

# Relatório Analítico dos Investimentos em agosto 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 (agosto / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
TÍTULOS PÚBLICOS			116.642.486,25	11,82%			Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	822.126,75	0,08%	193	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	10.128.502,66	1,03%	23	2,51%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	71.325.820,53	7,23%	355	5,40%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	4.149.783,11	0,42%	222	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	133.813.138,18	13,57%	754	2,40%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	4.901.050,86	0,50%	11	4,60%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2030	12.894.686,48	1,31%	26	5,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	3.477.988,39	0,35%	107	0,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SUL AMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	D+2	Não há	53.976.457,15	5,47%	107	14,61%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	6.270.197,82	0,64%	6	13,63%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	40.144.199,37	4,07%	35	8,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	6.383.573,13	0,65%	11	7,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	16.401.633,43	1,66%	167	1,45%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	6.865.821,20	0,70%	295	0,38%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	12.426.370,13	1,26%	72	1,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	28.354.451,01	2,87%	688	0,56%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	13.141.557,31	1,33%	77	0,70%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	11.196.779,12	1,14%	334	0,59%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	51.589.371,44	5,23%	256	4,19%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	147.005.907,31	14,90%	98	8,85%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.758.451,46	0,79%	329	0,30%	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
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	25.635.097,33	2,60%	62	1,71%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	D+5	Não há	8.575.392,37	0,87%	56	1,93%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	5.687.608,41	0,58%	60	6,10%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.589.451,98	0,26%	628	0,21%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	21.616.039,05	2,19%	440	1,11%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	3.330.069,62	0,34%	1.380	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
GÁVEA SUL FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1 LP	Não se aplica	Não se aplica	1.886.600,64	0,19%	1	5,20%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
SUL INVEST FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 6	Não se aplica	Não se aplica	890.252,57	0,09%	22	1,16%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
SILVERADO MAXIMUM II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	Não se aplica	Não se aplica	100.286,89	0,01%			Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
BELSUL 500 FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	15,14	0,00%	1	14,91%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
HSBC NILO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	D+4	Não há	23.896.691,78	2,42%	9	4,87%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	7.084.077,37	0,72%	39	1,26%	Artigo 8º, Inciso I
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	4.115.219,48	0,42%	20.225	1,11%	Artigo 8º, Inciso I
BRADESCO H REGIMES DE PREVIDÊNCIA IBOVESPA FIC AÇÕES	D+5	Não há	9.887.799,68	1,00%	11	11,08%	Artigo 8º, Inciso I
AZ LEGAN BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	8.660.107,33	0,88%	74	10,57%	Artigo 8º, Inciso III
APEX AÇÕES 30 FIC AÇÕES	D+4 ou D+33	Não há	4.716.003,70	0,48%	121	1,98%	Artigo 8º, Inciso III
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	D+13	Não há	5.521.125,09	0,56%	325	7,27%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	6.928.849,11	0,70%	1.380	11,73%	Artigo 8º, Inciso III
KONDOR EQUITIES INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+33	Não há	6.716.137,63	0,68%	587	6,89%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	D+12	Não há	2.168.792,12	0,22%	332	3,47%	Artigo 8º, Inciso III
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	3.000.000,00	0,30%	7.425	0,86%	Artigo 8º, Inciso III
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	5.807.948,30	0,59%	1.417	1,96%	Artigo 8º, Inciso III

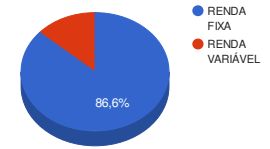
Carteira consolidada de investimentos - base (agosto / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
XP LONG SHORT FIC MULTIMERCADO	D+2 ou D+16	Não há	3.431.273,67	0,35%	4.883	0,69%	Artigo 8º, Inciso IV
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	13.658.115,28	1,38%	4.076	3,24%	Artigo 8º, Inciso IV
CAPITANIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+180	Não há	1.262.457,86	0,13%	24	0,81%	Artigo 8º, Inciso IV
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	4.866.559,29	0,49%	50	7,43%	Artigo 8º, Inciso IV
SUL AMÉRICA HIGH YIELD FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+361	2 anos	4.120.935,43	0,42%	10	11,37%	Artigo 8º, Inciso IV
SUL AMÉRICA CRÉDITO ATIVO FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+30	Não há	4.066.595,98	0,41%	179	0,93%	Artigo 8º, Inciso IV
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	5.182.105,94	0,53%	863	0,69%	Artigo 8º, Inciso IV
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	D+5	Não há	6.947.552,63	0,70%	32	3,08%	Artigo 8º, Inciso IV
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	836.385,16	0,08%			Artigo 8º, Inciso V
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	4.896.287,92	0,50%			Artigo 8º, Inciso V
LSH FIP	Não se aplica	Não se aplica	4.638.007,69	0,47%			Artigo 8º, Inciso V
RIO BRAVO ENERGIA I FIP	Não se aplica	Não se aplica	119.526,21	0,01%			Artigo 8º, Inciso V
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS12	S/Info	Não se aplica	7.478.524,07	0,76%		12,00%	Artigo 8º, Inciso VI
MÉRITO DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - MFII11	Não se aplica	Não se aplica	5.528.740,00	0,56%		7,37%	Artigo 8º, Inciso VI
DOMO FII - DOMC11	Não se aplica	Não se aplica	902.000,00	0,09%		1,14%	Artigo 8º, Inciso VI
		<b>TOTAL -</b>	<b>986.418.985,81</b>				

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

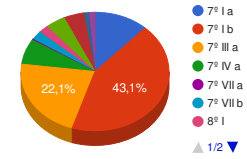
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	116.642.486,25	11,82%	8,00%	10,00%	15,00%	31.320.361,62
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	425.477.357,51	43,13%	39,00%	40,00%	60,00%	166.374.033,98
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	217.550.509,33	22,05%	8,00%	10,00%	30,00%	78.375.186,41
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	67.433.658,76	6,84%	5,00%	6,50%	30,00%	228.492.036,98
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,50%	10,00%	98.641.898,58
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	2.877.155,24	0,29%	0,00%	5,00%	5,00%	46.443.794,05
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	23.896.691,78	2,42%	0,00%	5,00%	5,00%	25.424.257,51
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>853.877.858,87</b>	<b>86,56%</b>	<b>60,00</b>	<b>80,00</b>	<b>155,00</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%	21.087.096,53	2,14%	2,00%	5,00%	10,00%	77.554.802,05
Artigo 8º, Inciso II	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	5,00%	49.320.949,29
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	43.518.963,28	4,41%	1,00%	3,00%	10,00%	55.122.935,30
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	43.535.596,08	4,41%	3,00%	5,00%	5,00%	5.785.353,21
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	10.490.206,98	1,06%	0,00%	3,00%	5,00%	38.830.742,31
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	13.909.264,07	1,41%	0,00%	3,00%	5,00%	35.411.685,22
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>132.541.126,94</b>	<b>13,44%</b>	<b>6,00</b>	<b>19,50</b>	<b>40,00</b>	<b>-</b>

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 "	116.642.486,25	11,82%	8,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	425.477.357,51	43,13%	39,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	217.550.509,33	22,05%	8,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	67.433.658,76	6,84%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	2.877.155,24	0,29%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	23.896.691,78	2,42%	0,00%	5,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>853.877.858,87</b>	<b>86,56%</b>	<b>60,00</b>	<b>155,00</b>

Artigos - Renda Variável	Base: agosto / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I	21.087.096,53	2,14%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso III	43.518.963,28	4,41%	1,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV	43.535.596,08	4,41%	3,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	10.490.206,98	1,06%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	13.909.264,07	1,41%	0,00%	5,00%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>132.541.126,94</b>	<b>13,44%</b>	<b>6,00</b>	<b>40,00</b>

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%	-	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,34%	11,49%	6,00%	3,94%	15,86%	50,41%	0,20%	2,654%	12,85%
IMA-B	1,34%	11,14%	5,57%	5,06%	15,49%	44,95%	-	-	-
HSBC NILO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	1,95%	12,72%	6,48%	5,54%	17,77%	48,71%	0,30%	2,398%	12,09%
SUL AMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	1,61%	13,22%	6,19%	7,03%	17,87%	47,83%	0,40%	1,831%	9,55%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	1,41%	10,85%	5,87%	5,08%	14,94%	42,22%	0,45%	1,903%	10,20%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	1,39%	11,37%	5,66%	5,12%	15,97%	44,82%	0,20%	1,866%	10,01%
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%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,33%	11,15%	5,59%	5,01%	15,58%	44,34%	0,30%	1,812%	9,85%
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%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA	1,30%	10,80%	5,47%	4,82%	14,93%	43,56%	0,40%	1,807%	9,82%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,99%	9,56%	4,09%	6,64%	13,51%	33,62%	0,20%	0,547%	3,58%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,93%	6,23%	3,02%	3,92%	9,37%	28,41%	0,20%	4,252%	8,59%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,13%	5,16%	3,06%	1,19%	8,45%	33,14%	0,20%	4,061%	12,23%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,62%	4,53%	1,86%	4,29%	8,30%	22,66%	0,20%	4,126%	5,91%
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%	-	-	-

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
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,24%	9,76%	4,66%	6,94%	13,74%	33,96%	0,20%	0,720%	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%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	1,23%	11,57%	5,39%	7,65%	15,74%	38,88%	0,40%	0,946%	5,20%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	1,22%	9,55%	4,60%	6,77%	13,46%	33,45%	0,40%	0,718%	3,64%
135% do CDI	1,08%	10,04%	3,29%	7,19%	16,60%	39,37%	-	-	-
GÁVEA SUL FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1 LP	-4,86%	-26,63%	-13,01%	-22,03%	-22,25%	-7,06%	0,40%	-	-
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%
130% do CDI	1,04%	9,65%	3,17%	6,92%	15,94%	37,67%	-	-	-
SILVERADO MAXIMUM II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	-1,11%	-10,24%	-3,30%	-	-11,06%	-95,28%	2,50%	-	-
IDKA IPCA 2 Anos	0,97%	10,12%	4,34%	7,49%	14,33%	34,57%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,87%	6,51%	3,90%	3,77%	7,44%	-	0,20%	0,413%	5,11%
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%
IPCA + 8,00% ao ano	0,90%	6,97%	2,21%	4,92%	10,62%	30,19%	-	-	-
BELSUL 500 FIDC SÊNIOR	-95,48%	-100,00%	-99,21%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	0,00%	-	-
IPCA + 7,50% ao ano	0,85%	6,64%	2,09%	4,68%	10,11%	28,99%	-	-	-



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
SUL INVEST FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 6	-11,04%	-6,05%	-10,22%	-7,87%	-2,97%	-1,51%	0,18%	-	-
CDI	0,80%	7,34%	2,43%	5,28%	12,05%	27,88%	-	-	-
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	0,91%	8,56%	2,44%	6,33%	13,82%	31,88%	0,75%	1,480%	9,19%
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,84%	7,50%	2,51%	5,42%	12,24%	28,13%	0,20%	0,038%	0,10%
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 FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,70%	6,67%	2,16%	4,76%	11,07%	25,76%	1,00%	0,003%	0,10%
IPCA	0,19%	1,62%	0,20%	0,90%	2,46%	11,65%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,18%	10,13%	4,75%	5,16%	15,38%	38,65%	0,40%	1,008%	6,26%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	1,18%	10,11%	4,74%	5,17%	-	-	0,40%	1,007%	-
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,13%	5,50%	2,90%	4,24%	9,26%	-	0,15%	3,918%	7,11%

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%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	8,47%	31,83%	19,20%	12,93%	33,04%	61,43%	2,00%	5,640%	20,52%
ibovespa	7,46%	17,61%	12,95%	6,26%	22,34%	51,93%	-	-	-
APEX AÇÕES 30 FIC AÇÕES	8,34%	16,87%	16,23%	5,00%	21,02%	44,04%	1,90%	5,301%	21,32%
AZ LEGAN BRASIL FI AÇÕES	6,95%	16,39%	11,91%	6,88%	21,46%	42,15%	2,00%	5,148%	18,03%
KONDOR EQUITIES INSTITUCIONAL FI AÇÕES	6,75%	16,28%	13,67%	1,87%	20,05%	65,71%	1,50%	6,076%	20,86%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	6,69%	19,34%	12,89%	7,50%	20,43%	48,47%	1,50%	4,894%	18,74%
BRADESCO H REGIMES DE PREVIDÊNCIA IBOVESPA FIC AÇÕES	5,76%	16,44%	10,24%	4,71%	18,81%	38,21%	1,00%	4,783%	18,35%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	2,49%	5,06%	7,90%	0,49%	9,69%	20,35%	2,00%	5,667%	20,91%
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	1,62%	1,68%	4,58%	-5,06%	9,11%	10,39%	4,00%	5,550%	21,37%
IBX	7,35%	18,72%	12,96%	7,20%	22,46%	50,80%	-	-	-
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	5,25%	16,03%	10,79%	7,50%	13,83%	32,95%	2,00%	4,168%	14,97%
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%
IPCA + 8,00% ao ano	0,90%	6,97%	2,21%	4,92%	10,62%	30,19%	-	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	-	-	-	-	-	-	2,00%	-	-

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

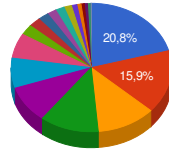
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	0,87%	11,80%	1,36%	2,76%	17,94%	42,94%	-	-	-
DOMO FII - DOMC11	10,00%	-6,82%	10,00%	-13,27%	-1,96%	-23,56%	0,95%	79,639%	76,61%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS12	-	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-	0,14%	-	-
CDI	0,80%	7,34%	2,43%	5,28%	12,05%	27,88%	-	-	-
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	1,08%	8,06%	3,46%	5,54%	12,69%	29,87%	0,50%	0,372%	1,66%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	0,99%	8,86%	2,81%	6,61%	15,92%	34,81%	1,00%	0,726%	11,64%
XP LONG SHORT FIC MULTIMERCADO	0,96%	3,58%	3,21%	1,57%	8,84%	35,81%	2,00%	1,976%	4,29%
SUL AMÉRICA CRÉDITO ATIVO FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	0,82%	8,36%	2,65%	6,07%	13,90%	29,82%	0,60%	0,032%	0,65%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	0,67%	6,04%	2,49%	3,08%	12,18%	31,23%	2,00%	0,536%	1,68%
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-0,32%	5,74%	1,51%	2,87%	10,23%	26,81%	0,55%	1,279%	1,73%
IPCA	0,19%	1,62%	0,20%	0,90%	2,46%	11,65%	-	-	-
SUL AMÉRICA HIGH YIELD FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	0,63%	9,03%	3,20%	6,07%	14,26%	22,55%	1,50%	0,433%	1,74%
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%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
MÉRITO DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - MFII11	-8,01%	8,10%	-1,46%	8,18%	10,72%	12,63%	0,15%	7,700%	14,33%

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

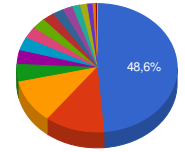
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,50%	-	-
LSH FIP	-	-	-	-	-	-	0,08%	-	-
RIO BRAVO ENERGIA I FIP	-	-	-	-	-	-	1,65%	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	204.923.217,28	20,77%
BANCO BRADESCO	156.893.706,99	15,91%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	117.819.634,93	11,94%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	116.642.486,25	11,82%
ITAÚ UNIBANCO	92.388.504,51	9,37%
BANCO SANTANDER	74.655.890,15	7,57%
SULAMÉRICA INVESTIMENTOS	62.163.988,56	6,30%
WESTERN ASSET	25.506.718,77	2,59%
HSBC Bank Brasil	23.896.691,78	2,42%
BEM DTVM	20.897.370,05	2,12%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	18.217.683,53	1,85%
Planner Corretora	17.903.551,99	1,82%
Safrá Asset Management	15.310.608,60	1,55%
BRB DTVM	10.554.167,70	1,07%
Itaú Unibanco S.A.	8.575.392,37	0,87%
GERAÇÃO FUTURO	6.284.011,60	0,64%
BTG Pactual Serviços Financeiros	6.270.197,82	0,64%
Orla DTVM	4.638.007,69	0,47%
Socopa	2.776.868,35	0,28%
Gradual Investimentos	100.286,89	0,01%



Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	479.514.228,95	48,61%
TÍTULOS PÚBLICOS	116.642.486,25	11,82%
IMA-B 5	108.192.979,32	10,97%
MULTIMERCADO	43.535.596,08	4,41%
GESTÃO DURATION	34.210.489,70	3,47%
CDI	33.223.169,06	3,37%
IRF-M	28.354.451,01	2,87%
AÇÕES - LIVRES	27.782.165,87	2,82%
CRÉDITO PRIVADO	23.896.691,78	2,42%
AÇÕES - INDEXADO	21.087.096,53	2,14%
IMA-B 5+	19.760.507,68	2,00%
AÇÕES - SETORIAIS	15.736.797,41	1,60%
FUNDO IMOBILIÁRIO	13.909.264,07	1,41%
FIP	10.490.206,98	1,06%
IDKA IPCA 3A	6.383.573,13	0,65%
FIDC - FECHADO	2.877.155,24	0,29%
IDKA IPCA 2A	822.126,75	0,08%

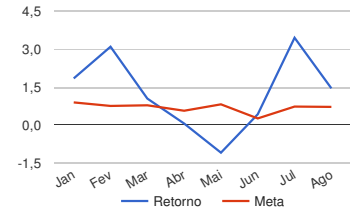
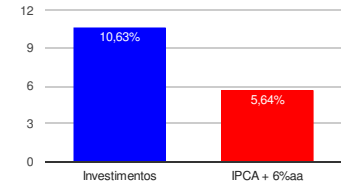


Carteira de Títulos Públicos - base (agosto / 2017)

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	3.187,985911	20.190.618,81	24.416.784,09	4.226.165,29
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2021	17/08/2016	4750	2.964,257204	3.231,677667	14.080.221,72	15.350.468,92	1.270.247,20
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2023	03/09/2015	6730	2.515,509771	3.248,916263	16.929.380,76	21.865.206,45	4.935.825,69
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	14/03/2014	6185	2.315,991673	3.232,296981	14.324.408,50	19.991.756,83	5.667.348,33
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2026	27/04/2016	2200	2.838,144079	3.241,388282	6.243.916,97	7.131.054,22	887.137,25
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	21/12/2015	8310	2.412,107871	3.355,862303	20.044.616,41	27.887.215,74	7.842.599,33

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

**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(%)
HSBC NILO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	23.440.401,28	0,00	0,00	23.896.691,78	456.290,50	1,95%	2,40%	1,95%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.542.972,04	0,00	329.636,33	12.426.370,13	213.034,42	1,70%	4,25%	-0,93%
SUL AMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	53.122.934,53	0,00	0,00	53.976.457,15	853.522,62	1,61%	1,83%	1,61%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	13.042.307,64	0,00	340.056,80	12.894.686,48	192.435,64	1,48%	4,06%	-1,13%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	9.988.100,65	0,00	0,00	10.128.502,66	140.402,01	1,41%	1,90%	1,41%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	144.991.746,20	0,00	0,00	147.005.907,31	2.014.161,11	1,39%	1,87%	1,39%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	7.654.557,47	0,00	0,00	7.758.451,46	103.893,99	1,36%	1,76%	1,36%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.342.171,49	0,00	157.274,80	6.270.197,82	85.301,13	1,34%	3,92%	-1,13%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.775.170,28	0,00	0,00	6.865.821,20	90.650,92	1,34%	2,65%	1,34%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	50.911.846,65	3.311,23	3.311,23	51.589.371,44	677.524,79	1,33%	1,81%	1,33%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	132.060.839,27	0,00	0,00	133.813.138,18	1.752.298,91	1,33%	1,81%	1,33%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA	39.630.513,86	0,00	0,00	40.144.199,37	513.685,51	1,30%	1,81%	1,30%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	11.059.186,08	0,00	0,00	11.196.779,12	137.593,04	1,24%	0,72%	1,24%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	70.455.091,22	0,00	0,00	71.325.820,53	870.729,31	1,24%	0,72%	1,24%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	4.841.539,10	0,00	0,00	4.901.050,86	59.511,76	1,23%	0,95%	1,23%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	12.983.678,14	0,00	0,00	13.141.557,31	157.879,17	1,22%	0,72%	1,22%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	25.336.006,30	0,00	0,00	25.635.097,33	299.091,03	1,18%	1,01%	1,18%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	8.475.454,54	0,00	0,00	8.575.392,37	99.937,83	1,18%	1,01%	1,18%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.535.181,50	0,00	93.896,53	3.477.988,39	36.703,42	1,04%	4,13%	-1,62%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	28.063.386,51	0,00	0,00	28.354.451,01	291.064,50	1,04%	0,98%	1,04%
GÁVEA SUL FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1 LP	1.983.028,87	0,00	116.922,34	1.886.600,64	20.494,11	1,03%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	16.701.458,59	0,00	462.478,61	16.401.633,43	162.653,45	0,97%	0,55%	0,99%



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(%)
SUL INVEST FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 6	1.000.755,96	0,00	120.095,44	890.252,57	9.592,05	0,96%	-	-
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	5.636.574,54	0,00	0,00	5.687.608,41	51.033,87	0,91%	1,48%	0,91%
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.328.417,99	0,00	0,00	6.383.573,13	55.155,14	0,87%	0,41%	0,87%
TÍTULOS PÚBLICOS	115.656.434,82	0,00	0,00	116.642.486,25	986.051,43	0,85%	-	-
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	3.657.322,03	0,00	356.998,33	3.330.069,62	29.745,92	0,81%	0,04%	0,84%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.236.453,31	0,00	115.182,17	4.149.783,11	28.511,97	0,67%	4,29%	-2,05%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	839.769,05	0,00	23.276,60	822.126,75	5.634,30	0,67%	0,29%	0,68%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	17.733.295,07	15.760.624,07	12.057.588,19	21.616.039,05	179.708,10	0,54%	0,02%	0,80%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	528.672,07	2.061.653,90	13.620,46	2.589.451,98	12.746,47	0,49%	0,00%	0,70%
SILVERADO MAXIMUM II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	101.432,66	0,00	0,00	100.286,89	-1.145,77	-1,13%	-	-
BELSUL 500 FIDC SÊNIOR	335,13	0,00	0,00	15,14	-319,99	-95,48%	-	-
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>10.585.572,66</b>	<b>1,26%</b>	<b>1,65%</b>	

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(%)
DOMO FII - DOMC11	820.000,00	0,00	0,00	902.000,00	82.000,00	10,00%	79,64%	10,00%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	6.369.502,67	0,00	0,00	6.928.849,11	559.346,44	8,78%	4,48%	8,78%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	5.354.208,97	0,00	0,00	5.807.948,30	453.739,33	8,47%	5,64%	8,47%
APEX AÇÕES 30 FIC AÇÕES	4.353.156,72	0,00	0,00	4.716.003,70	362.846,98	8,34%	5,30%	8,34%
AZ LEGAN BRASIL FI AÇÕES	8.097.595,71	0,00	0,00	8.660.107,33	562.511,62	6,95%	5,15%	6,95%
KONDOR EQUITIES INSTITUCIONAL FI AÇÕES	6.291.207,62	0,00	0,00	6.716.137,63	424.930,01	6,75%	6,08%	6,75%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	6.640.060,55	0,00	0,00	7.084.077,37	444.016,82	6,69%	4,89%	6,69%
BRDESCO H REGIMES DE PREVIDÊNCIA IBOVESPA FIC AÇÕES	9.349.638,32	0,00	0,00	9.887.799,68	538.161,36	5,76%	4,78%	5,76%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	5.245.881,45	0,00	0,00	5.521.125,09	275.243,64	5,25%	4,17%	5,25%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	2.116.114,49	0,00	0,00	2.168.792,12	52.677,63	2,49%	5,67%	2,49%
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	4.049.692,11	0,00	0,00	4.115.219,48	65.527,37	1,62%	5,55%	1,62%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	13.512.417,55	0,00	0,00	13.658.115,28	145.697,73	1,08%	4,31%	1,08%
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	5.126.975,10	0,00	0,00	5.182.105,94	55.130,84	1,08%	0,37%	1,08%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	4.818.915,44	0,00	0,00	4.866.559,29	47.643,85	0,99%	0,73%	0,99%
XP LONG SHORT FIC MULTIMERCADO	3.398.671,68	0,00	0,00	3.431.273,67	32.601,99	0,96%	1,98%	0,96%
SUL AMÉRICA CRÉDITO ATIVO FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	4.033.537,46	0,00	0,00	4.066.595,98	33.058,52	0,82%	0,03%	0,82%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	6.901.575,11	0,00	0,00	6.947.552,63	45.977,52	0,67%	0,54%	0,67%
SUL AMÉRICA HIGH YIELD FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	4.095.065,25	0,00	0,00	4.120.935,43	25.870,18	0,63%	0,43%	0,63%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS12	7.495.270,12	0,00	62.575,01	7.478.524,07	45.828,96	0,61%	-	0,00%
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	0,00	3.000.000,00	0,00	3.000.000,00	0,00	0,00%	5,08%	2,92%
LSH FIP	4.638.867,97	0,00	0,00	4.638.007,69	-860,28	-0,02%	-	-
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	4.909.147,12	0,00	0,00	4.896.287,92	-12.859,20	-0,26%	-	-

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(%)
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.266.483,83	0,00	0,00	1.262.457,86	-4.025,97	-0,32%	1,28%	-0,32%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	764.747,19	90.000,00	0,00	836.385,16	-18.362,03	-2,15%	-	-
MÉRITO DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - MFII11	6.009.980,76	0,00	0,00	5.528.740,00	-481.240,76	-8,01%	7,70%	-8,01%
RIO BRAVO ENERGIA I FIP	398.536,61	0,00	0,00	119.526,21	-279.010,40	-70,01%	-	-
				<b>Total Renda Variável</b>	<b>3.456.452,15</b>	<b>2,68%</b>	<b>4,56%</b>	

