

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

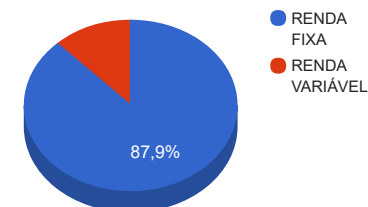
Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	64.691.353,52	18,07%	703	1,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	53.629.847,53	14,98%	307	2,95%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.518.739,30	0,42%	360	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	18.113.668,51	5,06%	11	19,89%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	22.907.793,82	6,40%	145	2,48%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADERCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	D+1	16/05/2019	11.474.923,28	3,20%	11	15,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	23.272.604,83	6,50%	1.197	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	11.507.322,42	3,21%	604	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	72.000.084,23	20,11%	98	4,59%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	13.921.235,68	3,89%	95	3,67%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BTG PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA	D+0 ou D+1	Não há	12.410.197,00	3,47%	12	8,43%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	2.279.012,08	0,64%	62	0,16%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+30 a D+2880	Não há	7.010.449,23	1,96%	62	1,81%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	6.854.352,66	1,91%	20.787	1,67%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	23/08/2017	1.180.775,00	0,33%	116	0,33%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	8.053.847,88	2,25%	2.684	4,63%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	6.720.778,10	1,88%	2.094	2,40%	Artigo 8º, Inciso IV
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	D+5	Não há	8.853.787,73	2,47%	33	3,60%	Artigo 8º, Inciso IV
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	951.510,04	0,27%	19	1,02%	Artigo 8º, Inciso V
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	Não se aplica	Não se aplica	3.984.888,22	1,11%	117	0,72%	Artigo 8º, Inciso V
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	Não se aplica	Não se aplica	5.340.267,93	1,49%		0,22%	Artigo 8º, Inciso VI
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPF11	Não se aplica	Não se aplica	1.406.847,96	0,39%		0,76%	Artigo 8º, Inciso VI
<b>TOTAL -</b>			<b>358.084.286,95</b>				

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

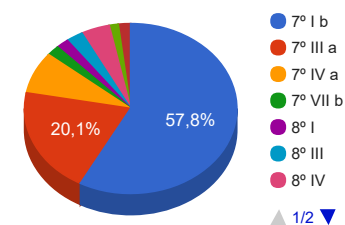
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	207.116.253,21	57,84%	30,00%	35,00%	70,00%	43.542.747,66
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	72.000.084,23	20,11%	10,00%	20,00%	60,00%	142.850.487,94
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	28.610.444,76	7,99%	5,00%	5,00%	30,00%	78.814.841,33
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	15,00%	53.712.643,04
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	17.904.214,35
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	7.010.449,23	1,96%	0,00%	2,50%	5,00%	10.893.765,12
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>314.737.231,43</b>	<b>87,89%</b>	<b>45,00</b>	<b>75,00</b>	<b>185,00</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%	6.854.352,66	1,91%	0,00%	0,00%	5,00%	11.049.861,69
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	9.234.622,88	2,58%	2,00%	10,00%	12,00%	33.735.491,55
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	15.574.565,83	4,35%	2,00%	5,00%	5,00%	2.329.648,52
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	4.936.398,26	1,38%	0,00%	5,00%	5,00%	12.967.816,09
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	6.747.115,89	1,88%	0,00%	5,00%	5,00%	11.157.098,46
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>43.347.055,52</b>	<b>12,11%</b>	<b>4,00</b>	<b>25,00</b>	<b>32,00</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 "	207.116.253,21	57,84%	30,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	72.000.084,23	20,11%	10,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	28.610.444,76	7,99%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	7.010.449,23	1,96%	0,00%	5,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>314.737.231,43</b>	<b>87,89%</b>	<b>45,00</b>	<b>185,00</b>

Artigos - Renda Variável	Base: junho / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I	6.854.352,66	1,91%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso III	9.234.622,88	2,58%	2,00%	12,00%
Artigo 8º, Inciso IV	15.574.565,83	4,35%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	4.936.398,26	1,38%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	6.747.115,89	1,88%	0,00%	5,00%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>43.347.055,52</b>	<b>12,11%</b>	<b>4,00</b>	<b>32,00</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	0,89%	6,25%	2,69%	6,25%	13,46%	30,44%	-	-	-
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%
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%
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%
IPCA + 6,00% ao ano	0,26%	4,13%	1,64%	4,13%	9,15%	25,94%	-	-	-
BTG PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA	0,47%	1,72%	-0,76%	1,72%	3,75%	13,38%	0,15%	0,240%	3,85%
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%
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%
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%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP	0,15%	5,39%	-1,36%	5,39%	13,15%	31,92%	0,20%	2,449%	9,82%
IPCA	-0,23%	1,18%	0,22%	1,18%	3,00%	12,11%	-	-	-
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%
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%

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

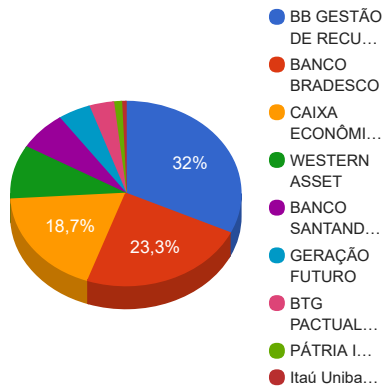
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5+	-0,06%	5,50%	-2,63%	5,50%	14,42%	34,03%	-	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,09%	5,09%	-2,84%	5,09%	13,85%	32,59%	0,20%	3,287%	12,82%

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

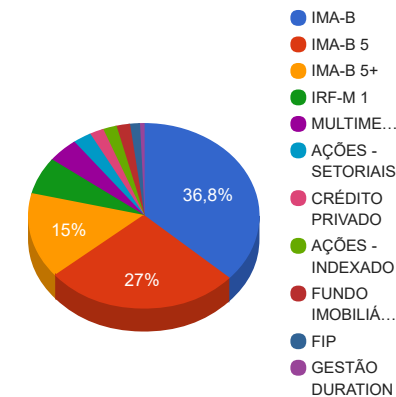
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	0,88%	11,27%	2,07%	11,27%	26,62%	42,05%	-	-	-
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	2,19%	15,20%	1,81%	15,20%	17,52%	24,10%	0,40%	7,782%	22,78%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-	-	0,30%	-	-
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%
S&P 500	0,48%	8,24%	2,57%	8,24%	15,46%	17,46%	-	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	1,12%	13,27%	5,01%	13,27%	29,19%	48,32%	1,00%	2,950%	7,80%
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%
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%
Não Possui	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,50%	0,008%	23,04%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	114.681.727,62	32,03%
BANCO BRADESCO	83.475.007,51	23,31%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	66.823.638,56	18,66%
WESTERN ASSET	33.688.234,34	9,41%
BANCO SANTANDER	24.426.533,12	6,82%
GERAÇÃO FUTURO	16.315.048,50	4,56%
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS	12.410.197,00	3,47%
PÁTRIA INVESTIMENTOS	3.984.888,22	1,11%
Itaú Unibanco	2.279.012,08	0,64%



Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	131.811.359,43	36,81%
IMA-B 5	96.733.958,33	27,01%
IMA-B 5+	53.629.847,53	14,98%
IRF-M 1	23.272.604,83	6,50%
MULTIMERCADO	15.574.565,83	4,35%
AÇÕES - SETORIAIS	9.234.622,88	2,58%
CRÉDITO PRIVADO	7.010.449,23	1,96%
AÇÕES - INDEXADO	6.854.352,66	1,91%
FUNDO IMOBILIÁRIO	6.747.115,89	1,88%
FIP	4.936.398,26	1,38%
GESTÃO DURATION	2.279.012,08	0,64%

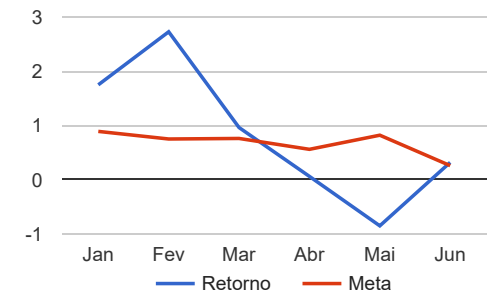
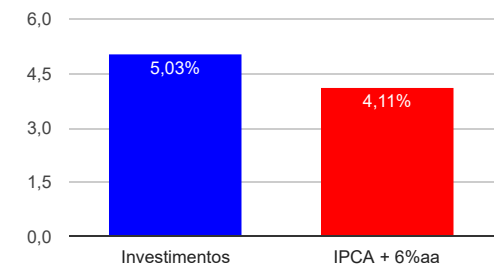




Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	316.694.151,95	16.186.674,39	5.832.522,08	332.762.274,86	5.713.970,60	1,75%	0,89%	196,31%	2,61%
Fevereiro	332.762.274,86	10.110.678,08	7.183.643,36	344.830.683,60	9.141.374,02	2,72%	0,75%	363,09%	1,69%
Março	344.830.683,60	17.998.289,25	18.041.475,61	348.100.630,40	3.313.133,16	0,96%	0,76%	125,68%	1,92%
Abril	348.100.630,40	6.828.114,55	7.288.033,54	347.855.613,79	214.902,38	0,06%	0,56%	11,07%	1,73%
Mai	347.855.613,79	7.601.852,25	8.042.063,54	344.465.169,66	-2.950.232,84	-0,85%	0,82%	-103,23%	9,66%
Junho	344.465.169,66	6.810.000,00	11.269.541,81	341.105.801,22	1.100.173,37	0,32%	0,26%	124,94%	2,00%
Acumulado no ano					16.533.320,69	5,03%	4,11%	122,39%	

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(%)	
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.257.087,33	0,00	0,00	2.279.012,08	21.924,75	0,97%	0,83%	0,97%	
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	6.944.636,75	0,00	0,00	7.010.449,23	65.812,48	0,95%	1,17%	0,95%	
BRADESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	11.396.937,19	0,00	0,00	11.474.923,28	77.986,09	0,68%	0,82%	0,68%	
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	17.998.880,25	0,00	0,00	18.113.668,51	114.788,26	0,64%	1,32%	0,64%	
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	27.732.214,25	6.810.000,00	11.487.500,00	23.272.604,83	217.890,58	0,63%	0,18%	0,87%	
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	64.361.850,57	0,00	0,00	64.691.353,52	329.502,95	0,51%	0,93%	0,51%	
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	1.511.050,85	0,00	0,00	1.518.739,30	7.688,45	0,51%	0,93%	0,51%	
BTG PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA	12.351.610,00	0,00	0,00	12.410.197,00	58.587,00	0,47%	0,24%	0,47%	
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%	
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	71.891.040,39	0,00	0,00	72.000.084,23	109.043,84	0,15%	2,49%	0,15%	
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.490.452,51	0,00	0,00	11.507.322,42	16.869,91	0,15%	2,45%	0,15%	
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIX...	22.874.243,43	0,00	0,00	22.907.793,82	33.550,39	0,15%	2,45%	0,15%	
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	53.676.081,68	0,00	0,00	53.629.847,53	-46.234,15	-0,09%	3,29%	-0,09%	
<b>Total Renda Fixa</b>						<b>1.054.504,45</b>	<b>0,33%</b>	<b>1,82%</b>	

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(%)
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	6.646.135,13	0,00	0,00	6.720.778,10	74.642,97	1,12%	2,95%	1,12%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	8.780.268,51	0,00	0,00	8.853.787,73	73.519,22	0,84%	0,46%	0,84%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	8.033.764,23	0,00	0,00	8.053.847,88	20.083,65	0,25%	6,26%	0,25%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	5.379.251,86	0,00	50.000,00	5.340.267,93	11.016,07	0,20%	-	0,00%
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	1.414.211,10	0,00	10.041,81	1.406.847,96	2.678,67	0,19%	7,78%	2,19%
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	6.842.473,67	0,00	0,00	6.854.352,66	11.878,99	0,17%	6,13%	0,17%
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	3.988.465,07	0,00	0,00	3.984.888,22	-3.576,85	-0,09%	0,00%	-0,09%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.182.248,00	0,00	0,00	1.180.775,00	-1.473,00	-0,12%	5,09%	-0,12%
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA FIP	952.855,32	0,00	0,00	951.510,04	-1.345,28	-0,14%	0,01%	-0,14%
Total Renda Variável					187.424,44	0,43%	3,51%	

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	63.862.639,04	0,00	0,00	64.691.353,52	828.714,48	1,30%	1,30%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	28.442.899,85	20.719.500,00	26.588.500,00	23.272.604,83	698.704,98	2,01%	2,63%
BTG PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA	12.505.455,00	0,00	334.784,05	12.410.197,00	239.526,05	1,93%	-0,76%
BRADERCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	11.562.662,25	0,00	316.237,70	11.474.923,28	228.498,73	1,99%	-0,76%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	17.901.146,48	0,00	0,00	18.113.668,51	212.522,03	1,19%	1,19%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	6.905.671,81	0,00	0,00	7.010.449,23	104.777,42	1,52%	1,52%
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%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	1.499.820,27	0,00	0,00	1.518.739,30	18.919,03	1,26%	1,26%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.277.761,52	0,00	0,00	2.279.012,08	1.250,56	0,05%	0,05%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.464.948,10	204.229,10	0,00	11.507.322,42	-161.854,78	-1,39%	-1,39%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIX...	23.223.569,73	0,00	0,00	22.907.793,82	-315.775,91	-1,36%	-1,36%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	72.727.059,98	316.237,70	0,00	72.000.084,23	-1.043.213,45	-1,43%	-1,42%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	55.196.532,34	0,00	0,00	53.629.847,53	-1.566.684,81	-2,84%	-2,84%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>-716.475,79</b>	<b>-0,22%</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 (%)
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	6.400.399,27	0,00	0,00	6.720.778,10	320.378,83	5,01%	5,01%
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA FIP	813.449,35	0,00	0,00	951.510,04	138.060,69	16,97%	-
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	8.785.139,43	0,00	0,00	8.853.787,73	68.648,30	0,78%	0,78%
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPF11	1.388.923,31	0,00	30.117,14	1.406.847,96	48.041,79	3,48%	1,81%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	5.462.130,98	0,00	150.000,00	5.340.267,93	28.136,95	0,51%	0,00%
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	3.994.829,85	0,00	0,00	3.984.888,22	-9.941,63	-0,25%	-
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.201.063,00	0,00	0,00	1.180.775,00	-20.288,00	-1,69%	-1,69%
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	7.366.776,51	0,00	0,00	6.854.352,66	-512.423,85	-6,96%	-6,96%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	8.606.586,05	0,00	0,00	8.053.847,88	-552.738,17	-6,42%	-6,42%
Total Renda Variável					-492.125,09	-1,12%	

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 (%)
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	67.917.160,86	316.237,70	0,00	72.000.084,23	3.766.685,67	5,55%	5,56%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	61.362.029,65	17.532,08	0,00	64.691.353,52	3.311.791,79	5,40%	5,40%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	41.739.196,48	10.000.000,00	0,00	53.629.847,53	1.890.651,05	5,03%	5,09%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	29.284.648,47	49.357.539,26	57.166.500,00	23.272.604,83	1.796.917,10	4,52%	6,11%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIX...	21.737.012,21	0,00	0,00	22.907.793,82	1.170.781,61	5,39%	5,39%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	17.002.075,08	0,00	0,00	18.113.668,51	1.111.593,43	6,54%	6,54%
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%
BRDESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	11.108.915,74	0,00	316.237,70	11.474.923,28	682.245,24	6,16%	3,29%
BTG PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA	12.200.800,00	0,00	334.784,05	12.410.197,00	544.181,05	4,47%	1,72%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	6.548.738,25	0,00	0,00	7.010.449,23	461.710,98	7,05%	7,05%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.185.609,13	4.933.196,43	0,00	11.507.322,42	388.516,86	4,44%	5,35%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.146.692,96	0,00	0,00	2.279.012,08	132.319,12	6,16%	6,16%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	1.441.326,53	0,00	0,00	1.518.739,30	77.412,77	5,37%	5,37%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	887.000,00	887.425,61	0,00	425,61	0,05%	5,71%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>16.104.032,85</b>	<b>5,29%</b>	

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 US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	5.933.297,53	0,00	0,00	6.720.778,10	787.480,57	13,27%	13,27%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	8.486.552,71	0,00	0,00	8.853.787,73	367.235,02	4,33%	4,33%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	5.303.958,33	0,00	275.000,00	5.340.267,93	311.309,60	5,93%	0,00%
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	1.291.809,23	0,00	62.197,14	1.406.847,96	177.235,87	13,89%	15,20%
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA FIP	816.825,88	0,00	0,00	951.510,04	134.684,16	16,49%	-
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.130.131,00	0,00	17.532,08	1.180.775,00	68.176,08	6,06%	4,48%
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	3.986.338,05	24.103,05	0,00	3.984.888,22	-25.552,88	-0,64%	-
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	7.037.805,08	0,00	0,00	6.854.352,66	-183.452,42	-2,61%	-2,61%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	8.237.462,26	0,00	0,00	8.053.847,88	-183.614,38	-2,23%	-2,23%
Total Renda Variável					1.453.501,62	3,44%	