

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

SIRU 

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 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	31.844.186,45	6,78%	223	1,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	25.614.526,84	5,45%	293	1,60%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	49.087.765,68	10,45%	178	3,82%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	20.934.651,75	4,46%	360	1,59%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	624.213,34	0,13%	193	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	58.107.046,98	12,37%	675	1,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	10.720.798,04	2,28%	11	11,77%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	5.840.768,05	1,24%	94	1,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	43.295.435,01	9,22%	703	0,73%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	54.367.368,37	11,57%	604	0,97%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	66.364.725,64	14,13%	98	4,23%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	14.317.061,46	3,05%	59	2,66%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	12.646.651,79	2,69%	475	0,14%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	29.212.314,10	6,22%	774	0,64%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
WESTERN ASSET ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	4.208.460,35	0,90%	811	0,27%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	95.554,03	0,02%	46	0,37%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	Não se aplica	Não se aplica	19.604,93	0,00%	1	0,83%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+30 a D+2880	Não há	6.866.019,79	1,46%	62	1,77%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
SANTANDER SELEÇÃO MAX FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.976.067,72	0,42%	8.671	13,79%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	12.795.736,57	2,72%	2.684	7,35%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	D+12	Não há	3.175.928,14	0,68%	353	5,13%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	D+5	Não há	7.209.610,53	1,53%	33	2,93%	Artigo 8º, Inciso IV

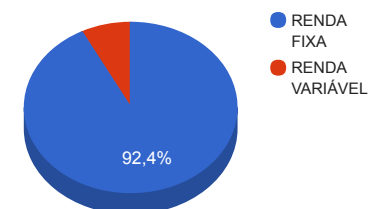
Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	Não se aplica	Não se aplica	3.355.310,94	0,71%	117	0,61%	Artigo 8º, Inciso V
ÁTICO GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	3.680.036,18	0,78%	33	1,09%	Artigo 8º, Inciso V
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS12	S/Info	Não se aplica	2.127.616,98	0,45%		3,41%	Artigo 8º, Inciso VI
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se aplica	Não se aplica	1.337.435,28	0,28%		2,70%	Artigo 8º, Inciso VI
		TOTAL -	469.824.894,94				

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

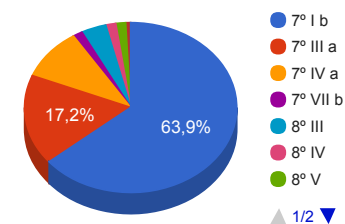
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	300.436.760,51	63,95%	10,00%	64,49%	100,00%	169.388.134,43
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	80.681.787,10	17,17%	0,00%	15,00%	80,00%	295.178.128,85
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	46.067.426,24	9,81%	5,00%	14,00%	30,00%	94.880.042,24
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	115.158,96	0,02%	0,00%	0,01%	5,00%	23.376.085,79
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	6.866.019,79	1,46%	0,00%	0,00%	5,00%	16.625.224,96
Total Renda Fixa	100,00%	434.167.152,60	92,41%	15,00	93,50	380,00	-

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	17.947.732,43	3,82%	2,00%	4,00%	15,00%	52.526.001,81
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	7.209.610,53	1,53%	0,00%	1,00%	5,00%	16.281.634,22
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	7.035.347,12	1,50%	0,00%	1,00%	5,00%	16.455.897,63
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	3.465.052,26	0,74%	0,00%	0,05%	5,00%	20.026.192,49
Total Renda Variável	30,00%	35.657.742,34	7,59%	2,00	6,05	80,00	-

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 "	0,00	0,00%	0,00%	50,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	300.436.760,51	63,95%	10,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80.681.787,10	17,17%	0,00%	80,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	80,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	46.067.426,24	9,81%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso V, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 7º, Inciso VI	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	115.158,96	0,02%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	6.866.019,79	1,46%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	434.167.152,60	92,41%	15,00	380,00

Artigos - Renda Variável	Base: junho / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I	0,00	0,00%	0,00%	30,00%
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	17.947.732,43	3,82%	2,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	7.209.610,53	1,53%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	7.035.347,12	1,50%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	3.465.052,26	0,74%	0,00%	5,00%
Total Renda Variável	35.657.742,34	7,59%	2,00	80,00

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+	1,51%	8,97%	2,02%	8,97%	18,13%	39,00%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,49%	8,81%	1,92%	8,81%	17,98%	38,93%	0,20%	1,814%	6,47%
IRF-M	1,35%	8,24%	2,20%	8,24%	16,77%	36,01%	-	-	-
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%
CDI + 3,50% ao ano	1,10%	7,45%	3,40%	7,45%	16,79%	37,91%	-	-	-
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	22,20%	8,50%	14,48%	8,50%	-69,63%	-59,10%	0,39%	42,634%	74,26%
110% do CDI	0,89%	6,23%	2,80%	6,23%	14,22%	32,05%	-	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	-4,08%	-16,58%	-9,97%	-16,58%	-19,38%	-41,68%	0,00%	27,769%	-
Selic	0,81%	5,65%	2,54%	5,65%	12,87%	28,79%	-	-	-
BRAPREMIUM 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%	-	-	-
WESTERN ASSET ATIVO FI RENDA FIXA	0,93%	6,25%	2,32%	6,25%	13,55%	30,12%	0,40%	0,354%	1,43%
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 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%	-	-	-
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	0,64%	6,54%	1,19%	6,54%	13,15%	32,29%	0,40%	1,324%	5,15%

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

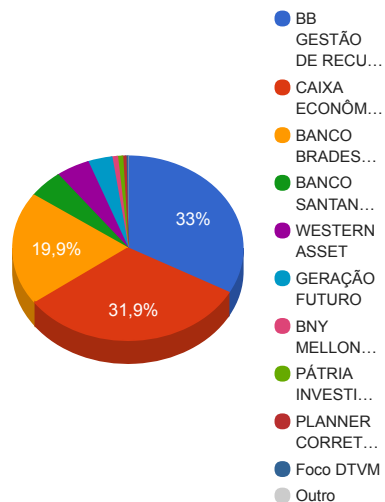
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,51%	5,40%	1,30%	5,40%	11,73%	30,08%	0,20%	0,925%	3,57%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	0,51%	5,37%	1,26%	5,37%	11,70%	30,41%	0,10%	0,930%	3,57%
IMA-B	0,16%	5,46%	-1,34%	5,46%	13,32%	32,28%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,57%	2,57%	2,08%	2,57%	5,52%	15,76%	0,20%	0,514%	4,51%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,34%	6,00%	0,41%	6,00%	13,17%	-	0,20%	1,412%	6,18%
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	0,15%	5,56%	-1,42%	5,56%	13,68%	31,83%	0,20%	2,485%	9,95%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,15%	5,35%	-1,39%	5,35%	13,12%	31,49%	0,20%	2,448%	9,79%
IPCA	-0,23%	1,18%	0,22%	1,18%	3,00%	12,11%	-	-	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,95%	7,05%	1,52%	7,05%	15,08%	34,39%	0,20%	1,166%	4,69%
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%
BRANCO 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)

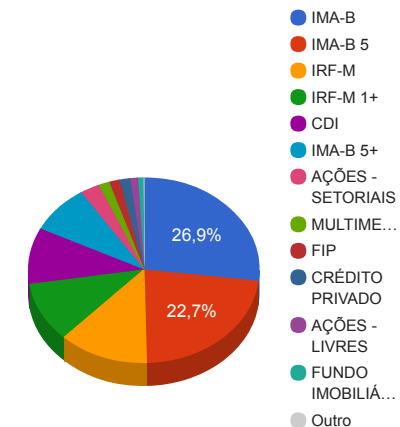
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	0,88%	11,27%	2,07%	11,27%	26,62%	42,05%	-	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-32,65%	0,02%	1,50%	0,000%	32,72%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS12	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-	0,14%	-	-
CDI	0,81%	5,65%	2,54%	5,65%	12,85%	28,75%	-	-	-
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	0,84%	4,33%	0,78%	4,33%	14,26%	32,95%	2,00%	0,456%	1,95%
IBX-50	0,50%	4,61%	-2,94%	4,61%	21,55%	16,57%	-	-	-
SANTANDER SELEÇÃO MAX FIC AÇÕES	0,31%	10,75%	-2,41%	10,75%	24,86%	26,54%	0,50%	5,540%	20,43%
Ibovespa	0,30%	4,44%	-3,21%	4,44%	22,07%	18,50%	-	-	-
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	1,44%	-1,23%	-5,11%	-1,23%	17,86%	7,41%	2,00%	6,027%	21,64%
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%
IPCA	-0,23%	1,18%	0,22%	1,18%	3,00%	12,11%	-	-	-
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	-	-	-	-	-	-	1,00%	0,004%	2,04%
ÁTICO GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,50%	0,001%	0,01%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	155.017.730,63	32,99%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	149.841.913,98	31,89%
BANCO BRADESCO	93.328.438,89	19,86%
BANCO SANTANDER	22.910.719,47	4,88%
WESTERN ASSET	22.138.868,92	4,71%
GERAÇÃO FUTURO	15.971.664,71	3,40%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	3.680.036,18	0,78%
PÁTRIA INVESTIMENTOS	3.355.310,94	0,71%
PLANNER CORRETORA	2.127.616,98	0,45%
Foco DTVM	1.337.435,28	0,28%
BRL Trust Investimentos	95.554,03	0,02%
GRADUAL INVESTIMENTOS	19.604,93	0,00%



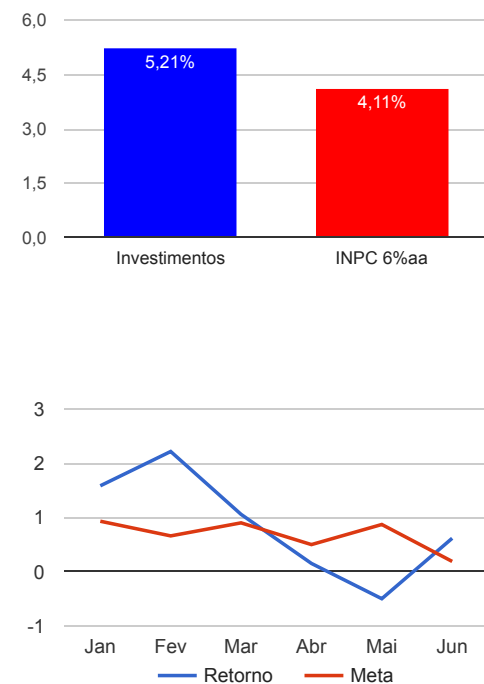
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	126.572.862,06	26,94%
IMA-B 5	106.795.071,25	22,73%
IRF-M	58.107.046,98	12,37%
IRF-M 1+	49.087.765,68	10,45%
CDI	46.067.426,24	9,81%
IMA-B 5+	39.931.588,30	8,50%
AÇÕES - SETORIAIS	12.795.736,57	2,72%
MULTIMERCADO	7.209.610,53	1,53%
FIP	7.035.347,12	1,50%
CRÉDITO PRIVADO	6.866.019,79	1,46%
AÇÕES - LIVRES	5.151.995,86	1,10%
FUNDO IMOBILIÁRIO	3.465.052,26	0,74%
IDKA IPCA 2A	624.213,34	0,13%
FIDC - FECHADO	115.158,96	0,02%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	436.576.227,58	31.006.264,66	29.059.550,65	445.460.368,97	6.937.427,38	1,58%	0,93%	170,11%	2,02%
Fevereiro	445.460.368,97	28.327.963,91	26.609.879,30	457.075.664,60	9.897.211,02	2,21%	0,66%	335,34%	1,71%
Março	457.075.664,60	55.817.962,90	54.252.429,76	463.486.562,84	4.845.365,10	1,06%	0,90%	118,02%	1,66%
Abril	463.486.562,84	6.900.951,17	5.127.055,12	465.972.314,50	711.855,61	0,15%	0,50%	30,76%	1,43%
Mai	465.972.314,50	6.859.029,84	5.356.198,78	465.154.827,18	-2.320.318,38	-0,50%	0,87%	-56,93%	8,41%
Junho	465.154.827,18	7.201.710,20	5.408.999,65	469.824.894,94	2.877.357,21	0,62%	0,19%	332,55%	1,76%
Acumulado no ano					22.948.897,94	5,21%	4,11%	126,90%	

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(%)
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	78.194,93	0,00	2.978,79	95.554,03	20.337,89	26,01%	42,63%	26,02%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	48.185.452,64	184.704,24	0,00	49.087.765,68	717.608,80	1,48%	1,81%	1,49%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	57.348.101,11	0,00	0,00	58.107.046,98	758.945,87	1,32%	1,37%	1,32%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,00	6.777.585,18	0,00	6.866.019,79	88.434,61	1,30%	1,17%	0,95%
WESTERN ASSET ATIVO FI RENDA FIXA	4.169.674,66	0,00	0,00	4.208.460,35	38.785,69	0,93%	0,35%	0,93%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	12.303.351,63	239.420,78	0,00	12.646.651,79	103.879,38	0,83%	0,01%	0,83%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	34.347.273,07	0,00	5.406.020,86	29.212.314,10	271.061,89	0,79%	0,03%	0,81%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	10.652.859,20	0,00	0,00	10.720.798,04	67.938,84	0,64%	1,32%	0,64%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	620.701,48	0,00	0,00	624.213,34	3.511,86	0,57%	0,51%	0,57%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	31.665.276,63	0,00	0,00	31.844.186,45	178.909,82	0,57%	0,51%	0,57%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	43.074.911,33	0,00	0,00	43.295.435,01	220.523,68	0,51%	0,93%	0,51%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	20.828.672,39	0,00	0,00	20.934.651,75	105.979,36	0,51%	0,93%	0,51%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.820.854,00	0,00	0,00	5.840.768,05	19.914,05	0,34%	1,41%	0,34%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	66.264.216,53	0,00	0,00	66.364.725,64	100.509,11	0,15%	2,49%	0,15%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	54.287.664,96	0,00	0,00	54.367.368,37	79.703,41	0,15%	2,45%	0,15%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	25.632.832,29	0,00	0,00	25.614.526,84	-18.305,45	-0,07%	3,27%	-0,07%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	14.329.526,23	0,00	0,00	14.317.061,46	-12.464,77	-0,09%	3,29%	-0,09%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	20.438,86	0,00	0,00	19.604,93	-833,93	-4,08%	27,77%	-4,08%
Total Renda Fixa					2.744.440,11	0,64%	1,64%	

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 SELEÇÃO FI AÇÕES	3.130.811,50	0,00	0,00	3.175.928,14	45.116,64	1,44%	6,03%	1,44%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	7.149.744,06	0,00	0,00	7.209.610,53	59.866,47	0,84%	0,46%	0,84%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS12	2.117.381,47	0,00	0,00	2.127.616,98	10.235,51	0,48%	-	0,48%
SANTANDER SELEÇÃO MAX FIC AÇÕES	1.969.986,35	0,00	0,00	1.976.067,72	6.081,37	0,31%	5,54%	0,31%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	12.763.828,22	0,00	0,00	12.795.736,57	31.908,35	0,25%	6,26%	0,25%
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	3.358.322,68	0,00	0,00	3.355.310,94	-3.011,74	-0,09%	0,00%	-0,09%
ÁTICO GERAÇÃO DE ENERGIA MULTIESTRATÉGIA FIP	3.684.749,04	0,00	0,00	3.680.036,18	-4.712,86	-0,13%	0,00%	-0,13%
ÁQUILLA FII - AQLL11	1.350.001,92	0,00	0,00	1.337.435,28	-12.566,64	-0,93%	0,00%	0,00%
Total Renda Variável					132.917,10	0,37%	3,38%	

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 (%)
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	56.920.312,27	0,00	0,00	58.107.046,98	1.186.734,71	2,08%	2,08%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	44.128.310,16	0,00	15.880.797,26	29.212.314,10	964.801,20	2,48%	2,54%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	34.482.575,23	13.760.922,95	0,00	49.087.765,68	844.267,50	1,79%	1,92%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	31.195.838,61	0,00	0,00	31.844.186,45	648.347,84	2,08%	2,08%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	42.740.808,23	0,00	0,00	43.295.435,01	554.626,78	1,30%	1,30%
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	11.900.391,39	423.183,08	1.400,00	12.646.651,79	324.477,32	2,68%	2,70%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	20.673.867,41	0,00	0,00	20.934.651,75	260.784,34	1,26%	1,26%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	10.595.014,27	0,00	0,00	10.720.798,04	125.783,77	1,19%	1,19%
WESTERN ASSET ATIVO FI RENDA FIXA	4.112.859,29	0,00	0,00	4.208.460,35	95.601,06	2,32%	2,32%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,00	6.777.585,18	0,00	6.866.019,79	88.434,61	1,30%	1,52%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.816.691,77	0,00	0,00	5.840.768,05	24.076,28	0,41%	0,41%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	83.468,20	0,00	10.056,29	95.554,03	22.142,12	28,81%	14,48%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	611.509,17	0,00	0,00	624.213,34	12.704,17	2,08%	2,08%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	21.776,43	0,00	0,00	19.604,93	-2.171,50	-9,97%	-9,97%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	14.723.529,45	0,00	0,00	14.317.061,46	-406.467,99	-2,76%	-2,76%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	26.284.078,42	0,00	0,00	25.614.526,84	-669.551,58	-2,55%	-2,55%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	55.135.358,84	0,00	0,00	54.367.368,37	-767.990,47	-1,39%	-1,39%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	67.319.069,63	0,00	0,00	66.364.725,64	-954.343,99	-1,42%	-1,42%
Total Renda Fixa					2.352.256,17	0,55%	

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 (%)
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	7.153.710,43	0,00	0,00	7.209.610,53	55.900,10	0,78%	0,78%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS12	2.106.312,14	0,00	0,00	2.127.616,98	21.304,84	1,01%	-
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	3.363.681,88	0,00	0,00	3.355.310,94	-8.370,94	-0,25%	-
ÁTICO GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	3.693.853,98	0,00	0,00	3.680.036,18	-13.817,80	-0,37%	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	1.377.804,95	0,00	0,00	1.337.435,28	-40.369,67	-2,93%	0,00%
SANTANDER SELEÇÃO MAX FIC AÇÕES	2.024.929,07	0,00	0,00	1.976.067,72	-48.861,35	-2,41%	-2,41%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	3.346.899,50	0,00	0,00	3.175.928,14	-170.971,36	-5,11%	-5,11%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	13.673.912,12	0,00	0,00	12.795.736,57	-878.175,55	-6,42%	-6,42%
Total Renda Variável					-1.083.361,73	-2,95%	

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 IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	40.384.116,11	14.000.000,00	0,00	58.107.046,98	3.722.930,87	7,83%	8,09%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	50.481.923,74	12.679.624,03	0,00	66.364.725,64	3.203.177,87	5,14%	5,56%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	52.105.479,75	6.574.860,50	18.000.000,00	43.295.435,01	2.615.094,76	5,11%	5,40%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	42.816.814,34	2.347,87	15.893.225,24	29.212.314,10	2.286.377,13	5,64%	5,71%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	37.188.757,46	15.174.751,13	0,00	54.367.368,37	2.003.859,78	4,68%	5,35%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	31.046.008,31	0,00	873.588,75	31.844.186,45	1.671.766,89	5,48%	2,57%
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	69.812.218,17	423.183,08	59.228.118,63	12.646.651,79	1.639.369,17	5,38%	5,83%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	24.050.538,82	14.538.336,46	14.294.854,84	25.614.526,84	1.320.506,40	5,11%	5,40%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	47.884.031,01	0,00	49.087.765,68	1.203.734,67	3,12%	8,81%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	19.867.576,30	0,00	0,00	20.934.651,75	1.067.075,45	5,37%	5,37%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	10.062.887,78	0,00	0,00	10.720.798,04	657.910,26	6,54%	6,54%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	16.885.179,02	0,00	17.333.127,39	0,00	447.948,37	3,02%	5,71%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.662.484,12	0,00	157.349,80	5.840.768,05	335.633,73	5,98%	6,00%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	0,00	14.042.590,96	0,00	14.317.061,46	274.470,50	2,28%	5,38%
WESTERN ASSET ATIVO FI RENDA FIXA	0,00	4.000.000,00	0,00	4.208.460,35	208.460,35	5,21%	6,25%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,00	6.777.585,18	0,00	6.866.019,79	88.434,61	1,30%	7,05%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	608.919,08	0,00	17.401,33	624.213,34	32.695,59	5,47%	5,48%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	88.067,22	0,00	16.447,28	95.554,03	23.934,09	31,48%	8,50%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	23.502,81	0,00	0,00	19.604,93	-3.897,88	-16,58%	-16,58%
Total Renda Fixa					22.799.482,61	5,63%	

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 (%)
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	6.910.572,25	0,00	0,00	7.209.610,53	299.038,28	4,33%	4,33%
SANTANDER SELEÇÃO MAX FIC AÇÕES	1.784.258,49	0,00	0,00	1.976.067,72	191.809,23	10,75%	10,75%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS12	2.042.301,77	0,00	0,00	2.127.616,98	85.315,21	4,18%	-
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	3.360.165,48	16.572,46	0,00	3.355.310,94	-21.427,00	-0,63%	-
ÁTICO GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	3.708.194,10	0,00	0,00	3.680.036,18	-28.157,92	-0,76%	-
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	3.215.466,39	0,00	0,00	3.175.928,14	-39.538,25	-1,23%	-1,23%
ÁQUILLA FII - AQLL11	1.383.337,92	0,00	0,00	1.337.435,28	-45.902,64	-3,32%	0,00%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	13.087.458,15	0,00	0,00	12.795.736,57	-291.721,58	-2,23%	-2,23%
Total Renda Variável					149.415,33	0,42%	