1,58%
IDKA IPCA 2A	8.034.427,22	1,52%
CRÉDITO PRIVADO	5.341.016,00	1,01%
CDI	96.639,56	0,02%
FIDC - FECHADO	66.095,58	0,01%



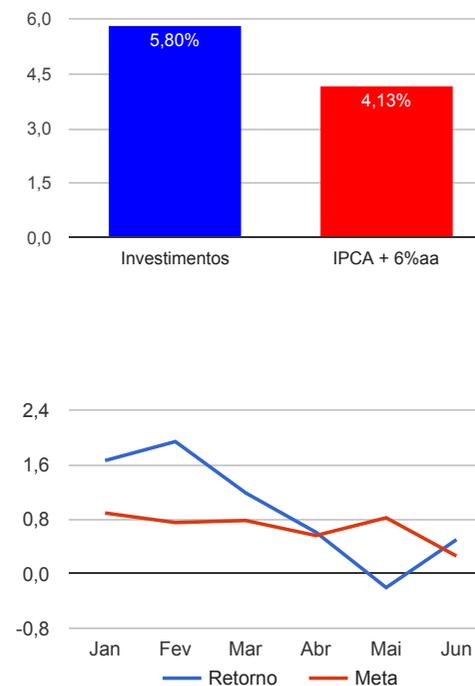
Carteira de Títulos Públicos - base (junho / 2017)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde.	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	GAP (Atual - Pago)
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2021	10/11/2016	7000	3.029,485123	3.076,474324	21.206.395,86	21.535.320,27	328.924,41
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2021	29/08/2016	10000	2.967,972738	3.076,474324	29.679.727,38	30.764.743,24	1.085.015,86
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2021	12/09/2016	10000	2.980,886631	3.076,474324	29.808.866,31	30.764.743,24	955.876,93
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2021	14/09/2016	10000	2.971,010111	3.076,474324	29.710.101,11	30.764.743,24	1.054.642,13
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2022	27/07/2016	15000	2.963,303079	3.115,478083	44.449.546,19	46.732.171,25	2.282.625,06
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2022	04/08/2016	13000	2.979,58205	3.115,478083	38.734.566,65	40.501.215,08	1.766.648,43
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2022	30/06/2016	9800	2.911,042410	3.115,478083	28.528.215,62	30.531.685,21	2.003.469,60

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	481.983.217,97	6.210.481,37	2.176.834,83	494.073.851,89	8.056.987,38	1,66%	0,89%	185,86%	2,50%
Fevereiro	494.073.851,89	14.049.236,35	10.223.919,06	507.535.988,06	9.636.818,88	1,94%	0,75%	258,60%	2,62%
Março	507.535.988,06	35.555.957,58	32.519.141,35	516.620.770,95	6.047.966,66	1,18%	0,78%	150,98%	1,71%
Abril	516.620.770,95	3.306.049,90	1.803.184,73	521.276.825,44	3.153.189,32	0,61%	0,56%	109,13%	1,42%
Mai	521.276.825,44	9.096.813,15	5.692.426,57	523.620.415,09	-1.060.796,93	-0,20%	0,82%	-24,61%	5,53%
Junho	523.620.415,09	4.068.727,92	1.927.246,10	528.387.399,93	2.625.503,02	0,50%	0,26%	195,34%	1,39%
Acumulado no ano					28.459.668,33	5,80%	4,13%	140,60%	

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(%)
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	76.242.301,21	586.187,32	0,00	77.513.323,62	684.835,09	0,89%	0,18%	0,90%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	24.627.583,53	0,00	0,00	24.840.903,58	213.320,05	0,87%	0,18%	0,87%
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	3.095,95	0,00	0,00	3.122,46	26,51	0,86%	0,01%	0,86%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	92.762,18	0,00	0,00	93.517,10	754,92	0,81%	0,03%	0,81%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	17.804.880,20	3.482.540,60	1.927.246,10	19.529.719,56	169.544,86	0,80%	0,18%	0,87%
BRADESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	113.969,37	0,00	0,00	114.749,23	779,86	0,68%	0,82%	0,68%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	5.308.256,00	0,00	0,00	5.341.016,00	32.760,00	0,62%	0,38%	0,62%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.646.967,40	0,00	0,00	6.687.611,45	40.644,05	0,61%	0,76%	0,61%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.339.238,50	0,00	0,00	1.346.815,77	7.577,27	0,57%	0,51%	0,57%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	23.716.680,00	0,00	0,00	23.850.680,00	134.000,00	0,57%	0,51%	0,57%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	58.485,38	0,00	0,00	58.784,80	299,42	0,51%	0,93%	0,51%
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.349.995,00	0,00	0,00	6.380.285,00	30.290,00	0,48%	0,23%	0,48%
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.638.002,50	0,00	0,00	9.683.880,00	45.877,50	0,48%	0,23%	0,48%
CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.641.572,50	0,00	0,00	9.686.835,00	45.262,50	0,47%	0,23%	0,47%
TÍTULOS PÚBLICOS	230.626.433,31	0,00	0,00	231.594.621,53	968.188,22	0,42%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.874.141,78	0,00	0,00	13.921.235,68	47.093,90	0,34%	1,47%	0,34%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.200.284,54	0,00	0,00	5.208.073,51	7.788,97	0,15%	2,45%	0,15%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	33.682.683,35	0,00	0,00	33.732.135,18	49.451,83	0,15%	2,45%	0,15%
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	66.002,41	0,00	0,00	66.095,58	93,17	0,14%	5,32%	0,14%
				Total Renda Fixa	2.478.588,12	0,53%	0,69%	

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(%)
KINEA PIPE FI AÇÕES	2.686.069,69	0,00	0,00	2.747.260,65	61.190,96	2,28%	6,06%	2,28%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	4.676.513,34	0,00	0,00	4.755.894,74	79.381,40	1,70%	5,24%	1,70%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	10.548.858,18	0,00	0,00	10.665.699,35	116.841,17	1,11%	4,54%	1,11%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	4.374.912,27	0,00	0,00	4.413.140,88	38.228,61	0,87%	5,64%	0,87%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS12	10.420.017,24	0,00	0,00	10.470.388,00	50.370,76	0,48%	-	0,48%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	2.771.790,57	0,00	0,00	2.784.056,74	12.266,17	0,44%	6,11%	0,44%
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	3.963.337,11	0,00	0,00	3.975.465,06	12.127,95	0,31%	3,27%	0,31%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	3.914.658,88	0,00	0,00	3.921.621,14	6.962,26	0,18%	5,90%	0,18%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	4.704.175,39	0,00	0,00	4.672.374,88	-31.800,51	-0,68%	6,22%	-0,68%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	5.379.251,85	0,00	0,00	5.340.267,93	-38.983,92	-0,72%	-	0,00%
BB CONSUMO FIC AÇÕES	5.147.495,46	0,00	0,00	4.987.825,51	-159.669,95	-3,10%	5,86%	-3,10%
Total Renda Variável					146.914,90	0,25%	5,27%	

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	73.814.685,34	1.724.807,49	0,00	77.513.323,62	1.973.830,79	2,63%	2,65%
TÍTULOS PÚBLICOS	233.590.888,91	0,00	3.271.047,75	231.594.621,53	1.274.780,37	0,55%	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	22.486.333,33	1.735.164,15	0,00	24.840.903,58	619.406,10	2,62%	2,63%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	23.365.080,00	0,00	0,00	23.850.680,00	485.600,00	2,08%	2,08%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.255.544,96	12.447.157,46	5.586.422,26	19.529.719,56	413.439,40	2,24%	2,65%
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.498.952,50	0,00	0,00	9.683.880,00	184.927,50	1,95%	1,95%
CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.503.647,50	0,00	0,00	9.686.835,00	183.187,50	1,93%	1,93%
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.258.260,00	0,00	0,00	6.380.285,00	122.025,00	1,95%	1,95%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.570.911,85	0,00	0,00	6.687.611,45	116.699,60	1,78%	1,78%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	5.235.544,00	0,00	0,00	5.341.016,00	105.472,00	2,01%	2,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.883.095,80	0,00	0,00	13.921.235,68	38.139,88	0,27%	0,27%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.319.405,00	0,00	0,00	1.346.815,77	27.410,77	2,08%	2,08%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	91.200,57	0,00	0,00	93.517,10	2.316,53	2,54%	2,54%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	58.031,75	0,00	0,00	58.784,80	753,05	1,30%	1,30%
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	2.805,46	564.461,87	564.461,87	3.122,46	317,00	1,12%	2,57%
BRDESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	115.626,62	0,00	0,00	114.749,23	-877,39	-0,76%	-0,76%
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	68.176,40	0,00	925,52	66.095,58	-1.155,30	-1,69%	-3,05%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.281.075,48	0,00	0,00	5.208.073,51	-73.001,97	-1,38%	-1,38%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	34.208.633,48	0,00	0,00	33.732.135,18	-476.498,30	-1,39%	-1,39%
Total Renda Fixa					4.996.772,53	1,08%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
KINEA PIPE FI AÇÕES	2.627.886,54	0,00	0,00	2.747.260,65	119.374,11	4,54%	4,54%
BB CONSUMO FIC AÇÕES	4.878.649,57	0,00	0,00	4.987.825,51	109.175,94	2,24%	2,24%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS12	10.365.543,07	0,00	0,00	10.470.388,00	104.844,93	1,01%	-
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	4.735.745,08	0,00	0,00	4.755.894,74	20.149,66	0,43%	0,43%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	2.808.330,07	0,00	0,00	2.784.056,74	-24.273,33	-0,86%	-0,86%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	10.699.184,80	0,00	0,00	10.665.699,35	-33.485,45	-0,31%	-0,31%
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	4.023.917,59	0,00	0,00	3.975.465,06	-48.452,53	-1,20%	-1,20%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	4.508.479,89	0,00	0,00	4.413.140,88	-95.339,01	-2,11%	-2,11%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	5.462.130,98	0,00	0,00	5.340.267,93	-121.863,05	-2,23%	0,00%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	4.053.979,93	0,00	0,00	3.921.621,14	-132.358,79	-3,26%	-3,26%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	4.849.024,48	0,00	0,00	4.672.374,88	-176.649,60	-3,64%	-3,64%
Total Renda Variável					-278.877,12	-0,47%	

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 (%)
TÍTULOS PÚBLICOS	224.969.023,85	0,00	6.588.881,06	231.594.621,53	13.214.478,74	5,91%	-
BRASESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	68.580.613,02	4.583.923,29	0,00	77.513.323,62	4.348.787,31	6,08%	6,14%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	32.018.748,04	0,00	0,00	33.732.135,18	1.713.387,14	5,35%	5,35%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	20.179.861,39	0,00	21.707.710,52	0,00	1.527.849,13	7,57%	5,09%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.532.038,47	0,00	379.603,36	13.921.235,68	768.800,57	5,74%	5,75%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	113.402,44	23.984.907,11	0,00	24.840.903,58	742.594,03	4,54%	6,11%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	23.252.860,00	0,00	0,00	23.850.680,00	597.820,00	2,57%	2,57%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	390.185,47	34.018.325,25	15.434.512,11	19.529.719,56	555.720,95	3,79%	6,15%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.943.699,46	3.317.833,31	8.704.466,88	0,00	442.934,11	6,27%	5,40%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.326.342,03	0,00	0,00	6.687.611,45	361.269,42	5,71%	5,71%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	5.076.404,00	0,00	0,00	5.341.016,00	264.612,00	5,21%	5,21%
CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.547.080,00	0,00	0,00	9.686.835,00	139.755,00	1,46%	1,46%
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.547.125,00	0,00	0,00	9.683.880,00	136.755,00	1,43%	1,43%
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.285.190,00	0,00	0,00	6.380.285,00	95.095,00	1,51%	1,51%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.313.816,56	0,00	37.545,48	1.346.815,77	70.544,69	5,47%	5,48%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	174.286,17	5.000.000,00	0,00	5.208.073,51	33.787,34	2,44%	5,36%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	88.469,36	0,00	0,00	93.517,10	5.047,74	5,71%	5,71%
BRASESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	111.089,16	0,00	0,00	114.749,23	3.660,07	3,29%	3,29%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	55.775,31	0,00	0,00	58.784,80	3.009,49	5,40%	5,40%
BRASESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	2.341,66	1.382.277,31	1.382.277,31	3.122,46	780,80	3,08%	5,61%
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	176.810,80	0,00	107.755,92	66.095,58	-2.959,30	-3,01%	-62,62%
				Total Renda Fixa	25.023.729,23	5,74%	

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 (%)
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	10.072.945,71	0,00	0,00	10.665.699,35	592.753,64	5,88%	5,88%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS12	10.050.536,43	0,00	0,00	10.470.388,00	419.851,57	4,18%	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	4.253.573,71	0,00	0,00	4.672.374,88	418.801,17	9,85%	9,85%
KINEA PIPE FI AÇÕES	2.355.766,95	0,00	0,00	2.747.260,65	391.493,70	16,62%	16,62%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	4.431.113,66	0,00	0,00	4.755.894,74	324.781,08	7,33%	7,33%
BB CONSUMO FIC AÇÕES	4.683.637,60	0,00	0,00	4.987.825,51	304.187,91	6,49%	6,49%
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	3.672.448,64	0,00	0,00	3.975.465,06	303.016,42	8,25%	8,25%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	4.138.402,81	0,00	0,00	4.413.140,88	274.738,07	6,64%	6,64%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	2.568.022,95	0,00	0,00	2.784.056,74	216.033,79	8,41%	8,41%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	3.767.648,99	0,00	0,00	3.921.621,14	153.972,15	4,09%	4,09%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	5.303.958,33	0,00	0,00	5.340.267,93	36.309,60	0,68%	0,00%
Total Renda Variável					3.435.939,10	6,21%	