

# 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 IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.982.440,38	4,01%	599	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	7.783.309,59	3,91%	1.360	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	840.067,05	0,42%	193	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	29.052.131,18	14,61%	675	0,58%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	47.541.524,86	23,91%	703	0,80%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.128.913,29	1,07%	1.197	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	9.161.890,02	4,61%	706	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	893.078,75	0,45%	79	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.923.182,34	0,97%	293	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.010.013,40	1,51%	178	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	25.720.280,80	12,93%	740	0,47%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	241.397,63	0,12%	57	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	15.353.852,02	7,72%	326	0,62%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1800	Não há	3.357.985,76	1,69%			Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	D+31 ou D+1461	Não há	594.671,94	0,30%	17	0,35%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRANCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.308.754,48	1,66%	87	0,35%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	24.487.552,58	12,31%	757	0,43%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	754.784,87	0,38%	774	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	4.983.546,59	2,51%	55	1,55%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
PRASS II FIDC SÊNIOR	D+540	Não há	1.507.474,76	0,76%	20	1,10%	Artigo 7º, Inciso VI
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	6.889,30	0,00%	42	0,31%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	107.862,19	0,05%	46	0,42%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "

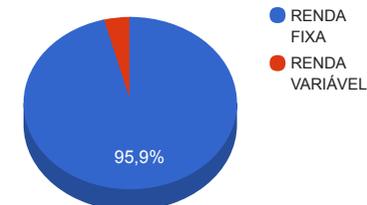
Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	918.193,79	0,46%	17	3,75%	Artigo 8º, Inciso II
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	922.062,31	0,46%	1.138		Artigo 8º, Inciso III
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	1.873.596,49	0,94%	925	6,62%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	910.002,54	0,46%	373	2,44%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	D+5	Não há	1.165.993,97	0,59%	33	0,47%	Artigo 8º, Inciso IV
ÁTICO FLORESTAL - FIP	Não se aplica	Não se aplica	1.252.856,37	0,63%	21	0,71%	Artigo 8º, Inciso V
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se aplica	Não se aplica	1.070.000,00	0,54%		0,63%	Artigo 8º, Inciso VI
		<b>TOTAL -</b>	<b>198.854.309,25</b>				

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

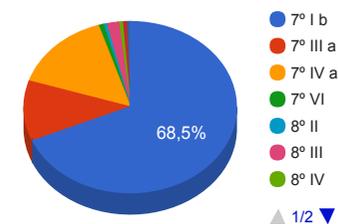
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	10,00%	19.885.430,93
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	136.278.229,29	68,53%	0,00%	90,00%	90,00%	42.690.649,04
Artigo 7º, Inciso II	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	9.942.715,46
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	22.615.264,20	11,37%	0,00%	20,00%	20,00%	17.155.597,65
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30.225.884,04	15,20%	0,00%	30,00%	30,00%	29.430.408,74
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	1.507.474,76	0,76%	0,00%	5,00%	5,00%	8.435.240,70
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	114.751,49	0,06%	0,00%	3,00%	3,00%	5.850.877,79
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	2,00%	3.977.086,19
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>190.741.603,78</b>	<b>95,92%</b>	<b>0,00</b>	<b>165,00</b>	<b>165,00</b>	<b>-</b>

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	10,00%	19.885.430,93
Artigo 8º, Inciso II	20,00%	918.193,79	0,46%	0,00%	5,00%	5,00%	9.024.521,67
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	3.705.661,34	1,86%	0,00%	15,00%	15,00%	26.122.485,05
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	1.165.993,97	0,59%	0,00%	5,00%	5,00%	8.776.721,49
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	1.252.856,37	0,63%	0,00%	5,00%	5,00%	8.689.859,09
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	1.070.000,00	0,54%	0,00%	5,00%	5,00%	8.872.715,46
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>8.112.705,47</b>	<b>4,08%</b>	<b>0,00</b>	<b>45,00</b>	<b>45,00</b>	<b>-</b>

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 "	136.278.229,29	68,53%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	22.615.264,20	11,37%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30.225.884,04	15,20%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso VI	1.507.474,76	0,76%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	114.751,49	0,06%	0,00%	0,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>190.741.603,78</b>	<b>95,92%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>

Artigos - Renda Variável	Base: junho / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso II	918.193,79	0,46%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso III	3.705.661,34	1,86%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso IV	1.165.993,97	0,59%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso V	1.252.856,37	0,63%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso VI	1.070.000,00	0,54%	0,00%	0,00%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>8.112.705,47</b>	<b>4,08%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>

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+	1,51%	8,97%	2,02%	8,97%	18,13%	39,00%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,49%	8,81%	1,92%	8,81%	17,98%	38,93%	0,20%	1,814%	6,47%
IRF-M	1,35%	8,24%	2,20%	8,24%	16,77%	36,01%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,32%	8,09%	2,08%	8,09%	16,54%	35,39%	0,20%	1,370%	4,86%
CDI + 3,50% ao ano	1,10%	7,45%	3,40%	7,45%	16,79%	37,91%	-	-	-
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	22,20%	8,50%	14,48%	8,50%	-69,63%	-59,10%	0,39%	42,634%	74,26%
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	0,14%	-62,62%	-3,05%	-62,62%	-41,28%	-60,43%	0,20%	5,324%	120,23%
IRF-M 1	0,89%	6,25%	2,69%	6,25%	13,46%	30,44%	-	-	-
BRABESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,90%	6,14%	2,65%	6,14%	13,25%	29,99%	0,20%	0,185%	0,67%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,90%	6,11%	2,65%	6,11%	13,15%	29,74%	0,20%	0,180%	0,65%
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%
CDI	0,81%	5,65%	2,54%	5,65%	12,85%	28,75%	-	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,82%	5,70%	2,57%	5,70%	12,90%	28,87%	0,20%	0,015%	0,09%
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%

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

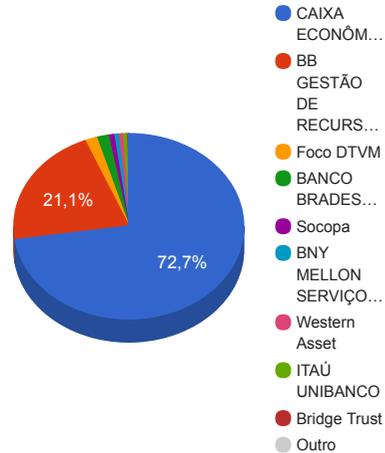
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,61%	5,71%	1,78%	5,71%	12,09%	30,65%	0,20%	0,756%	2,89%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,57%	5,48%	2,08%	5,48%	11,27%	29,37%	0,20%	0,506%	1,88%
IMA-B 5	0,52%	5,47%	1,32%	5,47%	11,91%	30,87%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	0,52%	5,28%	1,24%	5,28%	11,49%	29,82%	0,40%	0,912%	3,58%
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%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	1,30%	-	-
IPCA + 7,00% ao ano	0,33%	4,61%	1,87%	4,61%	10,18%	28,32%	-	-	-
PRASS II FIDC SÊNIOR	1,09%	7,64%	3,42%	7,64%	13,81%	32,83%	1,70%	0,008%	-
IMA-B	0,16%	5,46%	-1,34%	5,46%	13,32%	32,28%	-	-	-
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	0,19%	5,48%	0,25%	5,48%	14,16%	28,16%	1,30%	1,614%	5,59%
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%
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%
IPCA	-0,23%	1,18%	0,22%	1,18%	3,00%	12,11%	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,43%	5,38%	1,13%	5,38%	-	-	0,002	0,695%	-
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%

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

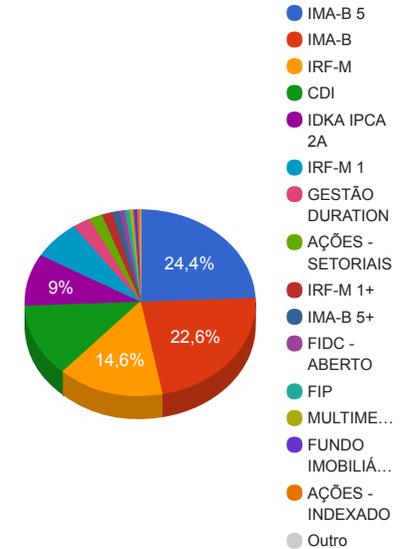
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	0,88%	11,27%	2,07%	11,27%	26,62%	42,05%	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	5,94%	4,90%	1,90%	4,90%	15,05%	35,44%	1,20%	9,780%	21,16%
CDI	0,81%	5,65%	2,54%	5,65%	12,85%	28,75%	-	-	-
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	0,84%	4,33%	0,78%	4,33%	14,26%	32,95%	2,00%	0,456%	1,95%
Ibovespa	0,30%	4,44%	-3,21%	4,44%	22,07%	18,50%	-	-	-
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	0,15%	4,20%	-3,21%	4,20%	21,68%	18,24%	0,50%	5,816%	21,83%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	-0,34%	5,97%	-4,35%	5,97%	14,46%	13,17%	2,00%	6,666%	23,11%
IDIV	-1,22%	7,20%	-5,99%	7,20%	36,68%	31,17%	-	-	-
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	-0,60%	4,08%	-3,31%	4,08%	6,97%	-6,18%	1,50%	5,347%	20,45%
SMLL	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	0,12%	18,04%	2,32%	18,04%	30,66%	28,84%	1,50%	5,724%	20,05%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ÁTICO FLORESTAL - FIP	-	-	-	-	-	-	1,50%	0,000%	0,01%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	144.479.557,69	72,66%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	41.937.786,41	21,09%
Foco DTVM	3.357.985,76	1,69%
BANCO BRADESCO	3.308.754,48	1,66%
Socopa	1.507.474,76	0,76%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	1.252.856,37	0,63%
Western Asset	1.165.993,97	0,59%
ITAÚ UNIBANCO	1.134.476,38	0,57%
Bridge Trust	594.671,94	0,30%
BRL Trust Investimentos	107.862,19	0,05%
CITIBANK DTVM	6.889,30	0,00%



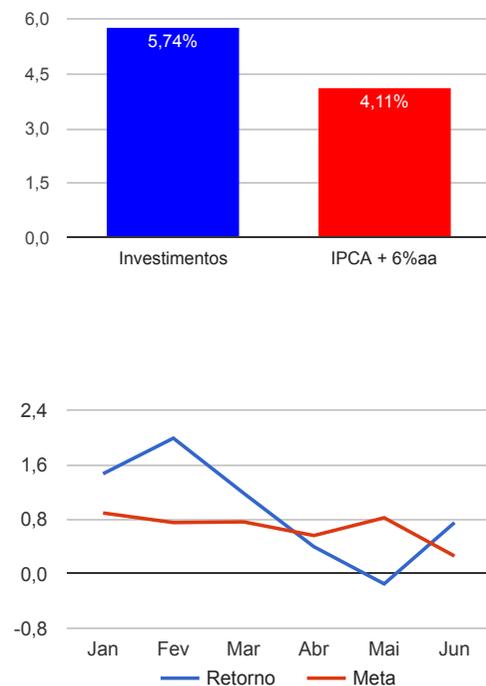
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5	48.434.603,61	24,36%
IMA-B	45.026.790,52	22,64%
IRF-M	29.052.131,18	14,61%
CDI	25.242.337,45	12,69%
IDKA IPCA 2A	17.984.397,45	9,04%
IRF-M 1	13.462.374,99	6,77%
GESTÃO DURATION	4.983.546,59	2,51%
AÇÕES - SETORIAIS	3.705.661,34	1,86%
IRF-M 1+	3.010.013,40	1,51%
IMA-B 5+	1.923.182,34	0,97%
FIDC - ABERTO	1.507.474,76	0,76%
FIP	1.252.856,37	0,63%
MULTIMERCADO	1.165.993,97	0,59%
FUNDO IMOBILIÁRIO	1.070.000,00	0,54%
AÇÕES - INDEXADO	918.193,79	0,46%
FIDC - FECHADO	114.751,49	0,06%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	176.426.263,36	3.845.430,28	329.839,39	182.576.997,07	2.635.142,82	1,46%	0,89%	164,54%	1,60%
Fevereiro	182.576.997,07	2.039.022,46	518.458,91	187.752.127,21	3.654.566,59	1,99%	0,75%	264,68%	0,94%
Março	187.752.127,21	2.156.479,69	376.820,07	191.768.083,95	2.236.297,12	1,18%	0,76%	154,34%	1,08%
Abril	191.768.083,95	2.082.428,77	372.191,96	194.245.134,36	766.813,60	0,40%	0,56%	71,07%	0,88%
Mai	194.245.134,36	17.161.249,92	15.393.560,13	195.722.729,50	-290.094,65	-0,15%	0,82%	-18,01%	6,37%
Junho	195.722.729,50	2.073.712,24	419.876,71	198.854.309,25	1.477.744,22	0,75%	0,26%	292,87%	1,32%
Acumulado no ano					10.480.469,70	5,74%	4,11%	139,89%	

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(%)
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	88.267,09	0,00	3.362,48	107.862,19	22.957,58	26,01%	42,63%	26,02%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	3.163.771,99	0,00	0,00	3.357.985,76	194.213,77	6,14%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.965.858,25	0,00	0,00	3.010.013,40	44.155,15	1,49%	1,81%	1,49%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	28.672.676,43	0,00	0,00	29.052.131,18	379.454,75	1,32%	1,37%	1,32%
PRASS II FIDC SÊNIOR	1.491.270,27	0,00	0,00	1.507.474,76	16.204,49	1,09%	0,01%	1,09%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	3.279.347,33	0,00	0,00	3.308.754,48	29.407,15	0,90%	0,19%	0,90%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	239.254,23	0,00	0,00	241.397,63	2.143,40	0,90%	0,18%	0,90%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.110.631,35	0,00	0,00	2.128.913,29	18.281,94	0,87%	0,18%	0,87%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.716.550,90	0,00	0,00	7.783.309,59	66.758,69	0,87%	0,18%	0,87%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	748.691,83	0,00	0,00	754.784,87	6.093,04	0,81%	0,03%	0,81%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	22.629.145,31	2.073.712,24	408.514,23	24.487.552,58	193.209,26	0,78%	0,02%	0,82%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.932.891,98	0,00	0,00	7.982.440,38	49.548,40	0,62%	0,73%	0,62%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.106.208,51	0,00	0,00	9.161.890,02	55.681,51	0,61%	0,76%	0,61%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	835.340,78	0,00	0,00	840.067,05	4.726,27	0,57%	0,51%	0,57%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	888.477,96	0,00	0,00	893.078,75	4.600,79	0,52%	0,91%	0,52%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	47.299.373,92	0,00	0,00	47.541.524,86	242.150,94	0,51%	0,93%	0,51%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	4.962.321,78	0,00	0,00	4.983.546,59	21.224,81	0,43%	0,69%	0,43%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	593.543,19	0,00	0,00	594.671,94	1.128,75	0,19%	1,61%	0,19%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	25.681.814,67	0,00	0,00	25.720.280,80	38.466,13	0,15%	2,45%	0,15%
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	6.879,59	0,00	0,00	6.889,30	9,71	0,14%	5,32%	0,14%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	15.336.101,77	0,00	0,00	15.353.852,02	17.750,25	0,12%	2,28%	0,12%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.924.556,74	0,00	0,00	1.923.182,34	-1.374,40	-0,07%	3,27%	-0,07%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>1.406.792,38</b>	<b>0,74%</b>	<b>1,17%</b>	

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(%)
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.010.000,00	0,00	8.000,00	1.070.000,00	68.000,00	6,73%	9,78%	5,94%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	1.156.311,90	0,00	0,00	1.165.993,97	9.682,07	0,84%	0,46%	0,84%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	916.809,97	0,00	0,00	918.193,79	1.383,82	0,15%	5,82%	0,15%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	1.871.344,75	0,00	0,00	1.873.596,49	2.251,74	0,12%	5,72%	0,12%
ÁTICO FLORESTAL - FIP	1.254.509,02	0,00	0,00	1.252.856,37	-1.652,65	-0,13%	0,00%	-0,13%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	913.125,84	0,00	0,00	910.002,54	-3.123,30	-0,34%	6,67%	-0,34%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	927.652,15	0,00	0,00	922.062,31	-5.589,84	-0,60%	5,35%	-0,60%
Total Renda Variável					70.951,84	0,88%	4,69%	

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 IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	51.868.794,39	0,00	5.000.000,00	47.541.524,86	672.730,47	1,35%	1,30%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	23.716.202,81	6.317.390,93	6.150.880,73	24.487.552,58	604.839,57	2,33%	2,57%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	28.458.792,26	0,00	0,00	29.052.131,18	593.338,92	2,08%	2,08%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	3.127.264,77	0,00	0,00	3.357.985,76	230.720,99	7,38%	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.582.225,83	0,00	0,00	7.783.309,59	201.083,76	2,65%	2,65%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.002.013,97	0,00	0,00	9.161.890,02	159.876,05	1,78%	1,78%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.838.556,76	0,00	0,00	7.982.440,38	143.883,62	1,84%	1,84%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	3.223.362,13	0,00	0,00	3.308.754,48	85.392,35	2,65%	2,65%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.074.316,73	0,00	0,00	2.128.913,29	54.596,56	2,63%	2,63%
PRASS II FIDC SÊNIOR	1.457.621,83	0,00	0,00	1.507.474,76	49.852,93	3,42%	3,42%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	94.219,61	0,00	11.351,60	107.862,19	24.994,18	28,81%	14,48%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	736.087,95	0,00	0,00	754.784,87	18.696,92	2,54%	2,54%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	822.969,77	0,00	0,00	840.067,05	17.097,28	2,08%	2,08%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	882.173,29	0,00	0,00	893.078,75	10.905,46	1,24%	1,24%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	3.000.000,00	0,00	3.010.013,40	10.013,40	0,33%	1,92%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	235.162,95	0,00	0,00	241.397,63	6.234,68	2,65%	2,65%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	593.189,25	0,00	0,00	594.671,94	1.482,69	0,25%	0,25%
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	7.106,19	0,00	96,47	6.889,30	-120,42	-1,69%	-3,05%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,00	5.000.000,00	0,00	4.983.546,59	-16.453,41	-0,33%	1,13%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	2.000.000,00	0,00	1.923.182,34	-76.817,66	-3,84%	-2,55%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	15.567.575,88	0,00	0,00	15.353.852,02	-213.723,86	-1,37%	-1,37%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	31.015.829,44	0,00	5.000.000,00	25.720.280,80	-295.548,64	-0,93%	-1,38%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>2.283.075,84</b>	<b>1,21%</b>	

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 RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.050.000,00	0,00	23.300,00	1.070.000,00	43.300,00	4,22%	1,90%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	1.156.953,37	0,00	0,00	1.165.993,97	9.040,60	0,78%	0,78%
ÁTICO FLORESTAL - FIP	1.257.664,77	0,00	0,00	1.252.856,37	-4.808,40	-0,38%	-
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	0,00	1.000.000,00	0,00	922.062,31	-77.937,69	-7,79%	-3,31%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	0,00	1.000.000,00	0,00	918.193,79	-81.806,21	-8,18%	-3,21%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	0,00	1.000.000,00	0,00	910.002,54	-89.997,46	-9,00%	-4,35%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	0,00	2.000.000,00	0,00	1.873.596,49	-126.403,51	-6,32%	2,32%
<b>Total Renda Variável</b>					<b>-328.612,67</b>	<b>-4,26%</b>	

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	49.851.995,35	0,00	5.000.000,00	47.541.524,86	2.689.529,51	5,45%	5,40%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	26.877.056,00	0,00	0,00	29.052.131,18	2.175.075,18	8,09%	8,09%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	29.031.871,14	0,00	5.000.000,00	25.720.280,80	1.688.409,66	5,84%	5,36%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	16.248.898,60	14.334.904,63	7.310.533,28	24.487.552,58	1.214.282,63	5,19%	5,70%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	14.584.646,51	0,00	0,00	15.353.852,02	769.205,51	5,27%	5,27%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.666.958,35	0,00	0,00	9.161.890,02	494.931,67	5,71%	5,71%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.332.545,23	0,00	0,00	7.783.309,59	450.764,36	6,15%	6,15%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.549.948,68	0,00	0,00	7.982.440,38	432.491,70	5,73%	5,73%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	3.090.450,01	0,00	0,00	3.357.985,76	267.535,75	8,66%	-
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	3.117.324,26	0,00	0,00	3.308.754,48	191.430,22	6,14%	6,14%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.006.396,04	0,00	0,00	2.128.913,29	122.517,25	6,11%	6,11%
PRASS II FIDC SÊNIOR	1.400.523,35	0,00	0,00	1.507.474,76	106.951,41	7,64%	7,64%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	848.328,43	0,00	0,00	893.078,75	44.750,32	5,28%	5,28%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	819.484,01	0,00	23.418,73	840.067,05	44.001,77	5,47%	5,48%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	691.016,43	23.418,73	0,00	754.784,87	40.349,71	5,69%	5,71%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	563.197,29	0,00	0,00	594.671,94	31.474,65	5,59%	5,48%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	99.411,02	0,00	18.565,78	107.862,19	27.016,95	31,48%	8,50%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	227.499,98	0,00	0,00	241.397,63	13.897,65	6,11%	6,11%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	3.000.000,00	0,00	3.010.013,40	10.013,40	0,33%	8,81%
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	18.429,42	0,00	11.231,67	6.889,30	-308,45	-3,01%	-62,62%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,00	5.000.000,00	0,00	4.983.546,59	-16.453,41	-0,33%	5,38%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	2.000.000,00	0,00	1.923.182,34	-76.817,66	-3,84%	5,40%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>10.721.049,78</b>	<b>6,00%</b>	

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 (%)
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.020.000,00	0,00	46.997,71	1.070.000,00	96.997,71	9,72%	4,90%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	1.117.631,18	0,00	0,00	1.165.993,97	48.362,79	4,33%	4,33%
ÁTICO FLORESTAL - FIP	1.262.652,08	0,00	0,00	1.252.856,37	-9.795,71	-0,78%	-
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	0,00	1.000.000,00	0,00	922.062,31	-77.937,69	-7,79%	4,08%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	0,00	1.000.000,00	0,00	918.193,79	-81.806,21	-8,18%	4,20%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	0,00	1.000.000,00	0,00	910.002,54	-89.997,46	-9,00%	5,97%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	0,00	2.000.000,00	0,00	1.873.596,49	-126.403,51	-6,32%	18,04%
<b>Total Renda Variável</b>					<b>-240.580,08</b>	<b>-1,78%</b>	