

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 IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.010.189,84	2,48%	706	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.009.243,26	9,87%	293	0,50%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	4.505.864,62	5,55%	307	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.306.883,36	6,54%	599	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	9.182.679,79	11,31%	115	1,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	9.721.996,20	11,98%	740	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	7.839.519,50	9,66%	604	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
TOWER BRIDGE II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	287.106,98	0,35%	29	0,25%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	12.128.619,74	14,94%	59	2,25%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	4.433,99	0,01%	98	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	613.398,78	0,76%	77	0,22%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	1.032.450,53	1,27%	32	0,19%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.272.597,84	4,03%	774	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	627.081,17	0,77%	5.953	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	345.817,15	0,43%	475	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	6.397,80	0,01%	28	1,10%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	2.208.302,73	2,72%	98	2,14%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	D+90 ou D+150 a D+450	18 meses	916.731,13	1,13%	14	8,35%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	1.719.091,59	2,12%	20.787	0,42%	Artigo 8º, Inciso I
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.805.239,54	3,46%	2.684	1,61%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	23/08/2017	1.265.508,28	1,56%	116	0,35%	Artigo 8º, Inciso III
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	D+4382	Não há	931.244,47	1,15%	5	0,75%	Artigo 8º, Inciso IV

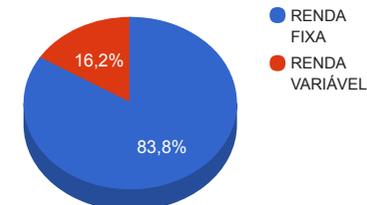
Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
CONQUEST FIP - FCCQ11	Não se aplica	Não se aplica	3.079.504,74	3,79%			Artigo 8º, Inciso V
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se aplica	Não se aplica	3.344.359,16	4,12%		6,76%	Artigo 8º, Inciso VI
		TOTAL -	81.164.262,19				

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

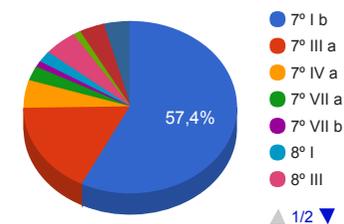
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	46.576.376,57	57,39%	30,00%	35,00%	70,00%	10.238.606,96
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	14.066.010,02	17,33%	15,00%	20,00%	60,00%	34.632.547,29
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	4.245.496,16	5,23%	5,00%	5,00%	30,00%	20.103.782,50
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	12.174.639,33
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	2.214.700,53	2,73%	0,00%	3,00%	5,00%	1.843.512,58
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	916.731,13	1,13%	0,00%	2,00%	5,00%	3.141.481,98
Total Renda Fixa	100,00%	68.019.314,41	83,80%	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%	1.719.091,59	2,12%	0,00%	2,00%	5,00%	2.339.121,52
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	4.070.747,82	5,02%	5,00%	9,00%	15,00%	8.103.891,51
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	931.244,47	1,15%	2,00%	5,00%	5,00%	3.126.968,64
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	3.079.504,74	3,79%	2,00%	4,50%	5,00%	978.708,37
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	3.344.359,16	4,12%	2,00%	4,50%	5,00%	713.853,95
Total Renda Variável	30,00%	13.144.947,78	16,20%	11,00	25,00	35,00	-

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 "	46.576.376,57	57,39%	30,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	14.066.010,02	17,33%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	4.245.496,16	5,23%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	0,00	0,00%	5,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	2.214.700,53	2,73%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	916.731,13	1,13%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	68.019.314,41	83,80%	55,00	185,00

Artigos - Renda Variável	Base: junho / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I	1.719.091,59	2,12%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso III	4.070.747,82	5,02%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	931.244,47	1,15%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	3.079.504,74	3,79%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	3.344.359,16	4,12%	2,00%	5,00%
Total Renda Variável	13.144.947,78	16,20%	11,00	35,00

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 II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-9,91%	-94,57%	-23,52%	-94,57%	-37,65%	-89,58%	0,20%	12,796%	1.007,15%
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%	-	-	-
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,82%	5,69%	2,56%	5,69%	12,91%	28,97%	0,25%	0,012%	0,08%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,81%	5,71%	2,54%	5,71%	13,04%	28,78%	0,20%	0,026%	0,09%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	0,14%	2,53%	1,01%	2,53%	5,95%	-21,08%	1,00%	0,438%	0,29%
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%	-	-	-
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%
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,43%	2,66%	0,69%	2,66%	9,18%	7,40%	0,70%	1,089%	4,52%
TOWER BRIDGE II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,42%	4,73%	1,16%	4,73%	3,46%	-	0,70%	2,975%	8,20%
101,50% do IPCA + 5,75% ao ano	0,22%	3,94%	1,55%	3,94%	8,77%	25,12%	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,63%	-3,09%	-1,80%	-3,09%	-12,76%	-16,55%	0,25%	0,633%	2,03%

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

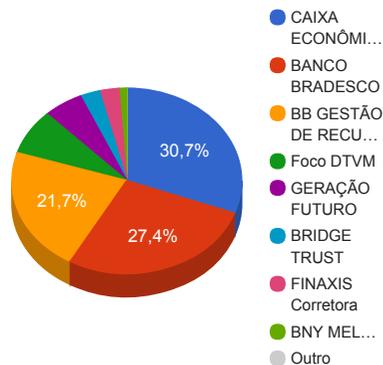
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	0,16%	5,46%	-1,34%	5,46%	13,32%	32,28%	-	-	-
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	0,15%	5,56%	-1,42%	5,56%	13,68%	31,83%	0,20%	2,485%	9,95%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,15%	5,36%	-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%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	0,01%	5,09%	-1,57%	5,09%	12,90%	30,88%	0,20%	2,511%	9,81%
IMA-B 5+	-0,06%	5,50%	-2,63%	5,50%	14,42%	34,03%	-	-	-
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%
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)

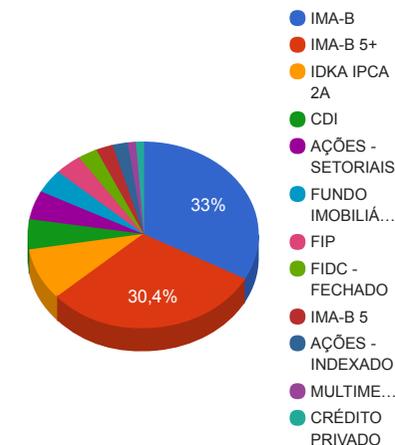
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	0,88%	11,27%	2,07%	11,27%	26,62%	42,05%	-	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-32,65%	0,02%	1,50%	0,000%	32,72%
IPCA + 8,00% ao ano	0,41%	5,09%	2,10%	5,09%	11,20%	30,72%	-	-	-
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	-4,91%	-43,20%	-12,99%	-43,20%	-38,56%	-35,13%	0,12%	12,261%	42,40%
Ibovespa	0,30%	4,44%	-3,21%	4,44%	22,07%	18,50%	-	-	-
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%	-	-	-
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	0,25%	-2,23%	-6,42%	-2,23%	9,89%	-6,75%	3,00%	6,259%	20,62%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	-0,12%	4,48%	-1,69%	4,48%	10,28%	13,57%	1,72%	5,093%	18,81%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CONQUEST FIP - FCCQ11	-	-	-	-	-	-	0,30%	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	24.930.712,27	30,72%
BANCO BRADESCO	22.274.949,45	27,44%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	17.628.171,80	21,72%
Foco DTVM	6.423.863,90	7,91%
GERAÇÃO FUTURO	4.524.331,13	5,57%
BRIDGE TRUST	2.250.801,98	2,77%
FINAXIS Corretora	2.208.302,73	2,72%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	916.731,13	1,13%
Socopa	6.397,80	0,01%



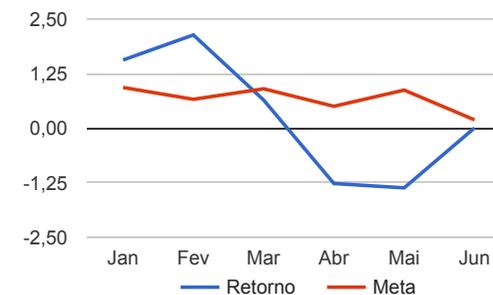
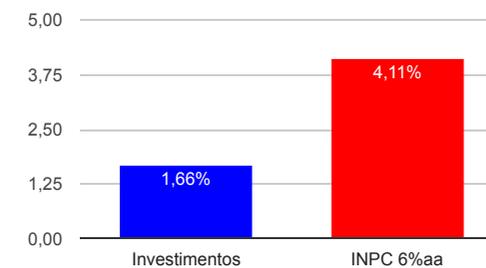
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	26.748.629,48	32,96%
IMA-B 5+	24.643.727,62	30,36%
IDKA IPCA 2A	7.317.073,20	9,02%
CDI	4.245.496,16	5,23%
AÇÕES - SETORIAIS	4.070.747,82	5,02%
FUNDO IMOBILIÁRIO	3.344.359,16	4,12%
FIP	3.079.504,74	3,79%
FIDC - FECHADO	2.214.700,53	2,73%
IMA-B 5	1.932.956,29	2,38%
AÇÕES - INDEXADO	1.719.091,59	2,12%
MULTIMERCADO	931.244,47	1,15%
CRÉDITO PRIVADO	916.731,13	1,13%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	80.243.090,02	465.586,99	1.496.916,24	80.462.675,95	1.250.915,18	1,56%	0,93%	167,62%	2,51%
Fevereiro	80.462.675,95	900.000,00	20.603.556,22	62.474.568,52	1.715.448,79	2,13%	0,66%	323,03%	1,96%
Março	62.474.568,52	20.269.735,67	1.369.893,58	81.897.302,99	522.892,38	0,64%	0,90%	71,78%	2,33%
Abril	81.897.302,99	2.574.868,03	1.734.064,29	81.689.738,99	-1.048.367,74	-1,27%	0,50%	-254,74%	2,30%
Mai	81.689.738,99	1.786.122,92	1.382.820,02	80.971.126,03	-1.121.915,86	-1,37%	0,87%	-156,76%	11,87%
Junho	80.971.126,03	2.092.316,37	1.902.013,66	81.164.262,19	2.833,45	0,00%	0,19%	1,88%	2,60%
Acumulado no ano					1.321.806,20	1,66%	4,11%	40,50%	

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(%)
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	342.960,81	0,00	0,00	345.817,15	2.856,34	0,83%	0,01%	0,83%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	621.960,66	0,00	0,00	627.081,17	5.120,51	0,82%	0,01%	0,82%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.246.179,63	0,00	0,00	3.272.597,84	26.418,21	0,81%	0,03%	0,81%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.312.352,25	0,00	38.494,15	5.306.883,36	33.025,26	0,62%	0,73%	0,62%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.997.972,89	0,00	0,00	2.010.189,84	12.216,95	0,61%	0,76%	0,61%
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	648.921,00	0,00	38.494,15	613.398,78	2.971,93	0,46%	1,01%	0,48%
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.028.039,15	0,00	0,00	1.032.450,53	4.411,38	0,43%	1,09%	0,40%
TOWER BRIDGE II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	285.910,76	0,00	0,00	287.106,98	1.196,22	0,42%	2,97%	0,42%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	4.427,28	0,00	0,00	4.433,99	6,71	0,15%	2,49%	0,15%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.828.026,64	0,00	0,00	7.839.519,50	11.492,86	0,15%	2,45%	0,15%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	915.412,63	0,00	0,00	916.731,13	1.318,50	0,14%	0,44%	0,14%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.574.331,06	1.046.158,19	912.512,68	9.721.996,20	14.019,63	0,13%	2,45%	0,15%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	9.052.184,85	1.046.158,18	912.512,68	9.182.679,79	-3.150,56	-0,03%	2,51%	0,01%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.014.967,06	0,00	0,00	8.009.243,26	-5.723,80	-0,07%	3,27%	-0,07%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.509.749,11	0,00	0,00	4.505.864,62	-3.884,49	-0,09%	3,29%	-0,09%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	12.139.179,19	0,00	0,00	12.128.619,74	-10.559,45	-0,09%	3,29%	-0,09%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	2.222.360,42	0,00	0,00	2.208.302,73	-14.057,69	-0,63%	0,63%	-0,63%
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	7.101,94	0,00	0,00	6.397,80	-704,14	-9,91%	12,80%	-9,91%
Total Renda Fixa					76.974,37	0,11%	2,31%	

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(%)
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.798.244,20	0,00	0,00	2.805.239,54	6.995,34	0,25%	6,26%	0,25%
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	1.716.112,29	0,00	0,00	1.719.091,59	2.979,30	0,17%	6,13%	0,17%
CONQUEST FIP - FCCQ11	3.082.534,98	0,00	0,00	3.079.504,74	-3.030,24	-0,10%	-	-
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.267.086,99	0,00	0,00	1.265.508,28	-1.578,71	-0,12%	5,09%	-0,12%
ÁQUILLA FII - AQLL11	3.375.782,99	0,00	0,00	3.344.359,16	-31.423,83	-0,93%	0,00%	0,00%
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	979.327,25	0,00	0,00	931.244,47	-48.082,78	-4,91%	12,26%	-4,91%
Total Renda Variável					-74.140,92	-0,56%	4,57%	

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	5.314.528,03	0,00	104.251,76	5.306.883,36	96.607,09	1,83%	1,84%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.191.531,69	0,00	0,00	3.272.597,84	81.066,15	2,54%	2,54%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.975.111,80	0,00	0,00	2.010.189,84	35.078,04	1,78%	1,78%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	611.443,81	0,00	0,00	627.081,17	15.637,36	2,56%	2,56%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	907.601,96	0,00	0,00	916.731,13	9.129,17	1,01%	1,01%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	336.733,73	0,00	0,00	345.817,15	9.083,42	2,70%	2,70%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	709.867,39	0,00	104.251,76	613.398,78	7.783,15	1,14%	1,19%
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.025.391,68	0,00	0,00	1.032.450,53	7.058,85	0,69%	0,69%
TOWER BRIDGE II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	283.825,18	0,00	0,00	287.106,98	3.281,80	1,16%	1,16%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	4.497,76	0,00	0,00	4.433,99	-63,77	-1,42%	-1,42%
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	8.364,97	0,00	0,00	6.397,80	-1.967,17	-23,52%	-23,52%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	2.248.727,14	0,00	8.234,02	2.208.302,73	-32.190,39	-1,44%	-1,80%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.950.260,13	0,00	0,00	7.839.519,50	-110.740,63	-1,39%	-1,39%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.629.202,45	8.304,84	0,00	4.505.864,62	-131.642,67	-2,84%	-2,84%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.822.582,87	1.270.538,69	2.224.466,77	9.721.996,20	-146.658,59	-1,40%	-1,38%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	10.294.934,40	1.270.538,68	2.224.466,77	9.182.679,79	-158.326,52	-1,59%	-1,57%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.434.833,72	1.893.091,40	117.742,29	8.009.243,26	-200.939,57	-2,49%	-2,55%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	10.697.146,43	2.010.833,71	235.484,60	12.128.619,74	-343.875,80	-2,79%	-2,76%
Total Renda Fixa					-861.680,08	-1,26%	

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 VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.287.252,16	0,00	0,00	1.265.508,28	-21.743,88	-1,69%	-1,69%
ÁQUILLA FII - AQLL11	3.445.306,60	0,00	0,00	3.344.359,16	-100.947,44	-2,93%	0,00%
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	1.847.608,97	0,00	0,00	1.719.091,59	-128.517,38	-6,96%	-6,96%
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	1.070.214,39	0,00	0,00	931.244,47	-138.969,92	-12,99%	-12,99%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.997.764,04	0,00	0,00	2.805.239,54	-192.524,50	-6,42%	-6,42%
CONQUEST FIP - FCCQ11	3.802.571,69	0,00	0,00	3.079.504,74	-723.066,95	-19,02%	-
Total Renda Variável					-1.305.770,07	-9,04%	

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 IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.923.964,94	1.270.538,69	4.098.042,64	9.721.996,20	625.535,21	5,28%	5,36%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	11.356.092,97	1.270.538,68	4.015.160,46	9.182.679,79	571.208,60	5,04%	5,09%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.441.319,63	0,00	0,00	7.839.519,50	398.199,87	5,35%	5,35%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.713.963,52	0,00	2.750.926,19	5.306.883,36	343.846,03	5,59%	5,73%
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	9.476.365,65	0,00	9.136.978,86	613.398,78	274.011,99	5,36%	5,52%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.811.377,86	0,00	4.000.000,00	2.010.189,84	198.811,98	5,63%	5,71%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.212.737,42	900.000,00	0,00	3.272.597,84	159.860,42	5,47%	5,71%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.945.757,57	0,00	1.989.296,61	0,00	43.539,04	2,24%	5,40%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	593.347,76	0,00	0,00	627.081,17	33.733,41	5,69%	5,69%
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.005.737,06	0,00	0,00	1.032.450,53	26.713,47	2,66%	2,66%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.175.949,42	0,00	1.201.068,25	0,00	25.118,83	2,14%	6,11%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	894.138,56	0,00	0,00	916.731,13	22.592,57	2,53%	2,53%
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	326.773,14	0,00	0,00	345.817,15	19.044,01	5,83%	5,83%
TOWER BRIDGE II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	274.150,40	0,00	0,00	287.106,98	12.956,58	4,73%	4,73%
BRADERCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	546.605,54	0,00	558.306,46	0,00	11.700,92	2,14%	6,14%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	142.560,41	105.897,59	253.342,37	0,00	4.884,37	1,97%	5,41%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	4.200,29	0,00	0,00	4.433,99	233,70	5,56%	5,56%
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	117.794,02	0,00	105.891,07	6.397,80	-5.505,15	-53,89%	-94,57%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	2.278.764,35	0,00	8.234,02	2.208.302,73	-62.227,60	-2,73%	-3,09%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	43.483,36	4.558.826,00	0,00	4.505.864,62	-96.444,74	4,94%	5,09%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	427.015,87	7.820.314,08	117.742,29	8.009.243,26	-120.344,40	4,89%	5,40%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	427.076,48	12.162.514,94	235.484,60	12.128.619,74	-225.487,08	4,19%	5,38%
Total Renda Fixa					2.261.982,03	3,47%	

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 VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.211.230,03	0,00	18.790,19	1.265.508,28	73.068,44	6,06%	4,48%
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	1.765.101,99	0,00	0,00	1.719.091,59	-46.010,40	-2,61%	-2,61%
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	980.970,87	0,00	0,00	931.244,47	-49.726,40	-5,07%	-43,20%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.869.194,37	0,00	0,00	2.805.239,54	-63.954,83	-2,23%	-2,23%
ÁQUILLA FII - AQLL11	3.459.142,22	0,00	0,00	3.344.359,16	-114.783,06	-3,32%	0,00%
CONQUEST FIP - FCCQ11	3.818.274,32	0,00	0,00	3.079.504,74	-738.769,58	-19,35%	-
Total Renda Variável					-940.175,83	-6,68%	