

# 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 GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	30.969.854,71	11,79%	204	2,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.530.015,25	3,25%	740	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	31.482.026,45	11,99%	706	0,62%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
DAYCOVAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+3	Não há	7.793.827,72	2,97%	86	15,58%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	26.881.365,28	10,24%	1.360	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	24.059.109,32	9,16%	307	1,33%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	3.110.674,73	1,18%	23	0,72%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2020	1.502.030,45	0,57%	122	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	5.946.905,05	2,26%	604	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRASESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	14.131.018,03	5,38%	77	5,04%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	8.602.869,99	3,28%	46	12,92%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
SICREDI INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	10.901.845,17	4,15%	64	7,04%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	100.087,74	0,04%	62	0,12%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2030	18.036.284,00	6,87%	34	9,15%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	25.692.884,14	9,78%	774	0,56%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	5.629.972,79	2,14%	143	0,54%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	10.458.590,40	3,98%	38	6,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SUL INVEST FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 6	Não se aplica	Não se aplica	1.089.123,76	0,41%	22	1,27%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	1.049.475,88	0,40%	98	1,02%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	D+15	Não há	4.082.081,23	1,55%	250	14,09%	Artigo 8º, Inciso I
BB INDEXADO IBRX FIC AÇÕES	D+4	Não há	2.068.460,40	0,79%	4.996	1,80%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	3.245.651,68	1,24%	17	13,24%	Artigo 8º, Inciso II

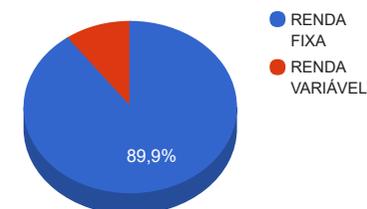
Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	5.805.486,89	2,21%	373	15,56%	Artigo 8º, Inciso III
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	7.426.890,32	2,83%	1.010	3,22%	Artigo 8º, Inciso III
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	D+4	Não há	966.911,61	0,37%	7.712	0,60%	Artigo 8º, Inciso III
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	3.053.248,80	1,16%	48	5,79%	Artigo 8º, Inciso IV
		<b>TOTAL -</b>	<b>262.616.691,79</b>				

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

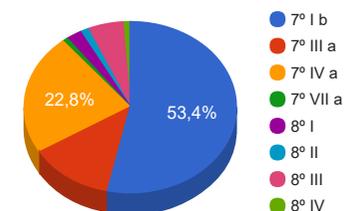
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	140.275.808,96	53,41%	30,00%	35,00%	70,00%	43.555.875,29
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	33.635.733,19	12,81%	10,00%	15,00%	60,00%	123.934.281,88
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	59.917.819,07	22,82%	5,00%	15,00%	30,00%	18.867.188,47
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	15,00%	39.392.503,77
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	2.138.599,64	0,81%	0,00%	2,50%	5,00%	10.992.234,95
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	13.130.834,59
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>235.967.960,86</b>	<b>89,85%</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%	6.150.541,63	2,34%	0,00%	3,00%	5,00%	6.980.292,96
Artigo 8º, Inciso II	20,00%	3.245.651,68	1,24%	0,00%	3,00%	3,00%	4.632.849,07
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	14.199.288,82	5,41%	1,00%	10,00%	10,00%	12.062.380,36
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	3.053.248,80	1,16%	0,00%	3,00%	4,00%	7.451.418,87
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	4,00%	10.504.667,67
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	4,00%	10.504.667,67
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>26.648.730,93</b>	<b>10,15%</b>	<b>1,00</b>	<b>25,00</b>	<b>30,00</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 "	140.275.808,96	53,41%	30,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	33.635.733,19	12,81%	10,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	59.917.819,07	22,82%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	2.138.599,64	0,81%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>235.967.960,86</b>	<b>89,85%</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	6.150.541,63	2,34%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso II	3.245.651,68	1,24%	0,00%	3,00%
Artigo 8º, Inciso III	14.199.288,82	5,41%	1,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV	3.053.248,80	1,16%	0,00%	4,00%
Artigo 8º, Inciso V	0,00	0,00%	0,00%	4,00%
Artigo 8º, Inciso VI	0,00	0,00%	0,00%	4,00%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>26.648.730,93</b>	<b>10,15%</b>	<b>1,00</b>	<b>30,00</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	1,35%	8,24%	2,20%	8,24%	16,77%	36,01%	-	-	-
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	1,36%	8,07%	2,04%	8,07%	16,37%	34,67%	0,20%	1,459%	5,07%
IRF-M 1	0,89%	6,25%	2,69%	6,25%	13,46%	30,44%	-	-	-
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%
IMA Geral	0,82%	6,55%	1,12%	6,55%	14,23%	32,35%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,82%	6,55%	1,21%	6,55%	14,43%	31,83%	0,20%	1,213%	4,77%
CDI	0,81%	5,65%	2,54%	5,65%	12,85%	28,75%	-	-	-
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	0,87%	6,90%	3,25%	6,90%	15,32%	33,02%	0,75%	2,484%	9,31%
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%
IMA-B 5	0,52%	5,47%	1,32%	5,47%	11,91%	30,87%	-	-	-
DAYCOVAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,49%	5,38%	1,23%	5,38%	11,44%	-	0,50%	0,927%	3,67%
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%
IPCA + 7,50% ao ano	0,37%	4,85%	1,99%	4,85%	10,69%	29,52%	-	-	-
SUL INVEST FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 6	0,29%	4,95%	2,08%	4,95%	-3,98%	-4,50%	0,20%	0,537%	0,35%
IPCA + 6,00% ao ano	0,26%	4,13%	1,64%	4,13%	9,15%	25,94%	-	-	-

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

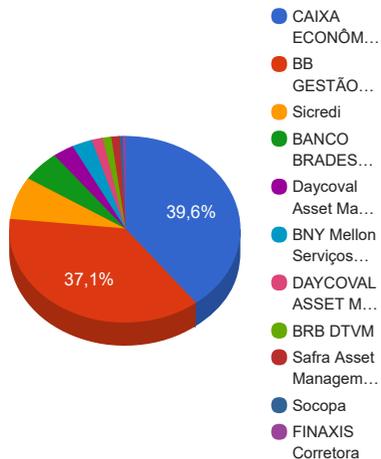
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,57%	5,86%	1,71%	5,86%	12,24%	30,90%	0,15%	0,675%	3,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,50%	4,66%	2,01%	4,66%	9,98%	27,66%	0,20%	0,226%	0,28%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,48%	1,31%	1,96%	1,31%	3,30%	12,94%	0,20%	0,228%	4,05%
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%
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%
IMA-B	0,16%	5,46%	-1,34%	5,46%	13,32%	32,28%	-	-	-
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%
SICREDI INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	0,12%	5,33%	-1,47%	5,33%	13,30%	31,10%	0,20%	2,463%	9,70%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	0,10%	4,81%	-1,86%	4,81%	12,26%	32,03%	0,45%	2,472%	10,14%
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)

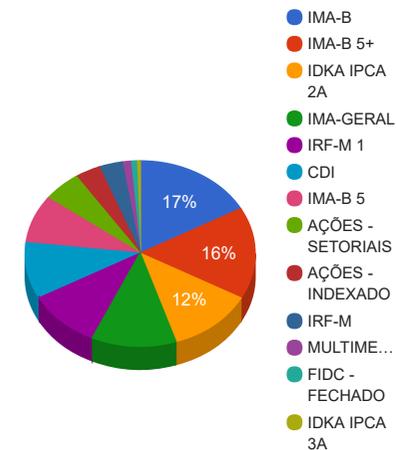
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	0,81%	5,65%	2,54%	5,65%	12,85%	28,75%	-	-	-
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	0,88%	6,81%	2,92%	6,81%	14,42%	36,31%	1,00%	1,310%	14,68%
SMLL	0,38%	19,24%	2,71%	19,24%	33,53%	30,90%	-	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS 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%	-	-	-
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	0,15%	4,20%	-3,21%	4,20%	21,68%	18,24%	0,50%	5,816%	21,83%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	-0,34%	5,97%	-4,35%	5,97%	14,46%	13,17%	2,00%	6,666%	23,11%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	-1,28%	7,83%	-1,66%	7,83%	22,72%	11,50%	2,80%	6,454%	21,65%
IBX	0,30%	5,41%	-2,52%	5,41%	22,39%	18,62%	-	-	-
BB INDEXADO IBRX FIC AÇÕES	0,07%	4,13%	-3,07%	4,13%	19,98%	15,17%	1,50%	6,095%	21,07%
BBSEGURIDADE ON NM - BBSE3	-1,55%	4,24%	-1,88%	4,24%	7,87%	-5,32%	-	-	-
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	-1,66%	3,32%	-2,23%	3,32%	6,23%	-8,44%	1,5%	12,286%	28,74%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	103.927.248,21	39,57%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	97.348.300,21	37,07%
Sicredi	19.504.715,16	7,43%
BANCO BRADESCO	14.131.018,03	5,38%
Daycoval Asset Management	7.793.827,72	2,97%
BNY Mellon Serviços Financeiros	7.426.890,32	2,83%
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT ADMINISTRAÇÃO DE RECURSOS	4.082.081,23	1,55%
BRB DTVM	3.153.336,54	1,20%
Safra Asset Management	3.110.674,73	1,18%
Socopa	1.089.123,76	0,41%
FINAXIS Corretora	1.049.475,88	0,40%



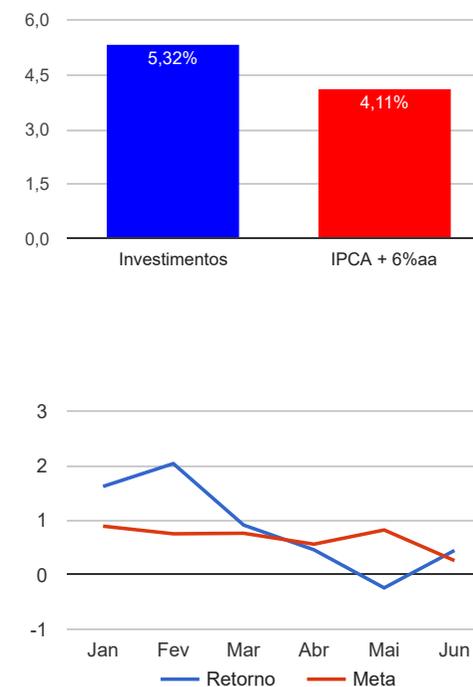
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	44.578.003,39	16,97%
IMA-B 5+	42.095.393,32	16,03%
IDKA IPCA 2A	31.482.026,45	11,99%
IMA-GERAL	30.969.854,71	11,79%
IRF-M 1	26.881.365,28	10,24%
CDI	25.792.971,88	9,82%
IMA-B 5	21.924.845,75	8,35%
AÇÕES - SETORIAIS	14.199.288,82	5,41%
AÇÕES - INDEXADO	9.396.193,31	3,58%
IRF-M	8.602.869,99	3,28%
MULTIMERCADO	3.053.248,80	1,16%
FIDC - FECHADO	2.138.599,64	0,81%
IDKA IPCA 3A	1.502.030,45	0,57%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	233.654.557,76	4.288.800,00	2.359.839,23	239.392.072,45	3.808.553,92	1,62%	0,89%	181,65%	1,85%
Fevereiro	239.392.072,45	6.000.206,00	2.987.505,78	247.336.459,83	4.931.687,16	2,03%	0,75%	271,26%	1,81%
Março	247.336.459,83	4.795.917,00	1.967.000,00	252.441.642,67	2.276.265,84	0,91%	0,76%	119,03%	1,44%
Abril	252.441.642,67	6.646.065,00	3.987.913,14	256.267.435,31	1.167.640,78	0,46%	0,56%	82,08%	1,30%
Mai	256.267.435,31	17.946.343,85	16.757.800,00	256.838.535,75	-617.443,41	-0,24%	0,82%	-29,19%	7,04%
Junho	256.838.535,75	4.925.770,00	310.439,95	262.616.691,79	1.162.825,99	0,44%	0,26%	173,98%	1,59%
Acumulado no ano					12.729.530,28	5,32%	4,11%	129,56%	

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(%)
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	8.487.283,96	0,00	0,00	8.602.869,99	115.586,03	1,36%	1,46%	1,36%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	26.957.039,65	0,00	306.365,00	26.881.365,28	230.690,63	0,86%	0,18%	0,87%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	30.717.751,55	0,00	0,00	30.969.854,71	252.103,16	0,82%	1,21%	0,82%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	20.683.587,03	4.825.770,00	0,00	25.692.884,14	183.527,11	0,72%	0,03%	0,81%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	31.290.694,01	0,00	0,00	31.482.026,45	191.332,44	0,61%	0,76%	0,61%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.493.489,32	0,00	0,00	1.502.030,45	8.541,13	0,57%	0,67%	0,57%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.601.971,67	0,00	0,00	5.629.972,79	28.001,12	0,50%	0,23%	0,50%
DAYCOVAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	7.755.542,19	0,00	0,00	7.793.827,72	38.285,53	0,49%	0,93%	0,49%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	17.949.834,00	0,00	0,00	18.036.284,00	86.450,00	0,48%	0,23%	0,48%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	14.063.473,97	0,00	0,00	14.131.018,03	67.544,06	0,48%	1,01%	0,48%
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.409.042,70	0,00	0,00	10.458.590,40	49.547,70	0,48%	0,23%	0,48%
SUL INVEST FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 6	1.085.936,60	0,00	0,00	1.089.123,76	3.187,16	0,29%	0,54%	0,29%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.517.258,13	0,00	0,00	8.530.015,25	12.757,12	0,15%	2,45%	0,15%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.938.186,80	0,00	0,00	5.946.905,05	8.718,25	0,15%	2,45%	0,15%
SICREDI INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	10.888.341,35	0,00	0,00	10.901.845,17	13.503,82	0,12%	2,46%	0,12%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	3.107.529,23	0,00	0,00	3.110.674,73	3.145,50	0,10%	2,47%	0,10%
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	0,00	100.000,00	0,00	100.087,74	87,74	0,09%	2,48%	0,87%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	24.079.850,61	0,00	0,00	24.059.109,32	-20.741,29	-0,09%	3,29%	-0,09%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.056.156,67	0,00	4.074,95	1.049.475,88	-2.605,84	-0,25%	0,63%	-0,63%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>1.269.661,37</b>	<b>0,54%</b>	<b>1,10%</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(%)
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	3.026.666,31	0,00	0,00	3.053.248,80	26.582,49	0,88%	1,31%	0,88%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	3.240.760,10	0,00	0,00	3.245.651,68	4.891,58	0,15%	5,82%	0,15%
BB INDEXADO IBRX FIC AÇÕES	2.066.916,05	0,00	0,00	2.068.460,40	1.544,35	0,07%	6,10%	0,07%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	5.825.412,48	0,00	0,00	5.805.486,89	-19.925,59	-0,34%	6,67%	-0,34%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	7.477.438,26	0,00	0,00	7.426.890,32	-50.547,94	-0,68%	6,22%	-0,68%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	4.135.180,81	0,00	0,00	4.082.081,23	-53.099,58	-1,28%	6,45%	-1,28%
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	983.192,30	0,00	0,00	966.911,61	-16.280,69	-1,66%	12,29%	-1,66%
Total Renda Variável					-106.835,38	-0,40%	5,95%	

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 IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	35.261.168,42	6.853.959,85	16.048.165,00	26.881.365,28	814.402,01	2,39%	2,65%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	22.549.459,66	7.564.219,00	5.000.000,00	25.692.884,14	579.205,48	2,34%	2,54%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	30.932.661,43	0,00	0,00	31.482.026,45	549.365,02	1,78%	1,78%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	30.598.264,17	0,00	0,00	30.969.854,71	371.590,54	1,21%	1,21%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	17.688.972,00	0,00	0,00	18.036.284,00	347.312,00	1,96%	1,96%
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.258.868,70	0,00	0,00	10.458.590,40	199.721,70	1,95%	1,95%
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	8.431.189,00	0,00	0,00	8.602.869,99	171.680,99	2,04%	2,04%
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	11.972.916,21	2.000.000,00	0,00	14.131.018,03	158.101,82	1,23%	1,19%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.518.854,72	0,00	0,00	5.629.972,79	111.118,07	2,01%	2,01%
DAYCOVAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	7.698.942,93	0,00	0,00	7.793.827,72	94.884,79	1,23%	1,23%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.476.759,92	0,00	0,00	1.502.030,45	25.270,53	1,71%	1,71%
SUL INVEST FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 6	1.066.934,43	0,00	0,00	1.089.123,76	22.189,33	2,08%	2,08%
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	0,00	100.000,00	0,00	100.087,74	87,74	0,09%	3,25%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.068.687,21	0,00	7.988,09	1.049.475,88	-11.223,24	-1,05%	-1,80%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	3.169.598,31	0,00	0,00	3.110.674,73	-58.923,58	-1,86%	-1,86%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.030.910,71	0,00	0,00	5.946.905,05	-84.005,66	-1,39%	-1,39%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.649.581,14	0,00	0,00	8.530.015,25	-119.565,89	-1,38%	-1,38%
SICREDI INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	11.064.656,28	0,00	0,00	10.901.845,17	-162.811,11	-1,47%	-1,47%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	22.696.037,92	2.000.000,00	0,00	24.059.109,32	-636.928,60	-2,65%	-2,84%
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>2.371.471,94</b>	<b>1,01%</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 (%)
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	0,00	3.000.000,00	0,00	3.053.248,80	53.248,80	1,77%	2,92%
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	988.973,95	0,00	0,00	966.911,61	-22.062,34	-2,23%	-2,23%
BB INDEXADO IBRX FIC AÇÕES	2.134.001,78	0,00	0,00	2.068.460,40	-65.541,38	-3,07%	-3,07%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	1.156.084,22	3.000.000,00	0,00	4.082.081,23	-74.002,99	0,14%	-1,66%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	3.353.368,06	0,00	0,00	3.245.651,68	-107.716,38	-3,21%	-3,21%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	2.487.220,94	3.500.000,00	0,00	5.805.486,89	-181.734,05	-2,69%	-4,35%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	6.187.530,56	1.500.000,00	0,00	7.426.890,32	-260.640,24	-3,07%	-3,64%
<b>Total Renda Variável</b>					<b>-658.448,58</b>	<b>-1,95%</b>	

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 GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	29.066.831,80	0,00	0,00	30.969.854,71	1.903.022,91	6,55%	6,55%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	32.752.448,32	14.582.540,85	22.346.155,00	26.881.365,28	1.892.531,11	5,52%	6,15%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	29.781.345,50	0,00	0,00	31.482.026,45	1.700.680,95	5,71%	5,71%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	20.533.781,34	8.940.355,00	5.000.000,00	25.692.884,14	1.218.747,80	5,46%	5,71%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	20.984.480,33	2.000.000,00	0,00	24.059.109,32	1.074.628,99	5,30%	5,09%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	17.803.450,00	0,00	518.246,60	18.036.284,00	751.080,60	4,30%	1,31%
BRASECO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	11.480.806,51	2.000.000,00	0,00	14.131.018,03	650.211,52	5,57%	5,52%
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	7.960.767,47	0,00	0,00	8.602.869,99	642.102,52	8,07%	8,07%
SICREDI INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	10.350.161,29	0,00	0,00	10.901.845,17	551.683,88	5,33%	5,33%
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.310.895,00	0,00	294.140,11	10.458.590,40	441.835,51	4,36%	1,43%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.117.078,11	1.000.000,00	0,00	8.530.015,25	412.937,14	5,09%	5,36%
DAYCOVAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	7.395.851,96	0,00	0,00	7.793.827,72	397.975,76	5,38%	5,38%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.665.614,79	1.000.000,00	0,00	5.946.905,05	281.290,26	4,96%	5,35%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.536.028,21	0,00	158.760,43	5.629.972,79	252.705,01	4,65%	4,66%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	2.967.836,07	0,00	0,00	3.110.674,73	142.838,66	4,81%	4,81%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.460.016,82	0,00	41.948,44	1.502.030,45	83.962,07	5,84%	5,86%
SUL INVEST FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 6	1.037.762,62	0,00	0,00	1.089.123,76	51.361,14	4,95%	4,95%
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	0,00	100.000,00	0,00	100.087,74	87,74	0,09%	6,90%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.082.962,13	0,00	11.247,52	1.049.475,88	-22.238,73	-2,06%	-3,09%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>12.427.444,84</b>	<b>5,53%</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 (%)
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	3.114.972,84	0,00	0,00	3.245.651,68	130.678,84	4,20%	4,20%
BB INDEXADO IBRX FIC AÇÕES	1.806.094,15	201.464,00	0,00	2.068.460,40	60.902,25	3,71%	4,13%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	2.245.122,87	3.500.000,00	0,00	5.805.486,89	60.364,02	7,80%	5,97%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	0,00	3.000.000,00	0,00	3.053.248,80	53.248,80	1,77%	6,81%
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	935.814,58	0,00	0,00	966.911,61	31.097,03	3,32%	3,32%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	1.054.272,14	3.000.000,00	0,00	4.082.081,23	27.809,09	9,81%	7,83%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	2.210.162,91	5.278.742,00	0,00	7.426.890,32	-62.014,59	6,62%	9,85%
<b>Total Renda Variável</b>					<b>302.085,44</b>	<b>5,92%</b>	