

Relatório Analítico dos Investimentos em julho 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 (julho / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	25.685.623,97	7,07%	304	1,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	45.855.263,21	12,62%	292	2,80%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	74.040.340,19	20,37%	739	1,32%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.046.834,16	0,29%	605	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	10.286.477,48	2,83%	703	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.747.185,38	0,76%	1.197	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	12.473.130,76	3,43%	112	1,66%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.181.931,70	1,43%	594	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	20.666.133,59	5,69%	706	0,40%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	D+1471	Não há	2.519.110,13	0,69%	29	2,19%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1461	Não há	5.091.638,01	1,40%	8	22,08%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1901	Não há	3.652.946,68	1,00%	10	6,22%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	9.127.897,37	2,51%	33	1,65%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	4.162.965,20	1,15%	20	14,67%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
MULTINVEST GRAU DE INVESTIMENTO FIC FI DE RENDA FIXA	D+4	Não há	5.137.716,78	1,41%	7	19,37%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	16/05/2023	11.200.883,98	3,08%	52	3,97%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	504.071,27	0,14%	434	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	12.585.489,13	3,46%	62	0,86%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	13.616.332,57	3,75%	766	0,24%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	13.446.380,34	3,70%	61	14,85%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	Não possui	1008 dias úteis	3.022.716,81	0,83%	6	12,76%	Artigo 7º, Inciso VI
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	13.898.941,82	3,82%			Artigo 7º, Inciso VI

Carteira consolidada de investimentos - base (julho / 2017)

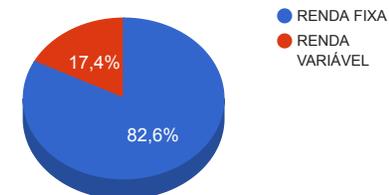
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	2.630.676,68	0,72%	70	3,53%	Artigo 7º, Inciso VI
TRX CORPORATIVO I FIDC SÊNIOR	D+1401	Não Informado	1.528.153,99	0,42%	7	20,78%	Artigo 7º, Inciso VI
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	D+13	Não há	3.190.808,89	0,88%	298	4,43%	Artigo 8º, Inciso III
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	4.832.597,26	1,33%	1.524	4,15%	Artigo 8º, Inciso III
META VALOR FI AÇÕES	D+4	Não há	1.008.577,91	0,28%	15	2,01%	Artigo 8º, Inciso III
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	4.290.032,66	1,18%	130	5,35%	Artigo 8º, Inciso III
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	3.236.529,75	0,89%	1.078	7,74%	Artigo 8º, Inciso III
CONSTÂNCIA BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	3.166.036,75	0,87%	77	4,16%	Artigo 8º, Inciso III
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	3.761.577,57	1,03%	50	6,28%	Artigo 8º, Inciso IV
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+180	Não há	6.329.456,55	1,74%	24	4,06%	Artigo 8º, Inciso IV
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	10.164.654,16	2,80%			Artigo 8º, Inciso V
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	14.671.370,68	4,04%	8	14,08%	Artigo 8º, Inciso V
CSHG BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	Não se aplica	Não se aplica	1.268.328,59	0,35%		0,11%	Artigo 8º, Inciso VI
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	Não se aplica	Não se aplica	7.451.338,18	2,05%		4,91%	Artigo 8º, Inciso VI
		Total	363.480.150,15				

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

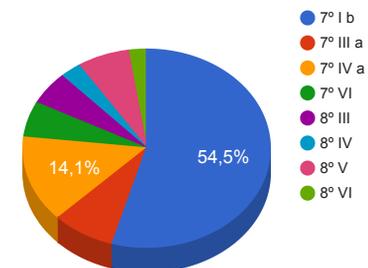
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	197.982.920,44	54,47%	30,00%	35,00%	70,00%	56.453.184,67
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	29.692.274,17	8,17%	15,00%	20,00%	60,00%	188.395.815,92
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	51.353.157,29	14,13%	5,00%	5,00%	30,00%	57.690.887,76
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	21.080.489,30	5,80%	5,00%	10,00%	15,00%	33.441.533,22
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	18.174.007,51
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	18.174.007,51
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	19.724.583,22	5,43%	5,00%	10,00%	15,00%	34.797.439,30
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	10.091.034,12	2,78%	2,00%	5,00%	5,00%	8.082.973,39
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	24.836.024,84	6,83%	2,00%	5,00%	5,00%	-6.662.017,33
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	8.719.666,77	2,40%	2,00%	5,00%	5,00%	9.454.340,74
Total Carteira		363.480.150,15					

RENDA FIXA	300.108.841,20	82,57%
RENDA VARIÁVEL	63.371.308,95	17,43%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: julho / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	197.982.920,44	54,47%	30,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	29.692.274,17	8,17%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	51.353.157,29	14,13%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	21.080.489,30	5,80%	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	19.724.583,22	5,43%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	10.091.034,12	2,78%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	24.836.024,84	6,83%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	8.719.666,77	2,40%	2,00%	5,00%
Total	363.480.150,15	100,00%	66,00	215,00

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5+	4,67%	10,43%	2,76%	8,01%	15,89%	42,86%	-	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4,70%	10,02%	2,58%	7,69%	15,35%	41,51%	0,20%	2,971%	12,84%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4,61%	10,26%	2,79%	7,91%	15,61%	41,52%	0,20%	2,937%	12,75%
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	2,70%	10,54%	3,82%	8,38%	23,76%	66,04%	0,50%	1,486%	7,27%

IMA-B	4,00%	9,67%	2,93%	7,66%	14,97%	38,57%	-	-	-
MULTINVEST GRAU DE INVESTIMENTO FIC FI DE RENDA FIXA	4,20%	11,03%	3,23%	8,71%	17,47%	-	0,65%	2,582%	10,21%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,97%	9,54%	2,89%	7,56%	14,82%	36,75%	0,20%	2,253%	9,84%
BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	3,97%	9,25%	2,68%	7,31%	14,48%	37,29%	0,20%	2,281%	9,85%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,96%	9,52%	2,86%	7,54%	14,73%	37,86%	0,20%	2,242%	9,85%

IMA-B 5	2,85%	8,47%	3,47%	7,23%	13,72%	32,24%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,82%	8,37%	3,44%	7,15%	13,53%	31,44%	0,20%	1,220%	3,64%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2,61%	8,01%	3,21%	7,26%	14,55%	28,33%	0,70%	1,151%	4,08%
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2,56%	9,67%	4,74%	8,51%	14,95%	29,91%	0,97%	1,543%	3,38%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2,21%	4,92%	2,53%	4,60%	9,98%	8,49%	0,70%	1,088%	4,55%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	1,43%	6,23%	1,99%	3,45%	10,83%	-	0,70%	0,826%	7,21%

IDKA IPCA 2 Anos	2,53%	9,07%	3,80%	7,90%	14,69%	32,93%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,44%	8,29%	3,47%	7,12%	13,62%	31,55%	0,20%	0,949%	2,92%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,41%	8,28%	3,48%	7,14%	13,54%	31,73%	0,20%	0,943%	2,85%
IRF-M 1	1,05%	7,36%	2,87%	5,99%	13,48%	30,14%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,06%	7,23%	2,83%	5,89%	13,20%	29,51%	0,10%	0,212%	0,67%
IPCA + 8,00% ao ano	0,88%	6,02%	2,30%	4,91%	10,89%	30,15%	-	-	-
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	0,19%	6,15%	2,14%	5,09%	-	-	0,35%	0,495%	-
IPCA + 7,00% ao ano	0,81%	5,45%	2,06%	4,44%	9,87%	27,76%	-	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	0,96%	-46,95%	-48,48%	-54,82%	-61,50%	-79,03%	0,00%	17,497%	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	-1,11%	2,87%	-0,51%	1,91%	7,56%	24,48%	1,65%	-	-
CDI	0,80%	6,49%	2,55%	5,35%	12,51%	28,27%	-	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,79%	6,53%	2,56%	5,40%	12,54%	28,36%	0,20%	0,017%	0,10%
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	0,64%	7,59%	2,75%	6,35%	14,18%	32,19%	0,75%	1,353%	9,28%
IPCA + 6,00% ao ano	0,73%	4,89%	1,82%	3,96%	8,85%	25,40%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,80%	9,75%	3,54%	8,24%	14,94%	36,59%	0,15%	2,064%	7,02%
IPCA	0,24%	1,43%	0,32%	1,04%	2,71%	11,68%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2,53%	8,85%	2,37%	6,59%	15,08%	37,25%	0,40%	1,090%	6,27%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

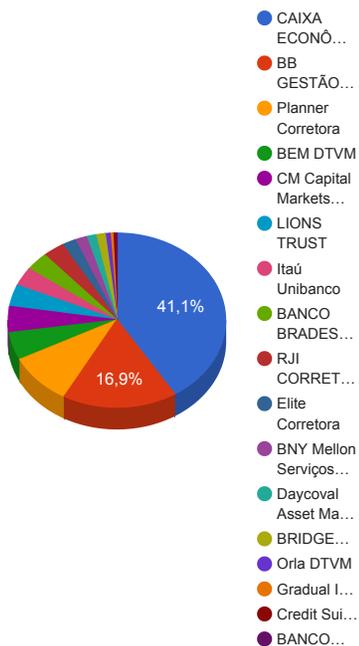
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,82%	6,47%	2,49%	5,31%	12,41%	27,90%	0,20%	0,029%	0,15%
TRX CORPORATIVO I FIDC SÊNIOR	-9,79%	-73,39%	-31,82%	-58,71%	-85,02%	-	1,55%	12,361%	-

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

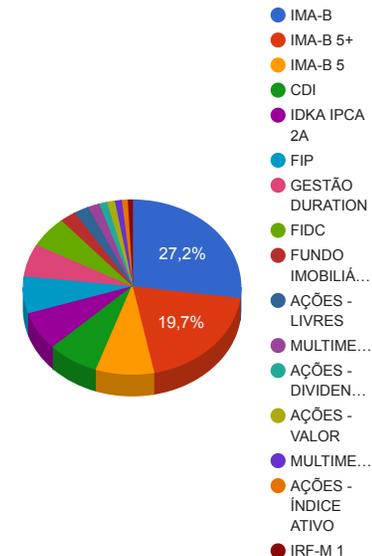
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IBX	4,91%	10,59%	1,38%	3,16%	15,35%	28,88%	-	-	-
META VALOR FI AÇÕES	6,91%	16,69%	2,65%	8,33%	25,21%	37,58%	2,50%	6,124%	25,77%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	4,12%	10,24%	1,91%	5,06%	6,79%	20,22%	2,00%	4,180%	15,08%
IDIV	4,82%	12,37%	-2,35%	3,49%	27,11%	42,43%	-	-	-
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	4,70%	9,72%	2,43%	6,33%	3,55%	28,50%	2,00%	3,477%	13,05%
Ibovespa	4,80%	9,45%	0,79%	1,93%	15,03%	29,60%	-	-	-
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	4,67%	14,12%	2,45%	6,15%	19,49%	42,37%	2,00%	4,189%	16,35%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4,50%	14,81%	2,70%	8,00%	20,98%	41,75%	1,85%	3,382%	12,51%
CONSTÂNCIA BRASIL FI AÇÕES	3,93%	8,83%	1,34%	3,16%	14,04%	19,61%	2,00%	4,939%	18,18%
CDI	0,80%	6,49%	2,55%	5,35%	12,51%	28,27%	-	-	-
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1,04%	6,08%	2,25%	4,69%	11,88%	28,22%	0,55%	0,373%	1,51%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	0,91%	7,79%	2,79%	6,70%	13,74%	35,34%	1,00%	0,708%	13,28%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	126,24%	128,82%	126,09%	128,55%	103,14%	84,50%	0,00%	207,136%	127,40%
CSHG BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	-0,79%	5,67%	0,37%	3,07%	16,57%	-	0,60%	4,689%	15,90%
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	-	-	-	-	-	-	1,35%	0,000%	0,00%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	149.484.416,42	41,13%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	61.346.661,08	16,88%
Planner Corretora	34.558.294,08	9,51%
BEM DTVM	18.716.005,31	5,15%
CM Capital Markets DTVM	17.551.888,50	4,83%
LIONS TRUST	14.671.370,68	4,04%
Itaú Unibanco	12.585.489,13	3,46%
BANCO BRADESCO	12.473.130,76	3,43%
RJI CORRETORA DE VALORES	11.647.007,50	3,20%
Elite Corretora	7.451.338,18	2,05%
BNY Mellon Serviços Financeiros	6.329.456,55	1,74%
Daycoval Asset Management	5.137.716,78	1,41%
BRIDGE ADMINISTRADORA DE RECURSOS	5.091.638,01	1,40%
Orla DTVM	2.630.676,68	0,72%
Gradual Investimentos	1.528.153,99	0,42%
Credit Suisse Hedging-Griffo Corretora	1.268.328,59	0,35%
BANCO DAYCOVAL	1.008.577,91	0,28%



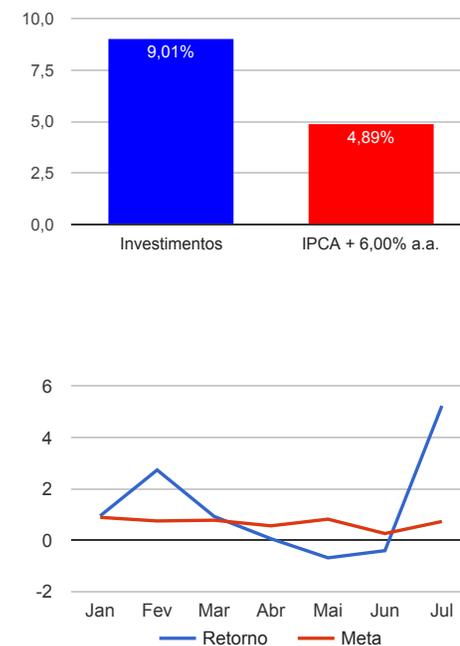
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	98.761.189,09	27,17%
IMA-B 5+	71.540.887,18	19,68%
IMA-B 5	30.678.069,67	8,44%
CDI	27.566.784,18	7,58%
IDKA IPCA 2A	25.848.065,29	7,11%
FIP	24.836.024,84	6,83%
GESTÃO DURATION	21.886.171,11	6,02%
FIDC	21.080.489,30	5,80%
FUNDO IMOBILIÁRIO	8.719.666,77	2,40%
AÇÕES - LIVRES	8.069.127,01	2,22%
MULTIMERCADO - CRÉDITO PRIVADO	6.329.456,55	1,74%
AÇÕES - DIVIDENDOS	4.290.032,66	1,18%
AÇÕES - VALOR	4.199.386,80	1,16%
MULTIMERCADO - MODERADO	3.761.577,57	1,03%
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	3.166.036,75	0,87%
IRF-M 1	2.747.185,38	0,76%



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%
Julho	345.307.845,94	10.537.265,29	10.443.369,99	363.480.150,15	18.078.408,91	5,23%	0,73%	719,04%	11,02%
Acumulado no ano					30.041.839,36	9,01%	4,89%	184,45%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	24.533.746,39	0,00	0,00	25.685.623,97	1.151.877,58	4,70%	2,97%	4,70%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	43.833.781,69	0,00	0,00	45.855.263,21	2.021.481,52	4,61%	2,94%	4,61%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	71.211.206,41	0,00	0,00	74.040.340,19	2.829.133,78	3,97%	2,25%	3,97%
BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	11.997.245,84	0,00	0,00	12.473.130,76	475.884,92	3,97%	2,28%	3,97%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.006.990,68	0,00	0,00	1.046.834,16	39.843,48	3,96%	2,24%	3,96%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.790.839,98	0,00	0,00	11.200.883,98	410.044,00	3,80%	2,06%	3,80%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.004.043,01	0,00	0,00	10.286.477,48	282.434,47	2,82%	1,22%	2,82%
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	4.053.511,82	0,00	0,00	4.162.965,20	109.453,38	2,70%	1,49%	2,70%
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	3.561.900,39	0,00	0,00	3.652.946,68	91.046,29	2,56%	1,54%	2,56%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	12.275.062,55	0,00	0,00	12.585.489,13	310.426,58	2,53%	1,09%	2,53%
MULTINVEST GRAU DE INVESTIMENTO FIC FI DE RENDA FIXA	2.511.582,38	2.500.000,00	0,00	5.137.716,78	126.134,40	2,52%	2,58%	4,20%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	20.174.793,41	0,00	0,00	20.666.133,59	491.340,18	2,44%	0,95%	2,44%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	8.930.844,29	0,00	0,00	9.127.897,37	197.053,08	2,21%	1,09%	2,21%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	12.604.377,86	0,00	7.658.870,52	5.181.931,70	236.424,36	1,88%	0,94%	2,41%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2.505.834,92	2.500.000,00	0,00	5.091.638,01	85.803,09	1,71%	1,15%	2,61%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	2.483.516,35	0,00	0,00	2.519.110,13	35.593,78	1,43%	0,83%	1,43%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.792.332,21	0,00	74.622,08	2.747.185,38	29.475,25	1,06%	0,21%	1,06%
LME REC IPCA FIDC MULTISSECTORIAL SÊNIOR	2.605.753,60	0,00	0,00	2.630.676,68	24.923,08	0,96%	17,50%	0,96%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	499.983,43	0,00	0,00	504.071,27	4.087,84	0,82%	0,03%	0,82%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	11.251.457,91	4.787.265,29	2.529.987,93	13.616.332,57	107.597,30	0,67%	0,02%	0,79%
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	13.360.771,86	0,00	0,00	13.446.380,34	85.608,48	0,64%	1,35%	0,64%
TRX CORPORATIVO I FIDC SÊNIOR	1.694.087,27	0,00	172.461,86	1.528.153,99	6.528,58	0,39%	12,36%	-9,79%

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	3.016.889,66	0,00	0,00	3.022.716,81	5.827,15	0,19%	0,49%	0,19%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	14.054.987,25	0,00	0,00	13.898.941,82	-156.045,43	-1,11%	-	-
Total Renda Fixa					9.001.977,14	3,09%	2,13%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	6.484.995,60	0,00	0,00	14.671.370,68	8.186.375,08	126,24%	207,14%	126,24%
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	4.097.647,46	0,00	0,00	4.290.032,66	192.385,20	4,70%	3,48%	4,70%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	3.092.003,18	0,00	0,00	3.236.529,75	144.526,57	4,67%	4,19%	4,67%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4.624.565,50	0,00	0,00	4.832.597,26	208.031,76	4,50%	3,38%	4,50%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	3.064.690,58	0,00	0,00	3.190.808,89	126.118,31	4,12%	4,18%	4,12%
CONSTÂNCIA BRASIL FI AÇÕES	3.046.221,14	0,00	0,00	3.166.036,75	119.815,61	3,93%	4,94%	3,93%
META VALOR FI AÇÕES	235.945,41	750.000,00	0,00	1.008.577,91	22.632,50	2,30%	6,12%	6,91%
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	6.264.109,58	0,00	0,00	6.329.456,55	65.346,97	1,04%	0,37%	1,04%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	3.727.500,00	0,00	0,00	3.761.577,57	34.077,57	0,91%	0,71%	0,91%
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	7.449.744,68	0,00	0,00	7.451.338,18	1.593,50	0,02%	0,00%	0,02%
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	10.172.233,66	0,00	0,00	10.164.654,16	-7.579,50	-0,07%	-	-
CSHG BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	1.292.647,99	0,00	7.427,60	1.268.328,59	-16.891,80	-1,31%	4,69%	-0,79%
Total Renda Variável					9.076.431,77	16,72%	58,83%	