

Relatório Analítico dos Investimentos em agosto de 2017

Carteira consolidada de investimentos - base (agosto / 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 | 36.154.663,40 | 9,76% | 711 | 0,57% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA | D+1 | Não há | 18.969.722,85 | 5,12% | 11 | 17,80% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+2 | Não há | 56.899.059,18 | 15,37% | 295 | 3,18% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA | D+1 | Não há | 1.580.891,03 | 0,43% | 355 | 0,12% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| BRADERCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA | D+1 | 16/05/2019 | 11.839.858,48 | 3,20% | 11 | 15,06% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+1 | Não há | 12.120.848,17 | 3,27% | 610 | 0,22% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | D+0 | Não há | 30.596.577,60 | 8,26% | 1.381 | 0,21% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP | D+1 | Não há | 24.134.105,25 | 6,52% | 158 | 3,07% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA | D+1 | Não há | 56.996.775,70 | 15,39% | 98 | 3,43% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a " |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+0 | Não há | 21.680.627,39 | 5,85% | 766 | 0,51% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+0 | 15/08/2022 | 14.289.133,19 | 3,86% | 95 | 3,67% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| BGT PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA | D+0 ou D+1 | Não há | 12.577.367,00 | 3,40% | 12 | 8,43% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| ITÁ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | D+1 | Não há | 2.364.230,55 | 0,64% | 62 | 0,16% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | D+0 | Não há | 18.314.699,35 | 4,95% | 534 | 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 | 7.313.592,56 | 1,98% | 61 | 1,71% | Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b " |
| GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES | D+4 | Não há | 5.588.714,41 | 1,51% | 20.225 | 1,51% | Artigo 8º, Inciso I |
| GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES | D+4 | Não há | 8.308.612,61 | 2,24% | 2.555 | 6,38% | Artigo 8º, Inciso III |
| CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES | D+33 | 23/08/2017 | 1.279.377,00 | 0,35% | 116 | 0,33% | Artigo 8º, Inciso III |
| WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO | D+1 | Não há | 8.522.167,12 | 2,30% | 4.076 | 2,02% | Artigo 8º, Inciso IV |
| WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO | D+5 | Não há | 8.999.291,49 | 2,43% | 32 | 3,99% | Artigo 8º, Inciso IV |
| PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP | Não se aplica | Não se aplica | 3.977.603,66 | 1,07% | | | Artigo 8º, Inciso V |
| CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA FIP | Não se aplica | Não se aplica | 948.693,50 | 0,26% | 19 | 1,02% | Artigo 8º, Inciso V |

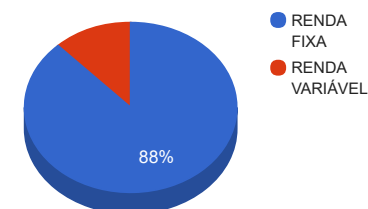
Carteira consolidada de investimentos - base (agosto / 2017)

| Produto / Fundo | Disponibilidade Resgate | Carência | Saldo | Particip. S/ Total | Qtde. Cotistas | % S/ PL Fundo | RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014 |
|---|-------------------------|----------------|-----------------------|-----------------------|-------------------|------------------|--------------------------------------|
| BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11 | Não se aplica | Não se aplica | 1.385.153,63 | 0,37% | | 0,74% | Artigo 8º, Inciso VI |
| BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11 | Não se aplica | Não se aplica | 5.466.309,87 | 1,48% | | 0,22% | Artigo 8º, Inciso VI |
| | | TOTAL - | 370.308.074,99 | | | | |

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

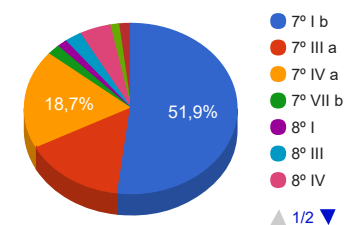
| Artigos - Renda Fixa | Resolução % | Carteira \$ | Carteira % | Estratégia de Alocação | | | GAP Superior |
|-------------------------------------|----------------|-----------------------|---------------|------------------------|--------------|---------------|----------------|
| | | | | Inferior % | Alvo % | Superior % | |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " | 100,00% | 192.295.725,96 | 51,93% | 30,00% | 35,00% | 70,00% | 66.919.926,53 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a " | 80,00% | 56.996.775,70 | 15,39% | 10,00% | 20,00% | 60,00% | 165.188.069,29 |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " | 30,00% | 69.226.057,48 | 18,69% | 5,00% | 5,00% | 30,00% | 41.866.365,02 |
| Artigo 7º, Inciso VI | 15,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 10,00% | 15,00% | 55.546.211,25 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a " | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 2,50% | 5,00% | 18.515.403,75 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b " | 5,00% | 7.313.592,56 | 1,98% | 0,00% | 2,50% | 5,00% | 11.201.811,19 |
| Total Renda Fixa | 100,00% | 325.832.151,70 | 87,99% | 45,00 | 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% | 5.588.714,41 | 1,51% | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 12.926.689,34 |
| Artigo 8º, Inciso III | 15,00% | 9.587.989,61 | 2,59% | 2,00% | 10,00% | 12,00% | 34.848.979,39 |
| Artigo 8º, Inciso IV | 5,00% | 17.521.458,61 | 4,73% | 2,00% | 5,00% | 5,00% | 993.945,14 |
| Artigo 8º, Inciso V | 5,00% | 4.926.297,16 | 1,33% | 0,00% | 5,00% | 5,00% | 13.589.106,59 |
| Artigo 8º, Inciso VI | 5,00% | 6.851.463,50 | 1,85% | 0,00% | 5,00% | 5,00% | 11.663.940,25 |
| Total Renda Variável | 30,00% | 44.475.923,29 | 12,01% | 4,00 | 25,00 | 32,00 | - |

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

| Artigos - Renda Fixa | Base: agosto / 2017 | | Limite Inferior (%) | Limite Superior (%) |
|-------------------------------------|-----------------------|---------------|---------------------|---------------------|
| | Carteira (\$) | Carteira (%) | | |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " | 192.295.725,96 | 51,93% | 30,00% | 70,00% |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a " | 56.996.775,70 | 15,39% | 10,00% | 60,00% |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " | 69.226.057,48 | 18,69% | 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 " | 7.313.592,56 | 1,98% | 0,00% | 5,00% |
| Total Renda Fixa | 325.832.151,70 | 87,99% | 45,00 | 185,00 |

| Artigos - Renda Variável | Base: agosto / 2017 | | Limite Inferior (%) | Limite Superior (%) |
|-----------------------------|----------------------|---------------|---------------------|---------------------|
| | Carteira (\$) | Carteira (%) | | |
| Artigo 8º, Inciso I | 5.588.714,41 | 1,51% | 0,00% | 5,00% |
| Artigo 8º, Inciso III | 9.587.989,61 | 2,59% | 2,00% | 12,00% |
| Artigo 8º, Inciso IV | 17.521.458,61 | 4,73% | 2,00% | 5,00% |
| Artigo 8º, Inciso V | 4.926.297,16 | 1,33% | 0,00% | 5,00% |
| Artigo 8º, Inciso VI | 6.851.463,50 | 1,85% | 0,00% | 5,00% |
| Total Renda Variável | 44.475.923,29 | 12,01% | 4,00 | 32,00 |

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

| | Mês | Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | Taxa adm | VaR - Mês | Volatilidade - 12 meses |
|--|-------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| IMA-B 5+ | 1,36% | 11,93% | 6,04% | 4,21% | 16,45% | 51,77% | - | - | - |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,34% | 11,49% | 6,00% | 3,94% | 15,86% | 50,41% | 0,20% | 2,654% | 12,85% |
| IMA-B | 1,34% | 11,14% | 5,57% | 5,06% | 15,49% | 44,95% | - | - | - |
| BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA | 1,39% | 11,37% | 5,66% | 5,12% | 15,97% | 44,82% | 0,20% | 1,866% | 10,01% |
| SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP | 1,32% | 11,03% | 5,51% | 4,98% | 15,32% | 44,54% | 0,20% | 1,813% | 9,86% |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,32% | 10,97% | 5,49% | 4,92% | 15,22% | 44,11% | 0,20% | 1,808% | 9,85% |
| BRADERCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA | 0,87% | 6,58% | 3,89% | 3,84% | 4,43% | - | 0,20% | 0,413% | 6,82% |
| IMA-B 5 | 1,25% | 9,83% | 4,68% | 6,98% | 13,91% | 34,53% | - | - | - |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1,24% | 9,71% | 4,63% | 6,90% | 13,72% | 33,75% | 0,20% | 0,717% | 3,64% |
| SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA | 1,24% | 9,68% | 4,62% | 6,86% | 13,68% | 34,03% | 0,10% | 0,721% | 3,64% |
| WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA | 1,23% | 11,57% | 5,39% | 7,65% | 15,74% | 38,88% | 0,40% | 0,946% | 5,20% |
| IRF-M 1 | 0,90% | 8,33% | 2,86% | 5,88% | 13,15% | 29,98% | - | - | - |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 0,89% | 8,21% | 2,82% | 5,81% | 12,96% | 29,61% | 0,20% | 0,081% | 0,67% |
| Selic | 0,80% | 7,35% | 2,43% | 5,29% | 12,06% | 27,92% | - | - | - |
| BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 0,99% | 7,74% | 2,65% | 5,65% | 12,68% | 28,66% | 0,20% | 0,074% | 0,12% |
| CDI | 0,80% | 7,34% | 2,43% | 5,28% | 12,05% | 27,88% | - | - | - |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,79% | 7,40% | 2,43% | 5,30% | 12,17% | 27,88% | 0,20% | 0,003% | 0,11% |

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

| | Mês | Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | Taxa adm | VaR - Mês | Volatilidade - 12 meses |
|--|-----|-----|---------|---------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
|--|-----|-----|---------|---------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|

| | | | | | | | | | |
|---|-------|--------|-------|-------|--------|--------|-------|--------|-------|
| IPCA + 6,00% ao ano | 0,72% | 5,65% | 1,72% | 3,93% | 8,58% | 25,42% | - | - | - |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,60% | 11,49% | 5,79% | 7,51% | 15,49% | 41,47% | 0,15% | 1,186% | 6,48% |
| BTG PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA | 0,95% | 3,09% | 1,83% | 1,41% | 3,11% | 12,45% | 0,15% | 0,196% | 3,85% |

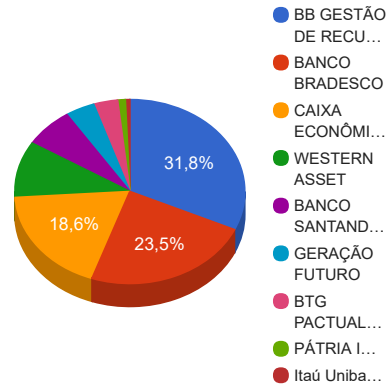
| | | | | | | | | | |
|--|-------|--------|-------|-------|--------|--------|-------|--------|-------|
| IPCA | 0,19% | 1,62% | 0,20% | 0,90% | 2,46% | 11,65% | - | - | - |
| BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO | 1,37% | 11,68% | 5,31% | 7,75% | 16,49% | 40,79% | 0,20% | 0,736% | 4,68% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 1,18% | 10,13% | 4,75% | 5,16% | 15,38% | 38,65% | 0,40% | 1,008% | 6,26% |

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

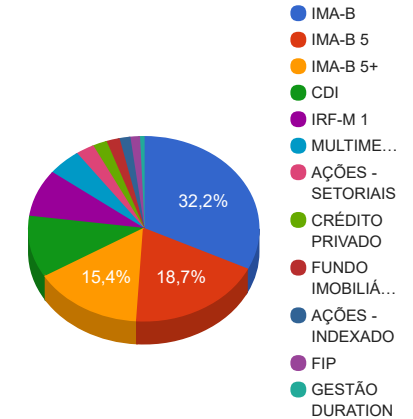
| | Mês | Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | Taxa adm | VaR - Mês | Volatilidade - 12 meses |
|--|-------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| Ibovespa | 7,46% | 17,61% | 12,95% | 6,26% | 22,34% | 51,93% | - | - | - |
| GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES | 1,62% | 1,68% | 4,58% | -5,06% | 9,11% | 10,39% | 4,00% | 5,550% | 21,37% |
| IDIV | 6,96% | 20,19% | 10,75% | 3,45% | 33,46% | 71,33% | - | - | - |
| CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES | 6,51% | 13,21% | 8,22% | 5,42% | 12,69% | 34,25% | 1,72% | 4,353% | 18,70% |
| GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES | 1,27% | 0,86% | 3,42% | -5,35% | 2,34% | -0,04% | 3,00% | 5,016% | 19,78% |
| IFIX | 0,87% | 11,80% | 1,36% | 2,76% | 17,94% | 42,94% | - | - | - |
| BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11 | 0,53% | 16,63% | 3,46% | 0,00% | 12,19% | 28,78% | 0,40% | 6,937% | 22,69% |
| BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11 | 0,00% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | - | - | 0,30% | - | - |
| CDI | 0,80% | 7,34% | 2,43% | 5,28% | 12,05% | 27,88% | - | - | - |
| WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO | 0,67% | 6,04% | 2,49% | 3,08% | 12,18% | 31,23% | 2,00% | 0,536% | 1,68% |
| IPCA | 0,19% | 1,62% | 0,20% | 0,90% | 2,46% | 11,65% | - | - | - |
| PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP | - | - | - | - | - | - | 1,00% | - | - |
| S&P 500 | 0,05% | 10,40% | 2,48% | 4,41% | 13,85% | 25,33% | - | - | - |
| WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO | 1,08% | 17,48% | 4,88% | 9,90% | 26,62% | 57,68% | 1,00% | 4,309% | 7,97% |
| Não Possui | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA FIP | - | - | - | - | - | - | 1,50% | 0,008% | 17,55% |

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

| Administrador | Valor | % |
|----------------------------------|----------------|--------|
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM | 117.769.570,36 | 31,80% |
| BANCO BRADESCO | 87.151.333,53 | 23,53% |
| CAIXA ECONÔMICA FEDERAL | 68.979.311,50 | 18,63% |
| WESTERN ASSET | 36.491.181,46 | 9,85% |
| BANCO SANTANDER | 25.714.996,28 | 6,94% |
| GERAÇÃO FUTURO | 15.282.480,65 | 4,13% |
| BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS | 12.577.367,00 | 3,40% |
| PÁTRIA INVESTIMENTOS | 3.977.603,66 | 1,07% |
| Itaú Unibanco | 2.364.230,55 | 0,64% |



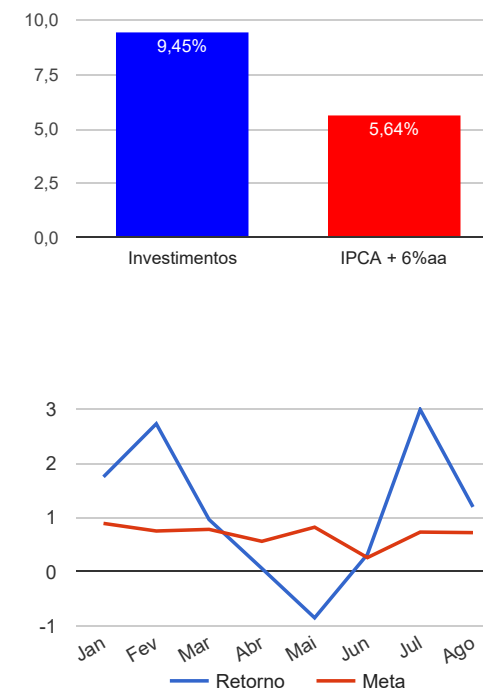
| Sub-segmento | Valor | % |
|-------------------|----------------|--------|
| IMA-B | 119.380.720,79 | 32,24% |
| IMA-B 5 | 69.282.644,28 | 18,71% |
| IMA-B 5+ | 56.899.059,18 | 15,37% |
| CDI | 39.995.326,74 | 10,80% |
| IRF-M 1 | 30.596.577,60 | 8,26% |
| MULTIMERCADO | 17.521.458,61 | 4,73% |
| AÇÕES - SETORIAIS | 9.587.989,61 | 2,59% |
| CRÉDITO PRIVADO | 7.313.592,56 | 1,98% |
| FUNDO IMOBILIÁRIO | 6.851.463,50 | 1,85% |
| AÇÕES - INDEXADO | 5.588.714,41 | 1,51% |
| FIP | 4.926.297,16 | 1,33% |
| GESTÃO DURATION | 2.364.230,55 | 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% | 0,78% | 122,46% | 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% |
| Julho | 341.105.801,22 | 64.007.589,09 | 64.874.606,18 | 350.419.080,68 | 10.180.296,55 | 2,98% | 0,73% | 410,00% | 1,68% |
| Agosto | 350.419.080,68 | 23.202.295,66 | 26.463.678,61 | 351.339.670,37 | 4.181.972,64 | 1,19% | 0,72% | 164,78% | 1,48% |
| Acumulado no ano | | | | | 30.895.589,88 | 9,45% | 5,64% | 167,43% | |

Acumulado no Ano



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de agosto / 2017

| Ativos de Renda Fixa | Sado Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | VaR - Mês (%) | Instituição(%) |
|---|---------------|---------------|---------------|-------------------------|---------------------|--------------|---------------|----------------|
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 14.445.796,73 | 0,00 | 383.691,30 | 14.289.133,19 | 227.027,76 | 1,57% | 1,19% | 1,60% |
| BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA | 56.215.850,03 | 0,00 | 0,00 | 56.996.775,70 | 780.925,67 | 1,39% | 1,87% | 1,39% |
| BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO | 7.214.466,60 | 0,00 | 0,00 | 7.313.592,56 | 99.125,96 | 1,37% | 0,74% | 1,37% |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 56.147.808,62 | 0,00 | 0,00 | 56.899.059,18 | 751.250,56 | 1,34% | 2,65% | 1,34% |
| SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIX... | 23.818.607,79 | 0,00 | 0,00 | 24.134.105,25 | 315.497,46 | 1,32% | 1,81% | 1,32% |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 11.962.631,21 | 0,00 | 0,00 | 12.120.848,17 | 158.216,96 | 1,32% | 1,81% | 1,32% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 35.711.961,85 | 0,00 | 0,00 | 36.154.663,40 | 442.701,55 | 1,24% | 0,72% | 1,24% |
| SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA | 1.561.591,87 | 0,00 | 0,00 | 1.580.891,03 | 19.299,16 | 1,24% | 0,72% | 1,24% |
| WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA | 18.739.380,09 | 0,00 | 0,00 | 18.969.722,85 | 230.342,76 | 1,23% | 0,95% | 1,23% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 2.336.646,49 | 0,00 | 0,00 | 2.364.230,55 | 27.584,06 | 1,18% | 1,01% | 1,18% |
| BTG PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA | 12.459.041,00 | 0,00 | 0,00 | 12.577.367,00 | 118.326,00 | 0,95% | 0,20% | 0,95% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 30.326.771,10 | 0,00 | 0,00 | 30.596.577,60 | 269.806,50 | 0,89% | 0,08% | 0,89% |
| BRDESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA | 11.738.154,17 | 0,00 | 0,00 | 11.839.858,48 | 101.704,31 | 0,87% | 0,41% | 0,87% |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 22.438.573,36 | 7.180.000,00 | 8.109.650,00 | 21.680.627,39 | 171.704,03 | 0,58% | 0,00% | 0,79% |
| BRDESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA | 18.168.435,88 | 0,00 | 18.242.295,66 | 0,00 | 73.859,78 | 0,41% | 0,08% | 0,88% |
| BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 0,00 | 18.242.295,66 | 0,00 | 18.314.699,35 | 72.403,69 | 0,40% | 0,07% | 0,99% |
| | | | | Total Renda Fixa | 3.859.776,21 | 1,19% | 1,24% | |

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de agosto / 2017

| Ativos de Renda Variável | Sado Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | VaR - Mês (%) | Instituição(%) |
|--|---------------|------------|-----------|--------------|---------------|-------------|---------------|----------------|
| CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES | 1.201.208,00 | 0,00 | 0,00 | 1.279.377,00 | 78.169,00 | 6,51% | 4,35% | 6,51% |
| GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES | 5.499.724,31 | 0,00 | 0,00 | 5.588.714,41 | 88.990,10 | 1,62% | 5,55% | 1,62% |
| GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES | 8.204.810,24 | 0,00 | 0,00 | 8.308.612,61 | 103.802,37 | 1,27% | 5,02% | 1,27% |
| BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11 | 1.379.922,14 | 0,00 | 10.041,65 | 1.385.153,63 | 15.273,14 | 1,11% | 6,94% | 0,53% |
| WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO | 8.431.257,04 | 0,00 | 0,00 | 8.522.167,12 | 90.910,08 | 1,08% | 4,31% | 1,08% |
| BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11 | 5.463.452,80 | 0,00 | 35.000,00 | 5.466.309,87 | 37.857,07 | 0,69% | - | 0,00% |
| WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO | 8.939.735,96 | 0,00 | 0,00 | 8.999.291,49 | 59.555,53 | 0,67% | 0,54% | 0,67% |
| PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP | 3.981.402,77 | 0,00 | 0,00 | 3.977.603,66 | -3.799,11 | -0,10% | - | - |
| CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA FIP | 950.161,81 | 0,00 | 0,00 | 948.693,50 | -1.468,31 | -0,15% | 0,01% | -0,15% |
| Total Renda Variável | | | | | 469.289,87 | 1,07% | 3,69% | |