

Relatório Analítico dos Investimentos em dezembro, 4º Trimestre e ano de 2017



Carteira consolidada de investimentos - base (dezembro / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	6.647.249,16	1,79%	94	1,32%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	21.699.914,64	5,86%	349	1,71%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
DAYCOVAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+3	Não há	1.991.403,12	0,54%	161	3,79%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	18/08/2018	10.777.308,58	2,91%	100	0,90%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2030	1.465.725,45	0,40%	18	2,73%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.714.225,60	1,27%	297	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	2.343.267,23	0,63%	107	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	15.420.982,62	4,16%	167	1,33%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	16/05/2023	3.173.543,67	0,86%	52	1,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	15/05/2019	5.757.493,54	1,55%	11	6,44%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2020	2.038.476,57	0,55%	122	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BTG PACTUAL TESOURO IPCA LONGO FI RENDA FIXA	D+2	Não há	4.191.933,37	1,13%	590	6,48%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	2.510.949,44	0,68%	193	0,70%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	1.308.164,76	0,35%	116	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	22.044.621,72	5,95%	703	0,33%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2030	3.554.310,60	0,96%	26	1,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.025.504,37	0,55%	193	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	12.592.937,98	3,40%	223	0,39%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	6.632.278,56	1,79%	72	0,67%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	2.555.182,79	0,69%	1.150	3,87%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2018	1.978.593,00	0,53%	163	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	18.487.558,70	4,99%	588	0,41%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "

Carteira consolidada de investimentos - base (dezembro / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	3.339.444,98	0,90%	46	1,87%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.993.988,22	1,89%	619	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	D+5	Não há	12.150.367,83	3,28%	86	1,48%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	5.886.391,41	1,59%	1.402	0,09%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
WESTERN ASSET ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	661.051,83	0,18%	819	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	2.080.940,11	0,56%	748	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	19.311.472,91	5,21%	71	24,34%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	19.296.477,00	5,21%	102	1,33%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	20.998.687,79	5,67%	632	1,66%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	17.230.522,14	4,65%	62	1,19%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	23.920.611,81	6,46%	54	3,41%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	948.550,47	0,26%	76	0,29%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	21.424.684,62	5,78%	235	4,78%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	2.499.656,40	0,67%	100	1,10%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+30 a D+2880	Não há	3.372.022,83	0,91%	60	0,79%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
WESTERN ASSET CRÉDITO CORPORATIVO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+91	Não há	563.747,52	0,15%	2	0,88%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
RIO BRAVO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+1	Não há	560.437,44	0,15%	4.360	0,15%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	1.524.873,99	0,41%	3.378	0,36%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	4.722.462,02	1,28%	18.837	2,22%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou D+33	Não há	15.278.118,72	4,13%	1.923	3,42%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
WESTERN ASSET VALUATION FI AÇÕES	D+4	Não há	4.026.895,30	1,09%	13	3,75%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB PIPE FIC AÇÕES	D+4	03/06/2018	1.741.169,69	0,47%	43	1,47%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "

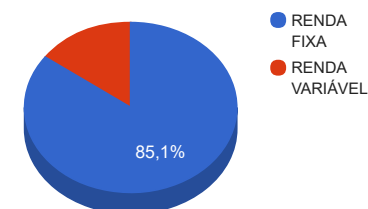
Carteira consolidada de investimentos - base (dezembro / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	D+12	Não há	8.023.066,65	2,17%	232	25,02%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	4.202.245,60	1,13%	264	0,66%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	D+33	Não há	2.721.063,02	0,73%	587	3,75%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
SANTANDER SELEÇÃO TOP FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.047.447,72	0,28%	4.229	0,21%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IBOVESPA CÍCLICO I FIC MULTIMERCADO	D+2	Não há	1.091.408,24	0,29%	1.291	1,25%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	D+5	Não há	1.506.848,04	0,41%	33	0,71%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	6.514.813,28	1,76%	9.642	0,69%	Artigo 8º, Inciso III
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	1.208.683,99	0,33%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se aplica	Não se aplica	1.605.000,00	0,43%		0,95%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
TOTAL -			370.364.777,04				

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

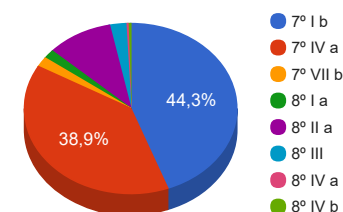
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	164.245.058,67	44,35%	30,00%	35,00%	70,00%	95.010.285,26
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	15,00%	20,00%	60,00%	222.218.866,22
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	143.909.757,92	38,86%	5,00%	5,00%	30,00%	-32.800.324,81
Artigo 7º, Inciso VI	0,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	55.554.716,56
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	18.518.238,85
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	6.995.864,19	1,89%	0,00%	2,50%	5,00%	11.522.374,66
Total Renda Fixa	100,00%	315.150.680,78	85,09%	55,00	75,00	185,00	-

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	6.247.336,01	1,69%	0,00%	0,00%	0,00%	-6.247.336,01
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	37.040.006,70	10,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-37.040.006,70
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	9.113.069,56	2,46%	5,00%	10,00%	15,00%	46.441.647,00
Artigo 8º, Inciso IV	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	18.518.238,85
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	1.208.683,99	0,33%	0,00%	0,00%	0,00%	-1.208.683,99
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	1.605.000,00	0,43%	0,00%	0,00%	0,00%	-1.605.000,00
Artigo 8º, Inciso V	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	18.518.238,85
Artigo 8º, Inciso VI	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	18.518.238,85
Total Renda Variável	30,00%	55.214.096,26	14,91%	11,00	25,00	34,00	-

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: dezembro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	164.245.058,67	44,35%	30,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	143.909.757,92	38,86%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	0,00	0,00%	5,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	6.995.864,19	1,89%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	315.150.680,78	85,09%	55,00	185,00

Artigos - Renda Variável	Base: dezembro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I	0,00	0,00%	0,00%	4,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	6.247.336,01	1,69%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	37.040.006,70	10,00%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso III	9.113.069,56	2,46%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	1.208.683,99	0,33%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	1.605.000,00	0,43%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso V	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Total Renda Variável	55.214.096,26	14,91%	11,00	34,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (dezembro / 2017)

Artigo 14º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR)

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	93.047.142,10	25,12%	0,03%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	89.815.558,79	24,25%	0,01%
ITAÚ UNIBANCO	54.449.856,42	14,70%	0,00%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	44.165.639,28	11,92%	0,00%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	28.633.753,77	7,73%	0,01%
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS	23.399.799,10	6,32%	0,07%
GERAÇÃO FUTURO	15.300.711,46	4,13%	0,09%
WESTERN ASSET	13.273.355,97	3,58%	0,03%
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	4.202.245,60	1,13%	0,01%
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	1.991.403,12	0,54%	0,09%
AZ QUEST INVESTIMENTOS	1.524.873,99	0,41%	0,01%
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	560.437,44	0,15%	0,04%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M	1,24%	15,20%	1,44%	6,42%	15,20%	42,12%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,19%	14,80%	1,27%	6,17%	14,80%	41,50%	0,20%	0,843%	4,59%
IDKA IPCA 2 Anos	1,16%	13,61%	2,24%	6,80%	13,61%	30,90%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,87%	12,34%	1,85%	6,25%	12,34%	29,13%	0,20%	0,454%	2,69%
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,70%	6,59%	-0,65%	3,27%	6,59%	17,46%	0,20%	0,291%	4,81%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,35%	10,19%	1,57%	4,46%	10,19%	24,79%	0,20%	0,130%	1,72%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,35%	10,21%	1,57%	4,47%	10,21%	-	0,20%	0,131%	1,74%
IPCA + 6,00% ao ano	0,91%	9,05%	2,58%	4,73%	9,05%	22,83%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,98%	13,56%	0,46%	7,40%	13,56%	38,55%	0,15%	1,196%	6,50%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,70%	2,99%	2,41%	1,41%	2,99%	10,08%	0,20%	0,111%	3,96%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,70%	8,95%	2,39%	4,28%	8,95%	23,16%	0,20%	0,111%	0,31%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,70%	11,86%	1,60%	5,67%	11,86%	29,52%	0,15%	0,326%	2,73%
IMA-B 5	0,88%	12,58%	1,48%	6,74%	12,58%	30,01%	-	-	-
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	0,87%	12,38%	1,45%	6,66%	12,38%	29,54%	0,10%	0,674%	3,50%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,87%	12,38%	1,42%	6,63%	12,38%	29,45%	0,20%	0,671%	3,50%
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	0,87%	12,66%	1,33%	6,76%	12,66%	29,92%	0,20%	0,722%	3,75%
DAYCOVAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,83%	12,07%	1,32%	6,35%	12,07%	28,17%	0,50%	0,672%	3,54%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA Geral	0,88%	12,82%	1,02%	5,88%	12,82%	36,50%	-	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	0,89%	13,07%	0,87%	5,97%	13,07%	37,36%	0,25%	0,757%	4,99%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,87%	12,59%	0,95%	5,67%	12,59%	36,17%	0,20%	0,702%	4,47%
IDKA IPCA 5 Anos	0,86%	14,12%	0,39%	7,69%	14,12%	37,82%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,03%	13,75%	0,94%	7,60%	13,75%	-	0,20%	1,077%	5,84%
IMA-B	0,83%	12,79%	-0,32%	6,96%	12,79%	40,78%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,05%	7,41%	1,61%	4,07%	7,41%	19,64%	0,20%	0,573%	5,61%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,90%	13,60%	0,68%	7,17%	13,60%	37,37%	0,20%	1,029%	5,71%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	0,85%	12,96%	-0,39%	7,01%	12,96%	40,80%	0,20%	1,450%	9,38%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	0,82%	12,25%	-0,47%	6,74%	12,25%	39,77%	0,50%	1,459%	9,46%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	0,81%	11,75%	-0,45%	6,69%	11,75%	38,54%	0,15%	1,467%	9,73%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,81%	12,52%	-0,38%	6,80%	12,52%	40,11%	0,20%	1,420%	9,25%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,77%	6,29%	-0,86%	3,85%	6,29%	29,93%	0,20%	1,786%	11,48%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,77%	6,48%	-0,87%	3,89%	6,48%	30,89%	0,20%	1,786%	11,44%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,75%	12,14%	1,47%	5,99%	12,14%	29,09%	0,20%	0,454%	3,25%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,60%	7,37%	-0,38%	3,96%	7,37%	24,37%	0,20%	1,374%	8,09%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,35%	4,26%	1,58%	1,65%	4,26%	13,21%	0,20%	0,131%	4,33%
IMA-B 5+	0,79%	12,75%	-1,63%	6,87%	12,75%	47,75%	-	-	-
BTG PACTUAL TESOURO IPCA LONGO FI RENDA FIXA	0,75%	12,39%	-1,73%	6,67%	12,39%	46,88%	0,20%	2,072%	12,15%
CDI	0,54%	9,93%	1,76%	4,05%	9,93%	25,31%	-	-	-
WESTERN ASSET ATIVO FI RENDA FIXA	0,74%	10,91%	1,57%	4,39%	10,91%	28,75%	0,40%	0,265%	1,34%
WESTERN ASSET CRÉDITO CORPORATIVO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,70%	11,36%	2,28%	5,12%	11,36%	24,24%	0,50%	0,071%	0,75%
RIO BRAVO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,54%	10,41%	1,78%	4,12%	10,41%	26,58%	0,45%	0,018%	0,16%
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,53%	10,10%	1,75%	4,10%	10,10%	25,55%	0,20%	0,007%	0,13%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,52%	9,94%	1,74%	4,01%	9,94%	25,33%	0,20%	0,021%	0,13%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,47%	9,05%	1,56%	3,63%	9,05%	23,28%	0,80%	0,006%	0,12%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,45%	8,87%	1,49%	3,51%	8,87%	23,14%	1,00%	0,010%	0,12%
IPCA	0,44%	2,95%	1,14%	1,74%	2,95%	9,42%	-	-	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1,02%	14,91%	1,62%	7,34%	14,91%	37,87%	0,20%	0,634%	4,22%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,80%	12,87%	0,97%	6,32%	12,87%	37,12%	0,40%	0,469%	5,77%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	0,80%	12,85%	0,97%	6,32%	12,85%	-	0,40%	0,468%	5,76%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,41%	9,42%	1,55%	4,00%	9,42%	27,86%	0,20%	0,118%	1,35%

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

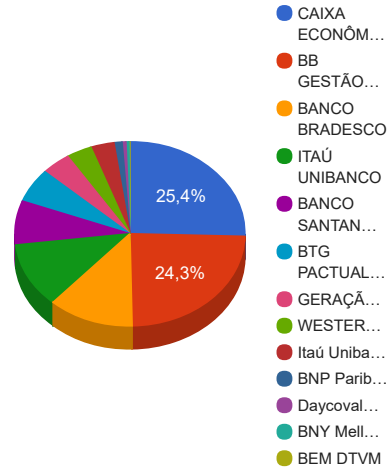
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
SMLL	7,03%	49,36%	2,89%	25,25%	49,36%	96,78%	-	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	5,02%	40,89%	0,99%	28,26%	40,89%	69,18%	2,00%	5,576%	20,19%
Ibovespa	6,16%	26,86%	2,84%	21,47%	26,86%	76,25%	-	-	-
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	5,79%	17,34%	0,46%	8,67%	17,34%	45,05%	2,00%	4,374%	10,08%
SANTANDER SELEÇÃO TOP FIC AÇÕES	5,51%	36,74%	2,79%	24,60%	36,74%	72,37%	2,00%	5,135%	17,96%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4,95%	29,72%	0,13%	17,07%	29,72%	53,49%	3,00%	4,667%	15,33%
WESTERN ASSET VALUATION FI AÇÕES	4,51%	23,81%	-1,77%	15,05%	23,81%	68,77%	2,50%	6,068%	16,33%
BB PIPE FIC AÇÕES	3,89%	30,82%	-0,12%	18,81%	30,82%	61,31%	1,20%	5,186%	15,92%
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	3,10%	0,90%	-4,11%	3,61%	0,90%	5,96%	4,00%	7,815%	19,07%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	2,81%	3,29%	-3,96%	4,58%	3,29%	12,13%	2,00%	7,543%	18,19%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IBOVESPA CÍCLICO I FIC MULTIMERCADO	1,54%	9,02%	1,83%	7,57%	9,02%	41,06%	1,60%	1,243%	4,43%
IDIV	4,94%	25,30%	-1,77%	16,88%	25,30%	101,09%	-	-	-
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	3,29%	22,49%	0,20%	14,12%	22,49%	44,87%	2,50%	4,437%	13,40%
IPCA + 8,00% ao ano	1,06%	11,08%	3,05%	5,70%	11,08%	27,47%	-	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	-	-	-	-	-	-	2,00%	-	-
S&P 500	0,98%	19,42%	6,12%	10,32%	19,42%	30,81%	-	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	1,71%	29,44%	7,96%	14,28%	29,44%	58,93%	1,00%	2,919%	6,33%

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

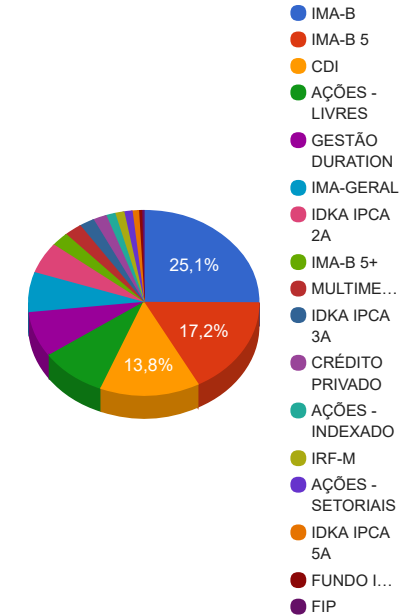
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	0,60%	19,41%	0,24%	7,34%	19,41%	58,02%	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	0,00%	4,90%	-2,72%	0,00%	4,90%	33,75%	1,20%	8,878%	23,30%
CDI	0,54%	9,93%	1,76%	4,05%	9,93%	25,31%	-	-	-
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	0,57%	8,66%	1,28%	4,15%	8,66%	27,66%	2,00%	0,807%	1,67%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	94.255.826,09	25,45%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	89.815.558,79	24,25%
BANCO BRADESCO	44.165.639,28	11,92%
ITAÚ UNIBANCO	42.299.488,59	11,42%
BANCO SANTANDER	28.633.753,77	7,73%
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS	22.191.115,11	5,99%
GERAÇÃO FUTURO	15.300.711,46	4,13%
WESTERN ASSET	13.273.355,97	3,58%
Itaú Unibanco S.A.	12.150.367,83	3,28%
BNP Paribas	4.202.245,60	1,13%
Daycoval Asset Management	1.991.403,12	0,54%
BNY Mellon Serviços Financeiros	1.524.873,99	0,41%
BEM DTVM	560.437,44	0,15%



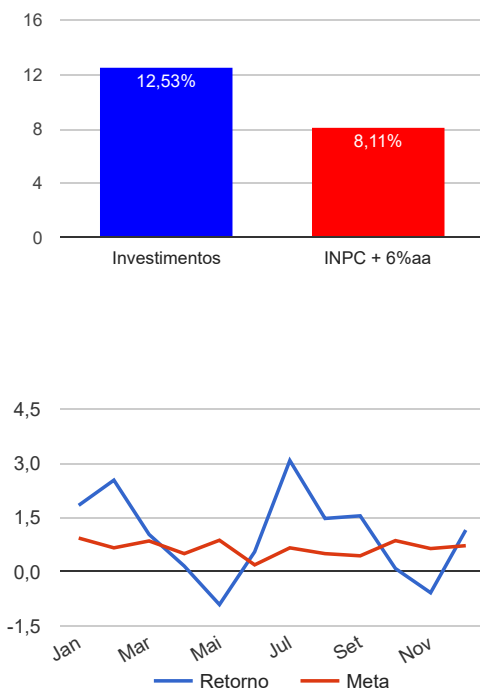
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	92.832.910,17	25,07%
IMA-B 5	63.599.288,16	17,17%
CDI	51.051.755,76	13,78%
AÇÕES - LIVRES	34.318.943,68	9,27%
GESTÃO DURATION	29.380.889,97	7,93%
IMA-GERAL	25.946.116,18	7,01%
IDKA IPCA 2A	20.282.246,24	5,48%
IMA-B 5+	9.211.969,42	2,49%
MULTIMERCADO	9.113.069,56	2,46%
IDKA IPCA 3A	7.795.970,11	2,10%
CRÉDITO PRIVADO	6.995.864,19	1,89%
AÇÕES - INDEXADO	4.722.462,02	1,28%
IRF-M	4.714.225,60	1,27%
AÇÕES - SETORIAIS	4.245.937,01	1,15%
IDKA IPCA 5A	3.339.444,98	0,90%
FUNDO IMOBILIÁRIO	1.605.000,00	0,43%
FIP	1.208.683,99	0,33%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	261.108.868,73	21.089.482,35	10.275.126,48	276.910.825,38	4.987.600,78	1,83%	0,93%	196,77%	2,94%
Fevereiro	276.910.825,38	13.599.502,76	8.670.949,49	288.966.546,61	7.127.167,96	2,53%	0,66%	384,27%	2,44%
Março	288.966.546,61	13.233.603,61	8.406.201,94	296.818.508,24	3.024.559,96	1,03%	0,85%	120,42%	2,23%
Abril	296.818.508,24	11.352.821,18	6.449.644,87	302.193.691,37	472.006,82	0,16%	0,50%	31,45%	1,88%
Mai	302.193.691,37	12.701.226,88	7.200.816,15	304.904.527,97	-2.789.574,13	-0,91%	0,87%	-103,99%	9,60%
Junho	304.904.527,97	13.784.904,33	8.658.620,03	311.736.959,56	1.706.147,29	0,55%	0,19%	296,99%	2,08%
Julho	311.736.959,56	10.705.529,18	5.660.510,55	326.513.320,18	9.731.341,99	3,07%	0,66%	467,16%	1,96%
Agosto	326.513.320,18	49.641.985,64	54.859.764,57	326.100.218,38	4.804.677,13	1,47%	0,50%	292,50%	1,69%
Setembro	326.100.218,38	27.322.132,26	11.475.736,40	347.225.431,52	5.278.817,28	1,54%	0,44%	348,14%	1,37%
Outubro	347.225.431,52	12.388.250,68	7.390.998,62	352.538.937,82	316.254,24	0,09%	0,86%	10,46%	1,83%
Novembro	352.538.937,82	11.480.615,88	6.234.614,36	355.711.146,70	-2.073.792,64	-0,58%	0,64%	-90,57%	2,08%
Dezembro	355.711.146,70	12.929.520,19	2.490.225,90	370.364.777,04	4.214.336,05	1,15%	0,72%	158,82%	1,35%
Acumulado no ano					36.799.542,73	12,53%	8,11%	154,48%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.658.854,80	0,00	0,00	4.714.225,60	55.370,80	1,19%	0,84%	1,19%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.318.885,12	0,00	0,00	2.343.267,23	24.382,11	1,05%	0,57%	1,05%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.305.401,50	0,00	0,00	3.339.444,98	34.043,48	1,03%	1,08%	1,03%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	3.337.894,64	0,00	0,00	3.372.022,83	34.128,19	1,02%	0,63%	1,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.142.857,52	0,00	0,00	3.173.543,67	30.686,15	0,98%	1,20%	0,98%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.587.951,92	0,00	0,00	6.647.249,16	59.297,24	0,90%	1,03%	0,90%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	23.709.421,38	0,00	0,00	23.920.611,81	211.190,43	0,89%	0,76%	0,89%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.933.636,87	0,00	0,00	6.993.988,22	60.351,35	0,87%	0,45%	0,87%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	21.512.742,77	0,00	0,00	21.699.914,64	187.171,87	0,87%	0,67%	0,87%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	21.854.745,51	0,00	0,00	22.044.621,72	189.876,21	0,87%	0,67%	0,87%
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	940.399,27	0,00	0,00	948.550,47	8.151,20	0,87%	0,72%	0,87%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.008.116,63	0,00	0,00	2.025.504,37	17.387,74	0,87%	0,70%	0,87%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	19.134.698,33	0,00	0,00	19.296.477,00	161.778,67	0,85%	1,45%	0,85%
DAYCOVAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.974.937,58	0,00	0,00	1.991.403,12	16.465,54	0,83%	0,67%	0,83%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	19.155.283,00	0,00	0,00	19.311.472,91	156.189,91	0,82%	1,46%	0,82%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	2.534.665,15	0,00	0,00	2.555.182,79	20.517,64	0,81%	1,47%	0,81%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	18.339.268,11	0,00	0,00	18.487.558,70	148.290,59	0,81%	1,42%	0,81%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	17.094.241,95	0,00	0,00	17.230.522,14	136.280,19	0,80%	0,47%	0,80%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	12.054.386,15	0,00	0,00	12.150.367,83	95.981,68	0,80%	0,47%	0,80%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.527.041,41	0,00	0,00	3.554.310,60	27.269,19	0,77%	1,79%	0,77%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.454.504,47	0,00	0,00	1.465.725,45	11.220,98	0,77%	1,79%	0,77%
BTG PACTUAL TESOURO IPCA LONGO FI RENDA FIXA	4.160.796,34	0,00	0,00	4.191.933,37	31.137,03	0,75%	2,07%	0,75%

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.306.498,87	0,00	0,00	15.420.982,62	114.483,75	0,75%	0,45%	0,75%
WESTERN ASSET ATIVO FI RENDA FIXA	656.167,20	0,00	0,00	661.051,83	4.884,63	0,74%	0,27%	0,74%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.964.790,00	0,00	0,00	1.978.593,00	13.803,00	0,70%	0,11%	0,70%
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.717.464,15	0,00	0,00	5.757.493,54	40.029,39	0,70%	0,29%	0,70%
WESTERN ASSET CRÉDITO CORPORATIVO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIV...	559.830,48	0,00	0,00	563.747,52	3.917,04	0,70%	0,07%	0,70%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.299.098,62	0,00	0,00	1.308.164,76	9.066,14	0,70%	0,11%	0,70%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.024.394,17	0,00	0,00	2.038.476,57	14.082,40	0,70%	0,33%	0,70%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.592.757,99	0,00	0,00	6.632.278,56	39.520,57	0,60%	1,37%	0,60%
RIO BRAVO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	557.431,83	0,00	0,00	560.437,44	3.005,61	0,54%	0,02%	0,54%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.070.101,01	0,00	0,00	2.080.940,11	10.839,10	0,52%	0,02%	0,52%
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	6.889.996,02	11.441,26	1.047.578,79	5.886.391,41	32.532,92	0,47%	0,01%	0,53%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	20.905.146,75	0,00	0,00	20.998.687,79	93.541,04	0,45%	0,01%	0,45%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	2.489.436,00	0,00	0,00	2.499.656,40	10.220,40	0,41%	0,12%	0,41%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	9.947.928,20	12.818.078,93	1.431.397,11	21.424.684,62	90.074,60	0,40%	0,01%	0,47%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.502.161,86	0,00	0,00	2.510.949,44	8.787,58	0,35%	0,13%	0,35%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.548.902,04	0,00	0,00	12.592.937,98	44.035,94	0,35%	0,13%	0,35%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.739.651,55	0,00	0,00	10.777.308,58	37.657,03	0,35%	0,13%	0,35%
Total Renda Fixa					2.287.649,33	0,73%	0,69%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	3.972.203,66	0,00	0,00	4.202.245,60	230.041,94	5,79%	4,37%	5,79%
SANTANDER SELEÇÃO TOP FIC AÇÕES	992.728,94	0,00	0,00	1.047.447,72	54.718,78	5,51%	5,14%	5,51%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	1.451.929,57	0,00	0,00	1.524.873,99	72.944,42	5,02%	5,58%	5,02%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	14.557.916,21	0,00	0,00	15.278.118,72	720.202,51	4,95%	4,67%	4,95%
WESTERN ASSET VALUATION FI AÇÕES	3.853.162,03	0,00	0,00	4.026.895,30	173.733,27	4,51%	6,07%	4,51%
BB PIPE FIC AÇÕES	1.676.011,41	0,00	0,00	1.741.169,69	65.158,28	3,89%	5,19%	3,89%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	2.634.508,79	0,00	0,00	2.721.063,02	86.554,23	3,29%	4,44%	3,29%
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	4.580.328,52	0,00	0,00	4.722.462,02	142.133,50	3,10%	7,82%	3,10%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	7.804.063,22	0,00	0,00	8.023.066,65	219.003,43	2,81%	7,54%	2,81%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.582.500,00	0,00	11.250,00	1.605.000,00	33.750,00	2,13%	8,88%	1,42%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	6.405.253,85	0,00	0,00	6.514.813,28	109.559,43	1,71%	2,92%	1,71%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IBOVESPA CÍCLICO I FIC MULTIMERCADO	1.074.847,53	0,00	0,00	1.091.408,24	16.560,71	1,54%	1,24%	1,54%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	1.498.238,37	0,00	0,00	1.506.848,04	8.609,67	0,57%	0,81%	0,57%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	1.114.967,44	100.000,00	0,00	1.208.683,99	-6.283,45	-0,52%	-	-
Total Renda Variável					1.926.686,72	3,62%	5,23%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre / 2017

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	21.388.961,62	0,00	0,00	21.699.914,64	310.953,02	1,45%	1,45%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	21.734.938,27	0,00	0,00	22.044.621,72	309.683,45	1,42%	1,42%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	20.605.088,89	85.120,38	0,00	20.998.687,79	308.478,52	1,49%	1,49%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.197.426,19	0,00	0,00	15.420.982,62	223.556,43	1,47%	1,47%
BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	23.713.379,86	0,00	0,00	23.920.611,81	207.231,95	0,87%	0,87%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	8.108.609,04	25.848.663,34	12.736.740,25	21.424.684,62	204.152,49	1,17%	1,56%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.397.440,86	0,00	0,00	12.592.937,98	195.497,12	1,58%	1,58%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.610.206,64	0,00	0,00	10.777.308,58	167.101,94	1,57%	1,57%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	17.065.684,63	0,00	0,00	17.230.522,14	164.837,51	0,97%	0,97%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.468.758,28	400.000,00	0,00	6.993.988,22	125.229,94	1,82%	1,85%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	11.075.782,81	961.151,51	0,00	12.150.367,83	113.433,51	0,94%	0,97%
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	6.101.653,68	2.703.481,52	3.021.601,39	5.886.391,41	102.857,60	1,43%	1,75%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.654.948,50	0,00	0,00	4.714.225,60	59.277,10	1,27%	1,27%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	3.318.327,02	0,00	0,00	3.372.022,83	53.695,81	1,62%	1,62%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.932.060,00	0,00	0,00	1.978.593,00	46.533,00	2,41%	2,41%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.602.180,52	0,00	0,00	6.647.249,16	45.068,64	0,68%	0,68%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.472.066,18	0,00	0,00	2.510.949,44	38.883,26	1,57%	1,57%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	2.461.397,40	0,00	0,00	2.499.656,40	38.259,00	1,55%	1,55%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.306.107,29	0,00	0,00	2.343.267,23	37.159,94	1,61%	1,61%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.283.109,76	0,00	238.626,86	2.080.940,11	36.457,21	1,71%	1,74%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.006.300,03	0,00	0,00	2.038.476,57	32.176,54	1,60%	1,60%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.308.251,76	0,00	0,00	3.339.444,98	31.193,22	0,94%	0,94%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre / 2017

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.277.577,79	0,00	0,00	1.308.164,76	30.586,97	2,39%	2,39%
DAYCOVAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.965.488,81	0,00	0,00	1.991.403,12	25.914,31	1,32%	1,32%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.006.502,02	0,00	0,00	2.025.504,37	19.002,35	0,95%	0,95%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.244.431,80	0,00	85.120,38	3.173.543,67	14.232,25	0,46%	0,46%
WESTERN ASSET CRÉDITO CORPORATIVO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIV...	551.173,27	0,00	0,00	563.747,52	12.574,25	2,28%	2,28%
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	936.103,10	0,00	0,00	948.550,47	12.447,37	1,33%	1,33%
WESTERN ASSET ATIVO FI RENDA FIXA	650.853,43	0,00	0,00	661.051,83	10.198,40	1,57%	1,57%
RIO BRAVO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	550.654,65	0,00	0,00	560.437,44	9.782,79	1,78%	1,78%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	2.566.817,24	0,00	0,00	2.555.182,79	-11.634,45	-0,45%	-0,45%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.478.560,33	0,00	0,00	1.465.725,45	-12.834,88	-0,87%	-0,87%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.657.369,18	0,00	0,00	6.632.278,56	-25.090,62	-0,38%	-0,38%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.585.266,01	0,00	0,00	3.554.310,60	-30.955,41	-0,86%	-0,86%
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.795.330,99	0,00	0,00	5.757.493,54	-37.837,45	-0,65%	-0,65%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	18.557.248,23	0,00	0,00	18.487.558,70	-69.689,53	-0,38%	-0,38%
BGT PACTUAL TESOURO IPCA LONGO FI RENDA FIXA	4.265.839,30	0,00	0,00	4.191.933,37	-73.905,93	-1,73%	-1,73%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	18.575.529,38	800.000,00	0,00	19.296.477,00	-79.052,38	-0,41%	-0,39%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	19.402.010,80	0,00	0,00	19.311.472,91	-90.537,89	-0,47%	-0,47%
Total Renda Fixa					2.554.917,35	0,82%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre / 2017

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	5.543.559,96	500.000,00	0,00	6.514.813,28	471.253,32	7,80%	7,96%
SANTANDER SELEÇÃO TOP FIC AÇÕES	1.019.028,17	0,00	0,00	1.047.447,72	28.419,55	2,79%	2,79%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	0,00	1.499.985,00	0,00	1.524.873,99	24.888,99	1,66%	0,99%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IBOVESPA CÍCLICO I FIC MULTIMERCADO	1.071.767,92	0,00	0,00	1.091.408,24	19.640,32	1,83%	1,83%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	4.183.084,42	0,00	0,00	4.202.245,60	19.161,18	0,46%	0,46%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	0,00	1.499.985,00	0,00	1.506.848,04	6.863,04	0,46%	1,28%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	14.472.166,79	800.000,00	0,00	15.278.118,72	5.951,93	0,04%	0,13%
BB PIPE FIC AÇÕES	1.743.192,26	0,00	0,00	1.741.169,69	-2.022,57	-0,12%	-0,12%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	1.932.008,23	800.000,00	0,00	2.721.063,02	-10.945,21	-0,40%	0,20%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.649.955,00	0,00	33.750,00	1.605.000,00	-11.205,00	-0,66%	-2,72%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	1.127.722,60	100.000,00	0,00	1.208.683,99	-19.038,61	-1,64%	-
WESTERN ASSET VALUATION FI AÇÕES	3.324.679,52	800.000,00	0,00	4.026.895,30	-97.784,22	-2,37%	-1,77%
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	4.924.681,45	0,00	0,00	4.722.462,02	-202.219,43	-4,11%	-4,11%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	8.354.149,64	0,00	0,00	8.023.066,65	-331.082,99	-3,96%	-3,96%
Total Renda Variável					-98.119,70	-0,22%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no Ano de 2017

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	17.146.770,34	2.500.000,00	0,00	22.044.621,72	2.397.851,38	12,20%	12,38%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	19.194.171,51	118.694,07	0,00	21.699.914,64	2.387.049,06	12,38%	12,38%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	15.248.527,91	2.056.082,23	0,00	19.311.472,91	2.006.862,77	11,92%	12,25%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	15.265.227,69	0,00	0,00	17.230.522,14	1.965.294,45	12,87%	12,87%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	11.810.341,85	5.621.683,88	0,00	19.296.477,00	1.864.451,27	12,26%	12,96%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.552.980,43	0,00	845.149,26	15.420.982,62	1.713.151,45	12,10%	12,14%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.728.780,64	0,00	16.421.465,58	0,00	1.692.684,94	11,49%	12,17%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	8.718.059,12	13.729.138,95	0,00	23.920.611,81	1.473.413,74	12,50%	13,07%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.364.999,92	6.716.279,56	0,00	18.487.558,70	1.406.279,22	11,99%	12,52%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.077.866,05	0,00	682.249,17	12.592.937,98	1.197.321,10	10,20%	4,26%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.353.888,85	0,00	600.531,01	10.777.308,58	1.023.950,74	10,18%	10,21%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	8.017.835,29	4.736.718,35	13.729.138,94	0,00	974.585,30	10,06%	12,39%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.174.800,07	0,00	344.845,52	6.647.249,16	817.294,61	13,55%	13,60%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.177.016,81	0,00	348.849,19	6.632.278,56	804.110,94	13,27%	7,37%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	3.728.152,74	93.054.782,21	76.138.781,88	21.424.684,62	780.531,55	5,87%	9,05%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.218.977,41	19.879.727,45	2.842.433,78	20.998.687,79	742.416,71	9,86%	8,87%
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.682.094,81	0,00	6.360.197,33	0,00	678.102,52	11,93%	11,62%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.587.303,24	2.742.158,21	0,00	6.993.988,22	664.526,77	12,16%	12,34%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	1.389.132,16	10.275.947,85	0,00	12.150.367,83	485.287,82	12,12%	12,85%
ITAÚ IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	2.671.900,04	2.237.388,15	5.378.217,68	0,00	468.929,49	9,86%	12,16%
BTG PACTUAL TESOURO IPCA LONGO FI RENDA FIXA	3.729.730,81	0,00	0,00	4.191.933,37	462.202,56	12,39%	12,39%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	4.284.030,49	0,00	4.714.225,60	430.195,11	12,06%	14,80%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no Ano de 2017

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.100.358,31	0,00	175.210,97	3.339.444,98	414.297,64	13,70%	13,75%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.344.038,15	0,00	188.003,94	3.554.310,60	398.276,39	12,08%	6,29%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.948.696,88	0,00	169.313,41	3.173.543,67	394.160,20	13,61%	13,56%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1.609.905,41	1.400.000,00	0,00	3.372.022,83	362.117,42	15,08%	14,91%
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.401.348,90	0,00	0,00	5.757.493,54	356.144,64	6,59%	6,59%
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	934.243,14	13.151.819,22	8.541.784,23	5.886.391,41	342.113,28	7,00%	10,10%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.181.633,82	0,00	124.793,21	2.343.267,23	286.426,62	13,50%	7,41%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	1.952.906,26	356.082,23	0,00	2.555.182,79	246.194,30	11,61%	11,75%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.411.418,44	0,00	138.555,35	2.510.949,44	238.086,35	10,16%	10,19%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.926.953,28	0,00	110.082,10	2.038.476,57	221.605,39	11,83%	11,86%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	2.284.381,80	0,00	0,00	2.499.656,40	215.274,60	9,42%	9,42%
DAYCOVAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.776.864,69	0,00	0,00	1.991.403,12	214.538,43	12,07%	12,07%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.626.634,71	524.621,61	238.626,86	2.080.940,11	168.310,65	9,78%	9,94%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.921.153,50	0,00	109.318,94	1.978.593,00	166.758,44	8,97%	2,99%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.376.474,15	0,00	75.023,71	1.465.725,45	164.275,01	12,10%	6,48%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	787.913,72	1.101.000,00	0,00	2.025.504,37	136.590,65	11,21%	12,59%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.270.799,15	0,00	72.415,73	1.308.164,76	109.781,34	8,92%	8,95%
BRANCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	0,00	919.728,55	0,00	948.550,47	28.821,92	3,13%	12,66%
WESTERN ASSET CRÉDITO CORPORATIVO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIV...	0,00	550.000,00	0,00	563.747,52	13.747,52	2,50%	11,36%
WESTERN ASSET ATIVO FI RENDA FIXA	0,00	650.000,00	0,00	661.051,83	11.051,83	1,70%	10,91%
RIO BRAVO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,00	550.000,00	0,00	560.437,44	10.437,44	1,90%	10,41%
Total Renda Fixa					30.935.503,56	12,08%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no Ano de 2017

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	9.606.360,84	2.610.280,45	0,00	15.278.118,72	3.061.477,43	29,36%	29,72%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	0,00	5.865.866,04	0,00	6.514.813,28	648.947,24	16,91%	29,44%
BB PIPE FIC AÇÕES	1.330.934,78	0,00	0,00	1.741.169,69	410.234,91	30,82%	30,82%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	0,00	3.846.866,04	0,00	4.202.245,60	355.379,56	13,14%	17,34%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	1.203.147,08	1.195.488,66	0,00	2.721.063,02	322.427,28	21,99%	22,49%
WESTERN ASSET VALUATION FI AÇÕES	0,00	3.733.866,04	0,00	4.026.895,30	293.029,26	14,71%	23,81%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	7.110.689,11	651.354,70	0,00	8.023.066,65	261.022,84	3,70%	3,29%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.530.000,00	0,00	138.221,57	1.605.000,00	213.221,57	14,43%	4,90%
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	8.610.155,03	0,00	4.000.000,00	4.722.462,02	112.306,99	0,95%	0,90%
SANTANDER SELEÇÃO TOP FIC AÇÕES	0,00	950.000,00	0,00	1.047.447,72	97.447,72	14,55%	36,74%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IBOVESPA CÍCLICO I FIC MULTIMERCADO	0,00	1.000.000,00	0,00	1.091.408,24	91.408,24	9,14%	9,02%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	0,00	1.499.985,00	0,00	1.524.873,99	24.888,99	1,66%	40,89%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	0,00	1.499.985,00	0,00	1.506.848,04	6.863,04	0,46%	8,66%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	1.023.299,89	220.000,00	0,00	1.208.683,99	-34.615,90	-3,02%	-
Total Renda Variável					5.864.039,17	15,65%	