

Relatório Analítico dos Investimentos em julho de 2017



Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

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
TÍTULOS PÚBLICOS			115.656.434,82	11,98%			Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	16.701.458,59	1,73%	167	1,45%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	12.542.972,04	1,30%	72	1,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	839.769,05	0,09%	193	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	9.988.100,65	1,03%	23	2,46%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SUL AMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	D+2	Não há	53.122.934,53	5,50%	106	15,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	4.841.539,10	0,50%	11	4,94%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	6.775.170,28	0,70%	304	0,35%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	4.236.453,31	0,44%	222	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	39.630.513,86	4,10%	34	8,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	12.983.678,14	1,34%	78	0,71%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	3.535.181,50	0,37%	107	0,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	28.063.386,51	2,91%	686	0,56%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	70.455.091,22	7,30%	356	5,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2030	13.042.307,64	1,35%	27	5,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	6.342.171,49	0,66%	6	13,63%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	6.328.417,99	0,66%	11	7,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	132.060.839,27	13,68%	739	2,35%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	50.911.846,65	5,27%	246	4,35%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	144.991.746,20	15,01%	98	8,69%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	11.059.186,08	1,15%	329	0,61%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.654.557,47	0,79%	325	0,30%	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
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	25.336.006,30	2,62%	62	1,73%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	D+5	Não há	8.475.454,54	0,88%	53	2,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	5.636.574,54	0,58%	61	6,23%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	528.672,07	0,05%	620	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	17.733.295,07	1,84%	434	0,94%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	3.657.322,03	0,38%	1.353	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SILVERADO MAXIMUM II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	Não se aplica	Não se aplica	101.432,66	0,01%			Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
BELSUL 500 FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	335,13	0,00%	6	14,91%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
SUL INVEST FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 6	Não se aplica	Não se aplica	1.000.755,96	0,10%	22	1,16%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
GÁVEA SUL FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1 LP	Não se aplica	Não se aplica	1.983.028,87	0,21%	17	5,20%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
HSBC NILO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	D+4	Não há	23.440.401,28	2,43%	8	5,89%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	6.640.060,55	0,69%	39	1,27%	Artigo 8º, Inciso I
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	4.049.692,11	0,42%	20.586	0,99%	Artigo 8º, Inciso I
BRADESCO H REGIMES DE PREVIDÊNCIA IBOVESPA FIC AÇÕES	D+5	Não há	9.349.638,32	0,97%	11	10,78%	Artigo 8º, Inciso I
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	D+13	Não há	5.245.881,45	0,54%	298	7,28%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	6.369.502,67	0,66%	1.060	18,21%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	D+12	Não há	2.116.114,49	0,22%	341	3,33%	Artigo 8º, Inciso III
AZ LEGAN BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	8.097.595,71	0,84%	77	10,64%	Artigo 8º, Inciso III
APEX AÇÕES 30 FIC AÇÕES	D+4 ou D+33	Não há	4.353.156,72	0,45%	124	1,59%	Artigo 8º, Inciso III
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	5.354.208,97	0,55%	1.089	2,05%	Artigo 8º, Inciso III
KONDOR EQUITIES INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+33	Não há	6.268.941,43	0,65%	597	8,23%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	D+5	Não há	6.901.575,11	0,71%	33	2,90%	Artigo 8º, Inciso IV

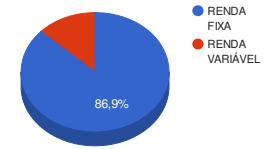
Carteira consolidada de investimentos - base (julho / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
SUL AMÉRICA CRÉDITO ATIVO FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+30	Não há	4.033.537,46	0,42%	179	0,93%	Artigo 8º, Inciso IV
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	5.126.975,10	0,53%	800	0,75%	Artigo 8º, Inciso IV
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+180	Não há	1.266.483,83	0,13%	24	0,81%	Artigo 8º, Inciso IV
SUL AMÉRICA HIGH YIELD FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+361	2 anos	4.095.065,25	0,42%	10	11,37%	Artigo 8º, Inciso IV
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	13.512.417,55	1,40%	3.069	3,88%	Artigo 8º, Inciso IV
XP LONG SHORT FIC MULTIMERCADO	D+2 ou D+16	Não há	3.398.671,68	0,35%	5.045	0,62%	Artigo 8º, Inciso IV
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	4.818.915,44	0,50%	50	8,04%	Artigo 8º, Inciso IV
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	4.909.147,12	0,51%			Artigo 8º, Inciso V
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	764.747,19	0,08%			Artigo 8º, Inciso V
RIO BRAVO ENERGIA I FIP	Não se aplica	Não se aplica	398.536,61	0,04%	23	0,18%	Artigo 8º, Inciso V
LSH FIP	Não se aplica	Não se aplica	4.638.867,97	0,48%			Artigo 8º, Inciso V
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS12	S/Info	Não se aplica	7.495.270,12	0,78%		12,03%	Artigo 8º, Inciso VI
DOMO FII - DOMC11	Não se aplica	Não se aplica	820.000,00	0,08%		1,14%	Artigo 8º, Inciso VI
MÉRITO DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - MFII11	Não se aplica	Não se aplica	6.009.980,76	0,62%		7,37%	Artigo 8º, Inciso VI
		TOTAL -	965.692.018,45				

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

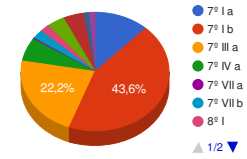
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	115.656.434,82	11,98%	8,00%	10,00%	15,00%	29.197.367,95
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	421.489.985,17	43,65%	39,00%	40,00%	60,00%	157.925.225,90
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	214.617.336,40	22,22%	8,00%	10,00%	30,00%	75.090.269,14
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	61.367.324,55	6,35%	5,00%	6,50%	30,00%	228.340.280,99
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,50%	10,00%	96.569.201,85
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	3.085.552,62	0,32%	0,00%	5,00%	5,00%	45.199.048,30
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	23.440.401,28	2,43%	0,00%	5,00%	5,00%	24.844.199,64
Total Renda Fixa	100,00%	839.657.034,84	86,95%	60,00	80,00	155,00	-

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	20.039.390,98	2,08%	2,00%	5,00%	10,00%	76.529.810,87
Artigo 8º, Inciso II	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	5,00%	48.284.600,92
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	37.805.401,44	3,91%	1,00%	3,00%	10,00%	58.763.800,41
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	43.153.641,42	4,47%	3,00%	5,00%	5,00%	5.130.959,50
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	10.711.298,89	1,11%	0,00%	3,00%	5,00%	37.573.302,03
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	14.325.250,88	1,48%	0,00%	3,00%	5,00%	33.959.350,04
Total Renda Variável	30,00%	126.034.983,61	13,05%	6,00	19,50	40,00	-

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 "	115.656.434,82	11,98%	8,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	421.489.985,17	43,65%	39,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	214.617.336,40	22,22%	8,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	61.367.324,55	6,35%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	3.085.552,62	0,32%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	23.440.401,28	2,43%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	839.657.034,84	86,95%	60,00	155,00

Artigos - Renda Variável	Base: julho / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I	20.039.390,98	2,08%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso III	37.805.401,44	3,91%	1,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV	43.153.641,42	4,47%	3,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	10.711.298,89	1,11%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	14.325.250,88	1,48%	0,00%	5,00%
Total Renda Variável	126.034.983,61	13,05%	6,00	40,00

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
IMA-B 5+	4,67%	10,43%	2,76%	8,01%	15,89%	42,86%	-	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4,70%	10,02%	2,58%	7,69%	15,35%	41,51%	0,20%	2,971%	12,84%
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%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	4,06%	9,85%	2,98%	7,77%	15,43%	38,22%	0,20%	2,320%	10,02%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4,01%	9,69%	2,91%	7,66%	15,18%	38,09%	0,30%	2,271%	9,85%
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%
SUL AMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	3,97%	11,43%	4,69%	9,42%	17,25%	41,22%	0,40%	2,254%	9,55%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA	3,95%	9,38%	2,80%	7,41%	14,41%	37,27%	0,40%	2,247%	9,83%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3,93%	6,36%	2,85%	4,41%	8,16%	24,86%	0,20%	2,540%	12,38%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3,82%	7,22%	3,58%	5,36%	8,76%	22,03%	0,20%	2,279%	8,76%
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%
HSBC NILO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	3,63%	10,57%	2,69%	7,96%	16,64%	39,45%	0,30%	2,702%	12,08%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,95%	6,25%	3,58%	4,96%	8,09%	18,73%	0,20%	1,225%	6,25%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,53%	8,48%	3,33%	7,27%	13,36%	31,25%	0,20%	1,028%	3,60%
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%	-	-	-

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
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	3,45%	10,22%	4,00%	8,57%	15,53%	34,90%	0,40%	1,559%	5,22%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2,85%	8,41%	3,47%	7,19%	13,59%	31,63%	0,20%	1,221%	3,65%
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%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	2,81%	8,23%	3,37%	7,03%	13,29%	31,18%	0,40%	1,225%	3,64%
IDKA IPCA 2 Anos	2,53%	9,07%	3,80%	7,90%	14,69%	32,93%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,30%	5,59%	0,54%	4,40%	7,72%	-	0,20%	0,870%	5,14%
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%
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%
135% do CDI	1,08%	8,86%	3,46%	7,28%	17,24%	39,94%	-	-	-
GÁVEA SUL FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1 LP	-4,53%	-22,88%	-12,05%	-20,69%	-16,93%	-0,85%	0,40%	9,143%	-
130% do CDI	1,04%	8,51%	3,33%	7,00%	16,55%	38,21%	-	-	-
SILVERADO MAXIMUM II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	-1,04%	-9,23%	-3,72%	-8,42%	-10,01%	-95,16%	2,50%	-	-
IPCA + 8,00% ao ano	0,88%	6,02%	2,30%	4,91%	10,89%	30,15%	-	-	-
BELSUL 500 FIDC SÊNIOR	-71,52%	-99,96%	-97,23%	-99,96%	-99,97%	-99,97%	0,00%	129,435%	-
IPCA + 7,50% ao ano	0,85%	5,74%	2,18%	4,67%	10,38%	28,95%	-	-	-

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
SUL INVEST FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 6	0,63%	5,61%	2,02%	4,45%	-4,32%	-5,10%	0,20%	0,224%	0,50%
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%
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,80%	6,60%	2,62%	5,45%	12,67%	28,49%	0,20%	0,010%	0,08%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,71%	5,92%	2,28%	4,86%	11,57%	26,18%	1,00%	0,009%	0,09%
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	0,64%	7,59%	2,75%	6,35%	14,18%	32,19%	0,75%	1,353%	9,28%
IPCA	0,24%	1,43%	0,32%	1,04%	2,71%	11,68%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2,53%	8,85%	2,37%	6,59%	15,08%	37,25%	0,40%	1,090%	6,27%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	2,53%	8,83%	2,37%	6,58%	-	-	0,40%	1,090%	-
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3,54%	6,71%	3,56%	5,05%	8,61%	-	0,15%	1,784%	7,29%

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
SMLL	8,14%	28,96%	7,42%	15,74%	26,01%	47,08%	-	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	10,64%	21,53%	4,77%	9,85%	20,25%	44,21%	2,00%	4,049%	20,70%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	7,86%	27,32%	6,80%	14,90%	24,35%	42,51%	1,50%	3,659%	19,69%
IBX	4,91%	10,59%	1,38%	3,16%	15,35%	28,88%	-	-	-
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	4,12%	10,24%	1,91%	5,06%	6,79%	20,22%	2,00%	4,180%	15,08%
Ibovespa	4,80%	9,45%	0,79%	1,93%	15,03%	29,60%	-	-	-
APEX AÇÕES 30 FIC AÇÕES	5,09%	7,87%	-0,11%	0,57%	9,46%	24,10%	1,90%	4,653%	21,52%
KONDOR EQUITIES INSTITUCIONAL FI AÇÕES	4,93%	8,92%	0,63%	-0,02%	15,67%	46,38%	1,50%	4,842%	20,98%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	4,89%	11,86%	1,48%	4,28%	12,81%	29,88%	1,50%	4,498%	18,89%
BRADERCO H REGIMES DE PREVIDÊNCIA IBOVESPA FIC AÇÕES	4,39%	10,10%	1,02%	2,04%	12,43%	22,42%	1,00%	4,463%	18,57%
AZ LEGAN BRASIL FI AÇÕES	3,93%	8,83%	1,34%	3,16%	14,04%	19,61%	2,00%	4,939%	18,18%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	3,78%	2,51%	-0,52%	-1,51%	10,18%	9,83%	2,00%	3,708%	21,29%
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	2,74%	0,06%	-3,19%	-5,81%	8,26%	1,50%	4,00%	4,254%	21,84%
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%
IPCA + 8,00% ao ano	0,88%	6,02%	2,30%	4,91%	10,89%	30,15%	-	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	-	-	-	-	-	-	2,00%	-	-

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

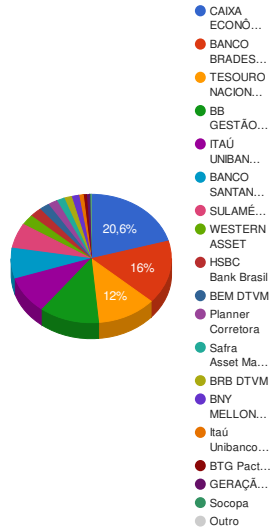
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	0,80%	6,49%	2,55%	5,35%	12,51%	28,27%	-	-	-
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	1,30%	6,91%	2,63%	5,53%	12,80%	28,41%	0,50%	0,366%	1,66%
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1,04%	6,08%	2,25%	4,69%	11,88%	28,22%	0,55%	0,373%	1,51%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	0,97%	5,34%	1,20%	3,39%	13,18%	32,22%	2,00%	0,336%	1,73%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	0,91%	7,79%	2,79%	6,70%	13,74%	35,34%	1,00%	0,708%	13,28%
SUL AMÉRICA CRÉDITO ATIVO FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	0,89%	7,48%	2,98%	6,34%	14,46%	30,16%	0,60%	0,061%	0,64%
XP LONG SHORT FIC MULTIMERCADO	0,15%	2,59%	3,45%	0,84%	10,29%	35,20%	2,00%	1,170%	4,25%
IPCA	0,24%	1,43%	0,32%	1,04%	2,71%	11,68%	-	-	-
SUL AMÉRICA HIGH YIELD FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1,88%	8,34%	3,12%	6,97%	15,11%	22,26%	1,50%	0,570%	1,73%
IFIX	-0,39%	10,84%	1,52%	6,83%	19,08%	40,54%	-	-	-
DOMO FII - DOMC11	2,50%	-15,29%	-9,19%	-15,81%	-18,00%	-33,33%	0,95%	15,543%	61,57%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS12	-	-100,00%	-100,00%	-	-100,00%	-	0,14%	-	-
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
MÉRITO DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - MFII11	4,74%	17,51%	8,70%	17,77%	20,21%	22,56%	0,15%	6,285%	13,52%
RIO BRAVO ENERGIA I FIP	-	-	-	-	-	-	1,65%	0,127%	0,99%
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,50%	-	-

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

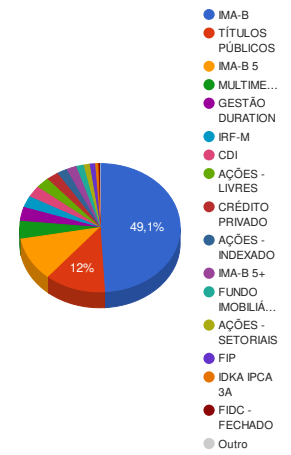
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
LSH FIP	-	-	-	-	-	-	1,15%	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	199.158.392,77	20,62%
BANCO BRADESCO	154.341.384,52	15,98%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	115.656.434,82	11,98%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	114.879.489,23	11,90%
ITAÚ UNIBANCO	90.918.676,84	9,41%
BANCO SANTANDER	74.112.413,25	7,67%
SULAMÉRICA INVESTIMENTOS	61.251.537,24	6,34%
WESTERN ASSET	25.255.531,76	2,62%
HSBC Bank Brasil	23.440.401,28	2,43%
BEM DTVM	19.612.418,59	2,03%
Planner Corretora	18.414.398,00	1,91%
Safra Asset Management	15.115.075,75	1,57%
BRB DTVM	15.094.357,95	1,56%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	14.372.521,20	1,49%
Itaú Unibanco S.A.	8.475.454,54	0,88%
BTG Pactual Serviços Financeiros	6.342.171,49	0,66%
GERAÇÃO FUTURO	6.165.806,60	0,64%
Socopa	2.984.119,96	0,31%
Gradual Investimentos	101.432,66	0,01%



Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	473.947.140,75	49,08%
TÍTULOS PÚBLICOS	115.656.434,82	11,98%
IMA-B 5	107.111.129,35	11,09%
MULTIMERCADO	43.153.641,42	4,47%
GESTÃO DURATION	33.811.460,84	3,50%
IRF-M	28.063.386,51	2,91%
CDI	27.555.863,71	2,85%
AÇÕES - LIVRES	26.081.689,80	2,70%
CRÉDITO PRIVADO	23.440.401,28	2,43%
AÇÕES - INDEXADO	20.039.390,98	2,08%
IMA-B 5+	19.817.477,92	2,05%
FUNDO IMOBILIÁRIO	14.325.250,88	1,48%
AÇÕES - SETORIAIS	11.723.711,64	1,21%
FIP	10.711.298,89	1,11%
IDKA IPCA 3A	6.328.417,99	0,66%
FIDC - FECHADO	3.085.552,62	0,32%
IDKA IPCA 2A	839.769,05	0,09%

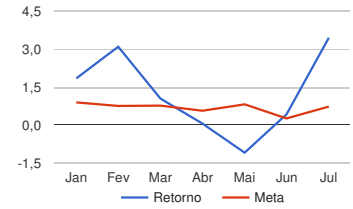
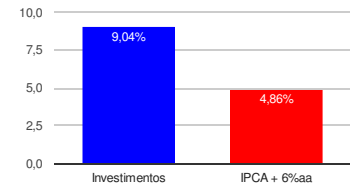


Carteira de Títulos Públicos - base (julho / 2017)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde.	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	GAP (Atual - Pago)
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2017	21/11/2016	1362	2.936,992217	0,000000	4.000.183,40	0,00	-4.000.183,40
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2019	25/08/2015	7659	2.636,195170	3.159,684734	20.190.618,81	24.200.025,38	4.009.406,57
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2021	17/08/2016	4750	2.964,257204	3.179,686301	14.080.221,72	15.103.509,93	1.023.288,21
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2023	03/09/2015	6730	2.515,509771	3.194,968936	16.929.380,76	21.502.140,94	4.572.760,18
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	14/03/2014	6185	2.315,991673	3.264,926514	14.324.408,50	20.193.570,49	5.869.161,99
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2026	27/04/2016	2200	2.838,144079	3.273,933208	6.243.916,97	7.202.653,06	958.736,08
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	21/12/2015	8310	2.412,107871	3.303,794829	20.044.616,41	27.454.535,03	7.409.918,62

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

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 IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.471.336,25	0,00	0,00	6.775.170,28	303.834,03	4,70%	2,97%	4,70%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	9.576.608,78	0,00	0,00	9.988.100,65	411.491,87	4,30%	2,47%	4,30%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	48.949.972,04	0,00	0,00	50.911.846,65	1.961.874,61	4,01%	2,27%	4,01%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	127.014.701,18	0,00	0,00	132.060.839,27	5.046.138,09	3,97%	2,25%	3,97%
SUL AMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	51.094.271,50	0,00	0,00	53.122.934,53	2.028.663,03	3,97%	2,25%	3,97%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA	38.124.784,67	0,00	0,00	39.630.513,86	1.505.729,19	3,95%	2,25%	3,95%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.549.512,74	0,00	0,00	13.042.307,64	492.794,90	3,93%	2,54%	3,93%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.081.115,64	0,00	0,00	12.542.972,04	461.856,40	3,82%	2,28%	3,82%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	7.376.192,81	0,00	0,00	7.654.557,47	278.364,66	3,77%	2,15%	3,77%
TÍTULOS PÚBLICOS	111.553.730,72	0,00	0,00	115.656.434,82	4.102.704,10	3,68%	-	-
HSBC NILO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	22.618.386,41	0,00	0,00	23.440.401,28	822.014,87	3,63%	2,70%	3,63%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.125.092,90	0,00	0,00	6.342.171,49	217.078,59	3,54%	1,78%	3,54%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	4.679.879,15	0,00	0,00	4.841.539,10	161.659,95	3,45%	1,56%	3,45%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	56.800.997,95	84.018.966,64	0,00	144.991.746,20	4.171.781,61	2,96%	2,32%	4,06%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.433.993,69	0,00	0,00	3.535.181,50	101.187,81	2,95%	1,23%	2,95%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	10.752.755,76	0,00	0,00	11.059.186,08	306.430,32	2,85%	1,22%	2,85%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	68.521.691,16	0,00	0,00	70.455.091,22	1.933.400,06	2,82%	1,23%	2,82%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	12.629.291,82	0,00	0,00	12.983.678,14	354.386,32	2,81%	1,22%	2,81%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	24.711.082,60	0,00	0,00	25.336.006,30	624.923,70	2,53%	1,09%	2,53%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	8.266.430,12	0,00	0,00	8.475.454,54	209.024,42	2,53%	1,09%	2,53%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	16.289.973,17	0,00	0,00	16.701.458,59	411.485,42	2,53%	1,03%	2,53%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	27.430.844,60	0,00	0,00	28.063.386,51	632.541,91	2,31%	1,03%	2,31%

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(%)
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.186.097,28	0,00	0,00	6.328.417,99	142.320,71	2,30%	0,87%	2,30%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	82.621.061,77	0,00	84.018.966,64	0,00	1.397.904,87	1,69%	2,28%	3,97%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.167.458,93	0,00	0,00	4.236.453,31	68.994,38	1,66%	0,66%	1,66%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	826.202,71	0,00	0,00	839.769,05	13.566,34	1,64%	0,65%	1,64%
GÂVEA SUL FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1 LP	2.077.191,57	0,00	115.698,44	1.983.028,87	21.535,74	1,04%	9,14%	-4,53%
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	3.568.741,65	62.253,00	2.338,32	3.657.322,03	28.665,70	0,79%	0,01%	0,80%
SUL INVEST FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 6	994.474,60	0,00	0,00	1.000.755,96	6.281,36	0,63%	0,22%	0,63%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	205.476,89	407.297,96	87.163,86	528.672,07	3.061,08	0,50%	0,01%	0,71%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.335.963,51	31.376.133,66	24.134.749,17	17.733.295,07	155.947,07	0,37%	0,03%	0,82%
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	616.502,55	5.000.000,00	0,00	5.636.574,54	20.071,99	0,36%	1,35%	0,64%
SILVERADO MAXIMUM II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	102.503,15	0,00	0,00	101.432,66	-1.070,49	-1,04%	-	-
BELSUL 500 FIDC SÊNIOR	1.176,66	0,00	0,00	335,13	-841,53	-71,52%	129,43%	-71,52%
				Total Renda Fixa	28.395.803,08	3,50%	1,94%	

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(%)
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	4.839.499,90	0,00	0,00	5.354.208,97	514.709,07	10,64%	4,05%	10,64%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	4.007.656,49	2.000.000,00	0,00	6.369.502,67	361.846,18	6,02%	3,66%	7,86%
APEX AÇÕES 30 FIC AÇÕES	4.142.138,60	0,00	0,00	4.353.156,72	211.018,12	5,09%	4,65%	5,09%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	6.330.207,78	0,00	0,00	6.640.060,55	309.852,77	4,89%	4,50%	4,89%
MÉRITO DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - MFII11	5.737.870,60	0,00	0,00	6.009.980,76	272.110,16	4,74%	6,29%	4,74%
KONDOR EQUITIES INSTITUCIONAL FI AÇÕES	5.995.557,40	0,00	0,00	6.268.941,43	273.384,03	4,56%	4,84%	4,93%
BRDESCO H REGIMES DE PREVIDÊNCIA IBOVESPA FIC AÇÕES	8.956.863,78	0,00	0,00	9.349.638,32	392.774,54	4,39%	4,46%	4,39%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	5.038.535,39	0,00	0,00	5.245.881,45	207.346,06	4,12%	4,18%	4,12%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	2.038.971,03	0,00	0,00	2.116.114,49	77.143,46	3,78%	3,71%	3,78%
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	3.941.778,62	0,00	0,00	4.049.692,11	107.913,49	2,74%	4,25%	2,74%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	13.169.427,36	0,00	0,00	13.512.417,55	342.990,19	2,60%	2,24%	2,60%
DOMO FII - DOMC11	800.000,00	0,00	0,00	820.000,00	20.000,00	2,50%	15,54%	2,50%
AZ LEGAN BRASIL FI AÇÕES	2.938.497,40	5.000.000,00	0,00	8.097.595,71	159.098,31	2,00%	4,94%	3,93%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS12	7.351.609,88	0,00	0,00	7.495.270,12	143.660,24	1,95%	-	0,00%
SUL AMÉRICA HIGH YIELD FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	4.019.351,94	0,00	0,00	4.095.065,25	75.713,31	1,88%	0,57%	1,88%
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	5.061.250,98	0,00	0,00	5.126.975,10	65.724,12	1,30%	0,37%	1,30%
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.253.408,32	0,00	0,00	1.266.483,83	13.075,51	1,04%	0,37%	1,04%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	6.835.222,13	0,00	0,00	6.901.575,11	66.352,98	0,97%	0,34%	0,97%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	4.775.259,04	0,00	0,00	4.818.915,44	43.656,40	0,91%	0,71%	0,91%
SUL AMÉRICA CRÉDITO ATIVO FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	3.997.775,59	0,00	0,00	4.033.537,46	35.761,87	0,89%	0,06%	0,89%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	18.474.393,76	0,00	18.528.284,67	0,00	53.890,91	0,29%	4,68%	4,61%
XP LONG SHORT FIC MULTIMERCADO	3.393.613,30	0,00	0,00	3.398.671,68	5.058,38	0,15%	1,17%	0,15%

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(%)
RIO BRAVO ENERGIA I FIP	397.958,41	0,00	0,00	398.536,61	578,20	0,15%	0,13%	0,15%
LSH FIP	4.640.356,43	0,00	0,00	4.638.867,97	-1.488,46	-0,03%	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	769.364,01	0,00	0,00	764.747,19	-4.616,82	-0,60%	-	-
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	0,00	5.000.000,00	0,00	4.909.147,12	-90.852,88	-1,82%	-	-
Total Renda Variável					3.656.700,14	2,84%	3,23%	

