

Relatório Analítico dos Investimentos em maio de 2017



Carteira consolidada de investimentos - base (maio / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	19.623.808,10	6,45%	181	1,41%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	11.049.856,48	3,63%	114	1,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	4.064.907,91	1,34%	22	0,92%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	14.133.542,78	4,65%	744	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.231.015,31	1,06%	206	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	2.741.574,60	0,90%	30	6,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.300.535,96	0,76%	1.184	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	837.495,67	0,28%	716	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	13.529.377,65	4,45%	609	0,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	41.657.139,39	13,69%	223	1,31%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	4.407.022,06	1,45%	1.348	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	31.370.485,78	10,31%	677	0,63%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.080.479,68	0,68%	716	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	4.185.925,93	1,38%	193	1,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.157.400,75	0,38%	291	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2024	740.135,32	0,24%	17	0,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	7.173.699,01	2,36%	359	0,55%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	834.203,67	0,27%	1.996	0,81%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADERCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.072.876,02	0,68%	83	0,23%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	31.700.998,02	10,42%	58	5,84%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	D+1	Não há	2.715.823,22	0,89%	14	0,79%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	20.068.477,28	6,60%	332	0,81%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "

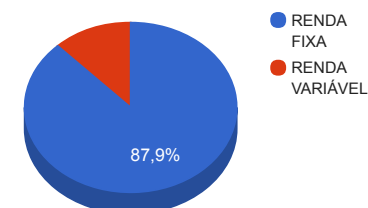
Carteira consolidada de investimentos - base (maio / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	2.604.470,47	0,86%	143	0,25%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	6.395.271,80	2,10%	761	0,14%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRASESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	841.518,06	0,28%	452	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	27.939.578,05	9,19%	426	1,48%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	16/05/2023	4.039.880,36	1,33%	52	1,49%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	998.894,59	0,33%	199	0,29%	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	1.622.215,32	0,53%	52	0,46%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	1.327.064,00	0,44%	100	0,61%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.220.030,49	0,73%	2.716	1,02%	Artigo 8º, Inciso III
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	D+4	Não há	3.981.787,82	1,31%	4.156	4,91%	Artigo 8º, Inciso III
BB PIPE FIC AÇÕES	D+4	03/06/2018	1.102.863,02	0,36%	43	1,13%	Artigo 8º, Inciso III
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	1.460.129,45	0,48%	6.770	0,75%	Artigo 8º, Inciso III
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	2.493.874,10	0,82%	28	6,29%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	1.549.366,34	0,51%	131	1,09%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	D+12	Não há	1.646.001,44	0,54%	354	2,50%	Artigo 8º, Inciso III
XP INVESTOR FI AÇÕES	D+4	Não há	2.108.466,13	0,69%	6.151	0,47%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	2.836.983,10	0,93%	375	7,07%	Artigo 8º, Inciso III
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	D+4	Não há	3.184.406,90	1,05%	7.802	2,09%	Artigo 8º, Inciso III
BB CIELO FI AÇÕES	D+4	Não há	1.645.040,62	0,54%	5.424	1,31%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	D+5	Não há	2.201.443,23	0,72%	33	0,89%	Artigo 8º, Inciso IV
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	10.302.408,89	3,39%	1.226	4,65%	Artigo 8º, Inciso IV
TOTAL -			304.178.474,77				

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

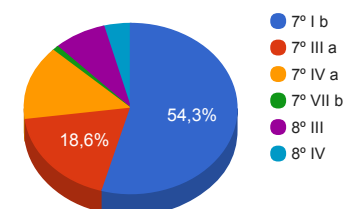
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	165.118.606,05	54,28%	0,00%	0,00%	0,00%	-165.118.606,05
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	56.558.174,54	18,59%	0,00%	0,00%	0,00%	-56.558.174,54
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	42.819.613,33	14,08%	0,00%	0,00%	0,00%	-42.819.613,33
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	2.949.279,32	0,97%	0,00%	0,00%	0,00%	-2.949.279,32
Total Renda Fixa	100,00%	267.445.673,24	87,92%	0,00	0,00	0,00	-

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	24.228.949,41	7,97%	0,00%	0,00%	0,00%	-24.228.949,41
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	12.503.852,12	4,11%	0,00%	0,00%	0,00%	-12.503.852,12
Total Renda Variável	30,00%	36.732.801,53	12,08%	0,00	0,00	0,00	-

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: maio / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	165.118.606,05	54,28%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	56.558.174,54	18,59%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	42.819.613,33	14,08%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	2.949.279,32	0,97%	0,00%	0,00%
Total Renda Fixa	267.445.673,24	87,92%	0,00	0,00

Artigos - Renda Variável	Base: maio / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso III	24.228.949,41	7,97%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso IV	12.503.852,12	4,11%	0,00%	0,00%
Total Renda Variável	36.732.801,53	12,08%	0,00	0,00

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA + 6,00% ao ano	0,97%	4,02%	2,33%	4,86%	9,98%	27,41%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,86%	4,14%	2,39%	4,91%	10,68%	28,75%	0,20%	0,086%	0,25%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,41%	5,56%	1,37%	7,41%	13,65%	31,88%	0,15%	8,922%	7,14%
Selic	0,93%	4,81%	2,79%	5,98%	13,27%	29,12%	-	-	-
BRASESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,93%	4,95%	2,92%	6,13%	13,69%	29,60%	0,20%	0,008%	0,09%
CDI	0,93%	4,80%	2,79%	5,97%	13,25%	29,08%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,92%	4,85%	2,80%	6,04%	13,32%	29,13%	0,20%	0,022%	0,18%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,85%	4,45%	2,58%	5,55%	12,32%	26,95%	0,80%	0,000%	0,06%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,84%	4,75%	2,69%	5,91%	13,10%	28,65%	0,20%	0,161%	0,14%
IRF-M 1	0,91%	5,31%	2,94%	6,57%	13,69%	30,50%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,90%	5,24%	2,91%	6,48%	13,48%	30,10%	0,20%	0,955%	0,65%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,89%	5,20%	2,87%	6,42%	13,36%	29,82%	0,10%	0,964%	0,66%
BRASESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,88%	5,20%	2,86%	6,43%	13,43%	29,97%	0,20%	0,982%	0,67%
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	0,75%	5,29%	2,66%	6,68%	13,91%	29,84%	0,50%	1,581%	1,15%
IPCA	0,46%	1,57%	0,85%	1,87%	3,75%	13,42%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,67%	4,57%	2,64%	5,83%	11,32%	30,93%	0,20%	1,785%	1,74%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	-0,02%	6,05%	2,32%	7,79%	15,02%	33,46%	0,20%	5,807%	4,81%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDKA IPCA 2 Anos	0,45%	5,54%	3,02%	6,90%	13,04%	32,14%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,71%	4,89%	2,84%	6,06%	12,05%	29,85%	0,20%	2,337%	1,86%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,41%	5,07%	2,64%	6,36%	12,38%	31,14%	0,20%	3,767%	2,85%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,39%	5,07%	2,58%	6,38%	12,32%	30,95%	0,20%	3,873%	2,93%
IRF-M	0,30%	6,80%	2,36%	8,77%	17,67%	34,63%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,25%	6,68%	2,24%	8,61%	17,38%	34,04%	0,20%	6,393%	4,86%
IRF-M 1+	0,09%	7,35%	2,15%	9,62%	19,47%	36,88%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,09%	7,21%	1,96%	9,44%	19,17%	36,79%	0,20%	8,320%	6,49%
IMA-B 5	0,08%	4,92%	2,20%	6,38%	12,37%	31,29%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,08%	4,86%	2,17%	6,30%	12,18%	30,41%	0,20%	4,893%	3,58%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	0,05%	4,84%	2,14%	6,29%	12,16%	30,82%	0,10%	4,895%	3,59%
IMA Geral	0,01%	5,69%	1,52%	7,68%	15,36%	31,64%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,08%	5,68%	1,58%	7,70%	15,49%	31,07%	0,20%	6,387%	4,77%
IDKA IPCA 20 Anos	-3,88%	5,73%	-6,30%	13,29%	23,74%	34,75%	-	-	-
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-3,43%	5,35%	-4,50%	11,30%	20,89%	34,13%	0,20%	25,048%	18,59%
IMA-B 5+	-1,78%	5,56%	-1,72%	9,48%	17,43%	33,12%	-	-	-

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,67%	5,47%	-1,66%	9,38%	17,23%	31,89%	0,20%	16,974%	12,71%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	-1,81%	5,47%	-1,90%	9,42%	17,31%	31,83%	0,20%	17,448%	13,02%
IMA-B	-1,19%	5,28%	-0,48%	8,34%	15,32%	31,71%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,71%	1,99%	2,85%	3,14%	5,79%	15,73%	0,20%	2,370%	4,56%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,39%	3,15%	0,87%	4,98%	7,91%	-	0,20%	9,476%	8,79%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	-0,96%	5,15%	-0,55%	8,10%	15,23%	30,33%	0,20%	12,692%	9,34%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,19%	5,20%	-0,51%	8,22%	15,18%	29,64%	0,20%	13,312%	9,77%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	-1,24%	5,08%	-0,58%	8,11%	14,99%	30,47%	0,20%	13,329%	9,78%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	-1,69%	4,71%	-0,75%	7,58%	14,15%	32,19%	0,45%	13,698%	10,12%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	-1,94%	4,62%	-1,11%	7,58%	14,43%	30,89%	0,15%	14,092%	10,30%

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

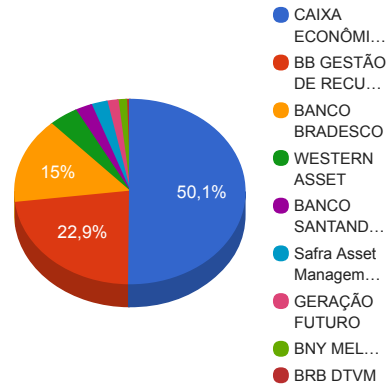
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
S&P 500	1,16%	7,73%	1,88%	9,69%	15,01%	14,44%	-	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	2,21%	12,01%	4,79%	15,55%	29,14%	45,24%	1,00%	3,541%	9,47%
CDI	0,93%	4,80%	2,79%	5,97%	13,25%	29,08%	-	-	-
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	-0,60%	3,46%	0,57%	4,90%	14,37%	34,45%	2,00%	1,210%	1,95%
IFNC	-7,59%	5,75%	-8,12%	4,15%	30,23%	30,18%	-	-	-
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	-7,76%	4,95%	-8,52%	3,32%	28,27%	27,52%	1,00%	21,977%	25,85%
IDIV	-5,70%	8,52%	-6,59%	7,56%	49,01%	29,48%	-	-	-
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	0,74%	8,14%	-5,13%	9,01%	21,40%	39,67%	3,00%	16,079%	19,37%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	-5,34%	-2,47%	-8,48%	-0,31%	13,90%	-5,79%	3,00%	16,273%	21,29%
CIELO ON NM - CIEL3	-5,35%	-0,86%	0,96%	-6,97%	-12,20%	-15,01%	-	-	-
BB CIELO FI AÇÕES	-5,39%	-1,47%	0,57%	-7,54%	-13,41%	-17,67%	1,50%	17,506%	28,63%
Ibovespa	-4,12%	4,12%	-5,93%	1,30%	29,38%	18,86%	-	-	-
XP INVESTOR FI AÇÕES	-0,81%	5,75%	-5,29%	5,31%	29,67%	51,54%	2,00%	18,219%	21,42%
BB PIPE FIC AÇÕES	-1,15%	8,30%	2,24%	9,06%	17,28%	19,23%	1,20%	14,123%	16,79%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	-4,77%	6,33%	-4,83%	5,96%	24,45%	11,54%	2,00%	20,285%	23,11%
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	-4,84%	0,98%	-7,11%	-0,83%	20,86%	11,25%	1,00%	18,826%	21,81%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	-5,51%	-2,63%	-6,87%	2,36%	23,40%	7,92%	2,00%	19,319%	22,39%

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

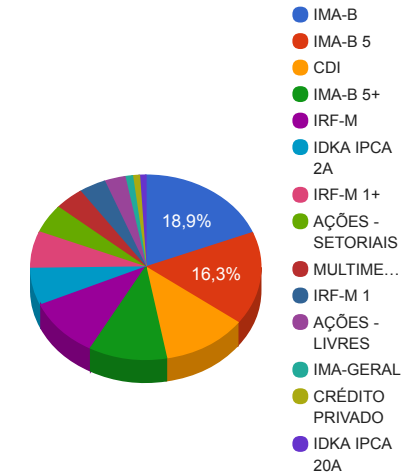
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
GERAÇÃO FI AÇÕES	-6,10%	-3,05%	-9,26%	-0,57%	22,13%	3,57%	3,00%	19,327%	22,93%
BBSEGURIDADE ON NM - BBSE3	-2,64%	5,88%	1,68%	5,91%	12,98%	-1,67%	-	-	-
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	-2,77%	5,06%	1,27%	4,96%	11,23%	-4,95%	1,5%	20,414%	29,05%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	152.487.934,05	50,13%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	69.748.812,36	22,93%
BANCO BRADESCO	45.665.248,58	15,01%
WESTERN ASSET	12.503.852,12	4,11%
BANCO SANTANDER	7.173.699,01	2,36%
Safra Asset Management	6.780.731,13	2,23%
GERAÇÃO FUTURO	4.700.235,60	1,55%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	3.568.595,58	1,17%
BRB DTVM	1.549.366,34	0,51%



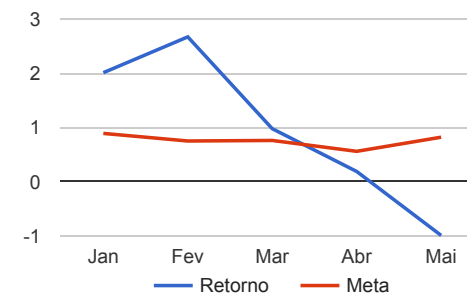
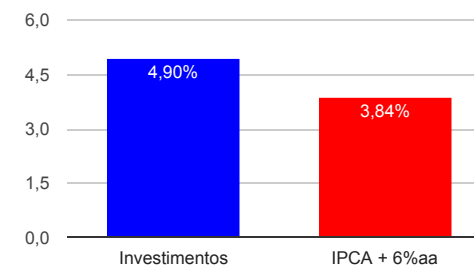
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	57.535.474,27	18,92%
IMA-B 5	49.668.334,07	16,33%
CDI	36.175.262,50	11,89%
IMA-B 5+	32.858.398,77	10,80%
IRF-M	31.370.485,78	10,31%
IDKA IPCA 2A	19.795.783,26	6,51%
IRF-M 1+	19.623.808,10	6,45%
AÇÕES - SETORIAIS	15.328.378,38	5,04%
MULTIMERCADO	12.503.852,12	4,11%
IRF-M 1	11.496.257,26	3,78%
AÇÕES - LIVRES	8.900.571,03	2,93%
IMA-GERAL	3.231.015,31	1,06%
CRÉDITO PRIVADO	2.949.279,32	0,97%
IDKA IPCA 20A	2.741.574,60	0,90%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	289.253.086,32	79.253.804,09	79.346.450,27	294.967.303,19	5.806.863,05	2,01%	0,89%	225,57%	2,71%
Fevereiro	294.967.303,19	19.962.969,81	19.256.670,24	303.557.146,11	7.883.543,35	2,67%	0,75%	355,51%	2,49%
Março	303.557.146,11	20.627.199,18	20.913.377,84	306.235.719,08	2.964.751,63	0,98%	0,76%	127,76%	2,15%
Abril	306.235.719,08	6.721.648,38	6.833.156,79	306.703.491,71	579.281,04	0,19%	0,56%	33,92%	1,95%
Mai	306.703.491,71	70.417.662,46	69.907.597,82	304.178.474,77	-3.035.081,58	-0,99%	0,82%	-120,25%	8,10%
Acumulado no ano					14.199.357,49	4,90%	3,84%	127,66%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	833.749,71	0,00	0,00	841.518,06	7.768,35	0,93%	0,01%	0,93%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.336.826,36	0,00	0,00	6.395.271,80	58.445,44	0,92%	0,02%	0,92%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.367.651,95	0,00	0,00	4.407.022,06	39.370,11	0,90%	0,96%	0,90%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.280.311,03	0,00	0,00	2.300.535,96	20.224,93	0,89%	0,96%	0,89%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	2.054.798,72	0,00	0,00	2.072.876,02	18.077,30	0,88%	0,98%	0,88%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.582.262,77	0,00	0,00	2.604.470,47	22.207,70	0,86%	0,09%	0,86%
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	2.695.629,21	0,00	0,00	2.715.823,22	20.194,01	0,75%	1,58%	0,75%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.156.447,34	0,00	0,00	4.185.925,93	29.478,59	0,71%	2,34%	0,71%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	41.363.777,28	0,00	0,00	41.657.139,39	293.362,11	0,71%	2,37%	0,71%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.318.285,00	0,00	0,00	1.327.064,00	8.779,00	0,67%	1,79%	0,67%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	13.473.680,92	0,00	0,00	13.529.377,65	55.696,73	0,41%	3,77%	0,41%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.843.071,52	43.300.000,00	21.400.000,00	27.939.578,05	196.506,53	0,40%	0,16%	0,84%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.072.355,41	0,00	0,00	2.080.479,68	8.124,27	0,39%	3,87%	0,39%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	31.181.865,41	112.299,08	0,00	31.370.485,78	76.321,29	0,24%	6,39%	0,25%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	19.605.375,06	0,00	0,00	19.623.808,10	18.433,04	0,09%	8,32%	0,09%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	836.786,88	0,00	0,00	837.495,67	708,79	0,08%	4,89%	0,08%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.228.557,75	0,00	0,00	3.231.015,31	2.457,56	0,08%	6,39%	0,08%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	563.614,09	6.787.428,86	6.356.582,48	998.894,59	4.434,12	0,06%	0,00%	0,85%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	7.169.918,62	0,00	0,00	7.173.699,01	3.780,39	0,05%	4,90%	0,05%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	112.257,37	112.299,08	0,00	41,71	0,04%	0,01%	0,82%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1.622.618,93	0,00	0,00	1.622.215,32	-403,61	-0,02%	5,81%	-0,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.167.377,76	0,00	112.257,37	4.039.880,36	-15.240,03	-0,37%	8,92%	-0,41%

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	743.019,12	0,00	0,00	740.135,32	-2.883,80	-0,39%	9,48%	-0,39%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	14.212.387,60	91.908,99	0,00	14.133.542,78	-170.753,81	-1,19%	13,31%	-1,19%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	11.188.646,51	0,00	0,00	11.049.856,48	-138.790,03	-1,24%	13,33%	-1,24%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.177.095,96	0,00	0,00	1.157.400,75	-19.695,21	-1,67%	16,97%	-1,67%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	4.134.698,40	0,00	0,00	4.064.907,91	-69.790,49	-1,69%	13,70%	-1,69%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	32.285.124,39	0,00	0,00	31.700.998,02	-584.126,37	-1,81%	17,45%	-1,81%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	850.695,01	0,00	0,00	834.203,67	-16.491,34	-1,94%	14,09%	-1,94%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	43.864.861,08	20.013.768,16	41.926.458,89	20.068.477,28	-1.883.693,07	-2,95%	12,69%	-0,96%
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.838.864,79	0,00	0,00	2.741.574,60	-97.290,19	-3,43%	25,05%	-3,43%
Total Renda Fixa					-2.114.745,98	-0,78%	7,34%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	10.079.829,31	0,00	0,00	10.302.408,89	222.579,58	2,21%	3,54%	2,21%
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.449.338,39	0,00	0,00	1.460.129,45	10.791,06	0,74%	16,08%	0,74%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	2.214.772,28	0,00	0,00	2.201.443,23	-13.329,05	-0,60%	1,21%	-0,60%
XP INVESTOR FI AÇÕES	2.125.780,71	0,00	0,00	2.108.466,13	-17.314,58	-0,81%	18,22%	-0,81%
BB PIPE FIC AÇÕES	1.115.663,34	0,00	0,00	1.102.863,02	-12.800,32	-1,15%	14,12%	-1,15%
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	3.275.105,58	0,00	0,00	3.184.406,90	-90.698,68	-2,77%	20,41%	-2,77%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	2.979.064,75	0,00	0,00	2.836.983,10	-142.081,65	-4,77%	20,29%	-4,77%
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	2.620.834,07	0,00	0,00	2.493.874,10	-126.959,97	-4,84%	18,83%	-4,84%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.345.194,77	0,00	0,00	2.220.030,49	-125.164,28	-5,34%	16,27%	-5,34%
BB CIELO FI AÇÕES	1.738.788,36	0,00	0,00	1.645.040,62	-93.747,74	-5,39%	17,51%	-5,39%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	1.741.959,91	0,00	0,00	1.646.001,44	-95.958,47	-5,51%	19,32%	-5,51%
GERAÇÃO FI AÇÕES	1.650.091,94	0,00	0,00	1.549.366,34	-100.725,60	-6,10%	19,33%	-6,10%
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	4.316.713,72	0,00	0,00	3.981.787,82	-334.925,90	-7,76%	21,98%	-7,76%
Total Renda Variável					-920.335,60	-2,44%	13,62%	