

# Relatório Analítico dos Investimentos em julho de 2017



Carteira consolidada de investimentos - base (julho / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	2.883.131,23	0,92%	30	6,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	865.548,51	0,28%	703	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	42.586.055,02	13,57%	222	1,31%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	4.491.501,01	1,43%	1.367	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	14.909.110,86	4,75%	739	0,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	4.278.731,70	1,36%	193	1,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.209.911,91	0,39%	292	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.144.179,29	0,68%	706	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2024	769.618,48	0,25%	17	0,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	32.518.604,84	10,36%	686	0,64%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	13.942.309,89	4,44%	594	0,39%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	868.611,58	0,28%	1.839	0,85%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.344.957,11	0,75%	1.197	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	11.488.922,80	3,66%	112	1,53%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	20.467.704,76	6,52%	185	1,52%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	4.243.862,02	1,35%	23	1,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	7.413.642,00	2,36%	356	0,56%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.332.446,40	1,06%	202	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.113.644,16	0,67%	86	0,22%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	33.136.193,82	10,56%	60	5,85%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	D+1	Não há	2.773.305,80	0,88%	14	0,78%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	20.878.706,41	6,65%	325	0,83%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "

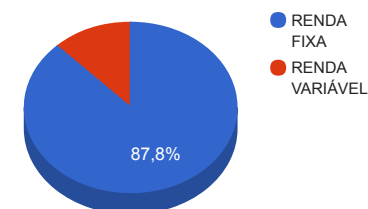
Carteira consolidada de investimentos - base (julho / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	6.499.260,35	2,07%	772	0,16%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	27.941.769,16	8,91%	434	1,47%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	16/05/2023	4.200.331,48	1,34%	52	1,49%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	724.628,61	0,23%	213	0,23%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	2.629.370,37	0,84%	143	0,25%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRASESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	855.393,87	0,27%	493	0,01%	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	1.685.245,56	0,54%	61	0,40%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	1.352.681,00	0,43%	100	0,61%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BB CIELO FI AÇÕES	D+4	Não há	1.885.763,03	0,60%	5.081	1,40%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	1.592.311,51	0,51%	126	1,39%	Artigo 8º, Inciso III
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	D+4	Não há	4.215.609,96	1,34%	4.074	5,29%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	D+12	Não há	1.732.894,25	0,55%	341	2,73%	Artigo 8º, Inciso III
XP INVESTOR FI AÇÕES	D+4	Não há	2.264.677,79	0,72%	5.722	0,49%	Artigo 8º, Inciso III
BB PIPE FIC AÇÕES	D+4	03/06/2018	1.165.924,17	0,37%	43	1,13%	Artigo 8º, Inciso III
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	2.578.832,10	0,82%	29	6,08%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.267.296,93	0,72%	2.634	1,30%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	2.989.257,05	0,95%	360	7,58%	Artigo 8º, Inciso III
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	D+4	Não há	2.997.156,83	0,96%	7.596	1,95%	Artigo 8º, Inciso III
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	1.582.994,92	0,50%	6.829	0,55%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	10.689.449,42	3,41%	3.069	3,07%	Artigo 8º, Inciso IV
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	D+5	Não há	2.241.425,90	0,71%	33	0,94%	Artigo 8º, Inciso IV
<b>TOTAL -</b>			<b>313.752.973,86</b>				

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

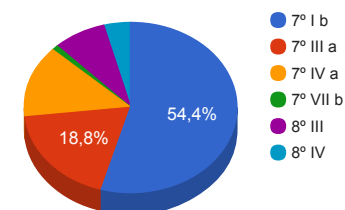
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	170.758.849,41	54,42%	50,00%	58,00%	75,00%	64.555.880,99
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	58.901.850,19	18,77%	10,00%	20,00%	50,00%	97.974.636,74
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	42.850.753,84	13,66%	5,00%	8,00%	30,00%	51.275.138,32
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	3.037.926,56	0,97%	0,00%	1,00%	5,00%	12.649.722,13
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>275.549.380,00</b>	<b>87,82%</b>	<b>85,00</b>	<b>87,00</b>	<b>210,00</b>	<b>-</b>

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	25.272.718,54	8,05%	5,00%	9,00%	15,00%	21.790.227,54
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	12.930.875,32	4,12%	2,00%	4,00%	5,00%	2.756.773,37
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>38.203.593,86</b>	<b>12,18%</b>	<b>7,00</b>	<b>13,00</b>	<b>35,00</b>	<b>-</b>

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: julho / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	0,00	0,00%	20,00%	50,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	170.758.849,41	54,42%	50,00%	75,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	58.901.850,19	18,77%	10,00%	50,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	42.850.753,84	13,66%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	3.037.926,56	0,97%	0,00%	5,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>275.549.380,00</b>	<b>87,82%</b>	<b>85,00</b>	<b>210,00</b>

Artigos - Renda Variável	Base: julho / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso III	25.272.718,54	8,05%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	12.930.875,32	4,12%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>38.203.593,86</b>	<b>12,18%</b>	<b>7,00</b>	<b>35,00</b>

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
IDKA IPCA 20 Anos	6,30%	11,78%	1,62%	8,05%	17,94%	56,46%	-	-	-
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5,57%	10,79%	1,56%	7,74%	16,54%	48,98%	0,20%	3,965%	18,69%
IMA-B 5+	4,67%	10,43%	2,76%	8,01%	15,89%	42,86%	-	-	-
BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	4,62%	10,24%	2,64%	7,78%	15,61%	41,63%	0,20%	2,955%	13,07%
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%
IMA-B	4,00%	9,67%	2,93%	7,66%	14,97%	38,57%	-	-	-
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	4,30%	9,32%	2,64%	7,49%	14,25%	37,47%	0,45%	2,474%	10,20%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	4,01%	8,93%	2,11%	6,90%	14,25%	36,93%	0,15%	2,301%	10,35%
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%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3,82%	7,26%	3,58%	5,40%	8,96%	-	0,20%	2,279%	8,70%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	3,77%	9,25%	2,89%	7,22%	14,74%	37,15%	0,20%	2,150%	9,41%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,66%	4,27%	2,95%	3,23%	6,22%	15,38%	0,20%	0,658%	4,51%
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%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	2,82%	8,34%	3,40%	7,12%	13,52%	31,75%	0,10%	1,226%	3,65%
IRF-M 1+	2,76%	11,98%	4,41%	9,07%	19,64%	41,12%	-	-	-

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 IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,77%	11,82%	4,40%	8,89%	19,48%	41,17%	0,20%	1,341%	6,47%
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%
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%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,64%	7,21%	2,94%	6,14%	11,83%	29,50%	0,20%	0,649%	1,92%
IMA Geral	2,34%	9,05%	3,19%	7,11%	14,99%	34,75%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,30%	9,00%	3,22%	7,12%	15,17%	34,15%	0,20%	1,022%	4,79%
IRF-M	2,31%	10,74%	4,00%	8,27%	17,91%	37,45%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,31%	10,59%	3,92%	8,10%	17,68%	36,85%	0,20%	1,028%	4,87%
IRF-M 1	1,05%	7,36%	2,87%	5,99%	13,48%	30,14%	-	-	-
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	1,14%	7,52%	2,88%	6,03%	13,72%	29,74%	0,50%	0,249%	1,17%
BRADERCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1,06%	7,27%	2,86%	5,94%	13,30%	29,71%	0,20%	0,193%	0,68%
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%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,04%	7,25%	2,84%	5,92%	13,28%	29,76%	0,20%	0,199%	0,66%
Selic	0,80%	6,50%	2,56%	5,35%	12,52%	28,31%	-	-	-
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,81%	6,68%	2,60%	5,53%	12,94%	28,82%	0,20%	0,008%	0,11%

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
CDI	0,80%	6,49%	2,55%	5,35%	12,51%	28,27%	-	-	-
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%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,81%	6,56%	2,56%	5,40%	12,68%	28,28%	0,20%	0,007%	0,10%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,73%	6,00%	2,34%	4,93%	11,60%	26,18%	0,80%	0,008%	0,08%
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%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,45%	5,13%	1,82%	4,16%	9,49%	26,60%	0,20%	0,105%	0,29%
IPCA	0,24%	1,43%	0,32%	1,04%	2,71%	11,68%	-	-	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	2,91%	10,17%	3,86%	8,65%	16,57%	36,41%	0,20%	1,377%	4,72%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,31%	6,59%	2,61%	5,60%	11,83%	30,36%	0,20%	0,474%	1,65%



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

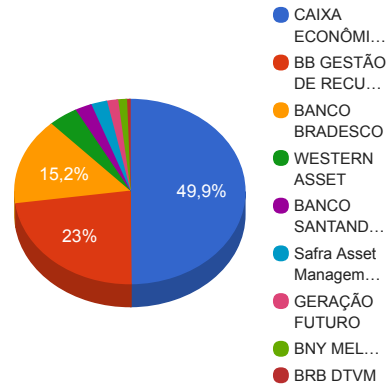
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CIELO ON NM - CIEL3	6,10%	13,99%	8,83%	19,54%	-12,78%	-10,61%	-	-	-
BB CIELO FI AÇÕES	5,92%	12,95%	8,45%	18,55%	-13,81%	-13,45%	1,50%	5,692%	28,12%
IDIV	4,82%	12,37%	-2,35%	3,49%	27,11%	42,43%	-	-	-
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	4,66%	17,24%	9,22%	7,62%	16,77%	52,41%	3,00%	4,366%	19,08%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	1,87%	-0,40%	-3,32%	-5,00%	2,70%	-7,95%	3,00%	3,753%	20,31%
Ibovespa	4,80%	9,45%	0,79%	1,93%	15,03%	29,60%	-	-	-
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	5,73%	12,04%	0,34%	6,14%	6,05%	23,74%	2,00%	4,130%	22,19%
XP INVESTOR FI AÇÕES	5,35%	13,59%	6,53%	4,98%	16,35%	58,14%	2,00%	3,902%	20,53%
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	4,65%	4,42%	-1,60%	-0,74%	7,02%	16,72%	1,00%	4,872%	20,98%
BB PIPE FIC AÇÕES	3,98%	14,49%	4,51%	9,09%	6,71%	26,55%	1,20%	4,891%	16,17%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	3,78%	2,51%	-0,52%	-1,51%	10,18%	9,83%	2,00%	3,708%	21,29%
GERAÇÃO FI AÇÕES	2,68%	-0,36%	-3,50%	-5,98%	8,69%	2,33%	3,00%	4,223%	21,92%
IFNC	4,08%	12,23%	-1,92%	3,16%	16,84%	38,84%	-	-	-
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	3,97%	11,11%	-2,34%	2,30%	15,01%	35,88%	1,00%	5,769%	24,89%
S&P 500	1,93%	10,34%	3,61%	8,40%	13,65%	17,42%	-	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	2,60%	16,22%	6,05%	13,91%	26,67%	47,89%	1,00%	2,243%	7,65%
CDI	0,80%	6,49%	2,55%	5,35%	12,51%	28,27%	-	-	-

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

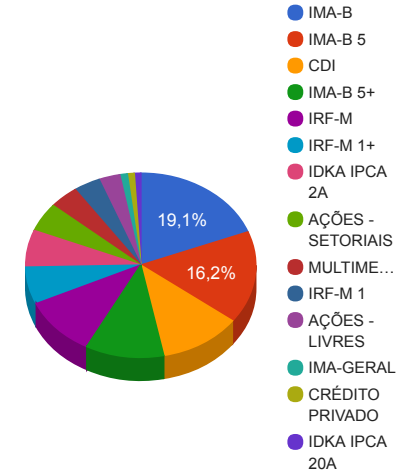
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	0,97%	5,34%	1,20%	3,39%	13,18%	32,22%	2,00%	0,336%	1,73%
BBSEGURIDADE ON NM - BBSE3	-4,19%	-0,13%	-8,16%	1,27%	-3,61%	-4,08%	-	-	-
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	-4,30%	-1,12%	-8,49%	0,39%	-5,03%	-7,26%	1,5%	9,094%	28,09%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	156.461.249,07	49,87%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	72.027.098,02	22,96%
BANCO BRADESCO	47.594.154,65	15,17%
WESTERN ASSET	12.930.875,32	4,12%
BANCO SANTANDER	7.413.642,00	2,36%
Safra Asset Management	7.017.167,82	2,24%
GERAÇÃO FUTURO	4.868.802,76	1,55%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	3.847.672,71	1,23%
BRB DTVM	1.592.311,51	0,51%



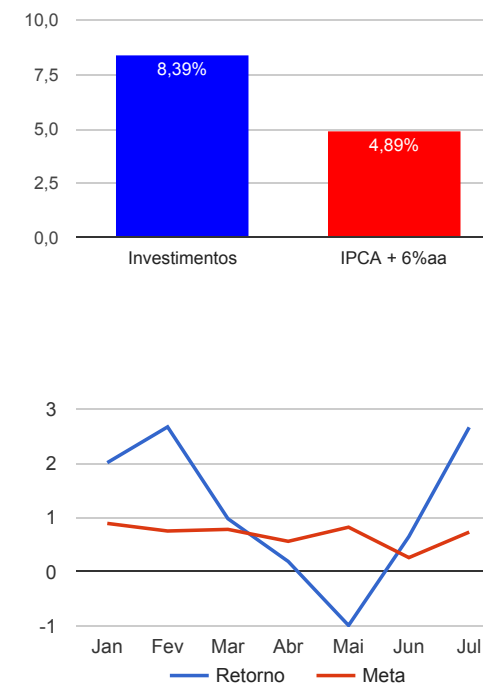
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	59.988.534,00	19,12%
IMA-B 5	50.865.245,53	16,21%
CDI	36.021.051,99	11,48%
IMA-B 5+	34.346.105,73	10,95%
IRF-M	32.518.604,84	10,36%
IRF-M 1+	20.467.704,76	6,52%
IDKA IPCA 2A	20.365.220,88	6,49%
AÇÕES - SETORIAIS	15.938.078,72	5,08%
MULTIMERCADO	12.930.875,32	4,12%
IRF-M 1	11.723.408,08	3,74%
AÇÕES - LIVRES	9.334.639,82	2,98%
IMA-GERAL	3.332.446,40	1,06%
CRÉDITO PRIVADO	3.037.926,56	0,97%
IDKA IPCA 20A	2.883.131,23	0,92%



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%	0,78%	124,48%	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%
Junho	304.178.474,77	7.155.613,40	7.706.564,30	305.599.542,75	1.972.018,88	0,65%	0,26%	253,61%	1,95%
Julho	305.599.542,75	7.095.270,35	7.065.123,69	313.752.973,86	8.123.284,45	2,66%	0,73%	365,13%	1,67%
Acumulado no ano					24.294.660,82	8,39%	4,89%	171,74%	

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 IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.730.928,10	0,00	0,00	2.883.131,23	152.203,13	5,57%	3,96%	5,57%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	31.673.422,43	0,00	0,00	33.136.193,82	1.462.771,39	4,62%	2,95%	4,62%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.156.574,20	0,00	0,00	1.209.911,91	53.337,71	4,61%	2,94%	4,61%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	4.069.022,49	0,00	0,00	4.243.862,02	174.839,53	4,30%	2,47%	4,30%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	835.151,06	0,00	0,00	868.611,58	33.460,52	4,01%	2,30%	4,01%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	14.247.536,43	91.908,99	0,00	14.909.110,86	569.665,44	3,97%	2,25%	3,97%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	11.050.588,18	0,00	0,00	11.488.922,80	438.334,62	3,97%	2,28%	3,97%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	741.287,88	0,00	0,00	769.618,48	28.330,60	3,82%	2,28%	3,82%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.046.564,98	0,00	0,00	4.200.331,48	153.766,50	3,80%	2,06%	3,80%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	20.091.704,85	28.276,06	0,00	20.878.706,41	758.725,50	3,77%	2,15%	3,77%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1.637.588,62	0,00	0,00	1.685.245,56	47.656,94	2,91%	1,38%	2,91%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	841.783,26	0,00	0,00	865.548,51	23.765,25	2,82%	1,22%	2,82%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	7.210.199,85	0,00	0,00	7.413.642,00	203.442,15	2,82%	1,23%	2,82%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	19.915.963,76	0,00	0,00	20.467.704,76	551.741,00	2,77%	1,34%	2,77%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.093.201,14	0,00	0,00	2.144.179,29	50.978,15	2,44%	0,95%	2,44%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	13.613.881,40	0,00	0,00	13.942.309,89	328.428,49	2,41%	0,94%	2,41%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	31.785.643,39	0,00	0,00	32.518.604,84	732.961,45	2,31%	1,03%	2,31%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.257.532,52	0,00	0,00	3.332.446,40	74.913,88	2,30%	1,02%	2,30%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	41.892.503,56	0,00	0,00	42.586.055,02	693.551,46	1,66%	0,66%	1,66%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.209.609,43	0,00	0,00	4.278.731,70	69.122,27	1,64%	0,65%	1,64%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.335.254,00	0,00	0,00	1.352.681,00	17.427,00	1,31%	0,47%	1,31%
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	2.741.998,65	0,00	0,00	2.773.305,80	31.307,15	1,14%	0,25%	1,14%

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(%)
BRDESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	2.091.464,28	0,00	0,00	2.113.644,16	22.179,88	1,06%	0,19%	1,06%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.320.462,82	0,00	0,00	2.344.957,11	24.494,29	1,06%	0,21%	1,06%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.445.148,82	0,00	0,00	4.491.501,01	46.352,19	1,04%	0,20%	1,04%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	27.914.866,48	0,00	200.000,00	27.941.769,16	226.902,68	0,81%	0,03%	0,82%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	848.526,63	0,00	0,00	855.393,87	6.867,24	0,81%	0,01%	0,81%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.447.318,11	0,00	0,00	6.499.260,35	51.942,24	0,81%	0,01%	0,81%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.617.488,75	0,00	0,00	2.629.370,37	11.881,62	0,45%	0,11%	0,45%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	610.726,95	6.975.085,30	6.865.123,69	724.628,61	3.940,05	0,05%	0,01%	0,73%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>7.045.290,32</b>	<b>2,62%</b>	<b>1,33%</b>	

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(%)	
BB CIELO FI AÇÕES	1.780.304,14	0,00	0,00	1.885.763,03	105.458,89	5,92%	5,69%	5,92%	
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	2.827.279,33	0,00	0,00	2.989.257,05	161.977,72	5,73%	4,13%	5,73%	
XP INVESTOR FI AÇÕES	2.149.681,70	0,00	0,00	2.264.677,79	114.996,09	5,35%	3,90%	5,35%	
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.512.570,52	0,00	0,00	1.582.994,92	70.424,40	4,66%	4,37%	4,66%	
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	2.464.156,22	0,00	0,00	2.578.832,10	114.675,88	4,65%	4,87%	4,65%	
BB PIPE FIC AÇÕES	1.121.336,06	0,00	0,00	1.165.924,17	44.588,11	3,98%	4,89%	3,98%	
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	4.054.487,50	0,00	0,00	4.215.609,96	161.122,46	3,97%	5,77%	3,97%	
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	1.669.721,19	0,00	0,00	1.732.894,25	63.173,06	3,78%	3,71%	3,78%	
GERAÇÃO FI AÇÕES	1.550.814,43	0,00	0,00	1.592.311,51	41.497,08	2,68%	4,22%	2,68%	
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	10.418.115,59	0,00	0,00	10.689.449,42	271.333,83	2,60%	2,24%	2,60%	
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.225.580,36	0,00	0,00	2.267.296,93	41.716,57	1,87%	3,75%	1,87%	
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	2.219.876,43	0,00	0,00	2.241.425,90	21.549,47	0,97%	0,34%	0,97%	
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	3.131.676,26	0,00	0,00	2.997.156,83	-134.519,43	-4,30%	9,09%	-4,30%	
<b>Total Renda Variável</b>						<b>1.077.994,13</b>	<b>2,90%</b>	<b>4,06%</b>	