

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

Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	1.067.543,25	1,44%	72	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	651.861,54	0,88%	706	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	654.510,17	0,88%	1.197	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.394.953,91	5,93%	293	0,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	2.092.585,26	2,82%	223	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.313.865,38	9,86%	740	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	2.043.217,28	2,76%	307	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	1.061.527,94	1,43%	107	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.260.149,44	9,79%	281	0,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.516.986,89	2,05%	604	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	632.719,79	0,85%	1.898	0,65%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.985.348,44	4,03%	1.360	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.147.221,11	2,90%	599	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	11.167.364,87	15,06%	703	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.046.103,66	9,50%	326	0,29%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2030	1.288.306,00	1,74%	34	0,65%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.982.026,84	5,37%	774	0,09%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	4.613.347,71	6,22%	5.953	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	696.061,80	0,94%	95	0,18%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.064.605,43	1,44%	475	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	1.290.589,54	1,74%	116	0,26%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	491.199,29	0,66%	20	1,90%	Artigo 8º, Inciso I

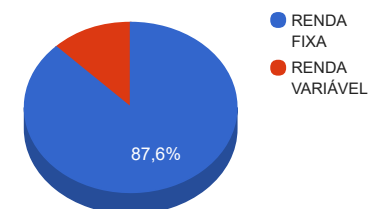
Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.878.576,04	2,53%	373	5,04%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	D+43	5 anos	715.794,57	0,97%	53	0,74%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	D+4	Não há	2.277.001,38	3,07%	1.103	17,98%	Artigo 8º, Inciso III
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.233.480,25	1,66%	6	2,11%	Artigo 8º, Inciso III
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.268.114,78	3,06%	474	0,46%	Artigo 8º, Inciso III
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	Não se aplica	Não se aplica	320.416,08	0,43%		0,01%	Artigo 8º, Inciso VI
		TOTAL -	74.155.478,64				

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

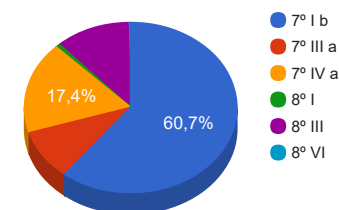
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	44.989.855,27	60,67%	30,00%	35,00%	85,00%	18.042.301,57
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	7.046.103,66	9,50%	15,00%	20,00%	60,00%	37.447.183,52
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	12.934.937,32	17,44%	5,00%	5,00%	30,00%	9.311.706,27
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	11.123.321,80
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	3.707.773,93
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	3.707.773,93
Total Renda Fixa	100,00%	64.970.896,25	87,61%	55,00	75,00	200,00	-

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	491.199,29	0,66%	1,00%	2,00%	5,00%	3.216.574,64
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	8.372.967,02	11,29%	5,00%	10,00%	15,00%	2.750.354,78
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	3.707.773,93
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	4,00%	5,00%	3.707.773,93
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	320.416,08	0,43%	2,00%	4,00%	5,00%	3.387.357,85
Total Renda Variável	30,00%	9.184.582,39	12,39%	12,00	25,00	35,00	-

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: junho / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	44.989.855,27	60,67%	30,00%	85,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	7.046.103,66	9,50%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	12.934.937,32	17,44%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	0,00	0,00%	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%
Total Renda Fixa	64.970.896,25	87,61%	55,00	200,00

Artigos - Renda Variável	Base: junho / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I	491.199,29	0,66%	1,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso III	8.372.967,02	11,29%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	320.416,08	0,43%	2,00%	5,00%
Total Renda Variável	9.184.582,39	12,39%	12,00	35,00

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	1,35%	8,24%	2,20%	8,24%	16,77%	36,01%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,34%	8,13%	2,13%	8,13%	16,65%	35,30%	0,20%	1,392%	4,89%
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%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,87%	6,15%	2,65%	6,15%	13,27%	30,05%	0,20%	0,178%	0,66%
Selic	0,81%	5,65%	2,54%	5,65%	12,87%	28,79%	-	-	-
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,83%	5,83%	2,70%	5,83%	13,30%	29,29%	0,20%	0,007%	0,10%
CDI	0,81%	5,65%	2,54%	5,65%	12,85%	28,75%	-	-	-
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,82%	5,69%	2,56%	5,69%	12,91%	28,97%	0,25%	0,012%	0,08%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,81%	5,71%	2,54%	5,71%	13,04%	28,78%	0,20%	0,026%	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%	-	-	-
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%
IPCA + 6,00% ao ano	0,26%	4,13%	1,64%	4,13%	9,15%	25,94%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,48%	1,31%	1,96%	1,31%	3,30%	12,94%	0,20%	0,228%	4,05%

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

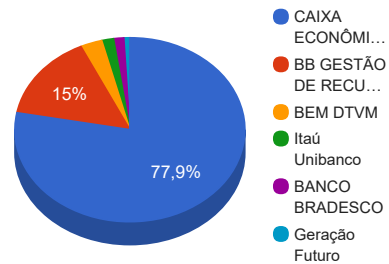
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,47%	4,48%	1,94%	4,48%	9,59%	26,82%	0,20%	0,228%	0,27%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,34%	5,75%	0,27%	5,75%	13,15%	31,58%	0,15%	1,474%	6,45%
IMA-B	0,16%	5,46%	-1,34%	5,46%	13,32%	32,28%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,57%	3,21%	1,30%	3,21%	6,67%	-	0,20%	1,000%	6,24%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,57%	2,57%	2,08%	2,57%	5,52%	15,76%	0,20%	0,514%	4,51%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,16%	3,28%	-0,15%	3,28%	7,08%	17,19%	0,20%	1,819%	8,71%
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%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	0,12%	5,27%	-1,37%	5,27%	13,21%	30,77%	0,20%	2,279%	9,37%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	0,11%	4,74%	-2,08%	4,74%	12,67%	31,30%	0,15%	2,538%	10,31%
IMA-B 5+	-0,06%	5,50%	-2,63%	5,50%	14,42%	34,03%	-	-	-
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%

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

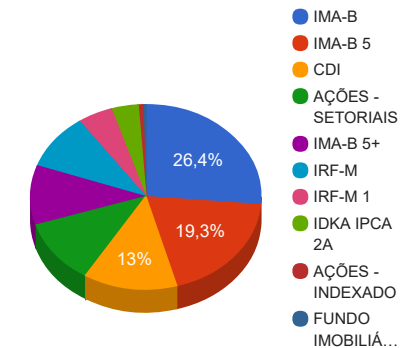
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IGCT	0,97%	8,69%	-1,35%	8,69%	25,89%	22,82%	-	-	-
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA FI AÇÕES	0,92%	8,43%	-1,42%	8,43%	25,47%	22,31%	0,90%	6,511%	21,39%
IFIX	0,88%	11,27%	2,07%	11,27%	26,62%	42,05%	-	-	-
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-	-	0,30%	-	-
SMLL	0,38%	19,24%	2,71%	19,24%	33,53%	30,90%	-	-	-
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	0,31%	8,25%	-1,20%	8,25%	2,67%	-13,93%	1,72%	3,267%	17,61%
Ibovespa	0,30%	4,44%	-3,21%	4,44%	22,07%	18,50%	-	-	-
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	0,18%	4,09%	-3,26%	4,09%	21,42%	18,00%	0,50%	5,904%	21,73%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	-0,34%	5,97%	-4,35%	5,97%	14,46%	13,17%	2,00%	6,666%	23,11%
ICON	-2,98%	7,29%	2,68%	7,29%	9,86%	6,43%	-	-	-
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	-3,04%	6,99%	2,44%	6,99%	8,77%	0,52%	1,60%	5,655%	19,56%
IDIV	-1,22%	7,20%	-5,99%	7,20%	36,68%	31,17%	-	-	-
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	0,74%	11,21%	-3,85%	11,21%	26,42%	24,76%	1,50%	5,777%	21,17%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	57.800.888,25	77,95%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	11.155.670,14	15,04%
BEM DTVM	2.268.114,78	3,06%
Itaú Unibanco	1.233.480,25	1,66%
BANCO BRADESCO	1.064.605,43	1,44%
Geração Futuro	632.719,79	0,85%



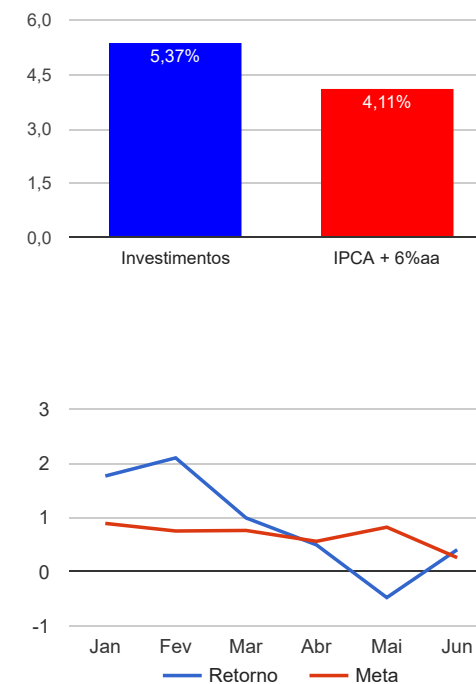
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	19.563.870,31	26,38%
IMA-B 5	14.321.478,07	19,31%
CDI	9.659.979,98	13,03%
AÇÕES - SETORIAIS	8.372.967,02	11,29%
IMA-B 5+	7.726.477,19	10,42%
IRF-M	7.260.149,44	9,79%
IRF-M 1	3.639.858,61	4,91%
IDKA IPCA 2A	2.799.082,65	3,77%
AÇÕES - INDEXADO	491.199,29	0,66%
FUNDO IMOBILIÁRIO	320.416,08	0,43%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	67.163.512,71	7.014.108,42	7.291.540,11	68.069.728,53	1.183.647,51	1,76%	0,89%	198,02%	1,95%
Fevereiro	68.069.728,53	5.152.660,24	5.326.071,97	69.322.645,25	1.426.328,45	2,10%	0,75%	279,39%	1,81%
Março	69.322.645,25	6.627.494,43	7.527.639,13	69.109.336,77	686.836,22	0,99%	0,76%	129,60%	1,87%
Abril	69.109.336,77	5.025.461,99	875.866,66	73.621.661,68	362.729,58	0,50%	0,56%	88,79%	1,56%
Mai	73.621.661,68	4.436.691,45	3.968.770,50	73.737.801,50	-351.781,13	-0,47%	0,82%	-57,79%	8,08%
Junho	73.737.801,50	7.441.430,30	7.323.294,51	74.155.478,64	299.541,35	0,41%	0,26%	158,65%	1,91%
Acumulado no ano					3.607.301,98	5,37%	4,11%	130,73%	

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(%)	
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.164.064,96	0,00	0,00	7.260.149,44	96.084,48	1,34%	1,39%	1,34%	
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	1.500.000,00	0,00	1.516.986,89	16.986,89	1,13%	2,45%	0,15%	
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	649.290,12	0,00	456,29	654.510,17	5.676,34	0,87%	0,18%	0,87%	
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.055.812,09	0,00	0,00	1.064.605,43	8.793,34	0,83%	0,01%	0,83%	
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.946.701,63	3.000,00	0,00	3.982.026,84	32.325,21	0,82%	0,03%	0,81%	
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	686.465,10	1.555.923,00	216.253,00	2.043.217,28	17.082,18	0,76%	3,29%	-0,09%	
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	691.042,06	0,00	0,00	696.061,80	5.019,74	0,73%	1,47%	0,34%	
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.133.892,93	0,00	0,00	2.147.221,11	13.328,18	0,62%	0,73%	0,62%	
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.055.485,70	0,00	0,00	1.061.527,94	6.042,24	0,57%	1,00%	0,57%	
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.080.828,52	0,00	0,00	2.092.585,26	11.756,74	0,57%	0,51%	0,57%	
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.528.168,11	417.971,24	3.996.893,98	2.985.348,44	36.103,07	0,52%	0,18%	0,87%	
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.283.953,59	0,00	0,00	1.290.589,54	6.635,95	0,52%	0,23%	0,47%	
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.110.484,31	0,00	0,00	11.167.364,87	56.880,56	0,51%	0,93%	0,51%	
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.282.131,00	0,00	0,00	1.288.306,00	6.175,00	0,48%	0,23%	0,48%	
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	901.605,62	3.964.536,06	267.021,24	4.613.347,71	14.227,27	0,29%	0,01%	0,82%	
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.065.869,26	0,00	0,00	1.067.543,25	1.673,99	0,16%	1,82%	0,16%	
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.302.927,07	0,00	0,00	7.313.865,38	10.938,31	0,15%	2,45%	0,15%	
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	7.037.957,80	0,00	0,00	7.046.103,66	8.145,86	0,12%	2,28%	0,12%	
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	632.002,04	0,00	0,00	632.719,79	717,75	0,11%	2,54%	0,11%	
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.398.094,76	0,00	0,00	4.394.953,91	-3.140,85	-0,07%	3,27%	-0,07%	
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.497.092,54	0,00	2.839.670,00	651.861,54	-5.561,00	-0,16%	0,76%	0,61%	
Total Renda Fixa						345.891,25	0,54%	1,38%	

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(%)
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA FI AÇÕES	1.222.247,21	0,00	0,00	1.233.480,25	11.233,04	0,92%	6,51%	0,92%
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.251.532,07	0,00	0,00	2.268.114,78	16.582,71	0,74%	5,78%	0,74%
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	713.610,89	0,00	0,00	715.794,57	2.183,68	0,31%	3,27%	0,31%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	322.755,11	0,00	3.000,00	320.416,08	660,97	0,20%	-	0,00%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	490.327,23	0,00	0,00	491.199,29	872,06	0,18%	5,90%	0,18%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	1.885.023,70	0,00	0,00	1.878.576,04	-6.447,66	-0,34%	6,67%	-0,34%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	2.348.436,08	0,00	0,00	2.277.001,38	-71.434,70	-3,04%	5,65%	-3,04%
Total Renda Variável					-46.349,90	-0,50%	5,84%	

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 IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.108.894,99	0,00	0,00	7.260.149,44	151.254,45	2,13%	2,13%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.908.225,41	7.564.520,69	8.635.531,14	2.985.348,44	148.133,48	1,74%	2,65%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.024.307,76	0,00	0,00	11.167.364,87	143.057,11	1,30%	1,30%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.880.452,39	3.000,00	0,00	3.982.026,84	98.574,45	2,54%	2,54%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.049.980,22	0,00	0,00	2.092.585,26	42.605,04	2,08%	2,08%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.108.517,42	0,00	0,00	2.147.221,11	38.703,69	1,84%	1,84%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.457.206,53	0,00	2.839.670,00	651.861,54	34.325,01	0,99%	1,78%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.233.354,55	0,00	200.000,00	1.064.605,43	31.250,88	2,67%	2,70%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	886.360,20	3.964.536,06	267.021,24	4.613.347,71	29.472,69	2,02%	2,56%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.263.498,00	0,00	0,00	1.288.306,00	24.808,00	1,96%	1,96%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.266.072,76	0,00	0,00	1.290.589,54	24.516,78	1,94%	1,94%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	1.500.000,00	0,00	1.516.986,89	16.986,89	1,13%	-1,39%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	638.170,90	0,00	456,29	654.510,17	16.795,56	2,63%	2,63%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.047.887,26	0,00	0,00	1.061.527,94	13.640,68	1,30%	1,30%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	694.154,81	0,00	0,00	696.061,80	1.906,99	0,27%	0,27%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.069.103,81	0,00	0,00	1.067.543,25	-1.560,56	-0,15%	-0,15%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	703.488,79	1.558.923,00	216.253,00	2.043.217,28	-2.941,51	-2,10%	-2,84%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	646.155,90	0,00	0,00	632.719,79	-13.436,11	-2,08%	-2,08%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	6.815.831,20	326.756,12	0,00	7.046.103,66	-96.483,66	-1,35%	-1,37%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.413.382,27	3.000,00	0,00	7.313.865,38	-102.516,89	-1,38%	-1,38%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.509.835,91	0,00	0,00	4.394.953,91	-114.882,00	-2,55%	-2,55%
Total Renda Fixa					484.210,97	0,75%	

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 (%)
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	1.580.798,64	682.847,87	0,00	2.277.001,38	13.354,87	1,84%	2,44%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	327.727,86	0,00	9.000,00	320.416,08	1.688,22	0,51%	0,00%
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	724.518,59	0,00	0,00	715.794,57	-8.724,02	-1,20%	-1,20%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	0,00	500.000,00	0,00	491.199,29	-8.800,71	-1,76%	-3,26%
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA FI AÇÕES	1.046.927,39	200.000,00	0,00	1.233.480,25	-13.447,14	-0,85%	-1,42%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	1.555.713,44	400.000,00	0,00	1.878.576,04	-77.137,40	-3,85%	-4,35%
BRADERCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.148.769,77	200.000,00	0,00	2.268.114,78	-80.654,99	-3,37%	-3,85%
Total Renda Variável					-173.721,17	-1,50%	

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 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.209.066,68	0,00	621.388,91	11.167.364,87	579.687,10	5,32%	5,40%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.714.190,62	0,00	0,00	7.260.149,44	545.958,82	8,13%	8,13%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.172.025,07	12.417.870,98	17.994.957,97	2.985.348,44	390.410,36	4,31%	6,15%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.233.612,72	1.578.138,37	838.927,80	7.313.865,38	341.042,09	4,62%	5,36%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.764.244,34	3.000,00	0,00	3.982.026,84	214.782,50	5,71%	5,71%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.747.493,50	0,00	1.776.750,95	2.147.221,11	176.478,56	5,58%	5,73%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.328.529,04	0,00	2.839.670,00	651.861,54	163.002,50	4,90%	5,71%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	6.117.640,81	3.964.536,06	5.599.841,79	4.613.347,71	131.012,63	4,85%	5,69%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.040.134,38	0,00	57.406,36	2.092.585,26	109.857,24	5,48%	2,57%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.196.871,89	0,00	200.000,00	1.064.605,43	67.733,54	5,80%	5,83%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.033.679,25	0,00	29.249,21	1.067.543,25	63.113,21	6,14%	3,28%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.028.524,14	0,00	29.807,74	1.061.527,94	62.811,54	6,19%	3,21%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	334.621,89	4.000.000,00	0,00	4.394.953,91	60.332,02	1,41%	5,40%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.270.799,16	0,00	35.975,08	1.290.589,54	55.765,46	4,47%	4,48%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.271.675,00	0,00	37.017,61	1.288.306,00	53.648,61	4,30%	1,31%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	650.437,17	1.558.923,00	216.253,00	2.043.217,28	50.110,11	5,89%	5,09%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	676.601,94	0,00	18.980,17	696.061,80	38.440,03	5,74%	5,75%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	617.274,86	0,00	456,29	654.510,17	37.691,60	6,11%	6,11%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	604.114,53	0,00	0,00	632.719,79	28.605,26	4,74%	4,74%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	1.830.361,33	7.192.530,55	2.000.000,00	7.046.103,66	23.211,78	3,94%	5,27%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	1.500.000,00	0,00	1.516.986,89	16.986,89	1,13%	5,35%
Total Renda Fixa					3.210.681,85	5,24%	

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 (%)
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.589.505,58	500.000,00	0,00	2.268.114,78	178.609,20	11,28%	11,21%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	1.223.407,85	982.847,87	0,00	2.277.001,38	70.745,66	6,14%	6,99%
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	661.235,54	0,00	0,00	715.794,57	54.559,03	8,25%	8,25%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	1.128.293,28	700.000,00	0,00	1.878.576,04	50.282,76	5,81%	5,97%
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA FI AÇÕES	400.934,63	800.000,00	0,00	1.233.480,25	32.545,62	6,84%	8,43%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	318.237,51	0,00	16.500,00	320.416,08	18.678,57	5,93%	0,00%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	0,00	500.000,00	0,00	491.199,29	-8.800,71	-1,76%	4,09%
Total Renda Variável					396.620,13	7,92%	