



Instituto de Previdência dos Servidores Municipais de Goiânia
Junho 2017



*A Trinus cresceu, evoluiu
e agora é a Sete Capital.*

*Estamos com novo nome e novas cores, mas
com o mesmo nível de atendimento e
comprometimento que você já conhece!*

Somos o dobro mais 1, somos Sete!





Dados do Ente Federativo

Ente Federativo	Prefeitura Municipal de Goiânia
CNPJ	01.612.092/0001-23
Endereço	Avenida do Cerrado, nº 999
E-mail	gabinete.goiania@gmail.com
Telefone	(62) 3524-1000
Prefeito	Iris Rezende Machado
Início da Gestão	01/02/2017
E-mail	gabinete.goiania@gmail.com

Dados da Unidade Gestora do RPPS do Município de Goiânia

Unidade Gestora	Instituto de Previdência dos Servidores Municipais de Goiânia
Nome Fantasia	IPSM
CNPJ	08.948.407/0001-57
Endereço	Av. B, Quadra C1, Lote 16/18, nº 155
CEP	74110-030
Telefone	(62) 3524-5831
E-mail	ipsm@goiania.go.gov.br

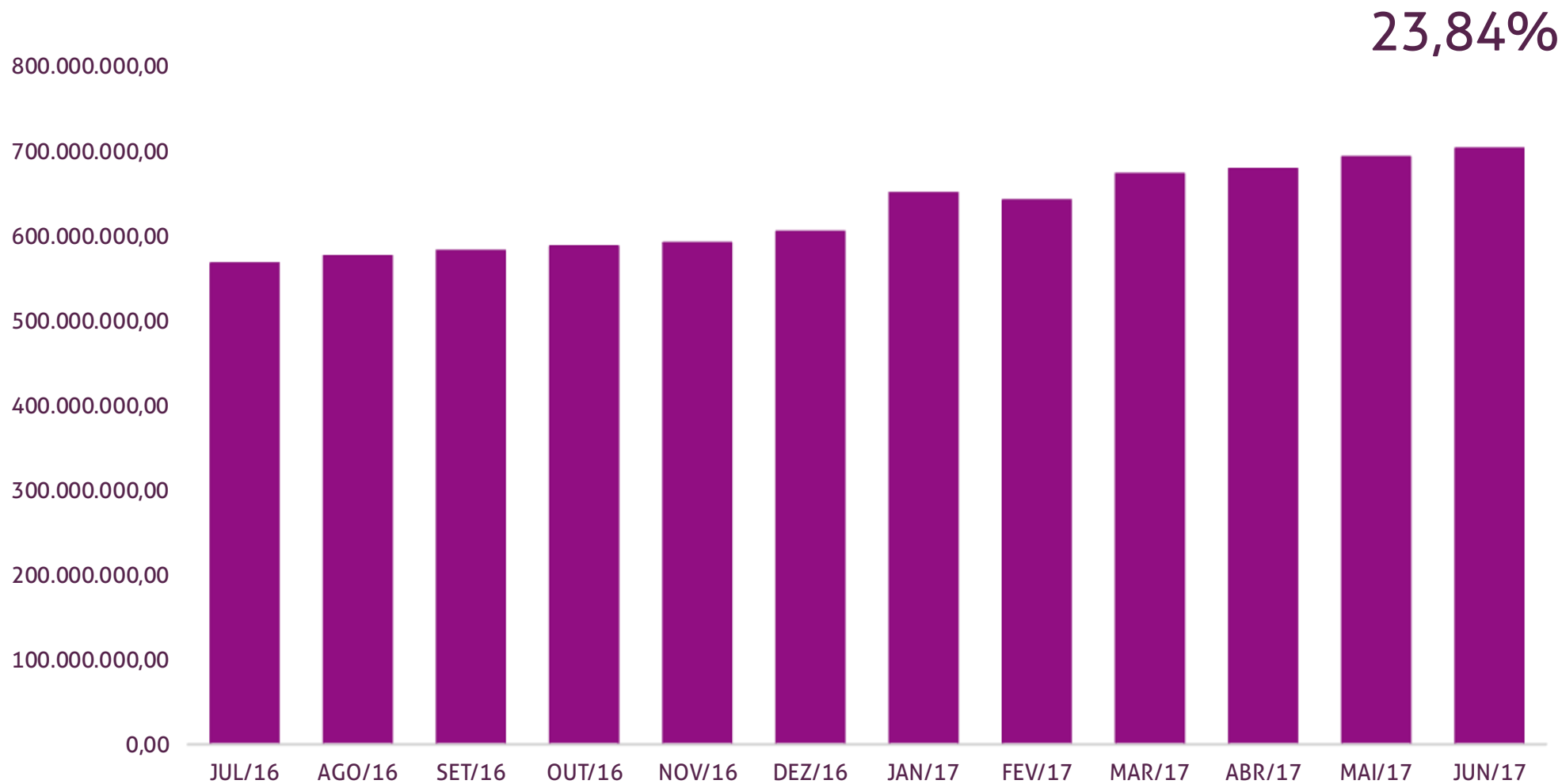
Representante Lega	Silvio Antonio Fernandes Filho	Gestor de Recursos	Oberlin da Cunha Nogueira
Cargo	Presidente	Cargo	Gerente de Investimentos
Início da Gestão	16/01/17	Início da Gestão	28/03/2017
E-mail	silvio.go@hotmail.com	E-mail	ipsm@goiania.go.gov.br
Telefone	(62) 3524-5831	Telefone	(62) 3524-5831
Certificação		Certificação	ANBIMA CPA 20
Validade		Validade	15/06/2019

Membros da Unidade Gestora do RPPS do Município de Goiânia

Comitê de Investimentos	Cargo	Conselho	Cargo
Silvio Antonio Fernandes Filho	Autorizador da Operação		
Fábio Alves Caixeta	Responsável pela Liquidação		
Oberlin da Cunha Nogueira	Preponente da Operação		

Evolução Patrimônio Líquido

Jan	R\$ 649.580.719,52	Fev	R\$ 640.982.473,98	Mar	R\$ 671.971.606,33	Abr	R\$ 677.887.073,42
Mai	R\$ 692.005.531,26	Jun	R\$ 701.984.982,41	Jul		Ago	
Set		Out		Nov		Dez	

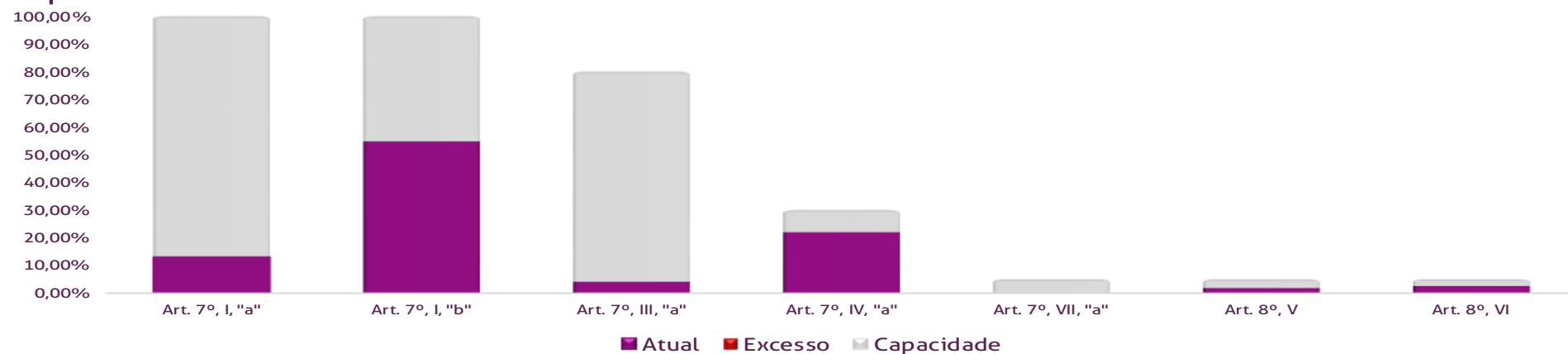




Fundos	Saldo no Mês	% do RPPS	Lt. do RPPS	Lt. por fundo	Status
Renda Fixa	669.245.343,04	95,70%	100%		
Art. 7º, I, "a" - Títulos Públicos Federais - SELIC	90.809.138,67	12,99%	100%		OK
NTN-B IPSM	11.756.457,21	1,68%			
NTN-F IPSM	79.052.681,46	11,30%			
Art. 7º, I, "b" - FI (100% TPF) - IMA ou IDKA	382.967.643,00	54,76%	100%		OK
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.026.053,92	1,43%			
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.186.292,29	0,17%			
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.020.135,07	0,57%			
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	199.638.450,34	28,55%			
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.973.869,31	0,28%			
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	898.366,59	0,13%			
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.342.690,21	0,62%			
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	100.128.487,77	14,32%			
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	20.031.307,62	2,86%			
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	527.868,09	0,08%			
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	39.885.320,19	5,70%			
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	308.801,60	0,04%			
Art. 7º, II - Compromissadas	0,00	0,00%	15%		OK
Art. 7º, III, "a" - FI Referenciado RF ou RF - IMA	28.449.983,77	4,07%	80%	20% por fundo	OK
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	249.217,34	0,04%			
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	16.083.632,94	2,30%			
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	740.704,66	0,11%			
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.822.099,17	0,98%			
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	297.252,10	0,04%			
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	3.307.013,96	0,47%			
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	950.063,60	0,14%			
Art. 7º, III, "b" - FI de Índices RF - IMA ou IDKA	0,00	0,00%	80%	20% por fundo	OK
Art. 7º, IV, "a" - FI Referenciado RF ou RF	166.608.464,05	21,97%	30%	20% por fundo	OK
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	219.291,07	0,03%			
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	113.762.600,65	16,27%			
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.184.039,97	0,31%			
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	569.729,98	0,08%			
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	35.996.663,84	5,15%			
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	921.684,49	0,13%			
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	297.787,18	0,04%			
BB SUPREMO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	94.071,65	0,01%			
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	1.377.815,10	0,20%			
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	791.930,38	0,11%			
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	10.392.849,74	1,49%			
Art. 7º, IV, "b" - FI de Índices RF	0,00	0,00%	30%	20% por fundo	OK

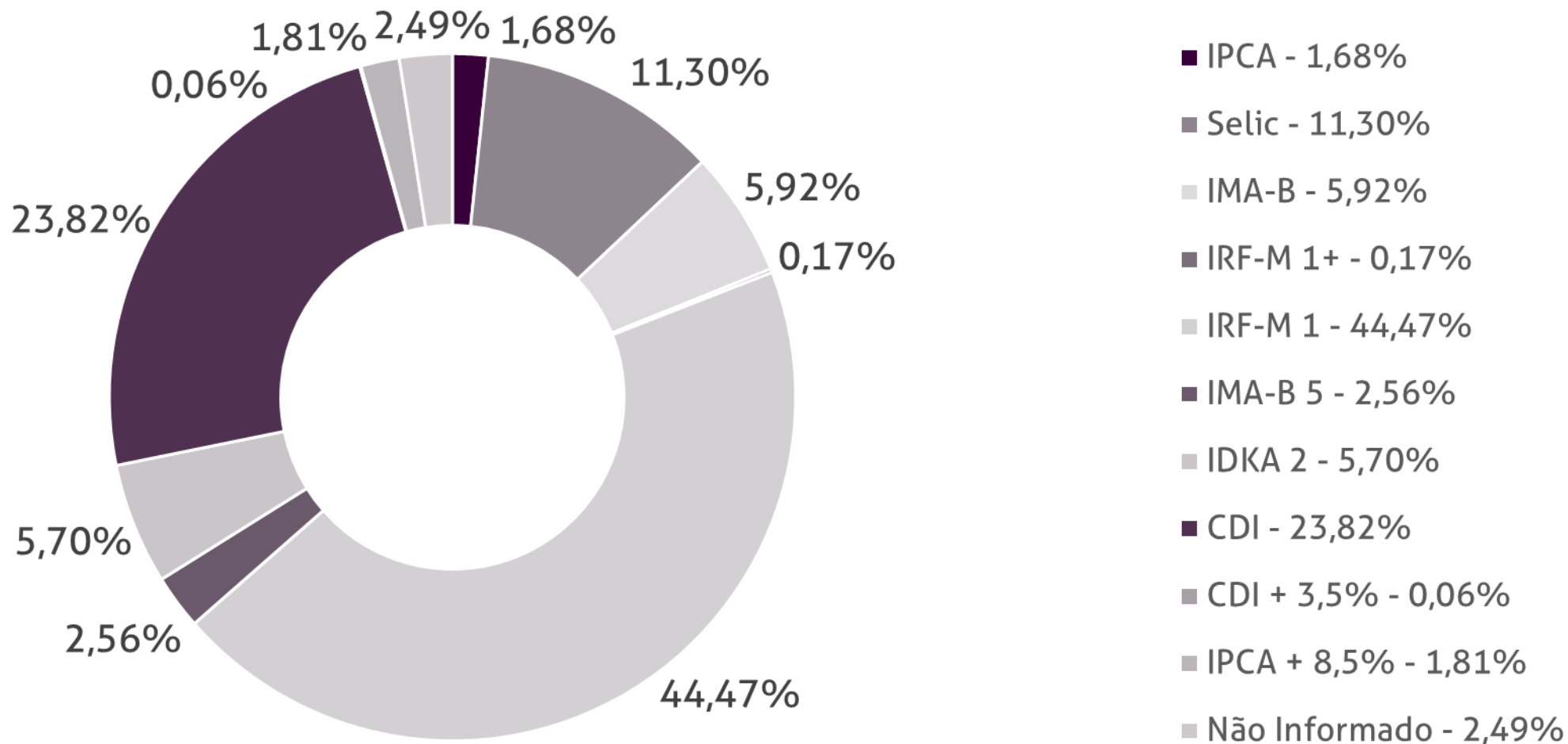
Art. 7º, V, "a" - Poupança	0,00	0,00%	20%	OK
Art. 7º, V, "b" - LIG - Letras Imobiliárias Garantidas	0,00	0,00%	20%	OK
Art. 7º, VI - FIDC Aberto	0,00	0,00%	15%	OK
Art. 7º, VII, "a" - FIDC Fechado	410.113,55	0,06%	5%	OK
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	410.113,55	0,06%		
Art. 7º, VII, "b" - FI Crédito Privado	0,00	0,00%	5%	OK
Renda Variável	30.065.483,30	4,30%	30%	
Art. 8º, I - FIA Referenciado - IBOV ou IBrX ou IE	0,00	0,00%	30%	20% por fundo
Art. 8º, II - ETF Referenciado - IBOV ou IBrX ou I	0,00	0,00%	20%	OK
Art. 8º, III - FIA - Fundo de Ações	0,00	0,00%	15%	OK
Art. 8º, IV - FI Multimercado - FIM	0,00	0,00%	5%	OK
Art. 8º, V - FI em Participações - FIP	12.662.852,63	1,81%	5%	OK
CONQUEST FIP - FCCQ11	12.662.852,63	1,81%		
Art. 8º, VI - FI Imobiliário - FII	17.402.630,67	2,49%	5%	OK
ÁQUILLA FII - AQLL11	6.322.273,99	0,90%		
FIRENZE FII	11.080.356,68	1,58%		
Não Enquadra	0,00	0,00%		OK
Aplicações	699.310.826,34	99,62%		
Imóveis	0,00	0,00%		
Art. 3º - Integralização em Imóveis	0,00	0,00%		OK
Conta Corrente	2.674.156,07	0,38%		
CARTEIRA	701.984.982,41	100,00%		

Disponibilidade 3.922

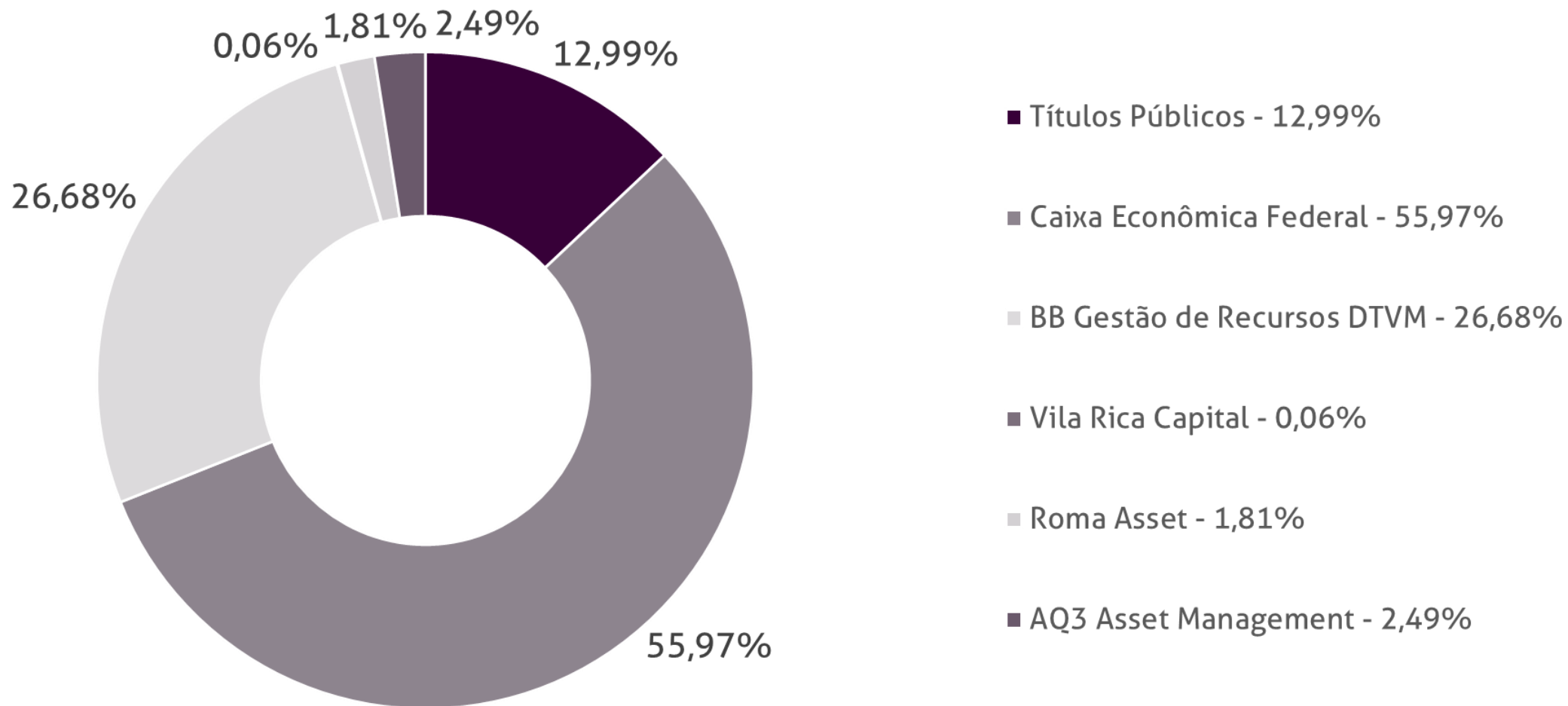


Fundos	CNPJ	Gestão	Taxa de Administração	Benchmark	Resgate
NTN-B IPISM		Títulos Públicos	0,00%	IPCA	-
NTN-F IPISM		Títulos Públicos	0,00%	Selic	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.740.658/0001-93	Caixa Econômica Federal	0,20%	IMA-B	D+0
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.577.519/0001-90	Caixa Econômica Federal	0,20%	IRF-M 1+	D+0
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.740.670/0001-06	Caixa Econômica Federal	0,20%	IRF-M 1	D+0
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.328.882/0001-35	BB Gestão de Recursos DTVM	0,10%	IRF-M 1	D+0
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	07.442.078/0001-05	BB Gestão de Recursos DTVM	0,20%	IMA-B	D+1
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.060.913/0001-10	Caixa Econômica Federal	0,20%	IMA-B 5	D+0
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	14.386.926/0001-71	Caixa Econômica Federal	0,20%	IDKA 2	D+0
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	03.543.447/0001-03	BB Gestão de Recursos DTVM	0,20%	IMA-B 5	D+1
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	07.861.554/0001-22	BB Gestão de Recursos DTVM	0,30%	IMA-B	D+1
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	10.646.895/0001-90	Caixa Econômica Federal	0,20%	IMA-B	D+0
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	14.508.643/0001-55	Caixa Econômica Federal	0,80%	CDI	D+0
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	03.737.206/0001-97	Caixa Econômica Federal	0,20%	CDI	D+0
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.077.418/0001-49	BB Gestão de Recursos DTVM	0,20%	CDI	D+0
BB SUPREMO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	04.288.966/0001-27	BB Gestão de Recursos DTVM	4,00%	CDI	D+0
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	13.990.000/0001-28	Vila Rica Capital	0,39%	CDI + 3,5%	Não se aplica
CONQUEST FIP - FCCQ11	10.625.626/0001-47	Roma Asset	0,30%	IPCA + 8,5%	Não se aplica
ÁQUILLA FII - AQLL11	13.555.918/0001-49	AQ3 Asset Management	1,50%	Não Informado	Não se aplica
FIRENZE FII	14.074.721/0001-50	AQ3 Asset Management	1,50%	Não Informado	Não se aplica

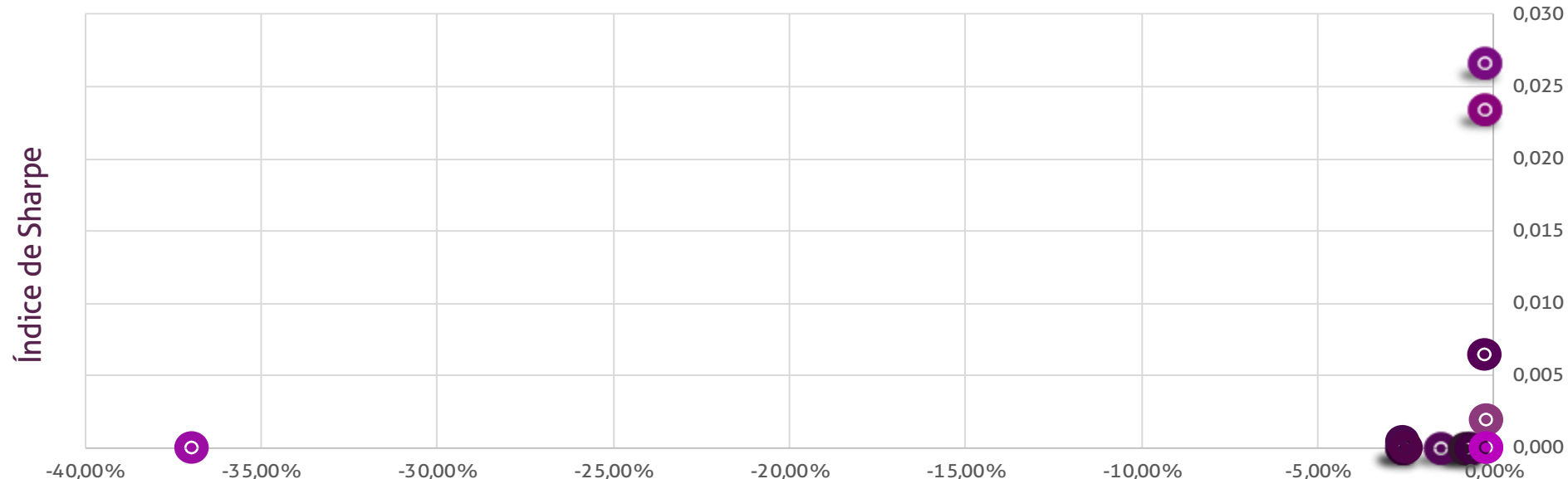
Distribuição por Indicador - Junho - 2017



Distribuição por Instituição - Junho - 2017



Índice de Sharpe e Var



VaR

- CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP
- CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA
- BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO
- CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP
- BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO
- CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA
- BB SUPREMO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO
- CONQUEST FIP - FCCQ11
- FIRENZE FII

- CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP
- BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO
- CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP
- BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP
- CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP
- CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP
- ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR
- ÁQUILLA FII - AQLL11
- BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO



Fundos	2016	12 meses	abr/17	mai/17	jun/17	2017
Renda Fixa						
Art. 7º, I, "a" - Títulos Públicos Federais - SELIC						
NTN-B IPSM	30,28%	30,28%	30,28%	30,28%	30,28%	0,12%
NTN-F IPSM	33,38%	33,38%	33,38%	33,38%	33,38%	2,39%
Art. 7º, I, "b" - FI (100% TPF) - IMA ou IDKA						
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	24,56%	13,17%	-0,34%	-1,19%	0,15%	5,36%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	29,55%	17,98%	0,33%	0,09%	1,49%	8,81%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	14,58%	13,27%	0,86%	0,90%	0,87%	6,15%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	14,58%	13,27%	0,86%	0,90%	0,87%	6,15%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	14,58%	13,27%	0,86%	0,90%	0,87%	6,15%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14,48%	13,17%	0,86%	0,89%	0,87%	6,11%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14,48%	13,17%	0,86%	0,89%	0,87%	6,11%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14,48%	13,17%	0,86%	0,89%	0,87%	6,11%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	24,52%	13,12%	-0,34%	-1,20%	0,15%	5,35%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	15,19%	11,73%	0,70%	0,08%	0,51%	5,40%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	14,94%	12,10%	0,79%	0,41%	0,62%	5,73%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	15,19%	11,73%	0,70%	0,08%	0,51%	5,40%
Art. 7º, II - Compromissadas						
Art. 7º, III, "a" - FI Referenciado RF ou RF - IMA ou IDKA						
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	15,28%	11,74%	0,70%	0,09%	0,51%	5,41%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	15,28%	11,74%	0,70%	0,09%	0,51%	5,41%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	15,28%	11,74%	0,70%	0,09%	0,51%	5,41%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	24,46%	13,47%	-0,35%	-1,24%	0,19%	5,47%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	24,14%	13,21%	-0,53%	-0,96%	0,12%	5,27%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	24,14%	13,21%	-0,53%	-0,96%	0,12%	5,27%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	24,14%	13,21%	-0,53%	-0,96%	0,12%	5,27%
Art. 7º, III, "b" - FI de Índices RF - IMA ou IDKA						

Art. 7º, IV, "a" - FI Referenciado RF ou RF

CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	13,05%	11,94%	0,73%	0,85%	0,74%	5,23%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	14,00%	12,90%	0,79%	0,93%	0,82%	5,70%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	14,00%	12,90%	0,79%	0,93%	0,82%	5,70%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	14,00%	12,90%	0,79%	0,93%	0,82%	5,70%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13,88%	13,04%	0,78%	0,92%	0,81%	5,71%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13,88%	13,04%	0,78%	0,92%	0,81%	5,71%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13,88%	13,04%	0,78%	0,92%	0,81%	5,71%
BB SUPREMO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	9,50%	8,44%	0,50%	0,57%	0,48%	3,59%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	13,05%	11,94%	0,73%	0,85%	0,74%	5,23%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	13,05%	11,94%	0,73%	0,85%	0,74%	5,23%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	13,05%	11,94%	0,73%	0,85%	0,74%	5,23%

Art. 7º, IV, "b" - FI de Índices RF

Art. 7º, V, "a" - Poupança

Art. 7º, V, "b" - LIG - Letras Imobiliárias Garantidas

Art. 7º, VI - FIDC Aberto

Art. 7º, VII, "a" - FIDC Fechado

ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-65,83%	-57,08%	0,87%	1,43%	26,02%	31,68%
-----------------------------------	---------	---------	-------	-------	--------	--------

Art. 7º, VII, "b" - FI Crédito Privado

Renda Variável

Art. 8º, I - FIA Referenciado - IBOV ou IBrX ou IBrX-50

Art. 8º, II - ETF Referenciado - IBOV ou IBrX ou IBrX-50

Art. 8º, III - FIA - Fundo de Ações

Art. 8º, IV - FI Multimercado - FIM

Art. 8º, V - FI em Participações - FIP

CONQUEST FIP - FCCQ11	-1,12%	-19,74%	-18,85%	-0,10%	-0,10%	-19,35%
-----------------------	--------	---------	---------	--------	--------	---------

Art. 8º, VI - FI Imobiliário - FII

ÁQUILLA FII - AQLL11	1,45%	-3,59%	-0,17%	-1,85%	-0,93%	-3,32%
----------------------	-------	--------	--------	--------	--------	--------

FIRENZE FII	-4,34%	0,09%	-0,06%	-4,47%	-0,04%	-3,85%
-------------	--------	-------	--------	--------	--------	--------

Imóveis

Art. 3º - Integralização em Imóveis

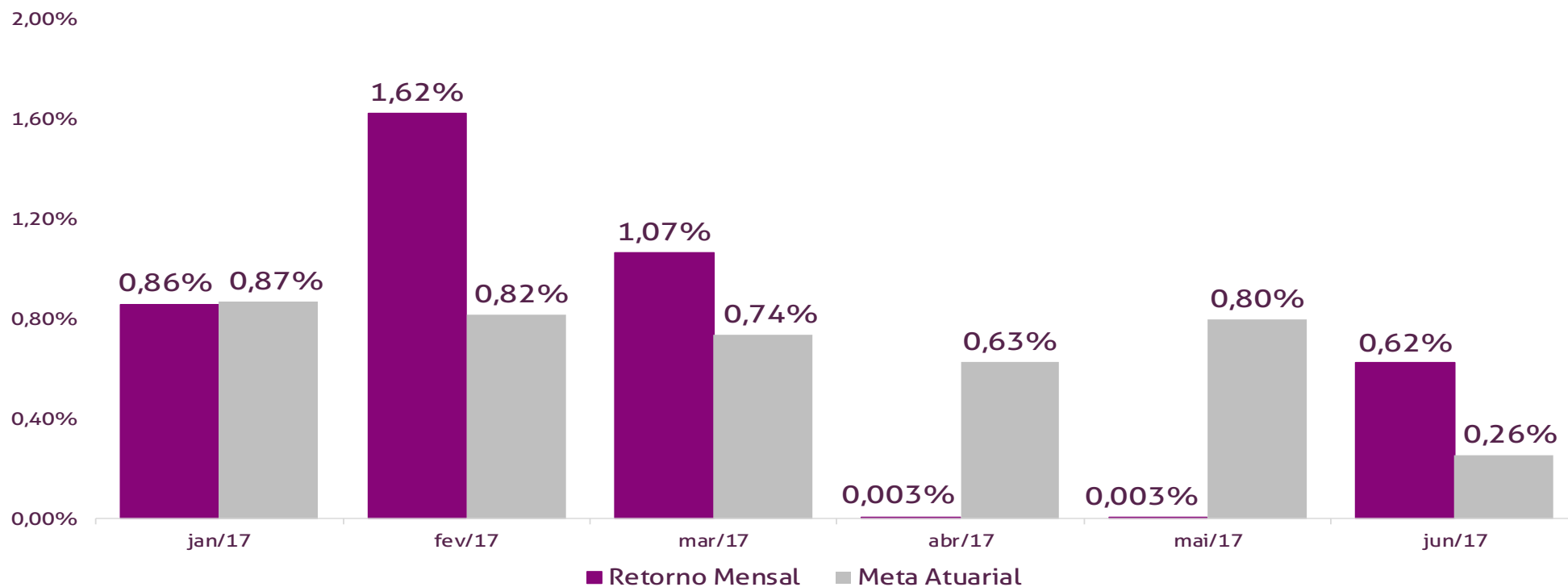
Não Enquadra

Performance Absoluta

	jan-17	fev-17	mar-17	abr-17	mai-17	jun-17
Carteira	0,86%	1,62%	1,07%	0,003%	0,003%	0,62%
Retorno Financeiro	5.174.309,97	10.777.512,71	7.109.609,66	21.209,28	23.627,98	4.333.547,78
Meta Atuarial	0,87%	0,82%	0,74%	0,63%	0,80%	0,26%

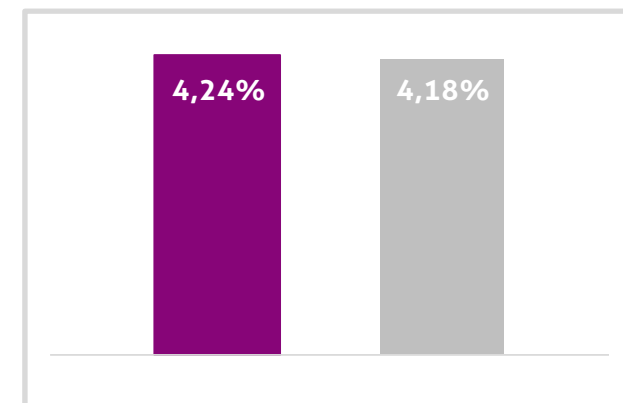
	jul-17	ago-17	set-17	out-17	nov-17	dez-17
Carteira						
Retorno Financeiro						
Meta Atuarial						

Retorno Mensal X Meta Atuarial Mensal



Estatística		
Meses positivos:	6	
Meses negativos:	0	
Meses acima da Meta Atuarial:	3	
Meses abaixo da Meta Atuarial:	3	
Retorno Mensal Máximo	1,62%	fev-17
Retorno Mensal Médio	0,70%	
Retorno Mensal Mínimo	0,003%	abr-17
Sharpe	0,13	
Volatilidade	12,45%	
VaR	-0,99%	
Meta Atuarial	IPCA + 6%	

Consolidado - 2017	
Carteira	4,24%
Retorno	R\$ 27.439.817,38
Meta	4,18%





jan/17

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
NTN-B IPSM		11.477.445,00				325.536,69	2,84%	11.802.981,69
NTN-F IPSM		76.108.499,33			3.672.865,96	-1.536.427,41	-2,02%	74.572.071,92
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	8.108.475,23				149.404,80	1,84%	8.257.880,03
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	1.090.240,93				29.380,30	2,69%	1.119.621,23
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 278-7	362.671,07				4.565,02	1,26%	367.236,09
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 267-1	119.956.819,09				1.509.919,77	1,26%	121.466.738,86
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁR	Ag. 86-8 cc 18272-9	563.567,80				7.100,96	1,26%	570.668,76
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁR	Ag. 86-8 cc 17879-9	2.960.377,80				37.300,81	1,26%	2.997.678,61
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	42.783.020,59				789.045,54	1,84%	43.572.066,13
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 278-7	928.991,84				10.567,94	1,14%	939.559,78
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 267-1	50.779.453,94				540.215,59	1,06%	51.319.669,53
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 281-7	530.852,48				6.038,82	1,14%	536.891,30
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 18272-9	521.839,95				5.937,99	1,14%	527.777,94
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 15852-6	43.799.217,81				498.388,72	1,14%	44.297.606,53
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 17879-9	1.844.334,30				20.986,57	1,14%	1.865.320,87
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	49.321.539,24				932.629,03	1,89%	50.254.168,27
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 281-7	616.159,82				11.634,12	1,89%	627.793,94
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	7.055.348,18				133.216,65	1,89%	7.188.564,83
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 278-7	2.142.293,95				40.450,06	1,89%	2.182.744,01
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 269-8	464.404,74		-195.345,46		4.361,09	1,62%	273.420,37
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 267-1	108.345.364,65				1.164.015,91	1,07%	109.509.380,56
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 278-7	2.066.203,71				22.198,40	1,07%	2.088.402,11
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 281-7	538.991,14				5.790,69	1,07%	544.781,83
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	33.985.777,11				373.114,60	1,10%	34.358.891,71
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 17879-9	871.935,28				9.572,58	1,10%	881.507,86
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 18272-9	281.713,70				3.092,81	1,10%	284.806,51
BB SUPREMO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	Ag. 86-8 cc 18961-8	90.814,03				661,84	0,73%	91.475,87
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR		377.980,53			3.516,63	907,23	0,24%	375.371,13
CONQUEST FIP - FCCQ11		15.700.656,17				-17.720,42	-0,11%	15.682.935,75
ÁQUILLA FII - AQLL11		6.539.263,25				-821,59	-0,01%	6.538.441,66
FIRENZE FII		11.523.739,89				93.244,86	0,81%	11.616.984,75
Aplicações		601.737.992,55						606.713.440,43
Imóveis		0,00						0,00
Conta Corrente		2.328.124,50						42.867.279,09
Caixa 267-1		221.776,52						6.340.246,58
Caixa 278-7		0,00						97.996,42
Caixa 281-7		0,00						0,00
Banco do Brasil 17160-3		0,00						37.314,95
Banco do Brasil 15853-4		0,00						0,00
Banco do Brasil 15854-2		158,73						3.645,23
Banco do Brasil 15852-6		0,00						23.407,33
Banco do Brasil 17879-9		0,00						0,00
Banco do Brasil 18272-9		0,00						0,00
Banco do Brasil 18961-8		0,00						0,00
Caixa 271-0		704.793,81						690.373,66
Caixa 269-8		0,00						0,00
Caixa 266-3		1.401.344,30						35.674.243,78
Caixa 538-7		51,14						51,14
Final		604.066.117,05	0,00	-195.345,46	3.676.382,59	5.174.309,97	0,86%	649.580.719,52



fev/17

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
NTN-B IPSM		11.802.981,69				774.353,51	6,56%	12.577.335,20
NTN-F IPSM		74.572.071,92				1.759.079,14	2,36%	76.331.151,06
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	8.257.880,03	6.466.426,57			310.181,38	2,11%	15.034.487,98
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	1.119.621,23				26.851,33	2,40%	1.146.472,56
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 278-7	367.236,09	413.886,69			3.816,45	0,49%	784.939,23
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 267-1	121.466.738,86				1.207.815,69	0,99%	122.674.554,55
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 281-7	0,00	330.941,08			131,78	0,04%	331.072,86
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁR	Ag. 86-8 cc 18272-9	570.668,76				5.632,18	0,99%	576.300,94
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁR	Ag. 86-8 cc 17879-9	2.997.678,61				29.585,40	0,99%	3.027.264,01
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	43.572.066,13				1.675.991,80	3,85%	45.248.057,93
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 278-7	939.559,78				13.883,33	1,48%	953.443,11
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 267-1	51.319.669,53	6.466.426,57			670.937,12	1,16%	58.457.033,22
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 281-7	536.891,30				7.933,33	1,48%	544.824,63
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 18272-9	527.777,94				7.800,50	1,48%	535.578,44
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 15852-6	44.297.606,53				654.713,79	1,48%	44.952.320,32
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 17879-9	1.865.320,87				27.569,24	1,48%	1.892.890,11
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	50.254.168,27				1.953.888,10	3,89%	52.208.056,37
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 281-7	627.793,94				23.707,33	3,78%	651.501,27
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	7.188.564,83				271.461,18	3,78%	7.460.026,01
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 278-7	2.182.744,01				82.426,78	3,78%	2.265.170,79
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 269-8	273.420,37	947.851,78	-637.902,47		1.101,12	0,19%	584.470,80
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 267-1	109.509.380,56				964.127,01	0,88%	110.473.507,57
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 278-7	2088402,11				18.386,43	0,88%	2.106.788,54
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 281-7	544.781,83				4.796,29	0,88%	549.578,12
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	34.358.891,71				306.344,13	0,89%	34.665.235,84
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 17879-9	881.507,86				7.859,53	0,89%	889.367,39
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 18272-9	284.806,51				2.539,34	0,89%	287.345,85
BB SUPREMO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	Ag. 86-8 cc 18961-8	91.475,87				526,38	0,58%	92.002,25
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR		375.371,13			10.585,47	3.925,97	1,05%	368.711,63
CONQUEST FIP - FCCQ11		15.682.935,75				-26.383,09	-0,17%	15.656.552,66
ÁQUILLA FII - AQLL11		6.538.441,66				-10.838,17	-0,17%	6.527.603,49
FIRENZE FII		11.616.984,75				-2.631,59	-0,02%	11.614.353,16
Aplicações		606.713.440,43						631.467.997,89
Imóveis		0,00						0,00
Conta Corrente		42.867.279,09						9.514.476,09
Caixa 267-1		6.340.246,58						3.077.657,66
Caixa 278-7		97.996,42						0,00
Caixa 281-7		0,00						0,00
Banco do Brasil 17160-3		37.314,95						37.314,95
Banco do Brasil 15854-2		3.645,23						10.420,74
Banco do Brasil 15852-6		23.407,33						54.819,59
Banco do Brasil 17879-9		0,00						0,00
Banco do Brasil 18272-9		0,00						0,00
Banco do Brasil 18961-8		0,00						0,00
Caixa 271-0		690.373,66						2.208.389,82
Caixa 269-8		0,00						0,00
Caixa 266-3		35.674.243,78						3.956.833,65
Caixa 538-7		51,14						169.039,68
FINAL		649.580.719,52	14.625.532,69	-637.902,47	10.585,47	10.777.512,71	1,62%	640.982.473,98

mar/17

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
NTN-B IPISM		12.577.335,20				49.367,18	0,39%	12.626.702,38
NTN-F IPISM		76.331.151,06				1.229.854,47	1,61%	77.561.005,53
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	15.034.487,98	5.150.000,00			166.454,21	0,82%	20.350.942,19
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	1.146.472,56				17.428,62	1,52%	1.163.901,18
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 278-7	784.939,23	355.193,38			10.023,37	0,88%	1.150.155,98
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 267-1	122.674.554,55	2.145.000,00			1.367.859,31	1,10%	126.187.413,86
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 281-7	331.072,86	329.637,02			4.877,11	0,74%	665.586,99
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 18272-9	576.300,94				6.344,80	1,10%	582.645,74
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 17879-9	3.027.264,01				33.328,75	1,10%	3.060.592,76
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	45.248.057,93	68.147,27			461.447,87	1,02%	45.777.653,07
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 278-7	953.443,11				13.131,77	1,38%	966.574,88
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 267-1	58.457.033,22	5.150.000,00			844.834,30	1,33%	64.451.867,52
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 281-7	544.824,63				7.503,87	1,38%	552.328,50
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 18272-9	535.578,44				7.395,75	1,38%	542.974,19
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 15852-6	44.952.320,32				620.741,93	1,38%	45.573.062,25
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 17879-9	1.892.890,11				26.138,72	1,38%	1.919.028,83
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	52.208.056,37				545.861,91	1,05%	52.753.918,28
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 281-7	651.501,27				6.184,52	0,95%	657.685,79
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	7.460.026,01				70.815,96	0,95%	7.530.841,97
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 278-7	2.265.170,79				21.502,64	0,95%	2.286.673,43
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 269-8	584.470,80	590.000,00	-654.383,76		4.094,38	0,79%	524.181,42
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 267-1	110.473.507,57				1.180.209,27	1,07%	111.653.716,84
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 278-7	2106788,54				22.507,20	1,07%	2.129.295,74
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 281-7	549.578,12				5.871,25	1,07%	555.449,37
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	34.665.235,84				369.734,77	1,07%	35.034.970,61
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 17879-9	889.367,39				9.485,88	1,07%	898.853,27
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 18272-9	287.345,85				3.064,79	1,07%	290.410,64
BB SUPREMO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	Ag. 86-8 cc 18961-8	92.002,25				629,95	0,68%	92.632,20
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 271-0	0,00	2.471.327,72	-1.642.678,04		5.914,07	0,71%	834.563,75
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 538-7	0,00	325.159,52			960,56	0,30%	326.120,08
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 266-3	0,00	10.900.000,00			32.199,90	0,30%	10.932.199,90
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR		368.711,63			13.327,68	2.857,79	0,78%	358.241,74
CONQUEST FIP - FCCQ11		15.656.552,66				-20.465,38	-0,13%	15.636.087,28
ÁQUILLA FII - AQLL11		6.527.603,49				-14.495,52	-0,22%	6.513.107,97
FIRENZE FII		11.614.353,16				-4.056,31	-0,03%	11.610.296,85
Aplicações		631.467.997,89						663.751.682,98
Imóveis		0,00						0,00
Conta Corrente		9.514.476,09						8.219.923,35
Caixa 267-1		3.077.657,66						2.529.034,63
Caixa 278-7		0,00						0,00
Caixa 281-7		0,00						0,00
Banco do Brasil 17160-3		37.314,95						0,00
Banco do Brasil 15854-2		10.420,74						7.076,25
Banco do Brasil 15852-6		54.819,59						19.549,24
Banco do Brasil 17879-9		0,00						0,00
Banco do Brasil 18272-9		0,00						0,00
Banco do Brasil 18961-8		0,00						0,00
Caixa 271-0		2.208.389,82						53.156,66
Caixa 269-8		0,00						0,00
Caixa 266-3		3.956.833,65						5.460.095,91
Caixa 538-7		169.039,68						151.010,66
FINAL		640.982.473,98	27.484.464,91	-2.297.061,80	13.327,68	7.109.609,66	1,07%	671.971.606,33

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
NTN-B IPSM		12.626.702,38				-189.558,32	-1,50%	12.437.144,06
NTN-F IPSM		77.561.005,53				333.196,46	0,43%	77.894.201,99
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	20.350.942,19				-69.414,04	-0,34%	20.281.528,15
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	1.163.901,18				3.890,93	0,33%	1.167.792,11
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 278-7	1.150.155,98	336.218,94			11.295,52	0,76%	1.497.670,44
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 267-1	126.187.413,86	6.237.563,30			1.110.372,78	0,84%	133.535.349,94
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 281-7	665.586,99	155.803,95			6.069,97	0,74%	827.460,91
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁR	Ag. 86-8 cc 18272-9	582.645,74				4.988,31	0,86%	587.634,05
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁR	Ag. 86-8 cc 17879-9	3.060.592,76				26.203,20	0,86%	3.086.795,96
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	45.777.653,07				-157.660,59	-0,34%	45.619.992,48
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 278-7	966.574,88				6.731,25	0,70%	973.306,13
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 267-1	64.451.867,52	4.775.163,29			525.454,02	0,76%	69.752.484,83
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 281-7	552.328,50				3.846,43	0,70%	556.174,93
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 18272-9	542.974,19				3.793,07	0,70%	546.767,26
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 15852-6	45.573.062,25				318.361,31	0,70%	45.891.423,56
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 17879-9	1.919.028,83				13.405,83	0,70%	1.932.434,66
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	52.753.918,28				-183.285,06	-0,35%	52.570.633,22
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 281-7	657.685,79				-3.466,82	-0,53%	654.218,97
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	7.530.841,97				-39.696,90	-0,53%	7.491.145,07
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 278-7	2.286.673,43				-12.053,61	-0,53%	2.274.619,82
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 269-8	524.181,42	412.567,15	-578.241,17		2.793,70	0,78%	361.301,10
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 267-1	111.653.716,84		-250.000,00		885.395,08	0,79%	112.289.111,92
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 278-7	2129295,74				16.884,97	0,79%	2.146.180,71
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 281-7	555.449,37				4.404,62	0,79%	559.853,99
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	35.034.970,61				274.234,73	0,78%	35.309.205,34
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 17879-9	898.853,27				7.035,73	0,78%	905.889,00
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 18272-9	290.410,64				2.273,18	0,78%	292.683,82
BB SUPREMO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	Ag. 86-8 cc 18961-8	92.632,20				4.62,13	0,50%	93.094,33
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 271-0	834.563,75	144.035,85			6.583,05	0,67%	985.182,65
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 538-7	326.120,08	149.855,40			2.897,89	0,61%	478.873,37
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 266-3	10.932.199,90	2.965.437,93	-2.618.682,56		68.665,45	0,61%	11.347.620,72
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR		358.241,74			15.611,83	2.994,55	0,84%	345.624,46
CONQUEST FIP - FCCQ11		15.636.087,28				-2.947.684,92	-18,85%	12.688.402,36
ÁQUILLA FII - AQLL11		6.513.107,97				-11.261,91	-0,17%	6.501.846,06
FIRENZE FII		11.610.296,85				-6.942,71	-0,06%	11.603.354,14
Aplicações		663.751.682,98						675.487.002,51
Imóveis		0,00						0,00
Conta Corrente		8.219.923,35						2.400.070,91
Caixa 267-1		2.529.034,63						553.006,14
Caixa 278-7		0,00						0,00
Caixa 281-7		0,00						0,00
Banco do Brasil 17160-3		0,00						0,00
Banco do Brasil 15854-2		7.076,25						4.701,25
Banco do Brasil 15852-6		19.549,24						56.319,76
Banco do Brasil 17879-9		0,00						0,00
Banco do Brasil 18272-9		0,00						0,00
Banco do Brasil 18961-8		0,00						0,00
Caixa 271-0		53.156,66						322.070,67
Caixa 269-8		0,00						0,00
Caixa 266-3		5.460.095,91						1.314.355,39
Caixa 538-7		151.010,66						149.617,70
FINAL		671.971.606,33	15.176.645,81	-3.446.923,73	15.611,83	21.209,28	0,003%	677.887.073,42



maí/17

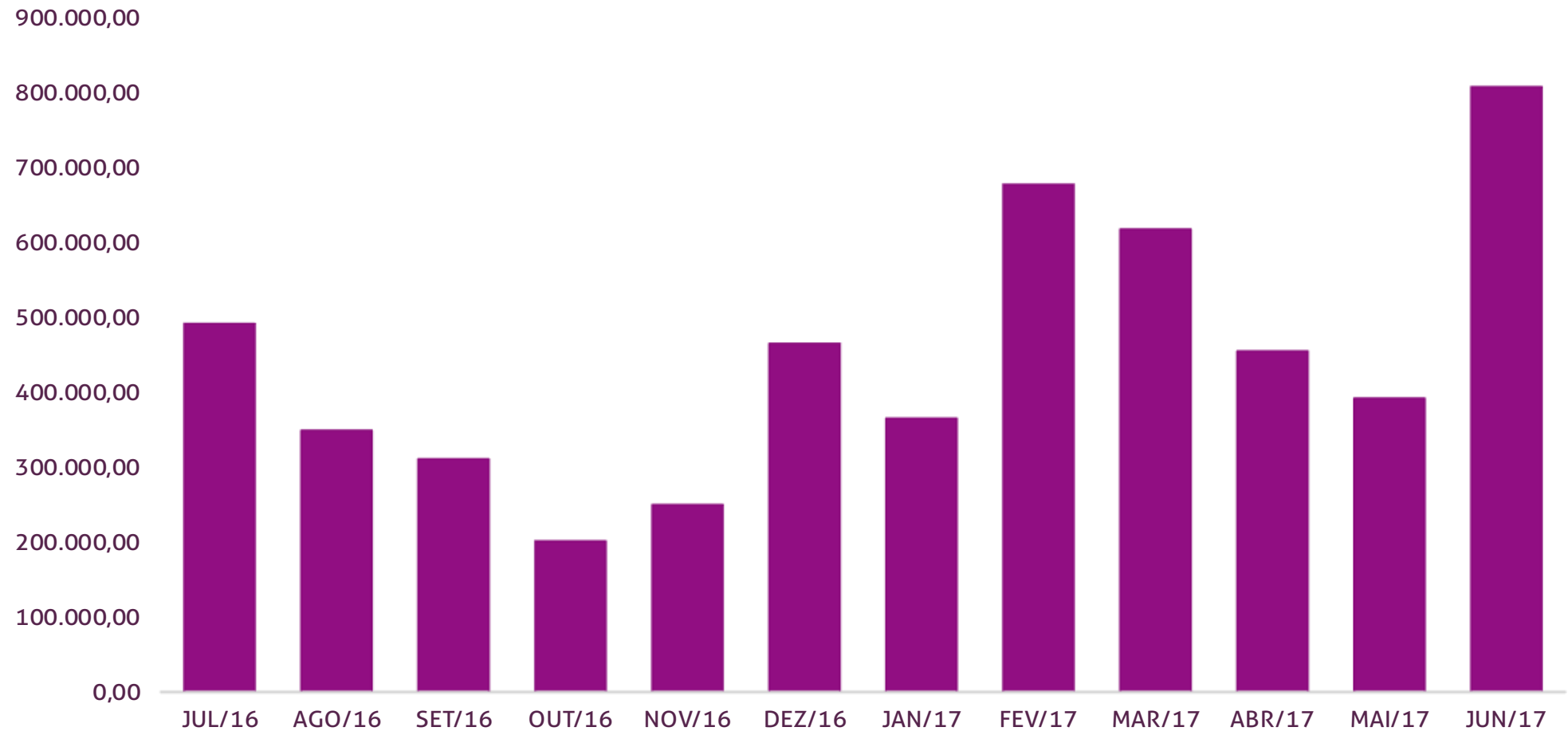
Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
NTN-B IPISM		12.437.144,06			329.756,97	-946.604,79	-7,61%	11.820.296,24
NTN-F IPISM		77.894.201,99				27.567,84	0,04%	77.921.769,83
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	20.281.528,15				-241.918,73	-1,19%	20.039.609,42
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	1.167.792,11				1.097,96	0,09%	1.168.890,07
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 278-7	1.497.670,44	387.859,02			14.396,07	0,76%	1.899.925,53
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 267-1	133.535.349,94	13.000.000,00			1.238.600,41	0,85%	147.773.950,35
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 281-7	827.460,91	524.755,76			9.145,37	0,68%	1.361.362,04
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁR	Ag. 86-8 cc 18272-9	587.634,05				5.211,94	0,89%	592.845,99
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁR	Ag. 86-8 cc 17879-9	3.086.795,96				27.377,94	0,89%	3.114.173,90
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	45.619.992,48				-546.160,64	-1,20%	45.073.831,84
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 278-7	973.306,13				824,43	0,08%	974.130,56
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 267-1	69.752.484,83				288.338,83	0,41%	70.040.823,66
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 281-7	556.174,93				471,10	0,08%	556.646,03
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 18272-9	546.767,26				502,09	0,09%	547.269,35
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 15852-6	45.891.423,56				42.141,63	0,09%	45.933.565,19
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 17879-9	1.932.434,66				1.774,53	0,09%	1.934.209,19
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	52.570.633,22				-650.598,87	-1,24%	51.920.034,35
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 281-7	654.218,97				-6.312,30	-0,96%	647.906,67
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	7.491.145,07				-72.279,10	-0,96%	7.418.865,97
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 278-7	2.274.619,82				-21.946,91	-0,96%	2.252.672,91
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 269-8	361.301,10	400.000,00	-465.096,83		1.785,72	0,60%	297.989,99
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 267-1	112.289.111,92		-500.000,00		1.043.287,43	0,93%	112.832.399,35
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 278-7	2146180,71				20.001,05	0,93%	2.166.181,76
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 281-7	559.853,99				5.217,48	0,93%	565.071,47
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	35.309.205,34	71.000,00			325.873,58	0,92%	35.706.078,92
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 17879-9	905.889,00				8.355,14	0,92%	914.244,14
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 18272-9	292.683,82				2.699,46	0,92%	295.383,28
BB SUPREMO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	Ag. 86-8 cc 18961-8	93.094,33				532,32	0,57%	93.626,65
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 271-0	985.182,65	130.728,48			8.903,00	0,80%	1.124.814,13
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 538-7	478.873,37	148.462,44			4.655,89	0,74%	631.991,70
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 266-3	11.347.620,72	9.400.000,00	-7.772.724,14		77.610,83	0,60%	13.052.507,41
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR		345.624,46			14.764,46	4.749,09	1,37%	335.609,09
CONQUEST FIP - FCCQ11		12.688.402,36				-13.089,44	-0,10%	12.675.312,92
ÁQUILLA FII - AQLL11		6.501.846,06				-120.167,54	-1,85%	6.381.678,52
FIRENZE FII		11.603.354,14				-518.414,83	-4,47%	11.084.939,31
Aplicações		675.487.002,51						691.150.607,73
Imóveis		0,00						0,00
Conta Corrente		2.400.070,91						854.923,53
Caixa 267-1		553.006,14						218.988,45
Caixa 278-7		0,00						14.058,19
Caixa 281-7		0,00						0,00
Banco do Brasil 17160-3		0,00						0,00
Banco do Brasil 15854-2		4.701,25						6.908,89
Banco do Brasil 15852-6		56.319,76						19.465,96
Banco do Brasil 17879-9		0,00						0,00
Banco do Brasil 18272-9		0,00						0,00
Banco do Brasil 18961-8		0,00						0,00
Caixa 271-0		322.070,67						302.127,10
Caixa 269-8		0,00						0,00
Caixa 266-3		1.314.355,39						137.562,13
Caixa 538-7		149.617,70						155.812,81
FINAL		677.887.073,42	24.062.805,70	-8.737.820,97	344.521,43	23.627,98	0,003%	692.005.531,26

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
NTN-B IPSM		11.820.296,24				-63.839,03	-0,54%	11.756.457,21
NTN-F IPSM		77.921.769,83				1.130.911,63	1,45%	79.052.681,46
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	20.039.609,42		-10.000.000,00		-13.555,50	-0,14%	10.026.053,92
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	1.168.890,07				17.402,22	1,49%	1.186.292,29
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 278-7	1.899.925,53	2.099.953,54			20.256,00	0,51%	4.020.135,07
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 267-1	147.773.950,35	50.500.000,00			1.364.499,99	0,69%	199.638.450,34
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 281-7	1.361.362,04	600.000,00			12.507,27	0,64%	1.973.869,31
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRI	Ag. 86-8 cc 18272-9	592.845,99	300.000,00			5.520,60	0,62%	898.366,59
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRI	Ag. 86-8 cc 17879-9	3.114.173,90	2.400.000,00	-1.200.000,00		28.516,31	0,66%	4.342.690,21
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRI	Ag. 86-8 cc 15852-6	0,00	100.000.000,00			128.487,77	0,13%	100.128.487,77
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRI	Ag. 86-8 cc 15852-6	45.073.831,84		-25.000.000,00		-42.524,22	-0,21%	20.031.307,62
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 278-7	974.130,56		-450.000,00		3.737,53	0,71%	527.868,09
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 267-1	70.040.823,66		-30.500.000,00		344.496,53	0,87%	39.885.320,19
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 281-7	556.646,03		-250.000,00		2.155,57	0,70%	308.801,60
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 18272-9	547.269,35		-300.000,00		1.947,99	0,79%	249.217,34
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 15852-6	45.933.565,19		-30.000.000,00		150.067,75	0,94%	16.083.632,94
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 17879-9	1.934.209,19		-1.200.000,00		6.495,47	0,88%	740.704,66
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	51.920.034,35		-45.000.000,00		-97.935,18	-1,42%	6.822.099,17
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 281-7	647.906,67		-350.000,00		-654,57	-0,22%	297.252,10
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	7.418.865,97		-4.100.000,00		-11.852,01	-0,36%	3.307.013,96
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 278-7	2.252.672,91		-1.300.000,00		-2.609,31	-0,27%	950.063,60
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 269-8	297.989,99	200.000,00	-279.930,64		1.231,72	0,56%	219.291,07
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 267-1	112.832.399,35				930.201,30	0,82%	113.762.600,65
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 278-7	2166181,76				17.858,21	0,82%	2.184.039,97
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 281-7	565.071,47				4.658,51	0,82%	569.729,98
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	35.706.078,92				290.584,92	0,81%	35.996.663,84
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 17879-9	914.244,14				7.440,35	0,81%	921.684,49
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 18272-9	295.383,28				2.403,90	0,81%	297.787,18
BB SUPREMO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	Ag. 86-8 cc 18961-8	93.626,65				445,00	0,48%	94.071,65
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 271-0	1.124.814,13	243.723,34			9.277,63	0,68%	1.377.815,10
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 538-7	631.991,70	154.657,55			5.281,13	0,67%	791.930,38
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 266-3	13.052.507,41	5.400.000,00	-8.128.948,12		69.290,45	0,67%	10.392.849,74
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR		335.609,09			12.784,84	87.289,30	26,01%	410.113,55
CONQUEST FIP - FCCQ11		12.675.312,92				-12.460,29	-0,10%	12.662.852,63
ÁQUILLA FII - AQLL11		6.381.678,52				-59.404,53	-0,93%	6.322.273,99
FIRENZE FII		11.084.939,31				-4.582,63	-0,04%	11.080.356,68
Aplicações		691.150.607,73						699.310.826,34
Imóveis		0,00						0,00
Conta Corrente		854.923,53						2.674.156,07
Caixa 267-1		218.988,45						348.955,33
Caixa 278-7		14.058,19						5.864,35
Caixa 281-7		0,00						0,00
Banco do Brasil 17160-3		0,00						0,00
Banco do Brasil 15854-2		6.908,89						5.165,39
Banco do Brasil 15852-6		19.465,96						51.076,57
Banco do Brasil 17879-9		0,00						0,00
Banco do Brasil 18272-9		0,00						0,00
Banco do Brasil 18961-8		0,00						0,00
Caixa 271-0		302.127,10						421.413,39
Caixa 269-8		0,00						493.172,46
Caixa 266-3		137.562,13						1.187.994,57
Caixa 538-7		155.812,81						160.514,01
FINAL		692.005.531,26	161.898.334,43	-158.058.878,76	12.784,84	4.333.547,78	0,62%	701.984.982,41

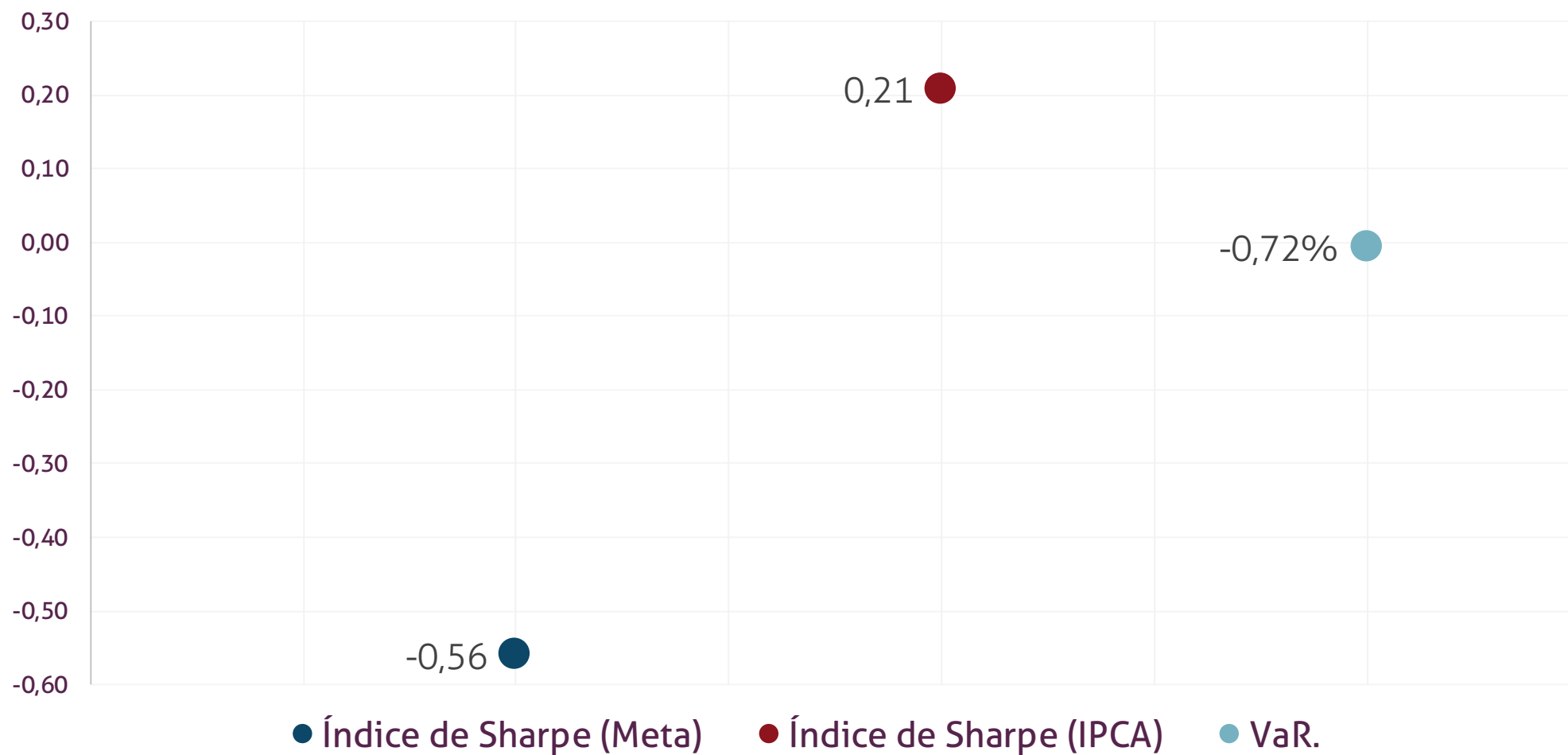


Evolução Patrimônio Líquido - Fundo Administrativo

Jan	R\$	364.896,24	Fev	R\$	676.473,05	Mar	R\$	616.813,62	Abr	R\$	454.395,43
Mai	R\$	391.616,64	Jun	R\$	806.535,18	Jul			Ago		
Set			Out			Nov			Dez		



Índice de Sharpe e Var da Carteira

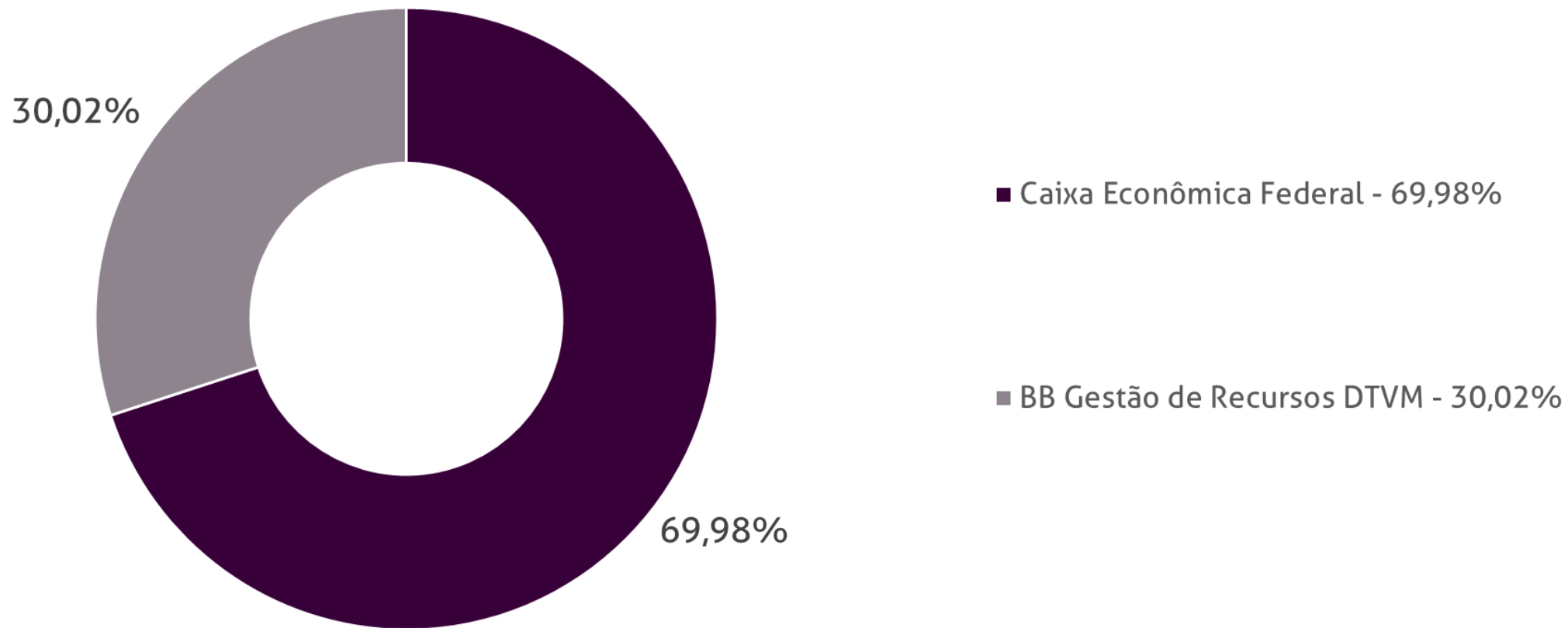


Fundos	CNPJ	Gestão	Taxa de Administração	Benchmark	Resgate
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	14.508.643/0001-55	Caixa Econômica Federal	0,80%	CDI	D+0
BB SUPREMO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	04.288.966/0001-27	BB Gestão de Recursos DTVM	4,00%	CDI	D+0

Distribuição por Indicador - Junho - 2017



Distribuição por Instituição - Junho - 2017

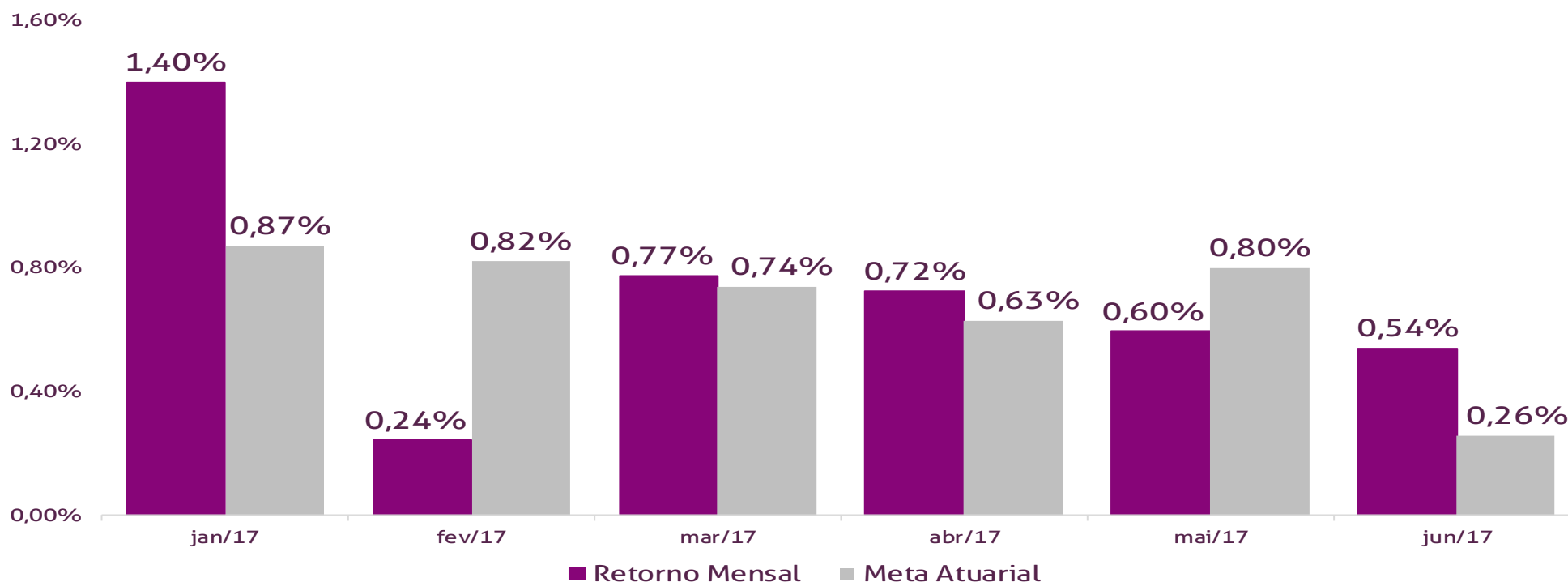


Performance Absoluta

	jan-17	fev-17	mar-17	abr-17	mai-17	jun-17
Carteira	1,40%	0,24%	0,77%	0,72%	0,60%	0,54%
Retorno Financeiro	5.022,93	1.627,50	4.724,33	3.255,83	2.318,04	1.676,72
Meta Atuarial	0,87%	0,82%	0,74%	0,63%	0,80%	0,26%

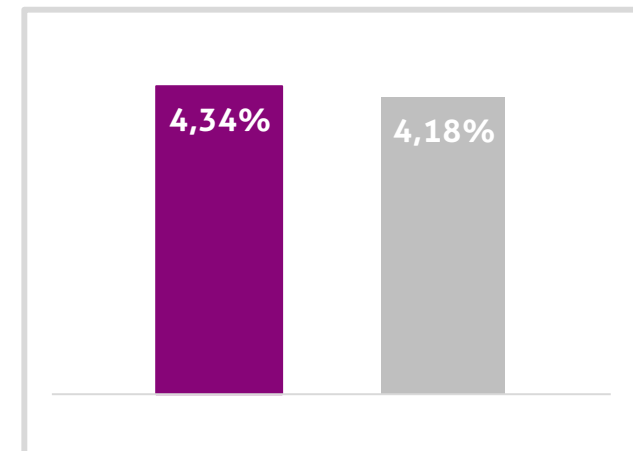
	jul-17	ago-17	set-17	out-17	nov-17	dez-17
Carteira						
Retorno Financeiro						
Meta Atuarial						

Retorno Mensal X Meta Atuarial Mensal



Estatística		
Meses positivos:	6	
Meses negativos:	0	
Meses acima da Meta Atuarial:	4	
Meses abaixo da Meta Atuarial:	2	
Retorno Mensal Máximo	1,40%	jan-17
Retorno Mensal Médio	0,71%	
Retorno Mensal Mínimo	0,24%	fev-17
Sharpe	-0,56	
Volatilidade	8,05%	
VaR	-0,72%	
Meta Atuarial	IPCA + 6%	

Consolidado - 2017	
Carteira	4,34%
Retorno	R\$ 18.625,35
Meta	4,18%





jan/17

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 269-8	464.404,74		-195.345,46		4.361,09	1,62%	273.420,37
BB SUPREMO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRA	Ag. 86-8 cc 18961-8	90.814,03				661,84	0,73%	91.475,87
Aplicações		555.218,77						364.896,24
Imóveis		0,00						0,00
Conta Corrente		0,00						0,00
Banco do Brasil 15853-4		0,00						0,00
Banco do Brasil 18961-8		0,00						0,00
Caixa 269-8		0,00						0,00
Final		555.218,77	0,00	-195.345,46	0,00	5.022,93	1,40%	364.896,24

fev/17

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 269-8	273.420,37	947.851,78	-637.902,47		1.101,12	0,19%	584.470,80
BB SUPREMO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRA	Ag. 86-8 cc 18961-8	91.475,87				526,38	0,58%	92.002,25
Aplicações		364.896,24						676.473,05
Imóveis		0,00						0,00
Conta Corrente		0,00						0,00
Banco do Brasil 18961-8		0,00						0,00
Caixa 269-8		0,00						0,00
FINAL		364.896,24	947.851,78	-637.902,47	0,00	1.627,50	0,24%	676.473,05

mar/17

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 269-8	584.470,80	590.000,00	-654.383,76		4.094,38	0,79%	524.181,42
BB SUPREMO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRA	Ag. 86-8 cc 18961-8	92.002,25				629,95	0,68%	92.632,20
Aplicações		676.473,05						616.813,62
Imóveis		0,00						0,00
Conta Corrente		0,00						0,00
Banco do Brasil 18961-8		0,00						0,00
Caixa 269-8		0,00						0,00
FINAL		676.473,05	590.000,00	-654.383,76	0,00	4.724,33	0,77%	616.813,62



abr/17

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 269-8	524.181,42	412.567,15	-578.241,17		2.793,70	0,78%	361.301,10
BB SUPREMO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRA	Ag. 86-8 cc 18961-8	92.632,20				462,13	0,50%	93.094,33
Aplicações		616.813,62						454.395,43
Imóveis		0,00						0,00
Conta Corrente		0,00						0,00
Banco do Brasil 18961-8		0,00						0,00
Caixa 269-8		0,00						0,00
FINAL		616.813,62	412.567,15	-578.241,17	0,00	3.255,83	0,72%	454.395,43

mai/17

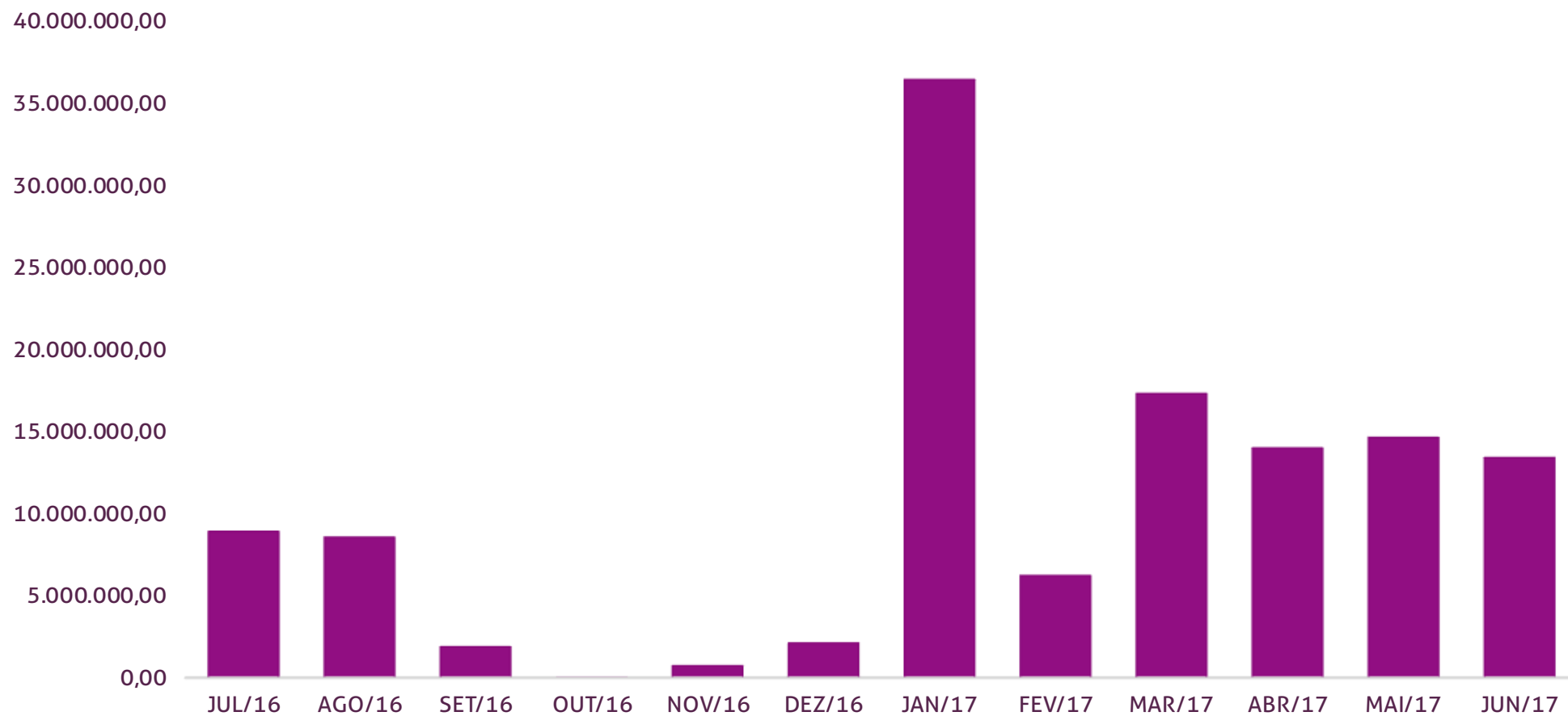
Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 269-8	361.301,10	400.000,00	-465.096,83		1.785,72	0,60%	297.989,99
BB SUPREMO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRA	Ag. 86-8 cc 18961-8	93.094,33				532,32	0,57%	93.626,65
Aplicações		454.395,43						391.616,64
Imóveis		0,00						0,00
Conta Corrente		0,00						0,00
Banco do Brasil 18961-8		0,00						0,00
Caixa 269-8		0,00						0,00
FINAL		454.395,43	400.000,00	-465.096,83	0,00	2.318,04	0,60%	391.616,64

jun/17

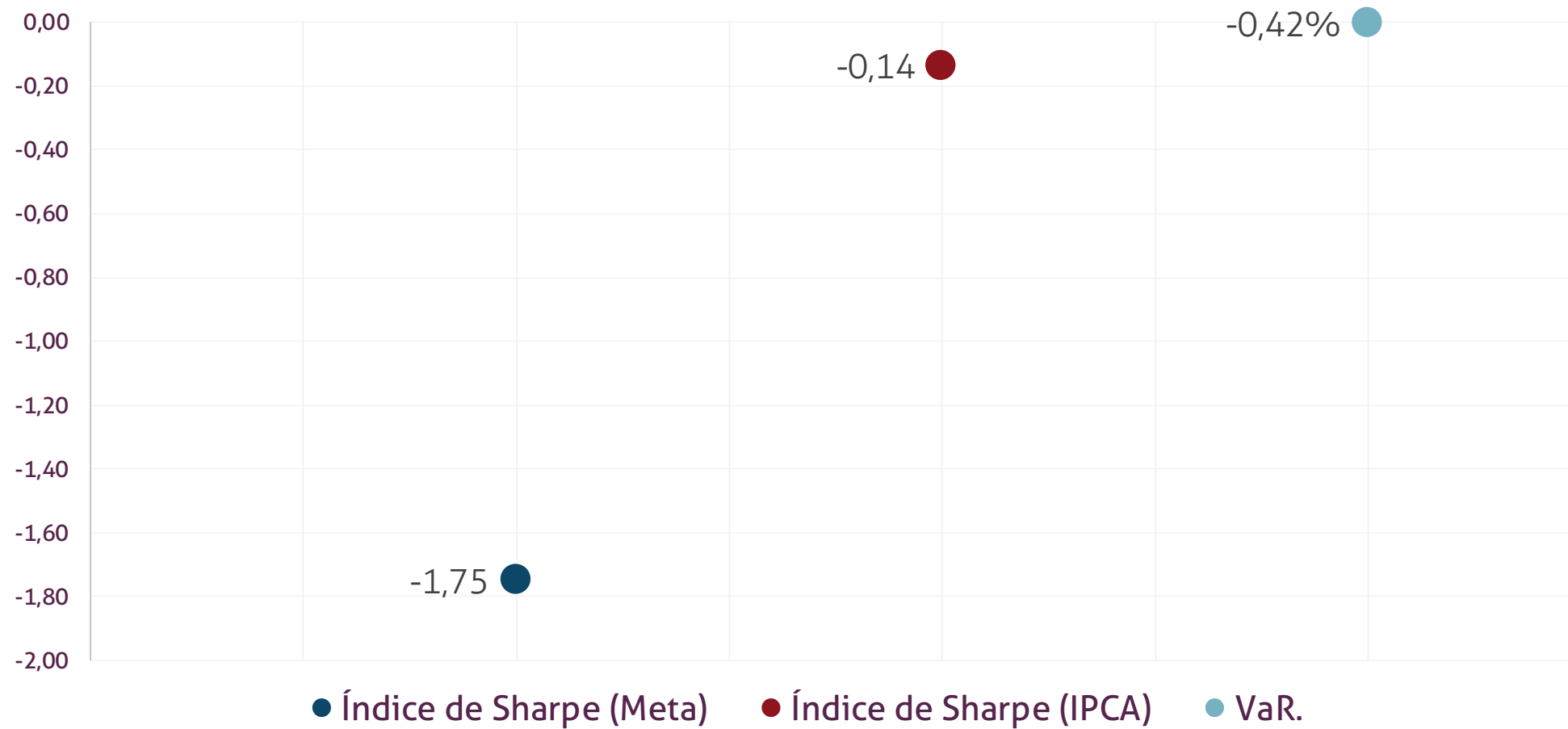
Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 269-8	297.989,99	200.000,00	-279.930,64		1.231,72	0,56%	219.291,07
BB SUPREMO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRA	Ag. 86-8 cc 18961-8	93.626,65				445,00	0,48%	94.071,65
Aplicações		391.616,64						313.362,72
Imóveis		0,00						0,00
Conta Corrente		0,00						493.172,46
Banco do Brasil 18961-8		0,00						0,00
Caixa 269-8		0,00						493.172,46
FINAL		391.616,64	200.000,00	-279.930,64	0,00	1.676,72	0,54%	806.535,18

Evolução Patrimônio Líquido - Fundo I

Jan	R\$ 36.405.577,62	Fev	R\$ 6.212.959,16	Mar	R\$ 17.287.092,47	Abr	R\$ 13.973.930,68
Mai	R\$ 14.623.919,66	Jun	R\$ 13.385.238,19	Jul		Ago	
Set		Out		Nov		Dez	



Índice de Sharpe e Var da Carteira



Fundos	CNPJ	Gestão	Taxa de Administração	Benchmark
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	14.508.643/0001-55	Caixa Econômica Federal	0,80%	CDI

Distribuição por Indicador - Junho - 2017



Distribuição por Instituição - Junho - 2017



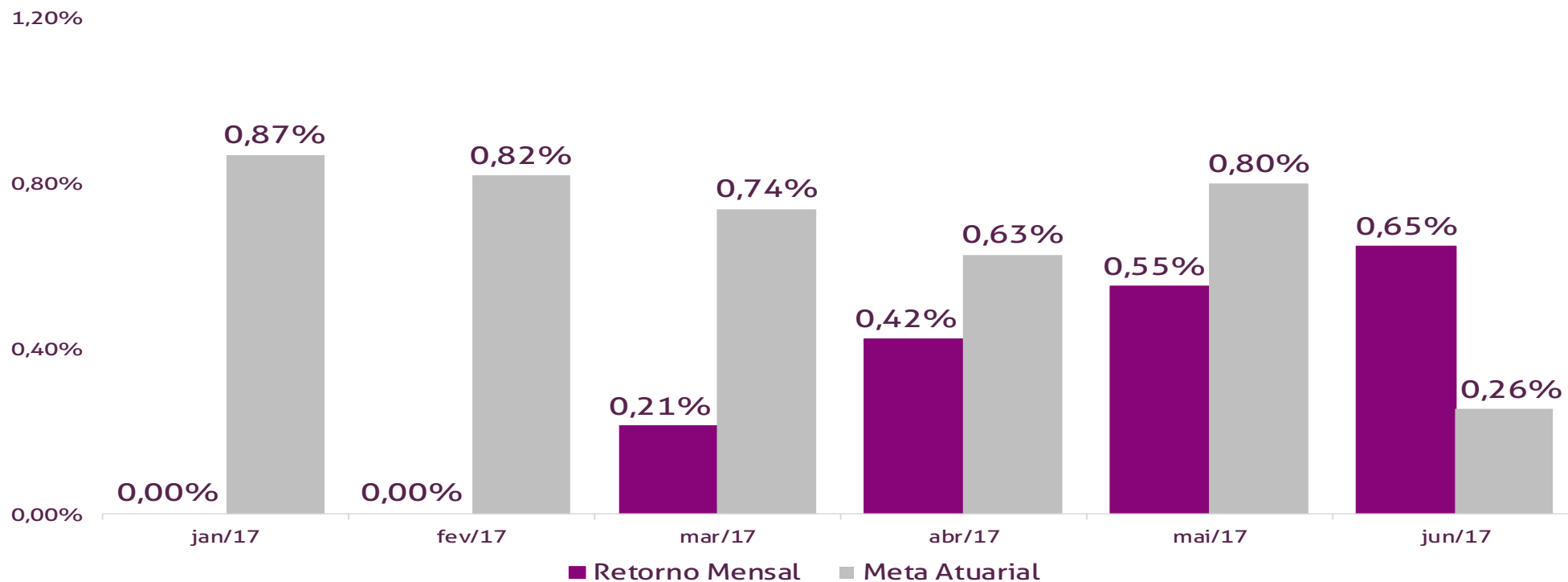


Performance Absoluta

	jan-17	fev-17	mar-17	abr-17	mai-17	jun-17
Carteira	0,00%	0,00%	0,21%	0,42%	0,55%	0,65%
Retorno Financeiro	0,00	0,00	38.113,97	75.248,50	86.513,83	78.568,08
Meta Atuarial	0,87%	0,82%	0,74%	0,63%	0,80%	0,26%

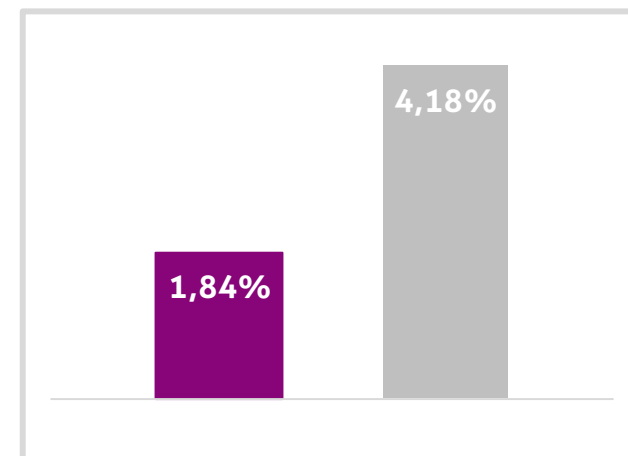
	jul-17	ago-17	set-17	out-17	nov-17	dez-17
Carteira						
Retorno Financeiro						
Meta Atuarial						

Retorno Mensal X Meta Atuarial Mensal



Estatística		
Meses positivos:	4	
Meses negativos:	0	
Meses acima da Meta Atuarial:	1	
Meses abaixo da Meta Atuarial:	3	
Retorno Mensal Máximo	0,65%	jun-17
Retorno Mensal Médio	0,31%	
Retorno Mensal Mínimo	0,00%	jan-17
Sharpe	-1,75	
Volatilidade	3,83%	
VaR	-0,42%	
Meta Atuarial	IPCA + 6%	

Consolidado - 2017	
Carteira	1,84%
Retorno	R\$ 278.444,38
Meta	4,18%





jan/17

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
								0,00
Aplicações		0,00						0,00
Imóveis		0,00						0,00
Conta Corrente		2.106.296,84						36.405.577,62
Banco do Brasil 17160-3		0,00						37.314,95
Banco do Brasil 15854-2		158,73						3.645,23
Caixa 271-0		704.793,81						690.373,66
Caixa 266-3		1.401.344,30						35.674.243,78
Final		2.106.296,84	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	36.405.577,62

fev/17

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
								0,00
Aplicações		0,00						0,00
Imóveis		0,00						0,00
Conta Corrente		36.405.577,62						6.212.959,16
Banco do Brasil 17160-3		37.314,95						37.314,95
Banco do Brasil 15854-2		3.645,23						10.420,74
Caixa 271-0		690.373,66						2.208.389,82
Caixa 266-3		35.674.243,78						3.956.833,65
FINAL		36.405.577,62	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	6.212.959,16

mar/17

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 271-0	0,00	2.471.327,72	-1.642.678,04		5.914,07	0,71%	834.563,75
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 266-3	0,00	10.900.000,00			32.199,90	0,30%	10.932.199,90
Aplicações		0,00						11.766.763,65
Imóveis		0,00						0,00
Conta Corrente		6.212.959,16						5.520.328,82
Banco do Brasil 17160-3		37.314,95						0,00
Banco do Brasil 15854-2		10.420,74						7.076,25
Caixa 271-0		2.208.389,82						53.156,66
Caixa 266-3		3.956.833,65						5.460.095,91
FINAL		6.212.959,16	13.371.327,72	-1.642.678,04	0,00	38.113,97	0,21%	17.287.092,47



abr/17

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 271-0	834.563,75	144.035,85			6.583,05	0,67%	985.182,65
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 266-3	10.932.199,90	2.965.437,93	-2.618.682,56		68.665,45	0,61%	11.347.620,72
Aplicações								12.332.803,37
Imóveis		0,00						0,00
Conta Corrente		5.520.328,82						1.641.127,31
Banco do Brasil 17160-3		0,00						0,00
Banco do Brasil 15854-2		7.076,25						4.701,25
Caixa 271-0		53.156,66						322.070,67
Caixa 266-3		5.460.095,91						1.314.355,39
FINAL		17.287.092,47	3.109.473,78	-2.618.682,56	0,00	75.248,50	0,42%	13.973.930,68

mai/17

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 271-0	985.182,65	130.728,48			8.903,00	0,80%	1.124.814,13
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 266-3	11.347.620,72	9.400.000,00	-7.772.724,14		77.610,83	0,60%	13.052.507,41
Aplicações								14.177.321,54
Imóveis		0,00						0,00
Conta Corrente		1.641.127,31						446.598,12
Banco do Brasil 17160-3		0,00						0,00
Banco do Brasil 15854-2		4.701,25						6.908,89
Caixa 271-0		322.070,67						302.127,10
Caixa 266-3		1.314.355,39						137.562,13
FINAL		13.973.930,68	9.530.728,48	-7.772.724,14	0,00	86.513,83	0,55%	14.623.919,66

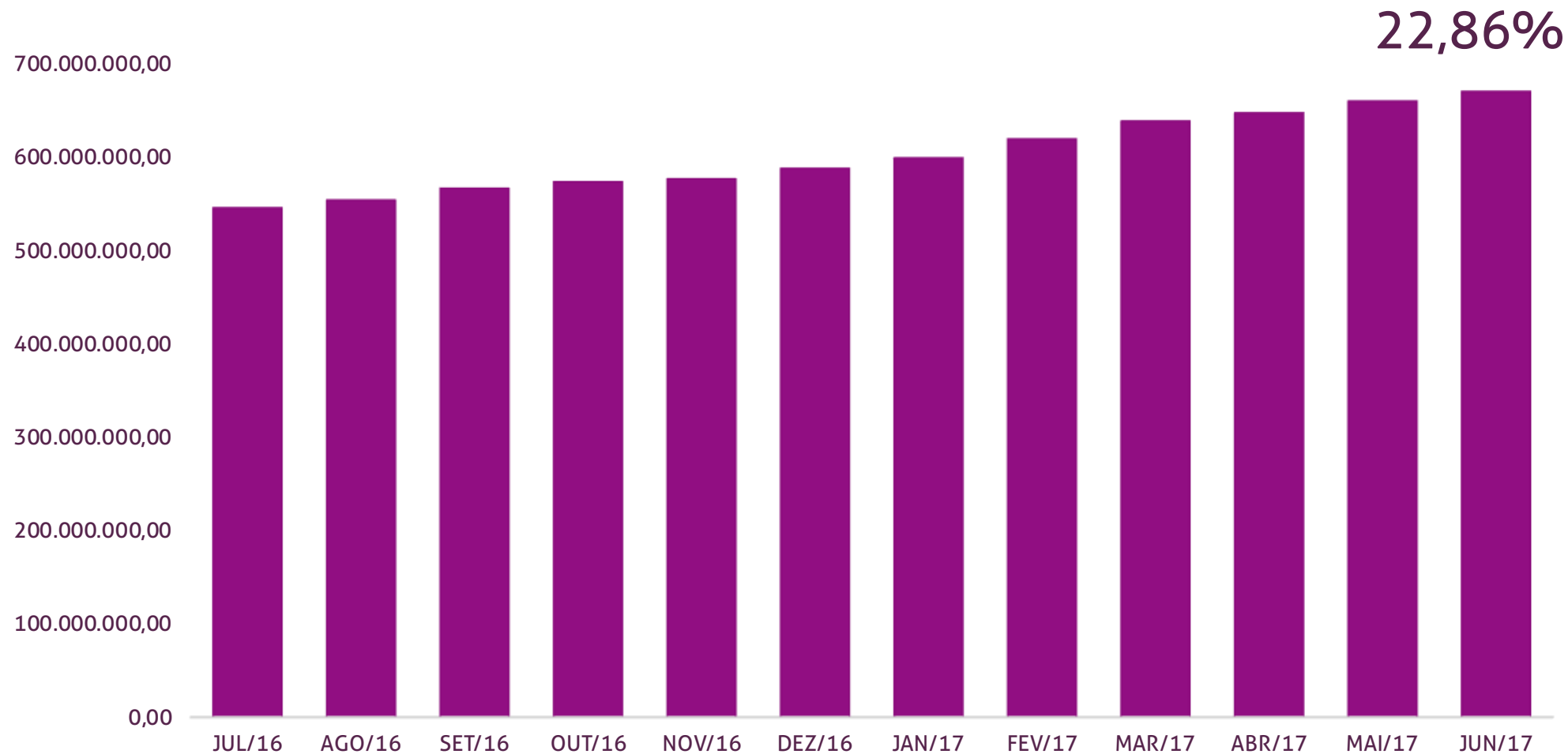
jun/17

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 271-0	1.124.814,13	243.723,34			9.277,63	0,68%	1.377.815,10
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 266-3	13.052.507,41	5.400.000,00	-8.128.948,12		69.290,45	0,67%	10.392.849,74
Aplicações								11.770.664,84
Imóveis		0,00						0,00
Conta Corrente		446.598,12						1.614.573,35
Banco do Brasil 17160-3		0,00						0,00
Banco do Brasil 15854-2		6.908,89						5.165,39
Caixa 271-0		302.127,10						421.413,39
Caixa 266-3		137.562,13						1.187.994,57
FINAL		14.623.919,66	5.643.723,34	-8.128.948,12	0,00	78.568,08	0,65%	13.385.238,19

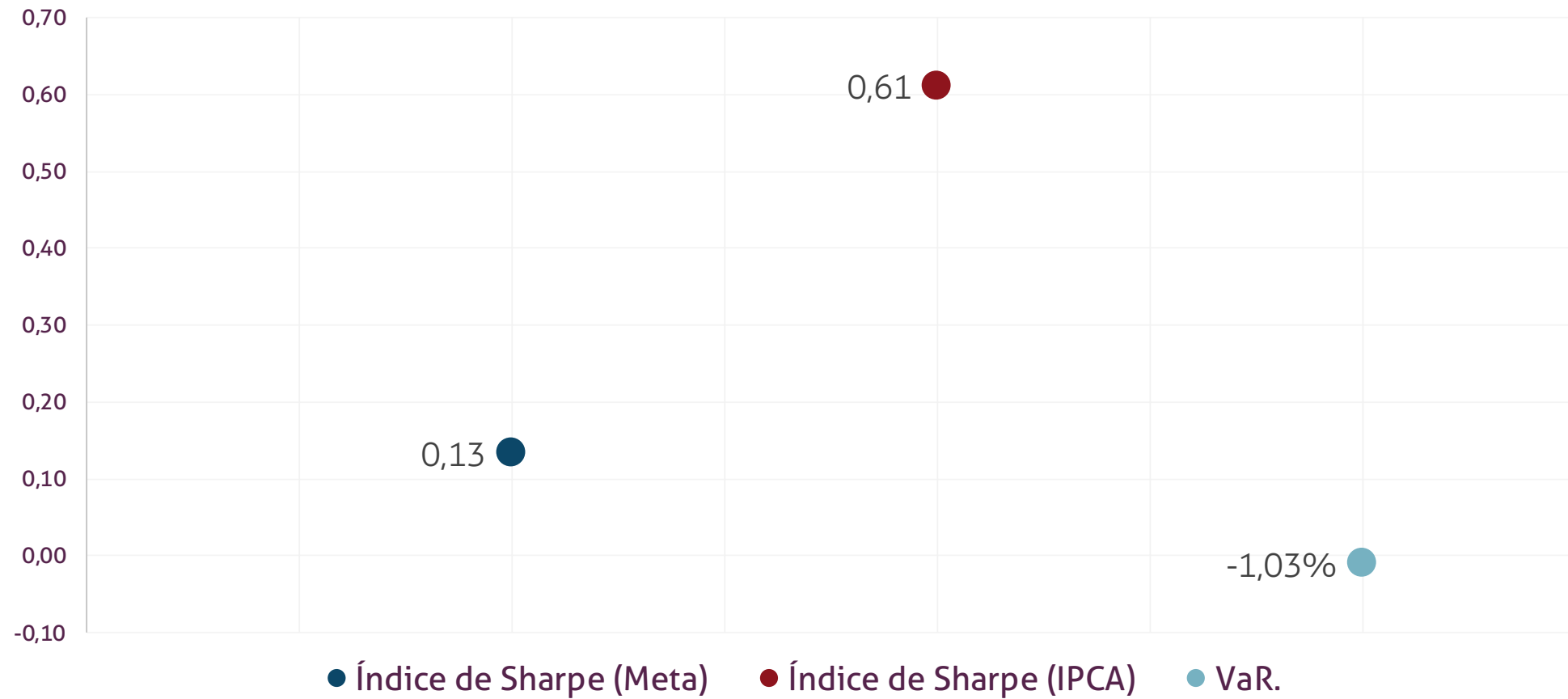


Evolução Patrimônio Líquido - Fundo II

Jan	R\$ 598.297.079,63	Fev	R\$ 618.696.976,48	Mar	R\$ 637.809.444,13	Abr	R\$ 646.617.056,66
Mai	R\$ 659.153.913,95	Jun	R\$ 669.505.134,50	Jul		Ago	
Set		Out		Nov		Dez	

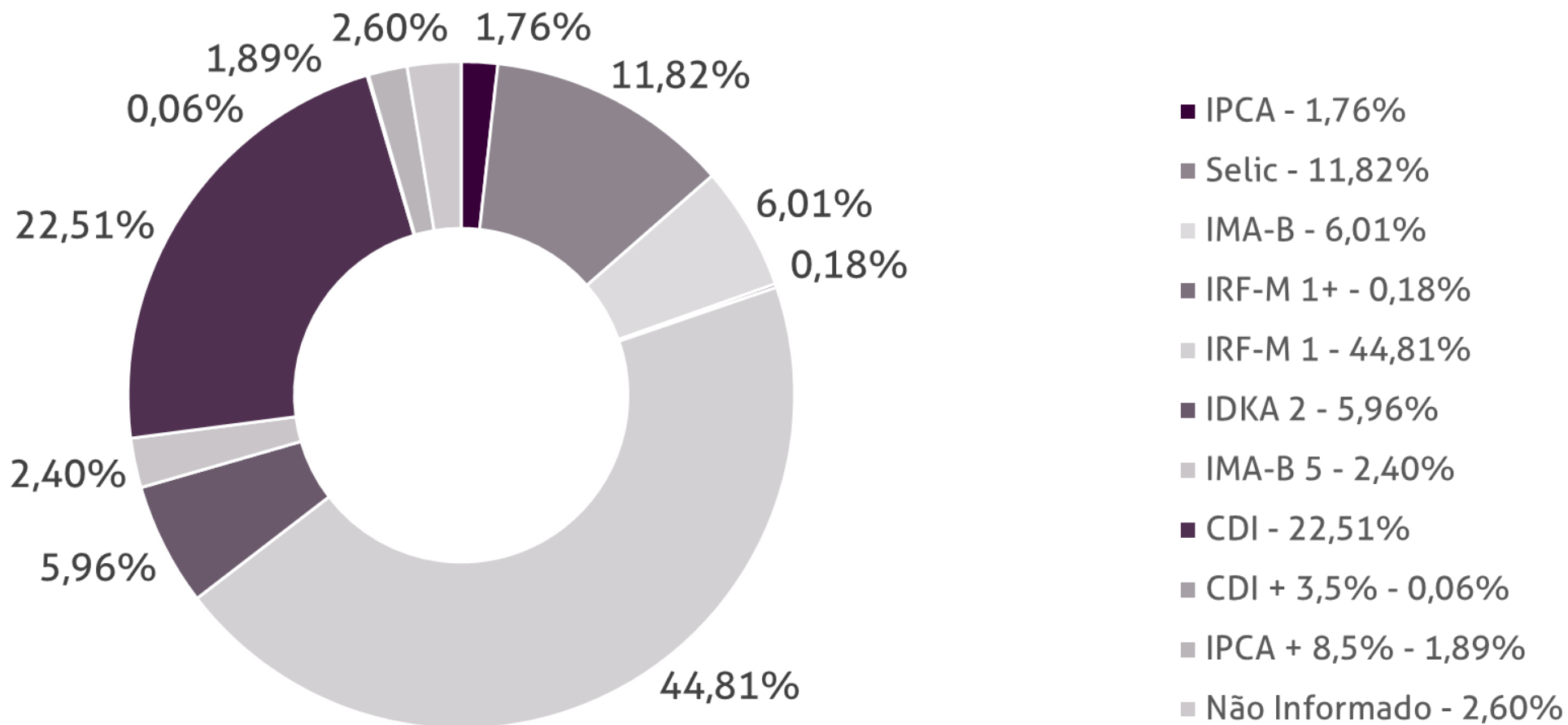


Índice de Sharpe e Var da Carteira

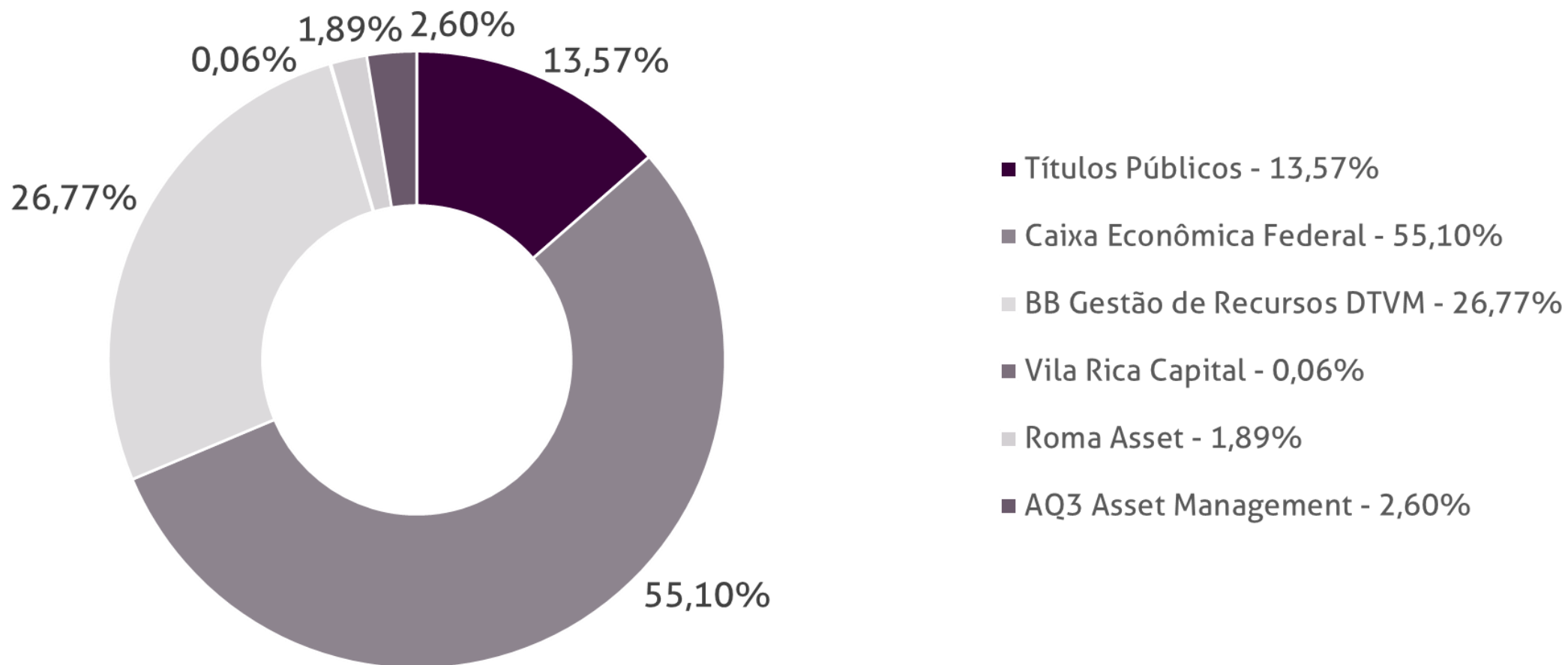


Fundos	CNPJ	Gestão	Taxa de Administração	Benchmark	Resgate
NTN-B IPSM		Títulos Públicos	0,00%	IPCA	-
NTN-F IPSM		Títulos Públicos	0,00%	Selic	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.740.658/0001-93	Caixa Econômica Federal	0,20%	IMA-B	D+0
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.577.519/0001-90	Caixa Econômica Federal	0,20%	IRF-M 1+	D+0
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.740.670/0001-06	Caixa Econômica Federal	0,20%	IRF-M 1	D+0
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	14.386.926/0001-71	Caixa Econômica Federal	0,20%	IDKA 2	D+0
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	07.442.078/0001-05	BB Gestão de Recursos DTVM	0,20%	IMA-B	D+1
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	03.543.447/0001-03	BB Gestão de Recursos DTVM	0,20%	IMA-B 5	D+1
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	07.861.554/0001-22	BB Gestão de Recursos DTVM	0,30%	IMA-B	D+1
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	10.646.895/0001-90	Caixa Econômica Federal	0,20%	IMA-B	D+0
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	03.737.206/0001-97	Caixa Econômica Federal	0,20%	CDI	D+0
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.077.418/0001-49	BB Gestão de Recursos DTVM	0,20%	CDI	D+0
ITÁLIA FIDC MULTISSECTORIAL SÊNIOR	13.990.000/0001-28	Vila Rica Capital	0,39%	CDI + 3,5%	Não se aplica
CONQUEST FIP - FCCQ11	10.625.626/0001-47	Roma Asset	0,30%	IPCA + 8,5%	Não se aplica
ÁQUILLA FII - AQLL11	13.555.918/0001-49	AQ3 Asset Management	1,50%	Não Informado	Não se aplica
FIRENZE FII	14.074.721/0001-50	AQ3 Asset Management	1,50%	Não Informado	Não se aplica
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	14.508.643/0001-55	Caixa Econômica Federal	0,80%	CDI	D+0
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.328.882/0001-35	BB Gestão de Recursos DTVM	0,10%	IRF-M 1	D+0

Distribuição por Indicador - Junho - 2017



Distribuição por Instituição - Junho - 2017



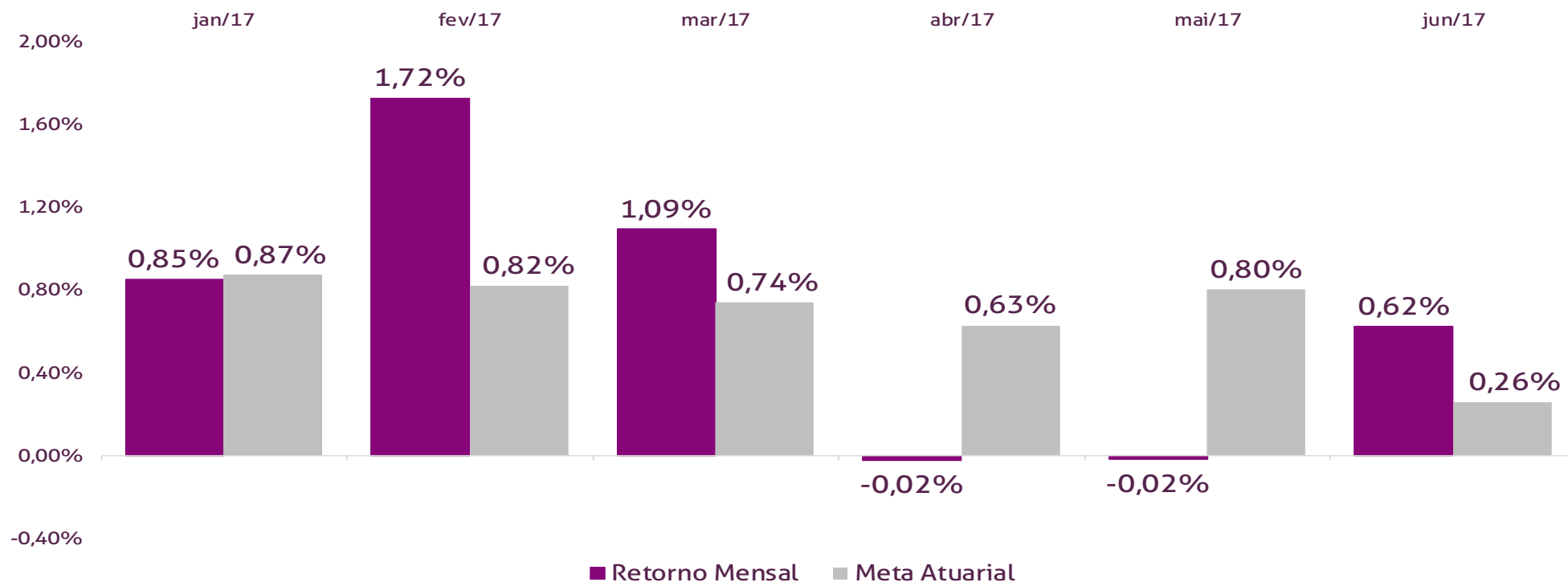


Performance Absoluta

	jan-17	fev-17	mar-17	abr-17	mai-17	jun-17
Carteira	0,85%	1,72%	1,09%	-0,02%	-0,02%	0,62%
Retorno Financeiro	4.984.050,27	10.539.817,30	6.889.410,94	-148.706,70	-132.921,28	4.143.069,15
Meta Atuarial	0,87%	0,82%	0,74%	0,63%	0,80%	0,26%

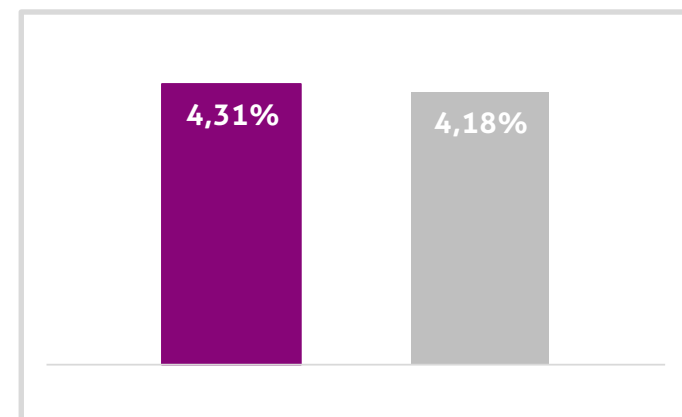
	jul-17	ago-17	set-17	out-17	nov-17	dez-17
Carteira						
Retorno Financeiro						
Meta Atuarial						

Retorno Mensal X Meta Atuarial Mensal



Estatística		
Meses positivos:	4	
Meses negativos:	2	
Meses acima da Meta Atuarial:	3	
Meses abaixo da Meta Atuarial:	3	
Retorno Mensal Máximo	1,72%	fev-17
Retorno Mensal Médio	0,71%	
Retorno Mensal Mínimo	-0,02%	abr-17
Sharpe	0,13	
Volatilidade	12,93%	
VaR	-1,03%	
Meta Atuarial	IPCA + 6%	

Consolidado - 2017	
Carteira	4,31%
Retorno	R\$ 26.274.719,68
Meta	4,18%



jan/17

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
NTN-B IPSM		11.477.445,00				325.536,69	2,84%	11.802.981,69
NTN-F IPSM		76.108.499,33			3.672.865,96	-1.536.427,41	-2,02%	74.572.071,92
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	8.108.475,23				149.404,80	1,84%	8.257.880,03
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	1.090.240,93				29.380,30	2,69%	1.119.621,23
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 267-1	119.956.819,09				1.509.919,77	1,26%	121.466.738,86
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	50.779.453,94				540.215,59	1,06%	51.319.669,53
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	42.783.020,59				789.045,54	1,84%	43.572.066,13
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 15852-6	43.799.217,81				498.388,72	1,14%	44.297.606,53
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	49.321.539,24				932.629,03	1,89%	50.254.168,27
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	7.055.348,18				133.216,65	1,89%	7.188.564,83
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 267-1	108.345.364,65				1.164.015,91	1,07%	109.509.380,56
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	33.985.777,11				373.114,60	1,10%	34.358.891,71
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR		377.980,53			3.516,63	907,23	0,24%	375.371,13
CONQUEST FIP - FCCQ11		15.700.656,17				-17.720,42	-0,11%	15.682.935,75
ÁQUILLA FII - AQLL11		6.539.263,25				-821,59	-0,01%	6.538.441,66
FIRENZE FII		11.523.739,89				93.244,86	0,81%	11.616.984,75
Aplicações		586.952.840,94						591.933.374,58
Imóveis		0,00						0,00
Conta Corrente		221.827,66						6.363.705,05
Caixa 267-1		221.776,52						6.340.246,58
Banco do Brasil 15852-6		0,00						23.407,33
Caixa 538-7		51,14						51,14
Final		587.174.668,60	0,00	0,00	3.676.382,59	4.984.050,27	0,85%	598.297.079,63

fev/17

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
NTN-B IPSM		11.802.981,69				774.353,51	6,56%	12.577.335,20
NTN-F IPSM		74.572.071,92				1.759.079,14	2,36%	76.331.151,06
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	8.257.880,03	6.466.426,57			310.181,38	2,11%	15.034.487,98
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	1.119.621,23				26.851,33	2,40%	1.146.472,56
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 267-1	121.466.738,86				1.207.815,69	0,99%	122.674.554,55
CAIXA BRASIL IDKA IPKA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	51.319.669,53	6.466.426,57			670.937,12	1,16%	58.457.033,22
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	43.572.066,13				1.675.991,80	3,85%	45.248.057,93
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 15852-6	44.297.606,53				654.713,79	1,48%	44.952.320,32
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	50.254.168,27				1.953.888,10	3,89%	52.208.056,37
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	7.188.564,83				271.461,18	3,78%	7.460.026,01
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 267-1	109.509.380,56				964.127,01	0,88%	110.473.507,57
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	34.358.891,71				306.344,13	0,89%	34.665.235,84
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR		375.371,13			10.585,47	3.925,97	1,05%	368.711,63
CONQUEST FIP - FCCQ11		15.682.935,75				-26.383,09	-0,17%	15.656.552,66
ÁQUILLA FII - AQLL11		6.538.441,66				-10.838,17	-0,17%	6.527.603,49
FIRENZE FII		11.616.984,75				-2.631,59	-0,02%	11.614.353,16
Aplicações		591.933.374,58						615.395.459,55
Imóveis		0,00						0,00
Conta Corrente		6.363.705,05						3.301.516,93
Caixa 267-1		6.340.246,58						3.077.657,66
Banco do Brasil 15852-6		23.407,33						54.819,59
Caixa 538-7		51,14						169.039,68
FINAL		598.297.079,63	12.932.853,14	0,00	10.585,47	10.539.817,30	1,72%	618.696.976,48

mar/17

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
NTN-B IPSM		12.577.335,20				49.367,18	0,39%	12.626.702,38
NTN-F IPSM		76.331.151,06				1.229.854,47	1,61%	77.561.005,53
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	15.034.487,98	5.150.000,00			166.454,21	0,82%	20.350.942,19
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	1.146.472,56				17.428,62	1,52%	1.163.901,18
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 267-1	122.674.554,55	2.145.000,00			1.367.859,31	1,10%	126.187.413,86
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	58.457.033,22	5.150.000,00			844.834,30	1,33%	64.451.867,52
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	45.248.057,93	68.147,27			461.447,87	1,02%	45.777.653,07
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 15852-6	44.952.320,32				620.741,93	1,38%	45.573.062,25
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	52.208.056,37				545.861,91	1,05%	52.753.918,28
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	7.460.026,01				70.815,96	0,95%	7.530.841,97
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 267-1	110.473.507,57				1.180.209,27	1,07%	111.653.716,84
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	34.665.235,84				369.734,77	1,07%	35.034.970,61
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 538-7	0,00	325.159,52			960,56	0,30%	326.120,08
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR		368.711,63			13.327,68	2.857,79	0,78%	358.241,74
CONQUEST FIP - FCCQ11		15.656.552,66				-20.465,38	-0,13%	15.636.087,28
ÂQUILLA FII - AQLL11		6.527.603,49				-14.495,52	-0,22%	6.513.107,97
FIRENZE FII		11.614.353,16				-4.056,31	-0,03%	11.610.296,85
Aplicações		615.395.459,55						635.109.849,60
Imóveis		0,00						0,00
Conta Corrente		3.301.516,93						2.699.594,53
Caixa 267-1		3.077.657,66						2.529.034,63
Banco do Brasil 15852-6		54.819,59						19.549,24
Caixa 538-7		169.039,68						151.010,66
FINAL		618.696.976,48	12.838.306,79	0,00	13.327,68	6.889.410,94	1,09%	637.809.444,13

abr/17

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
NTN-B IPSM		12.626.702,38				-189.558,32	-1,50%	12.437.144,06
NTN-F IPSM		77.561.005,53				333.196,46	0,43%	77.894.201,99
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	20.350.942,19				-69.414,04	-0,34%	20.281.528,15
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	1.163.901,18				3.890,93	0,33%	1.167.792,11
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 267-1	126.187.413,86	6.237.563,30			1.110.372,78	0,84%	133.535.349,94
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	64.451.867,52	4.775.163,29			525.454,02	0,76%	69.752.484,83
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	45.777.653,07				-157.660,59	-0,34%	45.619.992,48
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 15852-6	45.573.062,25				318.361,31	0,70%	45.891.423,56
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	52.753.918,28				-183.285,06	-0,35%	52.570.633,22
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	7.530.841,97				-39.696,90	-0,53%	7.491.145,07
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 267-1	111.653.716,84		-250.000,00		885.395,08	0,79%	112.289.111,92
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	35.034.970,61				274.234,73	0,78%	35.309.205,34
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 538-7	326.120,08	149.855,40			2.897,89	0,61%	478.873,37
ITÁLIA FIDC MULTISSECTORIAL SÊNIOR		358.241,74			15.611,83	2.994,55	0,84%	345.624,46
CONQUEST FIP - FCCQ11		15.636.087,28				-2.947.684,92	-18,85%	12.688.402,36
ÂQUILLA FII - AQLL11		6.513.107,97				-11.261,91	-0,17%	6.501.846,06
FIRENZE FII		11.610.296,85				-6.942,71	-0,06%	11.603.354,14
Aplicações		635.109.849,60						645.858.113,06
Imóveis		0,00						0,00
Conta Corrente		2.699.594,53						758.943,60
Caixa 267-1		2.529.034,63						553.006,14
Banco do Brasil 15852-6		19.549,24						56.319,76
Caixa 538-7		151.010,66						149.617,70
FINAL		637.809.444,13	11.162.581,99	-250.000,00	15.611,83	-148.706,70	-0,02%	646.617.056,66

mai/17

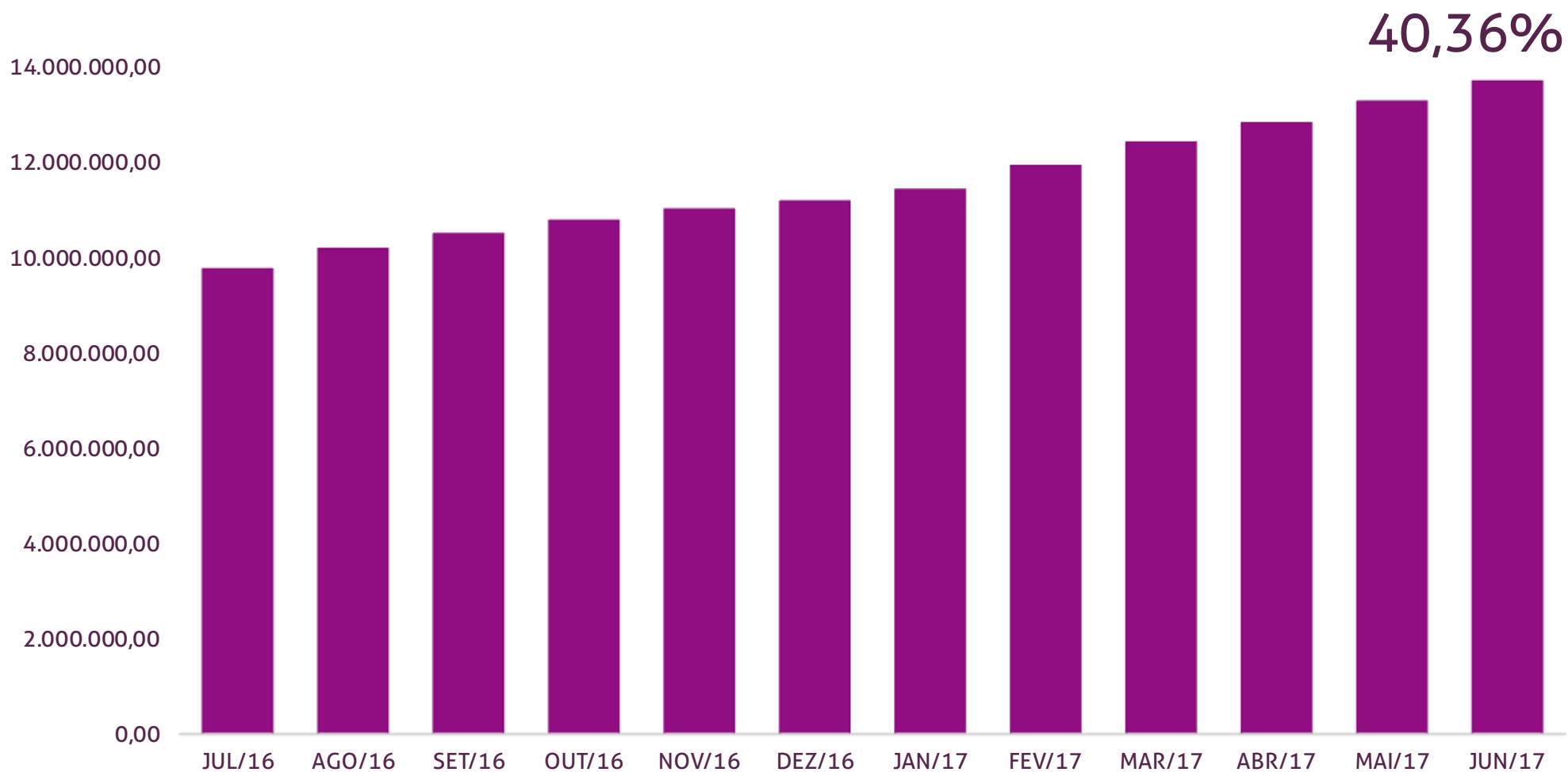
Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
NTN-B IPSM		12.437.144,06			329.756,97	-946.604,79	-7,61%	11.820.296,24
NTN-F IPSM		77.894.201,99				27.567,84	0,04%	77.921.769,83
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	20.281.528,15				-241.918,73	-1,19%	20.039.609,42
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	1.167.792,11				1.097,96	0,09%	1.168.890,07
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 267-1	133.535.349,94	13.000.000,00			1.238.600,41	0,85%	147.773.950,35
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	69.752.484,83				288.338,83	0,41%	70.040.823,66
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	45.619.992,48				-546.160,64	-1,20%	45.073.831,84
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 15852-6	45.891.423,56				42.141,63	0,09%	45.933.565,19
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	52.570.633,22				-650.598,87	-1,24%	51.920.034,35
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	7.491.145,07				-72.279,10	-0,96%	7.418.865,97
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 267-1	112.289.111,92		-500.000,00		1.043.287,43	0,93%	112.832.399,35
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	35.309.205,34	71.000,00			325.873,58	0,92%	35.706.078,92
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 538-7	478.873,37	148.462,44			4.655,89	0,74%	631.991,70
ITÁLIA FIDC MULTISSECTORIAL SÊNIOR		345.624,46			14.764,46	4.749,09	1,37%	335.609,09
CONQUEST FIP - FCCQ11		12.688.402,36				-13.089,44	-0,10%	12.675.312,92
ÁQUILLA FII - AQLL11		6.501.846,06				-120.167,54	-1,85%	6.381.678,52
FIRENZE FII		11.603.354,14				-518.414,83	-4,47%	11.084.939,31
Aplicações		645.858.113,06						658.759.646,73
Imóveis		0,00						0,00
Conta Corrente		758.943,60						394.267,22
Caixa 267-1		553.006,14						218.988,45
Banco do Brasil 15852-6		56.319,76						19.465,96
Caixa 538-7		149.617,70						155.812,81
FINAL		646.617.056,66	13.219.462,44	-500.000,00	344.521,43	-132.921,28	-0,02%	659.153.913,95

jun/17

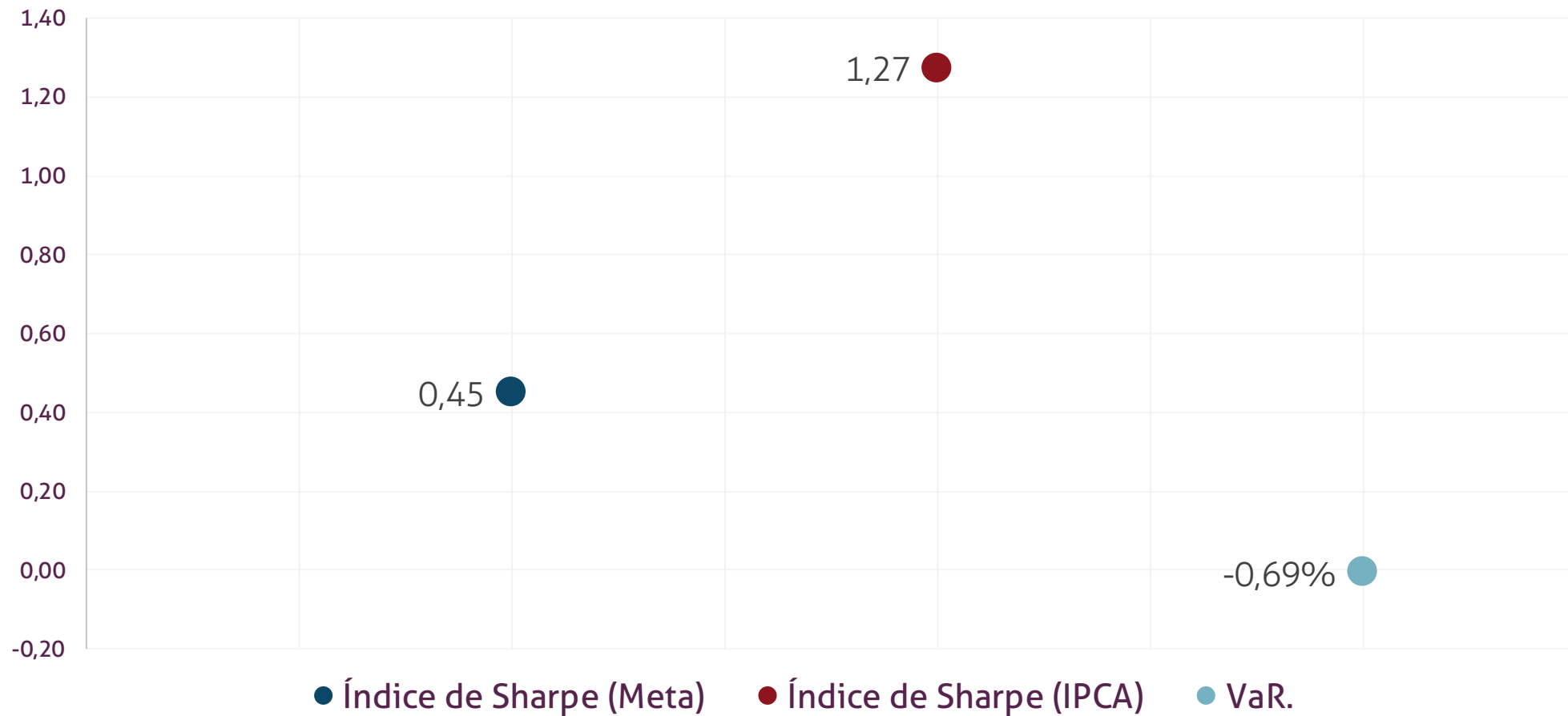
Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
NTN-B IPSM		11.820.296,24				-63.839,03	-0,54%	11.756.457,21
NTN-F IPSM		77.921.769,83				1.130.911,63	1,45%	79.052.681,46
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	20.039.609,42		-10.000.000,00		-13.555,50	-0,14%	10.026.053,92
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	1.168.890,07				17.402,22	1,49%	1.186.292,29
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 267-1	147.773.950,35	50.500.000,00			1.364.499,99	0,69%	199.638.450,34
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	0,00	100.000.000,00			128.487,77	0,13%	100.128.487,77
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	70.040.823,66		-30.500.000,00		344.496,53	0,87%	39.885.320,19
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	45.073.831,84		-25.000.000,00		-42.524,22	-0,21%	20.031.307,62
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 15852-6	45.933.565,19		-30.000.000,00		150.067,75	0,94%	16.083.632,94
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	51.920.034,35		-45.000.000,00		-97.935,18	-1,42%	6.822.099,17
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	7.418.865,97		-4.100.000,00		-11.852,01	-0,36%	3.307.013,96
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 267-1	112.832.399,35				930.201,30	0,82%	113.762.600,65
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	35.706.078,92				290.584,92	0,81%	35.996.663,84
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 538-7	631.991,70	154.657,55			5.281,13	0,67%	791.930,38
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR		335.609,09			12.784,84	87.289,30	26,01%	410.113,55
CONQUEST FIP - FCCQ11		12.675.312,92				-12.460,29	-0,10%	12.662.852,63
ÂQUILLA FII - AQLL11		6.381.678,52				-59.404,53	-0,93%	6.322.273,99
FIRENZE FII		11.084.939,31				-4.582,63	-0,04%	11.080.356,68
Aplicações		658.759.646,73						668.944.588,59
Imóveis		0,00						0,00
Conta Corrente		394.267,22						560.545,91
Caixa 267-1		218.988,45						348.955,33
Banco do Brasil 15852-6		19.465,96						51.076,57
Caixa 538-7		155.812,81						160.514,01
FINAL		659.153.913,95	150.654.657,55	-144.600.000,00	12.784,84	4.143.069,15	0,62%	669.505.134,50

Evolução Patrimônio Líquido - Fundo III

Jan	R\$ 11.420.445,75	Fev	R\$ 11.919.863,18	Mar	R\$ 12.411.174,89	Abr	R\$ 12.816.896,72
Mai	R\$ 13.269.596,18	Jun	R\$ 13.693.050,44	Jul		Ago	
Set		Out		Nov		Dez	

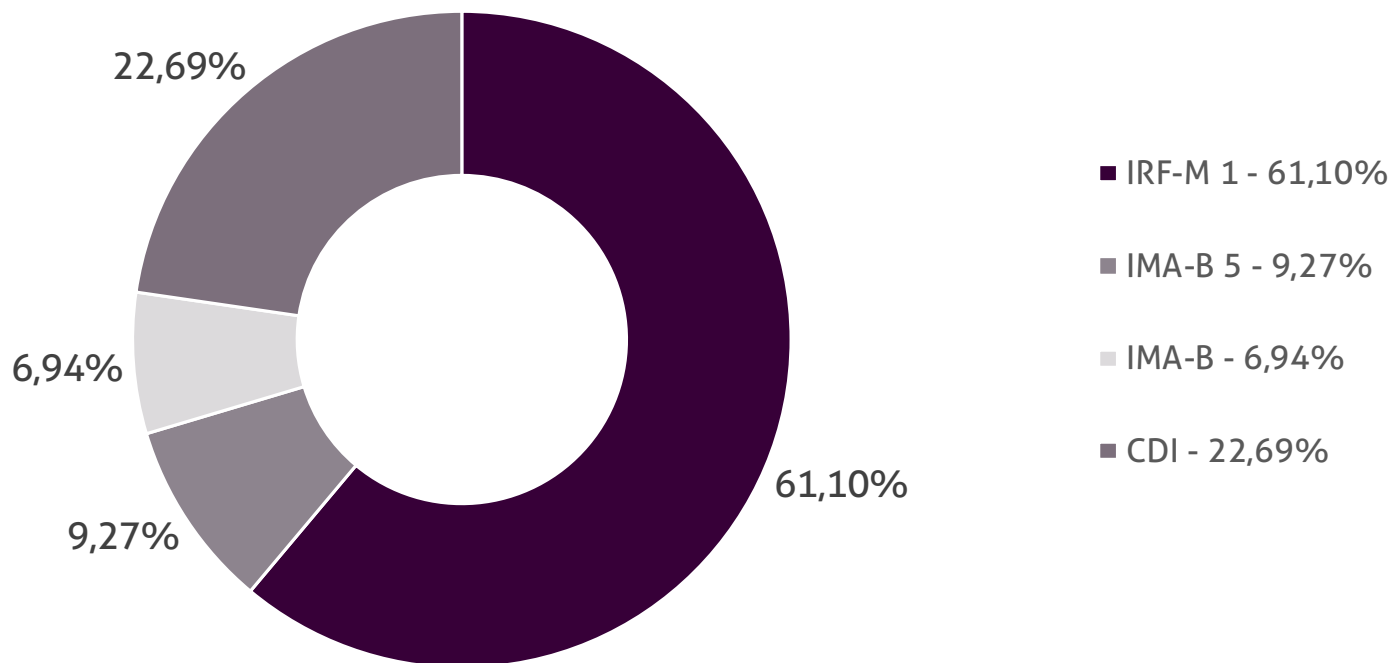


Índice de Sharpe e Var da Carteira

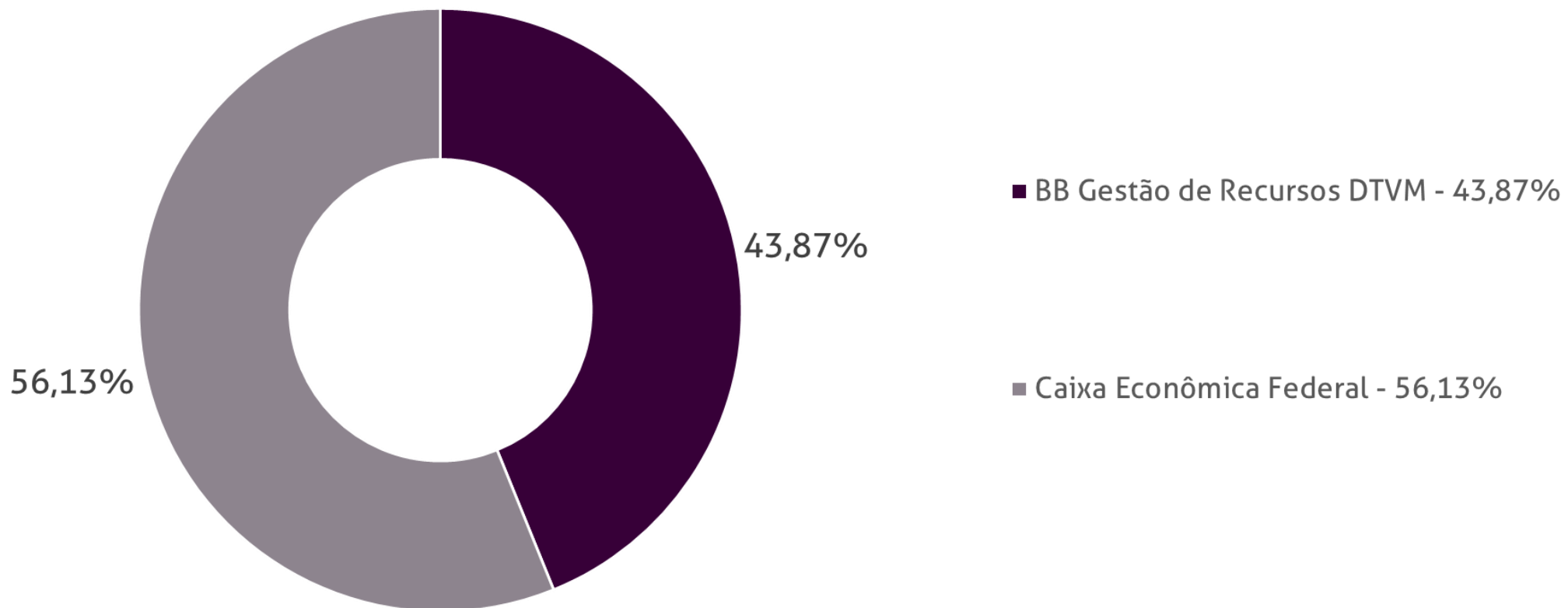


Fundos	CNPJ	Gestão	Taxa de Administração	Benchmark	Resgate
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.328.882/0001-35	BB Gestão de Recursos DTVM	0,10%	IRF-M 1	D+0
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.740.670/0001-06	Caixa Econômica Federal	0,20%	IRF-M 1	D+0
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.060.913/0001-10	Caixa Econômica Federal	0,20%	IMA-B 5	D+0
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	03.543.447/0001-03	BB Gestão de Recursos DTVM	0,20%	IMA-B 5	D+1
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	10.646.895/0001-90	Caixa Econômica Federal	0,20%	IMA-B	D+0
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	03.737.206/0001-97	Caixa Econômica Federal	0,20%	CDI	D+0
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.077.418/0001-49	BB Gestão de Recursos DTVM	0,20%	CDI	D+0

Distribuição por Indicador - Junho - 2017



Distribuição por Instituição - Junho - 2017



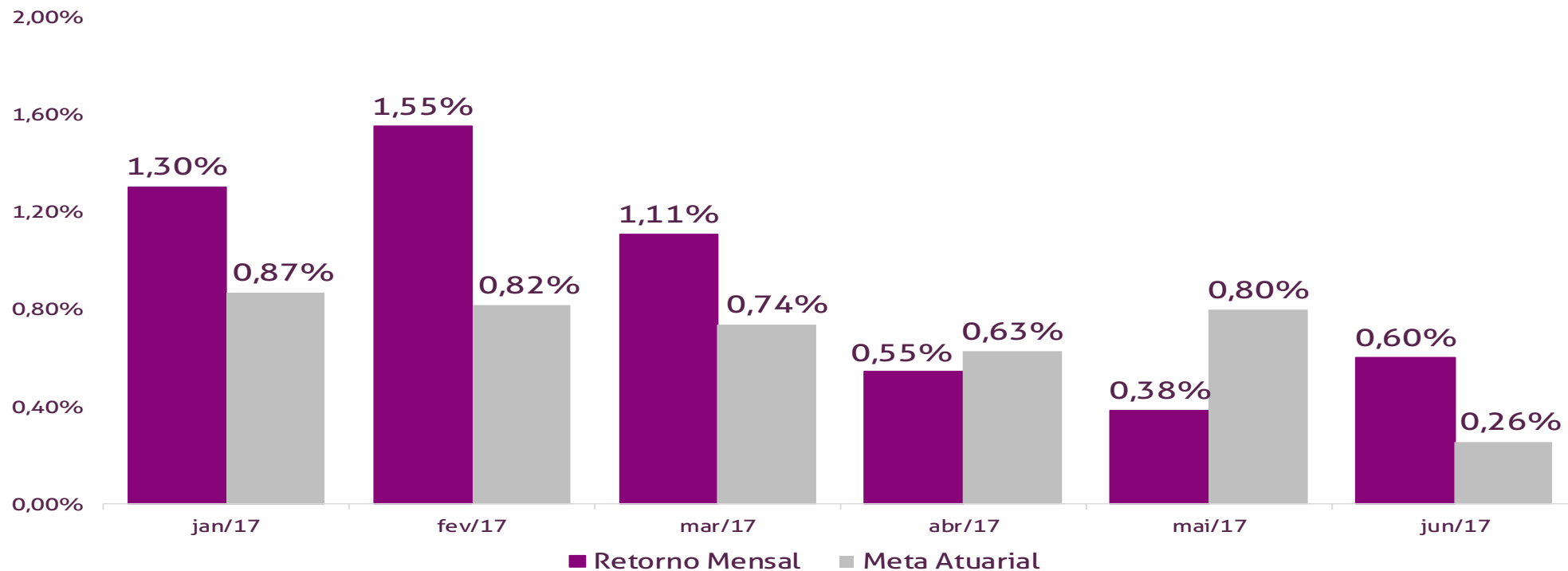


Performance Absoluta

	jan-17	fev-17	mar-17	abr-17	mai-17	jun-17
Carteira	1,30%	1,55%	1,11%	0,55%	0,38%	0,60%
Retorno Financeiro	145.641,38	183.527,16	136.118,33	69.502,89	50.782,25	81.694,56
Meta Atuarial	0,87%	0,82%	0,74%	0,63%	0,80%	0,26%

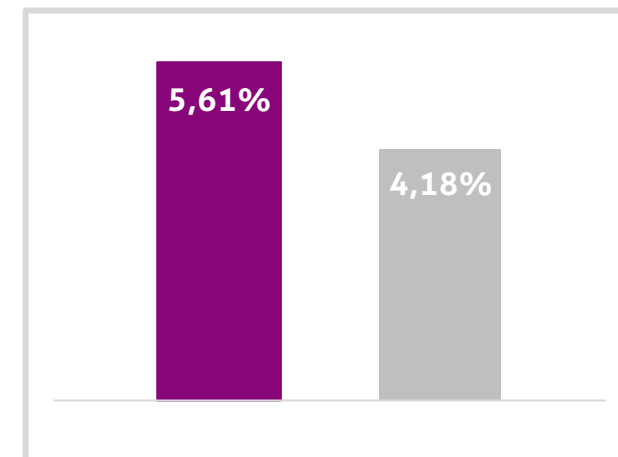
	jul-17	ago-17	set-17	out-17	nov-17	dez-17
Carteira						
Retorno Financeiro						
Meta Atuarial						

Retorno Mensal X Meta Atuarial Mensal



Estatística		
Meses positivos:	6	
Meses negativos:	0	
Meses acima da Meta Atuarial:	4	
Meses abaixo da Meta Atuarial:	2	
Retorno Mensal Máximo	1,55%	fev-17
Retorno Mensal Médio	0,92%	
Retorno Mensal Mínimo	0,38%	mai-17
Sharpe	0,45	
Volatilidade	7,51%	
VaR	-0,69%	
Meta Atuarial	IPCA + 6%	

Consolidado - 2017	
Carteira	5,61%
Retorno	R\$ 667.266,57
Meta	4,18%





jan/17

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 17879-9	2.960.377,80				37.300,81	1,26%	2.997.678,61
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 278-7	362.671,07				4.565,02	1,26%	367.236,09
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 278-7	928.991,84				10.567,94	1,14%	939.559,78
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 17879-9	1.844.334,30				20.986,57	1,14%	1.865.320,87
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 278-7	2.142.293,95				40.450,06	1,89%	2.182.744,01
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 278-7	2.066.203,71				22.198,40	1,07%	2.088.402,11
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 17879-9	871.935,28				9.572,58	1,10%	881.507,86
Aplicações		11.176.807,95						11.322.449,33
Imóveis		0,00						0,00
Conta Corrente		0,00						97.996,42
Caixa 278-7		0,00						97.996,42
Banco do Brasil 17879-9		0,00						0,00
Final		11.176.807,95	0,00	0,00	0,00	145.641,38	1,30%	11.420.445,75

fev/17

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 17879-9	2.997.678,61				29.585,40	0,99%	3.027.264,01
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 278-7	367.236,09	413.886,69			3.816,45	0,49%	784.939,23
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 278-7	939.559,78				13.883,33	1,48%	953.443,11
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 17879-9	1.865.320,87				27.569,24	1,48%	1.892.890,11
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 278-7	2.182.744,01				82.426,78	3,78%	2.265.170,79
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 278-7	2.088.402,11				18.386,43	0,88%	2.106.788,54
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 17879-9	881.507,86				7.859,53	0,89%	889.367,39
Aplicações		11.322.449,33						11.919.863,18
Imóveis		0,00						0,00
Conta Corrente		97.996,42						0,00
Caixa 278-7		97.996,42						0,00
Banco do Brasil 17879-9		0,00						0,00
FINAL		11.420.445,75	413.886,69	0,00	0,00	183.527,16	1,55%	11.919.863,18

mar/17

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 17879-9	3.027.264,01				33.328,75	1,10%	3.060.592,76
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 278-7	784.939,23	355.193,38			10.023,37	0,88%	1.150.155,98
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 278-7	953.443,11				13.131,77	1,38%	966.574,88
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 17879-9	1.892.890,11				26.138,72	1,38%	1.919.028,83
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 278-7	2.265.170,79				21.502,64	0,95%	2.286.673,43
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 278-7	2.106.788,54				22.507,20	1,07%	2.129.295,74
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 17879-9	889.367,39				9.485,88	1,07%	898.853,27
Aplicações		11.919.863,18						12.411.174,89
Imóveis		0,00						0,00
Conta Corrente		0,00						0,00
Caixa 278-7		0,00						0,00
Banco do Brasil 17879-9		0,00						0,00
FINAL		11.919.863,18	355.193,38	0,00	0,00	136.118,33	1,11%	12.411.174,89



abr/17

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 17879-9	3.060.592,76				26.203,20	0,86%	3.086.795,96
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 278-7	1.150.155,98	336.218,94			11.295,52	0,76%	1.497.670,44
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 278-7	966.574,88				6.731,25	0,70%	973.306,13
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 17879-9	1.919.028,83				13.405,83	0,70%	1.932.434,66
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 278-7	2.286.673,43				-12.053,61	-0,53%	2.274.619,82
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 278-7	2.129.295,74				16.884,97	0,79%	2.146.180,71
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 17879-9	898.853,27				7.035,73	0,78%	905.889,00
Aplicações		12.411.174,89						12.816.896,72
Imóveis		0,00						0,00
Conta Corrente		0,00						0,00
Caixa 278-7		0,00						0,00
Banco do Brasil 17879-9		0,00						0,00
FINAL		12.411.174,89	336.218,94	0,00	0,00	69.502,89	0,55%	12.816.896,72

mai/17

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 17879-9	3.086.795,96				27.377,94	0,89%	3.114.173,90
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 278-7	1.497.670,44	387.859,02			14.396,07	0,76%	1.899.925,53
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 278-7	973.306,13				824,43	0,08%	974.130,56
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 17879-9	1.932.434,66				1.774,53	0,09%	1.934.209,19
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 278-7	2.274.619,82				-21.946,91	-0,96%	2.252.672,91
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 278-7	2.146.180,71				20.001,05	0,93%	2.166.181,76
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 17879-9	905.889,00				8.355,14	0,92%	914.244,14
Aplicações		12.816.896,72						13.255.537,99
Imóveis		0,00						0,00
Conta Corrente		0,00						14.058,19
Caixa 278-7		0,00						14.058,19
Banco do Brasil 17879-9		0,00						0,00
FINAL		12.816.896,72	387.859,02	0,00	0,00	50.782,25	0,38%	13.269.596,18

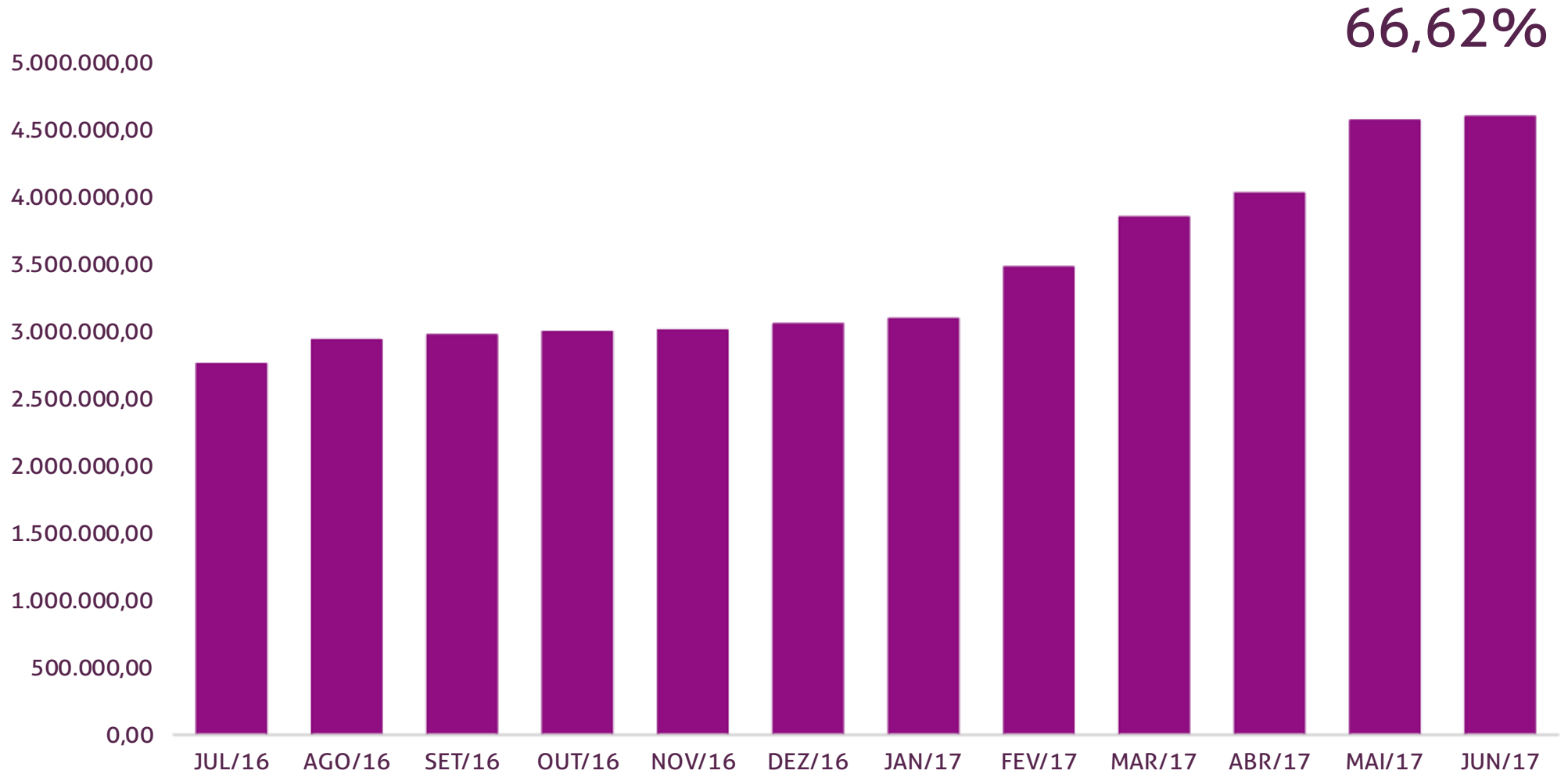
jun/17

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 17879-9	3.114.173,90	2.400.000,00	-1.200.000,00		28.516,31	0,66%	4.342.690,21
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 278-7	1.899.925,53	2.099.953,54			20.256,00	0,51%	4.020.135,07
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 278-7	974.130,56		-450.000,00		3.737,53	0,71%	527.868,09
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 17879-9	1.934.209,19		-1.200.000,00		6.495,47	0,88%	740.704,66
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 278-7	2.252.672,91		-1.300.000,00		-2.609,31	-0,27%	950.063,60
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 278-7	2.166.181,76				17.858,21	0,82%	2.184.039,97
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 17879-9	914.244,14				7.440,35	0,81%	921.684,49
Aplicações		13.255.537,99						13.687.186,09
Imóveis		0,00						0,00
Conta Corrente		14.058,19						5.864,35
Caixa 278-7		14.058,19						5.864,35
Banco do Brasil 17879-9		0,00						0,00
FINAL		13.269.596,18	4.499.953,54	-4.150.000,00	0,00	81.694,56	0,60%	13.693.050,44

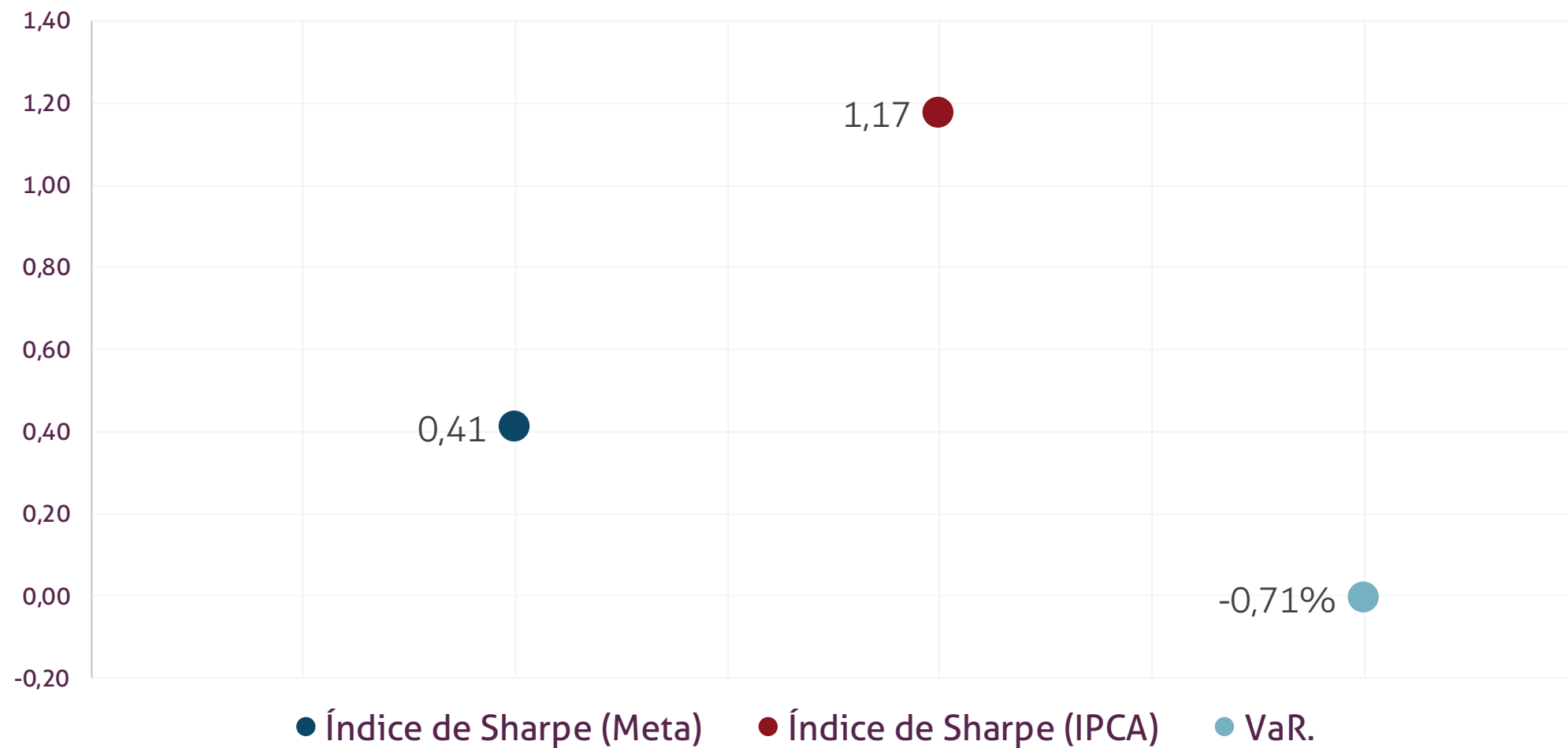


Evolução Patrimônio Líquido - Fundo IV

Jan	R\$	3.092.720,28	Fev	R\$	3.476.202,11	Mar	R\$	3.847.081,22	Abr	R\$	4.024.793,93
Mai	R\$	4.566.484,83	Jun	R\$	4.595.024,10	Jul			Ago		
Set			Out			Nov			Dez		



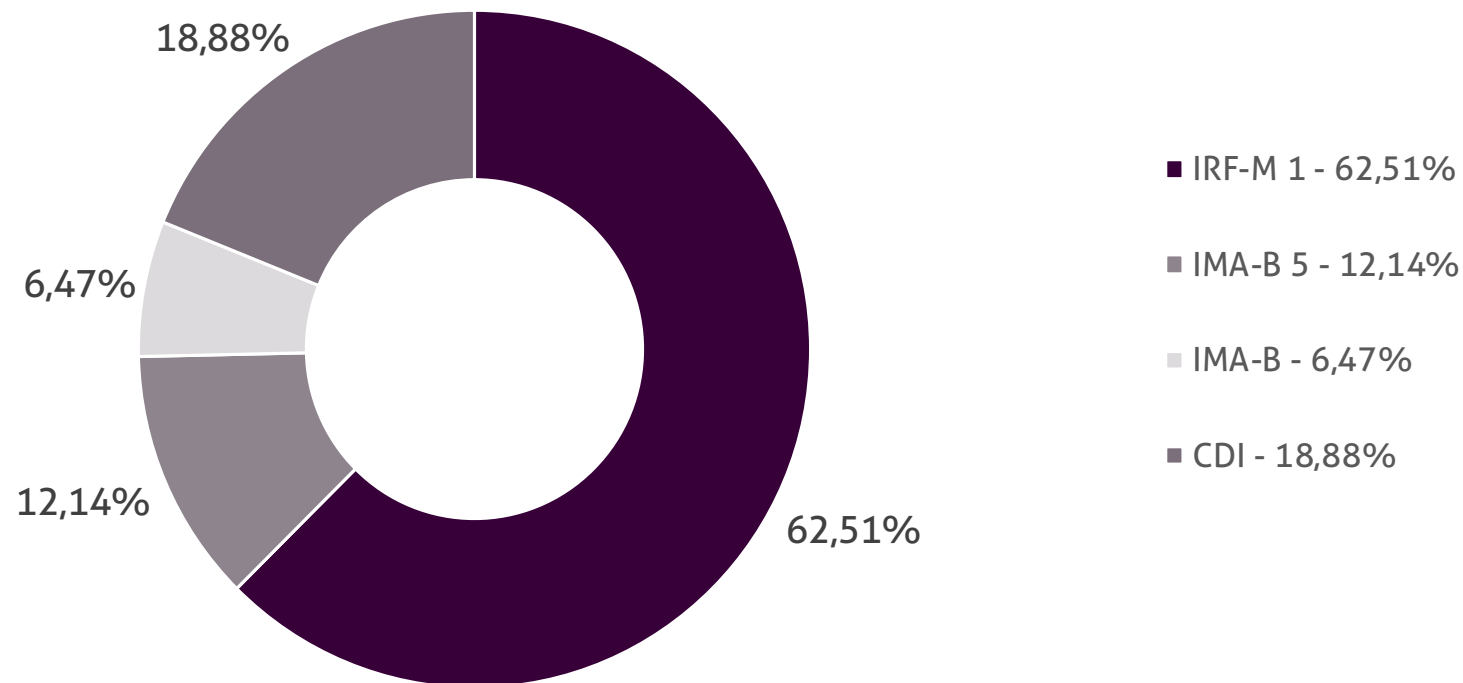
Índice de Sharpe e Var da Carteira



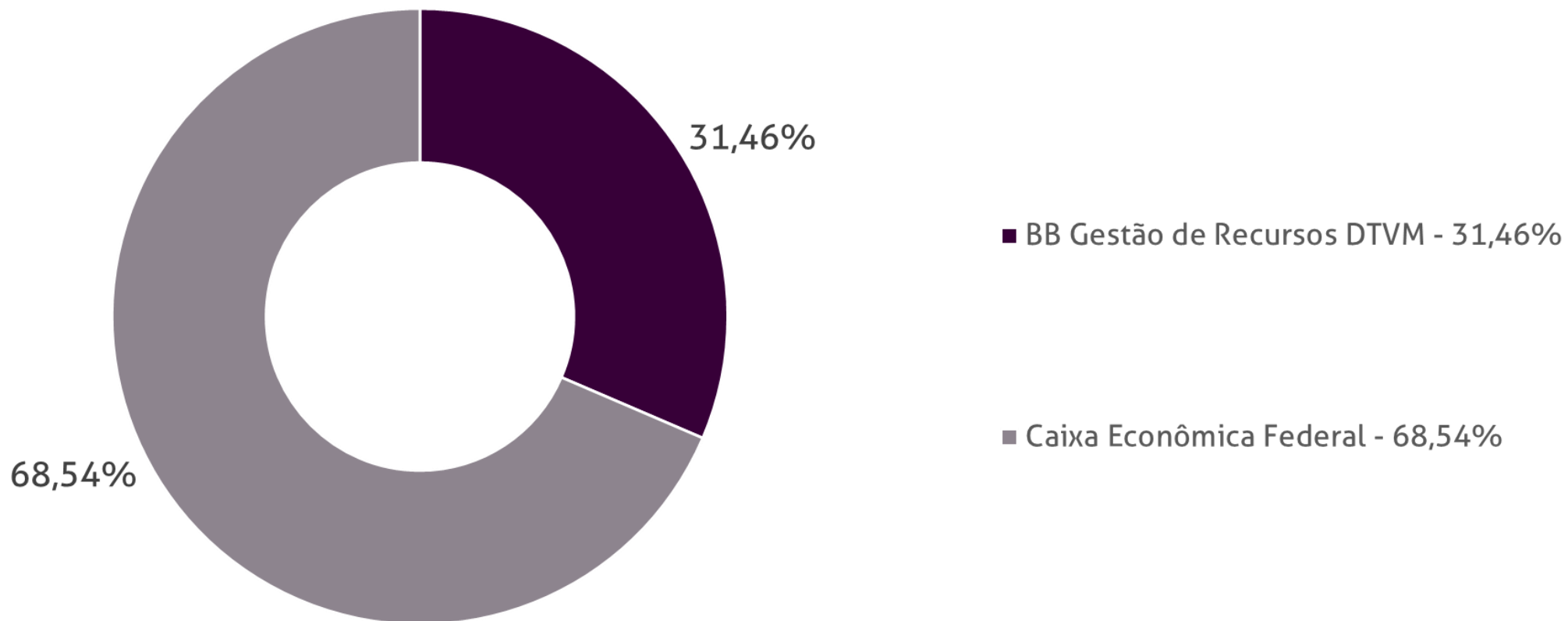


Fundos	CNPJ	Gestão	Taxa de Administração	Benchmark	Resgate
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.328.882/0001-35	BB Gestão de Recursos DTVM	0,10%	IRF-M 1	D+0
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.060.913/0001-10	Caixa Econômica Federal	0,20%	IMA-B 5	D+0
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	03.543.447/0001-03	BB Gestão de Recursos DTVM	0,20%	IMA-B 5	D+1
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	10.646.895/0001-90	Caixa Econômica Federal	0,20%	IMA-B	D+0
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	03.737.206/0001-97	Caixa Econômica Federal	0,20%	CDI	D+0
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.077.418/0001-49	BB Gestão de Recursos DTVM	0,20%	CDI	D+0
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.740.670/0001-06	Caixa Econômica Federal	0,20%	IRF-M 1	D+0

Distribuição por Indicador - Junho - 2017



Distribuição por Instituição - Junho - 2017



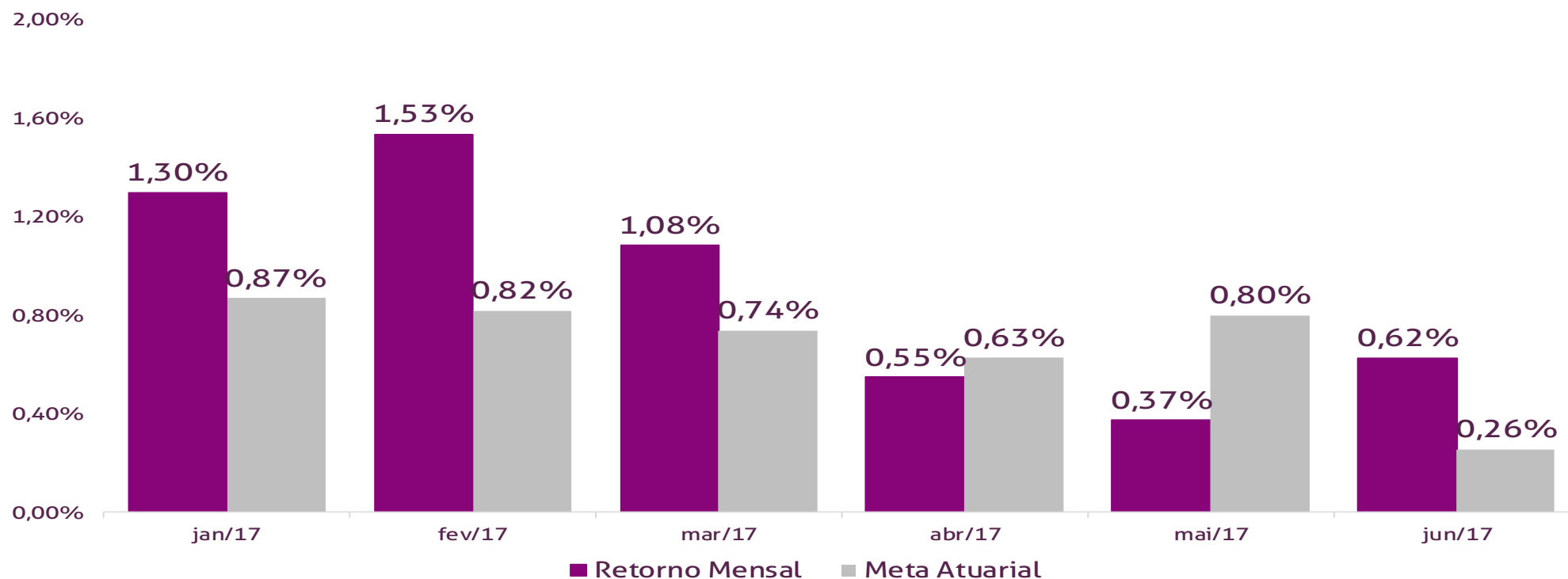


Performance Absoluta

	jan-17	fev-17	mar-17	abr-17	mai-17	jun-17
Carteira	1,30%	1,53%	1,08%	0,55%	0,37%	0,62%
Retorno Financeiro	39.595,39	52.540,75	41.242,09	21.908,76	16.935,14	28.539,27
Meta Atuarial	0,87%	0,82%	0,74%	0,63%	0,80%	0,26%

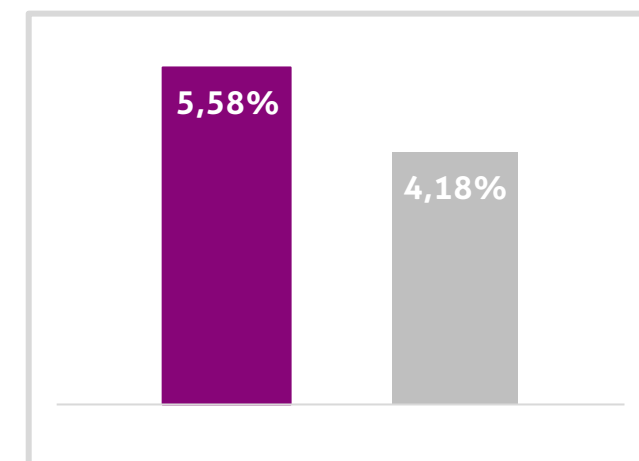
	jul-17	ago-17	set-17	out-17	nov-17	dez-17
Carteira						
Retorno Financeiro						
Meta Atuarial						

Retorno Mensal X Meta Atuarial Mensal



Estatística		
Meses positivos:	6	
Meses negativos:	0	
Meses acima da Meta Atuarial:	4	
Meses abaixo da Meta Atuarial:	2	
Retorno Mensal Máximo	1,53%	fev-17
Retorno Mensal Médio	0,91%	
Retorno Mensal Mínimo	0,37%	mai-17
Sharpe	0,41	
Volatilidade	8,07%	
VaR	-0,71%	
Meta Atuarial	IPCA + 6%	

Consolidado - 2017	
Carteira	5,58%
Retorno	R\$ 200.761,40
Meta	4,18%





jan/17

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 18272-9	563.567,80				7.100,96	1,26%	570.668,76
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 281-7	530.852,48				6.038,82	1,14%	536.891,30
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 18272-9	521.839,95				5.937,99	1,14%	527.777,94
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 281-7	616.159,82				11.634,12	1,89%	627.793,94
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 281-7	538.991,14				5.790,69	1,07%	544.781,83
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 18272-9	281.713,70				3.092,81	1,10%	284.806,51
Aplicações		3.053.124,89						3.092.720,28
Imóveis		0,00						0,00
Conta Corrente		0,00						0,00
Caixa 281-7		0,00						0,00
Banco do Brasil 18272-9		0,00						0,00
Final		3.053.124,89	0,00	0,00	0,00	39.595,39	1,30%	3.092.720,28

fev/17

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 18272-9	570.668,76				5.632,18	0,99%	576.300,94
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 281-7	536.891,30				7.933,33	1,48%	544.824,63
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 281-7	0,00	330.941,08			131,78	0,04%	331.072,86
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 18272-9	527.777,94				7.800,50	1,48%	535.578,44
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 281-7	627.793,94				23.707,33	3,78%	651.501,27
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 281-7	544.781,83				4.796,29	0,88%	549.578,12
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 18272-9	284.806,51				2.539,34	0,89%	287.345,85
Aplicações		3.092.720,28						3.476.202,11
Imóveis		0,00						0,00
Conta Corrente		0,00						0,00
Caixa 281-7		0,00						0,00
Banco do Brasil 18272-9		0,00						0,00
FINAL		3.092.720,28	330.941,08	0,00	0,00	52.540,75	1,53%	3.476.202,11

mar/17

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 18272-9	576.300,94				6.344,80	1,10%	582.645,74
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 281-7	544.824,63				7.503,87	1,38%	552.328,50
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 281-7	331.072,86	329.637,02			4.877,11	0,74%	665.586,99
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 18272-9	535.578,44				7.395,75	1,38%	542.974,19
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 281-7	651.501,27				6.184,52	0,95%	657.685,79
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 281-7	549.578,12				5.871,25	1,07%	555.449,37
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 18272-9	287.345,85				3.064,79	1,07%	290.410,64
Aplicações		3.476.202,11						3.847.081,22
Imóveis		0,00						0,00
Conta Corrente		0,00						0,00
Caixa 281-7		0,00						0,00
Banco do Brasil 18272-9		0,00						0,00
FINAL		3.476.202,11	329.637,02	0,00	0,00	41.242,09	1,08%	3.847.081,22



abr/17

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 18272-9	582.645,74				4.988,31	0,86%	587.634,05
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 281-7	552.328,50				3.846,43	0,70%	556.174,93
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 281-7	665.586,99	155.803,95			6.069,97	0,74%	827.460,91
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 18272-9	542.974,19				3.793,07	0,70%	546.767,26
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 281-7	657.685,79				-3.466,82	-0,53%	654.218,97
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 281-7	555.449,37				4.404,62	0,79%	559.853,99
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 18272-9	290.410,64				2.273,18	0,78%	292.683,82
Aplicações		3.847.081,22						4.024.793,93
Imóveis		0,00						0,00
Conta Corrente		0,00						0,00
Caixa 281-7		0,00						0,00
Banco do Brasil 18272-9		0,00						0,00
FINAL		3.847.081,22	155.803,95	0,00	0,00	21.908,76	0,55%	4.024.793,93

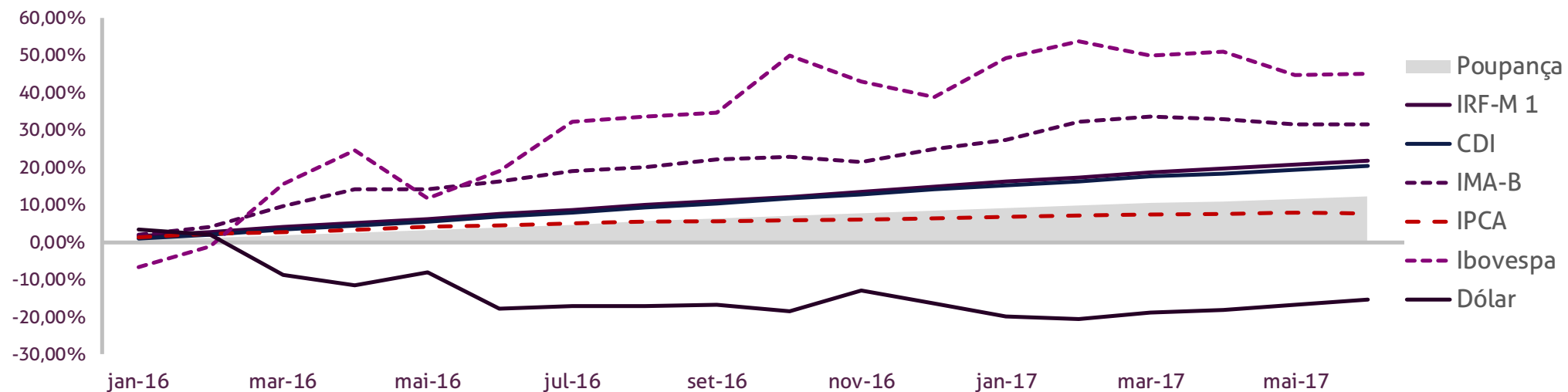
mai/17

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 18272-9	587.634,05				5.211,94	0,89%	592.845,99
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 281-7	556.174,93				471,10	0,08%	556.646,03
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 281-7	827.460,91	524.755,76			9.145,37	0,68%	1.361.362,04
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 18272-9	546.767,26				502,09	0,09%	547.269,35
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 281-7	654.218,97				-6.312,30	-0,96%	647.906,67
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 281-7	559.853,99				5.217,48	0,93%	565.071,47
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 18272-9	292.683,82				2.699,46	0,92%	295.383,28
Aplicações		4.024.793,93						4.566.484,83
Imóveis		0,00						0,00
Conta Corrente		0,00						0,00
Caixa 281-7		0,00						0,00
Banco do Brasil 18272-9		0,00						0,00
FINAL		4.024.793,93	524.755,76	0,00	0,00	16.935,14	0,37%	4.566.484,83

jun/17

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 18272-9	592.845,99	300.000,00			5.520,60	0,62%	898.366,59
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 281-7	556.646,03		-250.000,00		2.155,57	0,70%	308.801,60
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 281-7	1.361.362,04	600.000,00			12.507,27	0,64%	1.973.869,31
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 18272-9	547.269,35		-300.000,00		1.947,99	0,79%	249.217,34
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 281-7	647.906,67		-350.000,00		-654,57	-0,22%	297.252,10
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 281-7	565.071,47				4.658,51	0,82%	569.729,98
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 18272-9	295.383,28				2.403,90	0,81%	297.787,18
Aplicações		4.566.484,83						4.595.024,10
Imóveis		0,00						0,00
Conta Corrente		0,00						0,00
Caixa 281-7		0,00						0,00
Banco do Brasil 18272-9		0,00						0,00
FINAL		4.566.484,83	900.000,00	-900.000,00	0,00	28.539,27	0,62%	4.595.024,10

	IRF-M 1	CDI	IMA-B	IDKA 2	Poupança	IPCA	Ibovespa	Dólar	IPCA + 6%
2016	14,72%	13,99%	24,82%	13,75%	8,31%	6,29%	38,92%	-16,54%	12,67%
jul-16	1,04%	1,11%	2,51%	0,91%	0,66%	0,52%	11,22%	0,91%	1,01%
ago-16	1,19%	1,21%	0,89%	1,29%	0,76%	0,44%	1,03%	0,04%	0,93%
set-16	1,19%	1,11%	1,57%	1,50%	0,66%	0,08%	0,80%	0,18%	0,57%
out-16	0,94%	1,05%	0,64%	0,41%	0,66%	0,26%	11,23%	-2,01%	0,75%
nov-16	1,05%	1,04%	-1,22%	0,57%	0,64%	0,18%	-4,65%	6,78%	0,67%
dez-16	1,20%	1,12%	2,91%	1,28%	0,69%	0,30%	-2,71%	-4,05%	0,79%
jan-17	1,29%	1,08%	1,87%	1,09%	0,67%	0,38%	7,38%	-4,05%	0,87%
fev-17	1,01%	0,86%	3,85%	1,35%	0,53%	0,33%	3,08%	-0,89%	0,82%
mar-17	1,12%	1,05%	1,04%	1,62%	0,65%	0,25%	-2,52%	2,23%	0,74%
abr-17	0,87%	0,79%	-0,32%	0,92%	0,50%	0,14%	0,64%	0,95%	0,63%
mai-17	0,91%	0,93%	-1,19%	0,45%	0,58%	0,31%	-4,12%	1,42%	0,80%
jun-17	0,89%	0,81%	0,16%	0,79%	0,55%	-0,23%	0,30%	1,99%	0,26%
2017	6,24%	5,64%	5,46%	6,38%	3,53%	1,18%	4,43%	1,51%	4,18%



Europa

Primeira-ministra britânica Theresa May convocou em eleições antecipadas em abril com objetivo de estender sua base apoio no Parlamento e dar celeridade na saída do Reunião Unido da União Europeia. O resultado da eleição, entretanto, trouxe um parlamento heterogêneo, enfraquecendo a primeira-ministra para articular de acordo com suas preferências.

Será realizada no começo de julho a reunião dos países integrantes do G20 (20 maiores economias do mundo) em Hamburgo, Alemanha. Na oportunidade, EUA e Rússia se encontrarão para debater os escândalos envolvendo ambos os presidentes e os conflitos na Síria.

EUA

Relatório de criação de empregos apontou aumento de 138 mil postos de trabalho em maio. Apesar de o número ter sido menor do que nos dois meses anteriores, o mercado de trabalho segue em alta ao acumular a menor taxa de desemprego dos últimos 16 anos.

Em convergência com a melhora do cenário econômico norte-americano, o FED decidiu pelo aumento da taxa de juros em 0,25%. Agora a taxa básica de juros deverá oscilar no intervalo de 1% e 1,25%, intervalo este que não havia sido superado desde a crise deflagrada em 2008.

Brasil

No cenário político, o balanço do mês foi favorável para Temer que conseguiu absolvição no julgamento de sua chapa no TSE. Contudo, logo em seguida, o Procurador Geral da República Rodrigo Janot enviou ao STF, denúncias contra o presidente por crimes de corrupção passiva no caso JBS, além de outras denúncias. A ação era esperada pelo mercado como fator chave para o futuro do mandato do governante. Na forma como foi enviada, em acusações separadas, abriu-se espaço para maior grau de incerteza, por conta de maior complexidade e demora para o trâmite do processo. Caso foi encaminhado à Câmara de Deputados para ser votado, antes de ser julgado no STF.

Reforma trabalhista foi reprovada em votação na Comissão de Assuntos Sociais, após articulação contrária encabeçada por Renan Calheiros. O resultado, apesar de ter sido recebido de forma negativa, não afeta de fato a votação da Reforma no Senado. Em seguida, foi encaminhada para votação da Comissão de Constituição e Justiça, onde mantém perspectiva de ser aprovada.

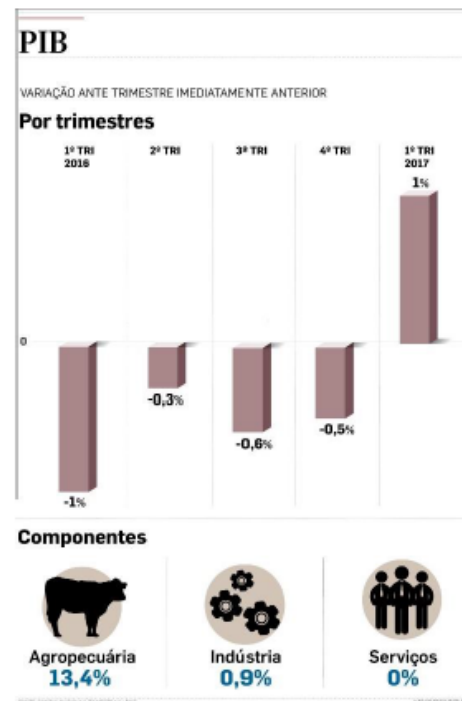
Em meio à escalada de incertezas, ex-ministro da Fazenda Antonio Palocci sinalizou fechamento de acordo de delação premiada, sugerindo envolvimento de instituições financeiras. Se confirmado, o mercado de juros deve sofrer com o aumento do risco. Apesar disso, o juiz Sérgio Moro entende que isso não passa de um blefe.

Mercado

Banco Central reduziu novamente a taxa Selic em 1 ponto no fim de maio. Apesar da continuidade do corte, alterou discurso indicando um corte menor nas próximas reuniões, dada a crise política. Posteriormente, Relatório Trimestral de Inflação incorporou as expectativas de queda maior para a inflação, dando abertura para corte de 1 p.p. na próxima reunião do Copom. Mesmo que o corte seja menor, aumentam as chances de não haver elevação de juros em 2018. Nesse sentido, o Conselho Monetário Nacional anunciou decisão sobre as metas de inflação para os próximos 3 anos, reduzindo-a para 4,25% em 2019 e 4,0% em 2020.

PIB do primeiro trimestre obteve crescimento de 1%, fortemente influenciado pelo agronegócio, atingindo crescimento de 13,4% após safra recorde no período. Indústria cresceu 0,9% e serviços seguiu estável.

O jornal Valor Econômico noticiou esse mês investimentos que estão sendo manejados no setor imobiliário, diante da perspectiva de melhora à frente. Segundo ele, a indústria de fundos imobiliários poderá dobrar nos próximos cinco anos, com bons ativos sendo negociados atualmente a preços baixos. O setor começa a se recuperar lentamente, ainda dependendo da retomada do emprego e da renda na economia. O grande desafio, entretanto, é o setor seguir se financiando diante da



fuga de capitais da poupança, principal fonte dos financiamentos para de ativos imobiliários.

Com a recente safra recorde de produtos agrícolas, o setor de agronegócio deverá deslanchar ainda mais. O governo federal anunciou neste mês o lançamento do Plano Safra, que visa a destinação de R\$ 190 bilhões de crédito aos médios e grandes produtores, com juros subsidiados. Além disso, o setor também se beneficia com a desvalorização do real, ocorrida depois da delação dos irmãos Batista.

Em busca de redução de dívidas, o grupo J&F (detentora da marca JBS) está em negociação de venda de parte de seus negócios. Recentemente, anunciou a negociação da sua participação na Alpargatas, empresa dona da marca Havaianas. No todo, o grupo pretende levantar até R\$ 15 bilhões com os desinvestimentos.



62 3924.6211
www.setecapital.com

Av. Olinda, 960,
Ed. Lozandes Corporate Design,
Sl. 806, Park Lozandes, Goiânia - GO - 74884-120