

Relatório Analítico dos Investimentos em agosto de 2017

Carteira consolidada de investimentos - base (agosto / 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	20.682.105,30	6,50%	195	1,51%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	4.188.841,91	1,32%	193	1,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2024	762.552,75	0,24%	17	0,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	876.278,24	0,28%	711	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	15.199.220,69	4,78%	754	0,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	879.460,24	0,28%	1.816	0,86%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	4.531.460,28	1,42%	1.381	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.165.284,82	0,68%	707	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	11.639.123,15	3,66%	113	1,52%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.365.533,50	0,74%	1.211	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	4.303.517,68	1,35%	23	1,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	14.076.710,93	4,43%	601	0,38%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.226.006,83	0,39%	276	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	32.855.877,44	10,33%	688	0,65%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	7.505.264,57	2,36%	355	0,57%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.366.691,21	1,06%	205	0,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	2.912.978,88	0,92%	29	7,47%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	41.714.821,18	13,12%	222	1,31%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	21.176.318,45	6,66%	329	0,81%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.132.251,11	0,67%	85	0,24%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	33.577.541,97	10,56%	60	6,34%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	D+1	Não há	2.798.440,68	0,88%	15	0,85%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "

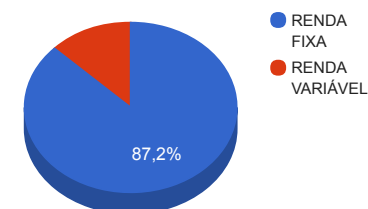
Carteira consolidada de investimentos - base (agosto / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	28.165.076,23	8,86%	440	1,45%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.017.264,62	0,32%	221	0,31%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	16/05/2023	4.270.499,67	1,34%	52	1,49%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	6.550.793,63	2,06%	766	0,15%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRASESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	863.844,75	0,27%	534	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	2.579.772,78	0,81%	143	0,25%	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	1.708.400,64	0,54%	61	0,40%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	1.360.529,00	0,43%	100	0,61%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	1.629.207,16	0,51%	7.425	0,47%	Artigo 8º, Inciso III
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	D+4	Não há	4.691.514,83	1,48%	4.072	5,72%	Artigo 8º, Inciso III
BB PIPE FIC AÇÕES	D+4	03/06/2018	1.246.720,77	0,39%	43	1,13%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	D+12	Não há	1.776.032,17	0,56%	332	2,84%	Artigo 8º, Inciso III
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	2.736.586,75	0,86%	26	6,65%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	3.147.582,42	0,99%	350	7,55%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	1.615.369,42	0,51%	119	1,00%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	1.194.569,37	0,38%	1.380	2,02%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.295.981,41	0,72%	2.555	1,76%	Artigo 8º, Inciso III
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	D+4	Não há	3.109.176,70	0,98%	7.459	1,99%	Artigo 8º, Inciso III
XP INVESTOR FI AÇÕES	D+4	Não há	2.438.402,96	0,77%	5.533	0,50%	Artigo 8º, Inciso III
BB CIELO FI AÇÕES	D+4	Não há	1.621.391,85	0,51%	5.082	1,42%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	D+5	Não há	2.256.358,03	0,71%	32	1,00%	Artigo 8º, Inciso IV
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	10.804.708,49	3,40%	4.076	2,56%	Artigo 8º, Inciso IV
TOTAL -			318.016.065,46				

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

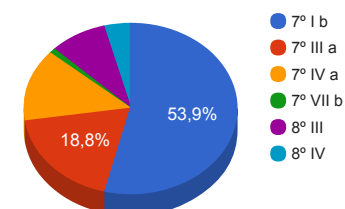
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	171.251.729,60	53,85%	50,00%	58,00%	75,00%	67.260.319,50
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	59.684.552,21	18,77%	10,00%	20,00%	50,00%	99.323.480,52
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	43.447.251,68	13,66%	5,00%	8,00%	30,00%	51.957.567,96
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	3.068.929,64	0,97%	0,00%	1,00%	5,00%	12.831.873,63
Total Renda Fixa	100,00%	277.452.463,13	87,24%	85,00	87,00	210,00	-

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	27.502.535,81	8,65%	5,00%	9,00%	15,00%	20.199.874,01
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	13.061.066,52	4,11%	2,00%	4,00%	5,00%	2.839.736,75
Total Renda Variável	30,00%	40.563.602,33	12,76%	7,00	13,00	35,00	-

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: agosto / 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 "	171.251.729,60	53,85%	50,00%	75,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	59.684.552,21	18,77%	10,00%	50,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	43.447.251,68	13,66%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	3.068.929,64	0,97%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	277.452.463,13	87,24%	85,00	210,00

Artigos - Renda Variável	Base: agosto / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso III	27.502.535,81	8,65%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	13.061.066,52	4,11%	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%
Total Renda Variável	40.563.602,33	12,76%	7,00	35,00

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5+	1,36%	11,93%	6,04%	4,21%	16,45%	51,77%	-	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	1,33%	11,71%	5,92%	3,91%	16,16%	50,49%	0,20%	2,662%	13,08%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,33%	11,73%	5,93%	4,17%	16,18%	50,38%	0,20%	2,644%	12,76%
IMA-B	1,34%	11,14%	5,57%	5,06%	15,49%	44,95%	-	-	-
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	1,41%	10,85%	5,87%	5,08%	14,94%	42,22%	0,45%	1,903%	10,20%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	1,36%	10,73%	5,30%	4,72%	15,18%	43,25%	0,20%	1,756%	9,40%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,33%	11,00%	5,51%	4,97%	15,39%	43,43%	0,20%	1,813%	9,83%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1,31%	10,68%	5,33%	4,73%	15,02%	43,63%	0,20%	1,815%	9,84%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	1,25%	10,29%	5,43%	4,25%	14,90%	43,55%	0,15%	1,905%	10,34%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,92%	6,28%	3,03%	3,93%	9,44%	29,25%	0,20%	4,233%	8,57%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-2,05%	2,14%	0,14%	2,99%	5,74%	17,74%	0,20%	4,288%	4,41%
IMA-B 5	1,25%	9,83%	4,68%	6,98%	13,91%	34,53%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,24%	9,71%	4,63%	6,90%	13,72%	33,75%	0,20%	0,717%	3,64%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	1,24%	9,68%	4,62%	6,86%	13,68%	34,03%	0,10%	0,721%	3,64%
IDKA IPCA 20 Anos	1,18%	13,11%	6,98%	0,23%	18,20%	73,49%	-	-	-
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,04%	11,93%	6,25%	1,47%	17,61%	60,45%	0,20%	3,988%	18,69%
IRF-M 1+	1,11%	13,22%	5,47%	7,73%	19,92%	45,81%	-	-	-

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (agosto / 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	1,05%	13,00%	5,39%	7,45%	19,66%	45,75%	0,20%	1,312%	6,45%
IMA Geral	1,07%	10,21%	4,28%	5,86%	15,03%	37,79%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,03%	10,12%	4,20%	5,85%	15,17%	37,24%	0,20%	0,879%	4,78%
IRF-M	1,06%	11,91%	4,79%	7,25%	18,00%	40,09%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,04%	11,73%	4,73%	7,08%	17,74%	39,52%	0,20%	0,975%	4,87%
IDKA IPCA 2 Anos	0,97%	10,12%	4,34%	7,49%	14,33%	34,57%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,98%	9,35%	4,08%	6,76%	13,28%	33,34%	0,20%	0,487%	2,90%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,96%	9,32%	4,05%	6,79%	13,26%	33,40%	0,20%	0,491%	2,83%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,68%	7,94%	2,91%	5,84%	11,82%	29,95%	0,20%	0,287%	1,90%
IRF-M 1	0,90%	8,33%	2,86%	5,88%	13,15%	29,98%	-	-	-
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	0,91%	8,49%	3,04%	5,79%	13,40%	29,76%	0,50%	0,163%	1,17%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,89%	8,21%	2,82%	5,81%	12,96%	29,61%	0,20%	0,081%	0,67%
BRADERCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,88%	8,21%	2,86%	5,81%	12,97%	29,45%	0,20%	0,080%	0,68%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,88%	8,17%	2,83%	5,78%	12,88%	29,36%	0,10%	0,081%	0,68%
Selic	0,80%	7,35%	2,43%	5,29%	12,06%	27,92%	-	-	-
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,99%	7,74%	2,65%	5,65%	12,68%	28,66%	0,20%	0,074%	0,12%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	0,80%	7,34%	2,43%	5,28%	12,05%	27,88%	-	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,80%	7,32%	2,45%	5,20%	11,97%	27,62%	0,20%	0,019%	0,15%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,79%	7,40%	2,43%	5,30%	12,17%	27,88%	0,20%	0,003%	0,11%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,72%	6,76%	2,21%	4,84%	11,14%	25,78%	0,80%	0,000%	0,10%
IPCA + 6,00% ao ano	0,72%	5,65%	1,72%	3,93%	8,58%	25,42%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,67%	11,58%	5,71%	7,16%	15,30%	42,49%	0,15%	1,271%	7,00%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,97%	6,15%	1,93%	4,37%	9,32%	26,71%	0,20%	0,182%	0,30%
IPCA	0,19%	1,62%	0,20%	0,90%	2,46%	11,65%	-	-	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1,37%	11,68%	5,31%	7,75%	16,49%	40,79%	0,20%	0,736%	4,68%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,58%	7,20%	2,52%	5,22%	10,51%	31,46%	0,20%	0,277%	1,60%

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

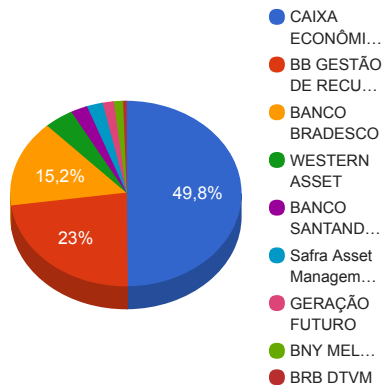
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
SMLL	8,58%	40,02%	17,87%	18,86%	36,58%	75,74%	-	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	8,78%	38,50%	17,47%	18,11%	36,39%	68,09%	1,50%	4,481%	19,51%
Ibovespa	7,46%	17,61%	12,95%	6,26%	22,34%	51,93%	-	-	-
XP INVESTOR FI AÇÕES	7,67%	22,30%	15,65%	9,53%	23,38%	85,10%	2,00%	5,259%	20,30%
BB PIPE FIC AÇÕES	6,93%	22,42%	13,04%	15,57%	18,96%	41,74%	1,20%	4,973%	16,16%
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	6,12%	10,81%	9,73%	1,93%	12,92%	32,67%	1,00%	5,729%	20,84%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	5,30%	17,97%	10,95%	5,59%	13,01%	45,44%	2,00%	7,740%	22,28%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	2,49%	5,06%	7,90%	0,49%	9,69%	20,35%	2,00%	5,667%	20,91%
GERAÇÃO FI AÇÕES	1,45%	1,08%	4,26%	-5,39%	9,33%	10,93%	3,00%	5,466%	21,45%
IDIV	6,96%	20,19%	10,75%	3,45%	33,46%	71,33%	-	-	-
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	2,92%	20,67%	11,58%	5,85%	20,85%	71,75%	3,00%	5,084%	18,95%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	1,27%	0,86%	3,42%	-5,35%	2,34%	-0,04%	3,00%	5,016%	19,78%
IFNC	6,72%	19,78%	13,27%	4,07%	22,61%	66,08%	-	-	-
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	6,63%	18,48%	12,89%	3,27%	20,51%	62,50%	1,00%	7,100%	24,72%
BBSEGURIDADE ON NM - BBSE3	4,12%	3,99%	-1,79%	-0,14%	0,95%	9,03%	-	-	-
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	3,74%	2,58%	-2,36%	-1,13%	-0,87%	5,22%	1,5%	11,039%	28,50%
CDI	0,80%	7,34%	2,43%	5,28%	12,05%	27,88%	-	-	-

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

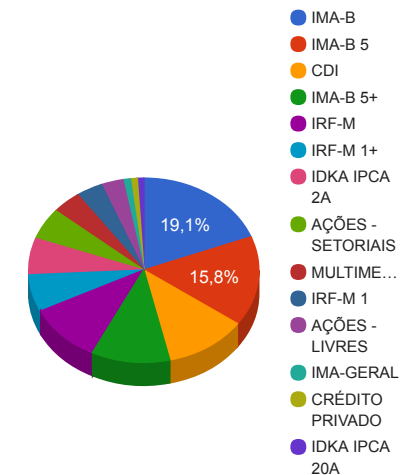
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	0,67%	6,04%	2,49%	3,08%	12,18%	31,23%	2,00%	0,536%	1,68%
S&P 500	0,05%	10,40%	2,48%	4,41%	13,85%	25,33%	-	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	1,08%	17,48%	4,88%	9,90%	26,62%	57,68%	1,00%	4,309%	7,97%
CIELO ON NM - CIEL3	-14,06%	-2,04%	-1,19%	-0,24%	-17,99%	-12,40%	-	-	-
BB CIELO FI AÇÕES	-14,02%	-2,89%	-1,44%	-0,88%	-18,89%	-15,04%	1,50%	10,544%	27,93%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	158.497.187,50	49,84%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	73.003.374,17	22,96%
BANCO BRADESCO	48.212.760,98	15,16%
WESTERN ASSET	13.061.066,52	4,11%
BANCO SANTANDER	7.505.264,57	2,36%
Safra Asset Management	7.101.958,36	2,23%
GERAÇÃO FUTURO	4.951.473,82	1,56%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	4.067.610,12	1,28%
BRB DTVM	1.615.369,42	0,51%



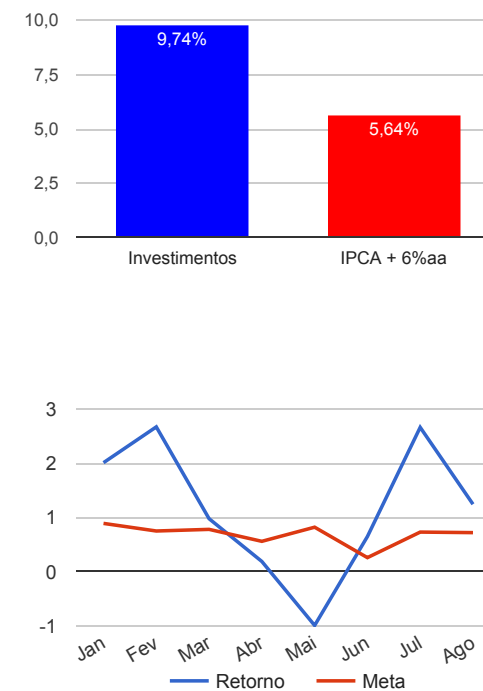
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	60.810.465,41	19,12%
IMA-B 5	50.096.363,99	15,75%
CDI	36.596.979,23	11,51%
IMA-B 5+	34.803.548,80	10,94%
IRF-M	32.855.877,44	10,33%
IRF-M 1+	20.682.105,30	6,50%
IDKA IPCA 2A	20.430.837,66	6,42%
AÇÕES - SETORIAIS	17.689.423,74	5,56%
MULTIMERCADO	13.061.066,52	4,11%
IRF-M 1	11.827.685,57	3,72%
AÇÕES - LIVRES	9.813.112,07	3,09%
IMA-GERAL	3.366.691,21	1,06%
CRÉDITO PRIVADO	3.068.929,64	0,97%
IDKA IPCA 20A	2.912.978,88	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%
Agosto	313.752.973,86	9.636.247,16	9.276.903,51	318.016.065,46	3.903.747,95	1,24%	0,72%	171,60%	2,21%
Acumulado no ano					28.198.408,77	9,74%	5,64%	172,49%	

Acumulado no Ano



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de agosto / 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	769.618,48	0,00	20.127,22	762.552,75	13.061,49	1,70%	4,23%	-0,92%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.200.331,48	0,00	0,00	4.270.499,67	70.168,19	1,67%	1,27%	1,67%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	4.243.862,02	0,00	0,00	4.303.517,68	59.655,66	1,41%	1,90%	1,41%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1.685.245,56	0,00	0,00	1.708.400,64	23.155,08	1,37%	0,74%	1,37%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	20.878.706,41	14.229,02	0,00	21.176.318,45	283.383,02	1,36%	1,76%	1,36%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	33.136.193,82	0,00	0,00	33.577.541,97	441.348,15	1,33%	2,66%	1,33%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.209.911,91	0,00	0,00	1.226.006,83	16.094,92	1,33%	2,64%	1,33%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	14.909.110,86	91.908,99	0,00	15.199.220,69	198.200,84	1,32%	1,81%	1,33%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	11.488.922,80	0,00	0,00	11.639.123,15	150.200,35	1,31%	1,82%	1,31%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	868.611,58	0,00	0,00	879.460,24	10.848,66	1,25%	1,91%	1,25%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	865.548,51	0,00	0,00	876.278,24	10.729,73	1,24%	0,72%	1,24%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	7.413.642,00	0,00	0,00	7.505.264,57	91.622,57	1,24%	0,72%	1,24%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	20.467.704,76	0,00	0,00	20.682.105,30	214.400,54	1,05%	1,31%	1,05%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	32.518.604,84	0,00	0,00	32.855.877,44	337.272,60	1,04%	0,98%	1,04%
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.883.131,23	0,00	0,00	2.912.978,88	29.847,65	1,04%	3,99%	1,04%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.332.446,40	0,00	0,00	3.366.691,21	34.244,81	1,03%	0,88%	1,03%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	855.393,87	0,00	0,00	863.844,75	8.450,88	0,99%	0,07%	0,99%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.144.179,29	0,00	0,00	2.165.284,82	21.105,53	0,98%	0,49%	0,98%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	13.942.309,89	0,00	0,00	14.076.710,93	134.401,04	0,96%	0,49%	0,96%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.629.370,37	0,00	74.651,53	2.579.772,78	25.053,94	0,95%	0,18%	0,97%
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	2.773.305,80	0,00	0,00	2.798.440,68	25.134,88	0,91%	0,16%	0,91%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.491.501,01	0,00	0,00	4.531.460,28	39.959,27	0,89%	0,08%	0,89%

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	2.113.644,16	0,00	0,00	2.132.251,11	18.606,95	0,88%	0,08%	0,88%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.344.957,11	0,00	0,00	2.365.533,50	20.576,39	0,88%	0,08%	0,88%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	27.941.769,16	0,00	0,00	28.165.076,23	223.307,07	0,80%	0,02%	0,80%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.499.260,35	0,00	0,00	6.550.793,63	51.533,28	0,79%	0,00%	0,79%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	42.586.055,02	0,00	1.157.844,52	41.714.821,18	286.610,68	0,67%	4,29%	-2,05%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.278.731,70	0,00	118.597,30	4.188.841,91	28.707,51	0,67%	0,29%	0,68%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.352.681,00	0,00	0,00	1.360.529,00	7.848,00	0,58%	0,28%	0,58%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	193.248,83	193.425,22	0,00	176,39	0,09%	0,00%	0,70%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	724.628,61	8.000.435,10	7.712.257,72	1.017.264,62	4.458,63	0,05%	0,00%	0,72%
				Total Renda Fixa	2.880.164,70	1,05%	1,69%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
XP INVESTOR FI AÇÕES	2.264.677,79	0,00	0,00	2.438.402,96	173.725,17	7,67%	5,26%	7,67%
BB PIPE FIC AÇÕES	1.165.924,17	0,00	0,00	1.246.720,77	80.796,60	6,93%	4,97%	6,93%
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	4.215.609,96	193.425,22	0,00	4.691.514,83	282.479,65	6,41%	7,10%	6,63%
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	2.578.832,10	0,00	0,00	2.736.586,75	157.754,65	6,12%	5,73%	6,12%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	2.989.257,05	0,00	0,00	3.147.582,42	158.325,37	5,30%	7,74%	5,30%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	0,00	1.143.000,00	0,00	1.194.569,37	51.569,37	4,51%	4,48%	8,78%
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	2.997.156,83	0,00	0,00	3.109.176,70	112.019,87	3,74%	11,04%	3,74%
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.582.994,92	0,00	0,00	1.629.207,16	46.212,24	2,92%	5,08%	2,92%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	1.732.894,25	0,00	0,00	1.776.032,17	43.137,92	2,49%	5,67%	2,49%
GERAÇÃO FI AÇÕES	1.592.311,51	0,00	0,00	1.615.369,42	23.057,91	1,45%	5,47%	1,45%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.267.296,93	0,00	0,00	2.295.981,41	28.684,48	1,27%	5,02%	1,27%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	10.689.449,42	0,00	0,00	10.804.708,49	115.259,07	1,08%	4,31%	1,08%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	2.241.425,90	0,00	0,00	2.256.358,03	14.932,13	0,67%	0,54%	0,67%
BB CIELO FI AÇÕES	1.885.763,03	0,00	0,00	1.621.391,85	-264.371,18	-14,02%	10,54%	-14,02%
Total Renda Variável					1.023.583,25	2,59%	5,81%	