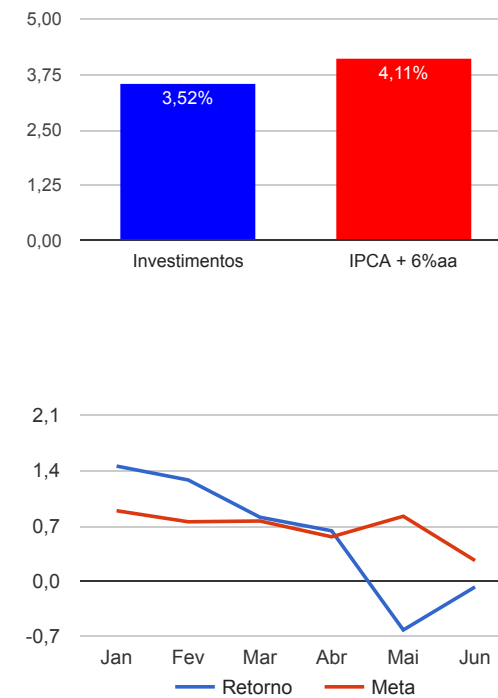


Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	1.300.119.362,13	58.020.888,99	49.377.703,20	1.327.799.154,52	19.036.606,60	1,45%	0,89%	163,43%	12,02%
Fevereiro	1.327.799.154,52	459.818.479,40	449.528.249,00	1.355.197.347,21	17.107.962,29	1,28%	0,75%	170,47%	1,83%
Março	1.355.197.347,21	13.909.451,33	5.412.001,58	1.374.708.020,26	11.013.223,30	0,81%	0,76%	105,64%	1,97%
Abril	1.374.708.020,26	59.796.315,64	52.959.155,27	1.390.331.824,53	8.786.643,90	0,64%	0,56%	114,05%	1,51%
Mai	1.390.331.824,53	325.545.529,53	316.581.189,47	1.390.643.499,69	-8.652.664,90	-0,62%	0,82%	-75,27%	8,62%
Junho	1.390.643.499,69	37.780.768,33	30.281.821,19	1.397.103.003,98	-1.039.442,85	-0,07%	0,26%	-29,08%	3,07%
Acumulado no ano					46.252.328,34	3,52%	4,11%	85,69%	
Acumulado no 2º Trimestre					-905.463,85	-0,06%	1,64%	-3,69%	

Acumulado no Ano



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de junho / 2017

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	247.868.364,06	0,00	0,00	251.558.582,96	3.690.218,90	1,49%	1,81%	1,49%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	45.298.069,46	0,00	0,00	45.897.544,98	599.475,52	1,32%	1,37%	1,32%
ITAÚ INSTITUCIONAL PRÉ-FIXADO FIC RENDA FIXA LP	80.502.974,43	0,00	18.000.000,00	63.497.481,02	994.506,59	1,24%	1,37%	1,33%
BMC FIDC SÊNIOR	3.888.782,40	0,00	112.463,44	3.823.756,91	47.437,95	1,22%	4,70%	-1,67%
ULTRA IMA-B FI RENDA FIXA	4.879.551,18	0,00	0,00	4.927.887,89	48.336,71	0,99%	0,20%	0,99%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	16.498.694,05	0,00	0,00	16.658.957,99	160.263,94	0,97%	0,83%	0,97%
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	24.608.779,17	0,00	0,00	24.845.961,54	237.182,37	0,96%	0,35%	0,96%
GGR PRIME I FIDC	42.728.722,66	0,00	0,00	43.124.341,20	395.618,54	0,93%	-	-
TRX CORPORATIVO I FIDC SÊNIOR	1.791.289,24	0,00	126.403,09	1.680.590,89	15.704,74	0,88%	9,55%	-6,18%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	17.602.028,08	0,00	0,00	17.754.493,93	152.465,85	0,87%	0,18%	0,87%
BNP PARIBAS TARGUS FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	20.875.725,03	0,00	0,00	21.052.807,61	177.082,58	0,85%	0,02%	0,85%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.278.339,17	0,00	0,00	1.288.877,92	10.538,75	0,82%	0,02%	0,82%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.057.533,23	0,00	0,00	2.074.277,95	16.744,72	0,81%	0,03%	0,81%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	2.828.130,01	0,00	0,00	2.850.833,55	22.703,54	0,80%	0,01%	0,80%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	43.613.282,35	19.780.768,33	6.042.954,66	57.836.893,05	485.797,03	0,77%	0,18%	0,87%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	35.047.152,64	18.000.000,00	0,00	53.421.962,75	374.810,11	0,71%	0,82%	0,97%
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.034.867,18	0,00	0,00	6.076.431,11	41.563,93	0,69%	0,82%	0,69%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	70.003.907,46	0,00	0,00	70.441.147,99	437.240,53	0,62%	0,73%	0,62%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	29.091.013,27	0,00	0,00	29.268.895,37	177.882,10	0,61%	0,76%	0,61%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	21.213.008,68	0,00	0,00	21.334.444,66	121.435,98	0,57%	1,00%	0,57%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	41.852.296,44	0,00	0,00	42.088.763,25	236.466,81	0,57%	0,51%	0,57%
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	49.915.566,82	0,00	0,00	50.129.757,49	214.190,67	0,43%	1,09%	0,40%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de junho / 2017

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	21.146.886,99	0,00	0,00	21.237.336,30	90.449,31	0,43%	0,69%	0,43%
TOWER BRIDGE II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	13.882.153,86	0,00	0,00	13.940.235,45	58.081,59	0,42%	2,97%	0,42%
SUL INVEST FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 6	20.630.810,23	0,00	0,00	20.691.360,48	60.550,25	0,29%	0,54%	0,29%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	11.729.702,50	0,00	0,00	11.752.009,10	22.306,60	0,19%	1,61%	0,19%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	117.519.241,60	0,00	0,00	117.435.316,42	-83.925,18	-0,07%	3,27%	-0,07%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	107.689.828,99	0,00	0,00	107.597.069,84	-92.759,15	-0,09%	3,29%	-0,09%
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL	15.621.228,70	0,00	0,00	4.058.192,68	-11.563.036,02	-74,02%	359,36%	-74,02%
Total Renda Fixa					-2.850.664,74	-0,25%	2,93%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de junho / 2017

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII - KNRE11	3.644.427,05	0,00	0,00	3.912.963,78	268.536,73	7,37%	20,08%	6,25%
TRX REALTY LOGÍSTICA RENDA I FII - TRXL11	600.000,00	0,00	0,00	617.000,00	17.000,00	2,83%	13,07%	-7,49%
KINEA PIPE FI AÇÕES	13.319.268,82	0,00	0,00	13.622.693,13	303.424,31	2,28%	6,06%	2,28%
APEX AÇÕES 30 FIC AÇÕES	25.383.583,73	0,00	0,00	25.914.347,49	530.763,76	2,09%	5,51%	2,09%
XP LONG SHORT 60 FIC MULTIMERCADO	10.723.587,31	0,00	0,00	10.944.990,76	221.403,45	2,06%	1,57%	2,06%
FRANKLIN TEMPLETON VALOR E FVL FI AÇÕES	17.816.164,46	0,00	0,00	18.032.109,11	215.944,65	1,21%	4,50%	1,21%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	6.542.236,98	0,00	0,00	6.614.700,05	72.463,07	1,11%	4,54%	1,11%
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	15.750.246,70	0,00	0,00	15.915.744,79	165.498,09	1,05%	0,38%	1,05%
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	22.897.470,01	0,00	0,00	23.075.823,40	178.353,39	0,78%	0,42%	0,78%
AZ LEGAN BRASIL FI AÇÕES	6.442.424,48	0,00	0,00	6.486.145,35	43.720,87	0,68%	5,96%	0,68%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	2.808.553,89	0,00	0,00	2.822.814,51	14.260,62	0,51%	5,12%	0,51%
INFRA REAL ESTATE FII - FINF11	21.162.009,59	0,00	0,00	21.213.982,63	51.973,04	0,25%	-	0,00%
JPM AÇÕES FIC AÇÕES	14.512.000,90	0,00	6.000.000,00	8.540.446,53	28.445,63	0,20%	5,57%	0,86%
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	15.677.837,64	0,00	0,00	15.683.343,68	5.506,04	0,04%	0,00%	0,04%
CAIXA CYRELA FIP	4.141.111,52	0,00	0,00	4.137.126,13	-3.985,39	-0,10%	0,00%	-0,10%
ÁTICO FLORESTAL - FIP	12.029.661,52	0,00	0,00	12.013.814,03	-15.847,49	-0,13%	0,00%	-0,13%
INFRA SANEAMENTO FIP	15.903.696,14	0,00	0,00	15.877.670,26	-26.025,88	-0,16%	-	-
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	14.320.993,87	0,00	0,00	14.293.288,86	-27.705,01	-0,19%	-	-
PACIFICO AÇÕES FIC AÇÕES	45.530.760,13	0,00	0,00	45.323.319,13	-207.441,00	-0,46%	5,70%	-0,46%
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FICFIP	3.739.535,07	0,00	0,00	3.714.468,08	-25.066,99	-0,67%	0,12%	-0,67%
Total Renda Variável					1.811.221,89	0,66%	3,75%	

Este relatório visa dar publicidade a Carteira de Investimentos do Ipresb, contendo as informações ref. ao 1º semestre de 2017, devendo ser aperfeiçoado em sua próximas publicações.