

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



Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	71.211.206,41	20,62%	740	1,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	12.604.377,86	3,65%	599	0,35%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	20.174.793,41	5,84%	706	0,40%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	24.533.746,39	7,10%	307	1,35%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	43.833.781,69	12,69%	293	2,73%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.006.990,68	0,29%	604	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	10.004.043,01	2,90%	703	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	11.997.245,84	3,47%	115	1,46%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.792.332,21	0,81%	1.197	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	8.930.844,29	2,59%	33	1,67%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
MULTINVEST GRAU DE INVESTIMENTO FIC FI DE RENDA FIXA	D+4	Não há	2.511.582,38	0,73%	8	11,21%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	4.053.511,82	1,17%	20	14,72%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	D+1471	Não há	2.483.516,35	0,72%	29	2,19%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1461	Não há	2.505.834,92	0,73%	8	12,52%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1901	Não há	3.561.900,39	1,03%	10	6,69%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	499.983,43	0,14%	432	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	11.251.457,91	3,26%	757	0,20%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	13.360.771,86	3,87%	62	16,14%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	12.275.062,55	3,55%	62	0,86%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	16/05/2023	10.790.839,98	3,12%	52	3,97%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TRX CORPORATIVO I FIDC SÊNIOR	D+1401	Não Informado	1.694.087,27	0,49%	7	20,78%	Artigo 7º, Inciso VI
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	Não possui	1008 dias úteis	3.016.889,66	0,87%	6	12,76%	Artigo 7º, Inciso VI

Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2017)

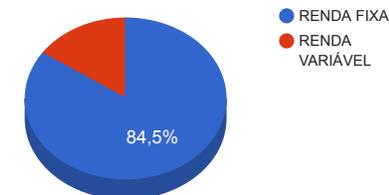
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	14.054.987,25	4,07%			Artigo 7º, Inciso VI
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	2.605.753,60	0,75%	70	3,49%	Artigo 7º, Inciso VI
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	3.092.003,18	0,90%	1.021	8,32%	Artigo 8º, Inciso III
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	4.097.647,46	1,19%	133	5,36%	Artigo 8º, Inciso III
META VALOR FI AÇÕES	D+4	Não há	235.945,41	0,07%	13	0,54%	Artigo 8º, Inciso III
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	4.624.565,50	1,34%	1.462	4,21%	Artigo 8º, Inciso III
CONSTÂNCIA BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	3.046.221,14	0,88%	79	4,44%	Artigo 8º, Inciso III
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	D+13	Não há	3.064.690,58	0,89%	297	4,50%	Artigo 8º, Inciso III
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	3.727.500,00	1,08%	48	7,07%	Artigo 8º, Inciso IV
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+180	Não há	6.264.109,58	1,81%	24	4,06%	Artigo 8º, Inciso IV
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	6.484.995,60	1,88%	8	14,08%	Artigo 8º, Inciso V
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	10.172.233,66	2,95%			Artigo 8º, Inciso V
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	Não se aplica	Não se aplica	7.449.744,68	2,16%		4,91%	Artigo 8º, Inciso VI
CSHG BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	Não se aplica	Não se aplica	1.292.647,99	0,37%		0,11%	Artigo 8º, Inciso VI
		Total	345.307.845,94				

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

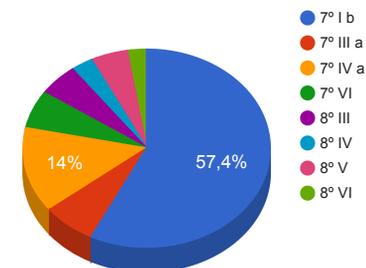
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	198.158.517,50	57,39%	30,00%	35,00%	70,00%	43.556.974,66
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	24.047.190,15	6,96%	15,00%	20,00%	60,00%	183.137.517,41
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	48.178.115,73	13,95%	5,00%	5,00%	30,00%	55.414.238,05
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	21.371.717,78	6,19%	5,00%	10,00%	15,00%	30.424.459,11
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	17.265.392,30
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	17.265.392,30
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	18.161.073,27	5,26%	5,00%	10,00%	15,00%	33.635.103,62
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	9.991.609,58	2,89%	2,00%	5,00%	5,00%	7.273.782,72
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	16.657.229,26	4,82%	2,00%	5,00%	5,00%	608.163,04
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	8.742.392,67	2,53%	2,00%	5,00%	5,00%	8.522.999,63
Total Carteira		345.307.845,94					

RENDA FIXA	291.755.541,16	84,49%
RENDA VARIÁVEL	53.552.304,78	15,51%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: junho / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	198.158.517,50	57,39%	30,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	24.047.190,15	6,96%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	48.178.115,73	13,95%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	21.371.717,78	6,19%	5,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso III	18.161.073,27	5,26%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	9.991.609,58	2,89%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	16.657.229,26	4,82%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	8.742.392,67	2,53%	2,00%	5,00%
Total	345.307.845,94	100,00%	66,00	215,00

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	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%
CDI	0,81%	5,65%	2,54%	5,65%	12,85%	28,75%	-	-	-
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	0,87%	6,90%	3,25%	6,90%	15,32%	33,02%	0,75%	2,484%	9,31%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,82%	5,70%	2,57%	5,70%	12,90%	28,87%	0,20%	0,015%	0,09%
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%	-	-	-
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1,24%	6,94%	2,76%	6,94%	13,54%	-	0,97%	1,255%	3,27%
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%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,46%	5,26%	1,19%	5,26%	11,04%	26,43%	0,70%	0,973%	4,20%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,43%	2,66%	0,69%	2,66%	9,18%	7,40%	0,70%	1,099%	4,52%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	0,42%	4,73%	1,16%	4,73%	3,46%	-	0,70%	2,975%	8,20%
IPCA + 8,00% ao ano	0,41%	5,09%	2,10%	5,09%	11,20%	30,72%	-	-	-
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	0,99%	5,94%	2,80%	5,94%	-	-	0,35%	0,067%	-
IPCA + 7,00% ao ano	0,33%	4,61%	1,87%	4,61%	10,18%	28,32%	-	-	-

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
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	0,93%	4,02%	1,37%	4,02%	9,93%	27,49%	1,65%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-48,97%	-47,45%	-48,74%	-47,45%	-61,13%	-78,98%	0,00%	80,603%	-
IPCA + 6,00% ao ano	0,26%	4,13%	1,64%	4,13%	9,15%	25,94%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,17%	5,73%	-0,09%	5,73%	13,27%	32,29%	0,15%	1,702%	6,96%
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%
BRADESCO 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%
MULTINVEST GRAU DE INVESTIMENTO FIC FI DE RENDA FIXA	-0,19%	6,55%	-1,20%	6,55%	-	-	0,65%	3,193%	-
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%
IMA-B 5+	-0,06%	5,50%	-2,63%	5,50%	14,42%	34,03%	-	-	-
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	0,65%	7,64%	1,78%	7,64%	25,49%	61,05%	0,50%	0,980%	7,70%
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%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

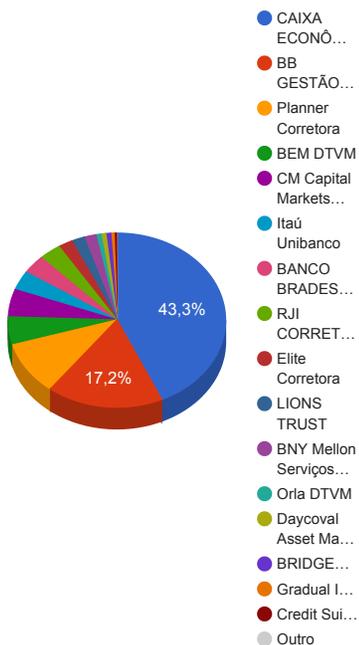
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,81%	5,61%	2,44%	5,61%	12,72%	28,40%	0,20%	0,007%	0,14%
TRX CORPORATIVO I FIDC SÊNIOR	-6,18%	-70,50%	-32,92%	-70,50%	-83,24%	-	1,55%	9,546%	-

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

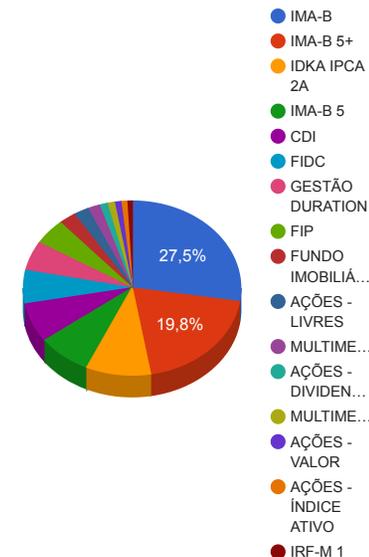
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	0,81%	5,65%	2,54%	5,65%	12,85%	28,75%	-	-	-
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	0,88%	6,81%	2,92%	6,81%	14,42%	36,31%	1,00%	1,310%	14,68%
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	0,78%	4,99%	1,79%	4,99%	12,26%	28,51%	0,55%	0,415%	1,49%
Ibovespa	0,30%	4,44%	-3,21%	4,44%	22,07%	18,50%	-	-	-
CONSTÂNCIA BRASIL FI AÇÕES	0,68%	4,71%	-2,02%	4,71%	19,83%	11,72%	2,00%	5,962%	18,33%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	0,51%	9,02%	-1,57%	9,02%	25,44%	33,86%	2,00%	5,118%	16,43%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,27%	9,87%	-0,23%	9,87%	28,45%	36,47%	1,85%	4,430%	12,94%
IBX	0,30%	5,41%	-2,52%	5,41%	22,39%	18,62%	-	-	-
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	1,11%	5,88%	-0,31%	5,88%	11,10%	15,57%	2,00%	4,543%	15,54%
META VALOR FI AÇÕES	0,41%	9,15%	-3,15%	9,15%	36,51%	23,49%	2,50%	7,346%	26,95%
IDIV	-1,22%	7,20%	-5,99%	7,20%	36,68%	31,17%	-	-	-
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	-0,66%	4,80%	-0,52%	4,80%	8,25%	21,35%	2,00%	3,461%	13,71%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	0,17%	1,14%	0,23%	1,14%	-9,95%	-18,57%	0,00%	0,144%	17,38%
CSHG BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	-1,64%	6,50%	-1,73%	6,50%	26,07%	-	0,60%	2,065%	16,48%
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	-	-	-	-	-	-	1,35%	0,000%	0,00%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	149.404.850,31	43,27%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	59.298.702,67	17,17%
Planner Corretora	34.330.907,00	9,94%
BEM DTVM	17.925.127,86	5,19%
CM Capital Markets DTVM	17.616.887,64	5,10%
Itaú Unibanco	12.275.062,55	3,55%
BANCO BRADESCO	11.997.245,84	3,47%
RJI CORRETORA DE VALORES	11.414.360,64	3,31%
Elite Corretora	7.449.744,68	2,16%
LIONS TRUST	6.484.995,60	1,88%
BNY Mellon Serviços Financeiros	6.264.109,58	1,81%
Orla DTVM	2.605.753,60	0,75%
Daycoval Asset Management	2.511.582,38	0,73%
BRIDGE ADMINISTRADORA DE RECURSOS	2.505.834,92	0,73%
Gradual Investimentos	1.694.087,27	0,49%
Credit Suisse Hedging-Griffo Corretora	1.292.647,99	0,37%
BANCO DAYCOVAL	235.945,41	0,07%



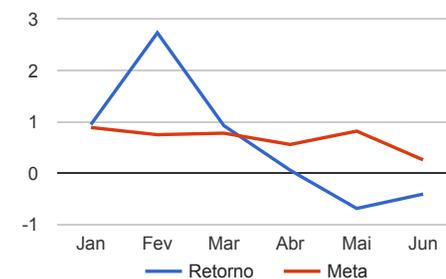
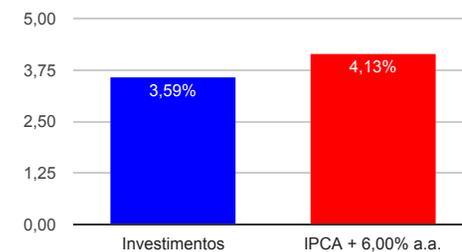
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	95.006.282,91	27,51%
IMA-B 5+	68.367.528,08	19,80%
IDKA IPCA 2A	32.779.171,27	9,49%
IMA-B 5	27.486.138,96	7,96%
CDI	25.112.213,20	7,27%
FIDC	21.371.717,78	6,19%
GESTÃO DURATION	18.840.156,75	5,46%
FIP	16.657.229,26	4,82%
FUNDO IMOBILIÁRIO	8.742.392,67	2,53%
AÇÕES - LIVRES	7.716.568,68	2,23%
MULTIMERCADO - CRÉDITO PRIVADO	6.264.109,58	1,81%
AÇÕES - DIVIDENDOS	4.097.647,46	1,19%
MULTIMERCADO - MODERADO	3.727.500,00	1,08%
AÇÕES - VALOR	3.300.635,99	0,96%
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	3.046.221,14	0,88%
IRF-M 1	2.792.332,21	0,81%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	333.191.383,73	50.805.024,13	50.784.536,34	336.373.007,09	3.161.135,57	0,95%	0,89%	106,36%	3,77%
Fevereiro	336.373.007,09	4.383.044,13	4.286.869,69	345.675.439,19	9.206.257,66	2,74%	0,75%	365,57%	1,99%
Março	345.675.439,19	6.995.766,92	6.873.075,36	349.006.074,13	3.207.943,38	0,93%	0,78%	118,24%	2,54%
Abril	349.006.074,13	15.352.991,65	15.257.588,01	349.300.105,27	198.627,50	0,06%	0,56%	10,20%	1,98%
Mai	349.300.105,27	6.301.198,84	6.303.707,04	346.899.240,40	-2.398.356,67	-0,69%	0,82%	-83,57%	10,57%
Junho	346.899.240,40	10.500.098,33	10.679.315,80	345.307.845,94	-1.412.176,99	-0,41%	0,26%	-159,24%	2,76%
Acumulado no ano					11.963.430,45	3,59%	4,13%	86,97%	

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(%)
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	3.518.377,01	0,00	0,00	3.561.900,39	43.523,38	1,24%	1,25%	1,24%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	12.156.972,94	0,00	0,00	12.275.062,55	118.089,61	0,97%	0,83%	0,97%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	13.926.048,15	0,00	0,00	14.054.987,25	128.939,10	0,93%	-	-
TRX CORPORATIVO I FIDC SÊNIOR	1.805.674,62	0,00	127.418,20	1.694.087,27	15.830,85	0,88%	9,55%	-6,18%
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	13.245.220,92	0,00	0,00	13.360.771,86	115.550,94	0,87%	2,48%	0,87%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.842.846,49	0,00	75.092,73	2.792.332,21	24.578,45	0,86%	0,18%	0,87%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	495.953,63	0,00	0,00	499.983,43	4.029,80	0,81%	0,01%	0,81%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	12.500.560,43	1.110.081,95	2.469.377,27	11.251.457,91	110.192,80	0,81%	0,02%	0,82%
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	4.027.171,72	0,00	0,00	4.053.511,82	26.340,10	0,65%	0,98%	0,65%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.133.812,40	1.390.016,38	0,00	12.604.377,86	80.549,08	0,64%	0,73%	0,62%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	20.052.180,84	0,00	0,00	20.174.793,41	122.612,57	0,61%	0,76%	0,61%
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	0,00	3.000.000,00	0,00	3.016.889,66	16.889,66	0,56%	0,07%	0,99%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.953.087,80	0,00	0,00	10.004.043,01	50.955,21	0,51%	0,93%	0,51%
MULTINVEST GRAU DE INVESTIMENTO FIC FI DE RENDA FIXA	0,00	2.500.000,00	0,00	2.511.582,38	11.582,38	0,46%	3,19%	-0,19%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	8.892.685,24	0,00	0,00	8.930.844,29	38.159,05	0,43%	1,10%	0,43%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	2.473.168,85	0,00	0,00	2.483.516,35	10.347,50	0,42%	2,97%	0,42%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,00	2.500.000,00	0,00	2.505.834,92	5.834,92	0,23%	0,97%	0,46%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.773.014,33	0,00	0,00	10.790.839,98	17.825,65	0,17%	1,70%	0,17%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	71.104.706,01	0,00	0,00	71.211.206,41	106.500,40	0,15%	2,45%	0,15%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	43.865.107,51	0,00	0,00	43.833.781,69	-31.325,82	-0,07%	3,27%	-0,07%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	24.554.896,87	0,00	0,00	24.533.746,39	-21.150,48	-0,09%	3,29%	-0,09%
BRAPRESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	15.017.251,98	0,00	3.000.000,00	11.997.245,84	-20.006,14	-0,13%	2,51%	0,01%

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(%)
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.019.892,51	0,00	5.000.000,00	1.006.990,68	-12.901,83	-0,21%	2,45%	0,15%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	5.106.288,60	0,00	0,00	2.605.753,60	-2.500.535,00	-48,97%	80,60%	-48,97%
Total Renda Fixa					-1.537.587,82	-0,52%	2,84%	

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(%)
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	3.031.117,35	0,00	0,00	3.064.690,58	33.573,23	1,11%	4,54%	1,11%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	3.695.047,27	0,00	0,00	3.727.500,00	32.452,73	0,88%	1,31%	0,88%
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	6.215.694,18	0,00	0,00	6.264.109,58	48.415,40	0,78%	0,42%	0,78%
CONSTÂNCIA BRASIL FI AÇÕES	3.025.687,62	0,00	0,00	3.046.221,14	20.533,52	0,68%	5,96%	0,68%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	3.076.382,63	0,00	0,00	3.092.003,18	15.620,55	0,51%	5,12%	0,51%
META VALOR FI AÇÕES	234.971,46	0,00	0,00	235.945,41	973,95	0,41%	7,35%	0,41%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4.612.144,90	0,00	0,00	4.624.565,50	12.420,60	0,27%	4,43%	0,27%
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	6.474.096,16	0,00	0,00	6.484.995,60	10.899,44	0,17%	0,14%	0,17%
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	7.447.129,26	0,00	0,00	7.449.744,68	2.615,42	0,04%	0,00%	0,04%
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	10.191.950,74	0,00	0,00	10.172.233,66	-19.717,08	-0,19%	-	-
CSHG BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	1.305.292,88	0,00	7.427,60	1.292.647,99	-5.217,29	-0,40%	2,06%	-1,64%
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	4.124.807,10	0,00	0,00	4.097.647,46	-27.159,64	-0,66%	3,46%	-0,66%
Total Renda Variável					125.410,83	0,23%	2,20%	

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 (%)
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	12.940.790,94	0,00	0,00	13.360.771,86	419.980,92	3,25%	3,25%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	18.863.552,00	6.804.183,25	14.787.150,49	11.251.457,91	370.873,15	2,28%	2,57%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	19.527.774,79	299.352,98	0,00	20.174.793,41	347.665,64	1,77%	1,78%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.957.167,22	4.448.705,77	0,00	12.604.377,86	198.504,87	1,82%	1,84%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	13.864.662,51	0,00	0,00	14.054.987,25	190.324,74	1,37%	1,37%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.875.888,40	0,00	0,00	10.004.043,01	128.154,61	1,30%	1,30%
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	3.466.134,88	0,00	0,00	3.561.900,39	95.765,51	2,76%	2,76%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.941.484,36	197,93	224.748,81	2.792.332,21	75.398,73	2,63%	2,63%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	8.869.784,24	0,00	0,00	8.930.844,29	61.060,05	0,69%	0,69%
TRX CORPORATIVO I FIDC SÊNIOR	2.525.443,67	0,00	879.809,01	1.694.087,27	48.452,61	2,26%	-32,92%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	2.455.128,33	0,00	0,00	2.483.516,35	28.388,02	1,16%	1,16%
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	1.034.341,31	3.000.000,00	0,00	4.053.511,82	19.170,51	0,99%	1,78%
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	0,00	3.000.000,00	0,00	3.016.889,66	16.889,66	0,56%	2,80%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	488.053,75	0,00	0,00	499.983,43	11.929,68	2,44%	2,44%
MULTINVEST GRAU DE INVESTIMENTO FIC FI DE RENDA FIXA	0,00	2.500.000,00	0,00	2.511.582,38	11.582,38	0,46%	-1,20%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	12.268.326,92	0,00	0,00	12.275.062,55	6.735,63	0,05%	0,05%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,00	2.500.000,00	0,00	2.505.834,92	5.834,92	0,23%	1,19%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.095.085,49	0,00	299.352,98	10.790.839,98	-4.892,53	-0,04%	-0,09%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.113.892,24	0,00	5.000.000,00	1.006.990,68	-106.901,56	-1,75%	-1,39%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	15.257.543,90	0,00	3.000.000,00	11.997.245,84	-260.298,06	-1,71%	-1,57%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	25.250.448,93	0,00	0,00	24.533.746,39	-716.702,54	-2,84%	-2,84%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	72.209.379,42	0,00	0,00	71.211.206,41	-998.173,01	-1,38%	-1,38%

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 (%)
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	47.596.283,66	5.351.848,89	8.000.000,00	43.833.781,69	-1.114.350,86	-2,26%	-2,55%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	5.083.700,56	0,00	0,00	2.605.753,60	-2.477.946,96	-48,74%	-48,74%
				Total Renda Fixa	-3.642.553,89	-1,23%	

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 (%)
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	6.153.865,84	0,00	0,00	6.264.109,58	110.243,74	1,79%	1,79%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	3.621.790,10	0,00	0,00	3.727.500,00	105.709,90	2,92%	2,92%
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	6.469.815,40	0,00	27.266,76	6.484.995,60	42.446,96	0,66%	0,23%
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	7.447.168,46	0,00	0,00	7.449.744,68	2.576,22	0,03%	-
CSHG BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	1.314.523,47	0,00	22.282,80	1.292.647,99	407,32	0,05%	-1,73%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4.635.137,72	0,00	0,00	4.624.565,50	-10.572,22	-0,23%	-0,23%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	2.076.684,49	1.000.000,00	0,00	3.064.690,58	-11.993,91	-0,39%	-0,31%
META VALOR FI AÇÕES	0,00	250.000,00	0,00	235.945,41	-14.054,59	-5,62%	-3,15%
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	3.115.304,74	1.000.000,00	0,00	4.097.647,46	-17.657,28	-0,43%	-0,52%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	2.133.612,69	1.000.000,00	0,00	3.092.003,18	-41.609,51	-1,33%	-1,57%
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	10.229.606,70	0,00	0,00	10.172.233,66	-57.373,04	-0,56%	-
CONSTÂNCIA BRASIL FI AÇÕES	2.123.697,00	1.000.000,00	0,00	3.046.221,14	-77.475,86	-2,48%	-2,02%
				Total Renda Variável	30.647,73	0,06%	

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	46.390.258,49	21.654.492,42	0,00	71.211.206,41	3.166.455,50	4,78%	5,36%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	24.769.567,73	24.955.267,36	8.000.000,00	43.833.781,69	2.108.946,60	4,91%	5,40%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	30.654.139,26	299.352,98	12.000.000,00	20.174.793,41	1.221.301,17	5,76%	5,71%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	21.281.598,30	10.674.107,54	21.654.376,59	11.251.457,91	950.128,66	5,24%	5,70%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.587.848,74	12.000.000,00	0,00	24.533.746,39	945.897,65	4,01%	5,09%
BRAPRES INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	18.067.287,64	0,00	7.000.000,00	11.997.245,84	929.958,20	4,77%	5,09%
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	12.498.340,31	0,00	0,00	13.360.771,86	862.431,55	6,90%	6,90%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	11.607.637,71	0,00	47.771,72	12.275.062,55	715.196,56	6,16%	6,16%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	24.300.404,23	0,00	15.000.000,00	10.004.043,01	703.638,78	5,49%	5,40%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.484.255,57	0,00	299.352,98	10.790.839,98	605.937,39	5,78%	5,73%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	15.566.145,35	4.448.705,77	8.000.000,00	12.604.377,86	589.526,74	5,66%	5,73%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	13.511.642,84	0,00	0,00	14.054.987,25	543.344,41	4,02%	4,02%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.722.507,90	0,00	5.000.000,00	1.006.990,68	284.482,78	4,97%	5,35%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	8.699.769,04	0,00	0,00	8.930.844,29	231.075,25	2,66%	2,66%
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	3.330.876,94	0,00	0,00	3.561.900,39	231.023,45	6,94%	6,94%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.072.181,68	197,93	456.891,85	2.792.332,21	176.844,45	6,10%	6,11%
TRX CORPORATIVO I FIDC SÊNIOR	5.742.577,25	0,00	4.200.861,29	1.694.087,27	152.371,31	4,92%	-70,50%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.160.909,18	0,00	4.783.428,86	499.983,43	122.503,11	5,61%	5,61%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	2.371.440,05	0,00	0,00	2.483.516,35	112.076,30	4,73%	4,73%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.601.268,41	0,00	7.668.060,79	0,00	66.792,38	0,88%	6,15%
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	0,00	4.000.000,00	0,00	4.053.511,82	53.511,82	4,45%	7,64%
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	0,00	3.000.000,00	0,00	3.016.889,66	16.889,66	0,56%	5,94%

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 (%)
MULTINVEST GRAU DE INVESTIMENTO FIC FI DE RENDA FIXA	0,00	2.500.000,00	0,00	2.511.582,38	11.582,38	0,46%	6,55%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,00	2.500.000,00	0,00	2.505.834,92	5.834,92	0,23%	5,26%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	4.958.570,12	0,00	0,00	2.605.753,60	-2.352.816,52	-47,45%	-47,45%
				Total Renda Fixa	12.454.934,50	4,30%	

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 (%)
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4.209.111,27	0,00	0,00	4.624.565,50	415.454,23	9,87%	9,87%
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	5.966.581,79	0,00	0,00	6.264.109,58	297.527,79	4,99%	4,99%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	3.489.703,06	0,00	0,00	3.727.500,00	237.796,94	6,81%	6,81%
CSHG BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	1.214.712,10	0,00	47.081,40	1.292.647,99	125.017,29	10,31%	6,50%
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.005.504,94	2.000.000,00	0,00	4.097.647,46	92.142,52	5,25%	4,80%
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	6.370.623,06	56.000,00	27.266,76	6.484.995,60	85.639,30	1,33%	1,14%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	1.000.749,28	2.000.000,00	0,00	3.064.690,58	63.941,30	7,34%	5,88%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	1.032.220,98	2.000.000,00	0,00	3.092.003,18	59.782,20	9,45%	9,02%
CONSTÂNCIA BRASIL FI AÇÕES	1.045.097,33	2.000.000,00	0,00	3.046.221,14	1.123,81	5,48%	4,71%
META VALOR FI AÇÕES	0,00	250.000,00	0,00	235.945,41	-14.054,59	-5,62%	9,15%
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	10.288.177,28	0,00	0,00	10.172.233,66	-115.943,62	-1,13%	-
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	9.189.675,90	0,00	0,00	7.449.744,68	-1.739.931,22	-18,93%	-
				Total Renda Variável	-491.504,05	-1,08%	