

Relatório Analítico dos Investimentos em setembro e 3º Trimestre de 2017



Carteira consolidada de investimentos - base (setembro / 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 IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2020	2.006.300,03	0,58%	122	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	15.197.426,19	4,38%	167	1,33%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	18.557.248,23	5,34%	613	0,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	2.566.817,24	0,74%	1.788	2,99%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2030	1.478.560,33	0,43%	18	2,73%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	5.795.330,99	1,67%	11	6,44%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.654.948,50	1,34%	303	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	2.472.066,18	0,71%	193	0,70%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	3.308.251,76	0,95%	46	1,87%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	12.397.440,86	3,57%	222	0,39%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BTG PACTUAL TESOURO IPCA LONGO FI RENDA FIXA	D+2	Não há	4.265.839,30	1,23%	650	6,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.006.502,02	0,58%	205	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	21.388.961,62	6,16%	349	1,64%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	18/08/2018	10.610.206,64	3,06%	100	0,90%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	21.734.938,27	6,26%	711	0,35%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
DAYCOVAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+3	Não há	1.965.488,81	0,57%	137	3,71%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2030	3.585.266,01	1,03%	26	1,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	6.657.369,18	1,92%	72	0,67%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	2.306.107,29	0,66%	107	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.468.758,28	1,86%	601	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	6.602.180,52	1,90%	94	1,32%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	936.103,10	0,27%	77	0,31%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "

Carteira consolidada de investimentos - base (setembro / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BRABESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	23.713.379,86	6,83%	53	3,29%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	19.402.010,80	5,59%	69	24,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRABESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	18.575.529,38	5,35%	103	1,09%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
WESTERN ASSET ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	650.853,43	0,19%	841	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	16/05/2023	3.244.431,80	0,93%	52	1,12%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2018	1.932.060,00	0,56%	163	0,15%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	17.065.684,63	4,91%	62	1,12%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	8.108.609,04	2,34%	229	2,35%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	1.277.577,79	0,37%	116	0,26%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	2.283.109,76	0,66%	776	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	D+5	Não há	11.075.782,81	3,19%	66	2,24%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	20.605.088,89	5,93%	642	1,73%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	6.101.653,68	1,76%	1.398	0,09%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
WESTERN ASSET CRÉDITO CORPORATIVO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+91	Não há	551.173,27	0,16%	2	0,88%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	2.461.397,40	0,71%	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	3.318.327,02	0,96%	61	0,77%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
RIO BRAVO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+1	Não há	550.654,65	0,16%	3.820	0,14%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	4.924.681,45	1,42%	19.854	1,39%	Artigo 8º, Inciso I
BB PIPE FIC AÇÕES	D+4	03/06/2018	1.743.192,26	0,50%	43	1,47%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	D+12	Não há	8.354.149,64	2,41%	297	19,57%	Artigo 8º, Inciso III
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	4.183.084,42	1,20%	230	0,62%	Artigo 8º, Inciso III
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou D+33	Não há	14.472.166,79	4,17%	1.061	3,61%	Artigo 8º, Inciso III

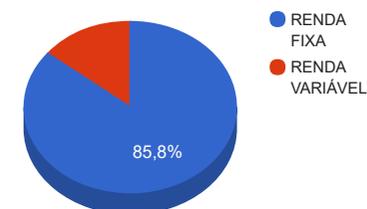
Carteira consolidada de investimentos - base (setembro / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
SANTANDER SELEÇÃO TOP FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.019.028,17	0,29%	2.313	0,40%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET VALUATION FI AÇÕES	D+4	Não há	3.324.679,52	0,96%	13	3,18%	Artigo 8º, Inciso III
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	D+33	Não há	1.932.008,23	0,56%	383	2,64%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IBOVESPA CÍCLICO I FIC MULTIMERCADO	D+2	Não há	1.071.767,92	0,31%	1.335	1,21%	Artigo 8º, Inciso IV
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	5.543.559,96	1,60%	4.790	1,18%	Artigo 8º, Inciso IV
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	1.127.722,60	0,32%			Artigo 8º, Inciso V
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se aplica	Não se aplica	1.649.955,00	0,48%		0,95%	Artigo 8º, Inciso VI
		TOTAL -	347.225.431,52				

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

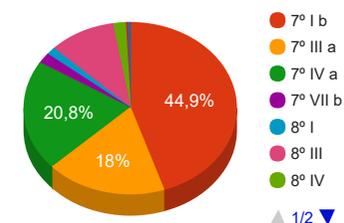
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	156.026.008,25	44,94%	30,00%	35,00%	70,00%	87.031.793,81
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	62.627.023,14	18,04%	15,00%	20,00%	60,00%	145.708.235,77
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	72.344.851,83	20,84%	5,00%	5,00%	30,00%	31.822.777,63
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	52.083.814,73
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	17.361.271,58
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	6.881.552,34	1,98%	0,00%	2,50%	5,00%	10.479.719,24
Total Renda Fixa	100,00%	297.879.435,56	85,79%	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	30,00%	4.924.681,45	1,42%	0,00%	0,00%	4,00%	8.964.335,81
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	35.028.309,03	10,09%	5,00%	10,00%	15,00%	17.055.505,70
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	6.615.327,88	1,91%	2,00%	5,00%	5,00%	10.745.943,70
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	1.127.722,60	0,32%	2,00%	5,00%	5,00%	16.233.548,98
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	1.649.955,00	0,48%	2,00%	5,00%	5,00%	15.711.316,58
Total Renda Variável	30,00%	49.345.995,96	14,21%	11,00	25,00	34,00	-

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: setembro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	156.026.008,25	44,94%	30,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	62.627.023,14	18,04%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	72.344.851,83	20,84%	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 "	6.881.552,34	1,98%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	297.879.435,56	85,79%	55,00	185,00

Artigos - Renda Variável	Base: setembro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I	4.924.681,45	1,42%	0,00%	4,00%
Artigo 8º, Inciso III	35.028.309,03	10,09%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	6.615.327,88	1,91%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	1.127.722,60	0,32%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	1.649.955,00	0,48%	2,00%	5,00%
Total Renda Variável	49.345.995,96	14,21%	11,00	34,00

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5+	2,40%	14,62%	8,64%	5,79%	17,29%	57,99%	-	-	-
BTG PACTUAL TESOURO IPCA LONGO FI RENDA FIXA	2,38%	14,37%	8,55%	5,64%	16,82%	56,96%	0,20%	2,007%	12,89%
IMA-B	1,81%	13,16%	7,30%	5,86%	15,76%	48,59%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,95%	7,21%	4,76%	2,39%	9,84%	37,87%	0,20%	1,578%	12,18%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,95%	7,42%	4,80%	2,42%	10,05%	38,90%	0,20%	1,577%	12,14%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	1,83%	13,41%	7,43%	5,91%	16,15%	48,50%	0,20%	1,376%	9,96%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	1,82%	12,78%	7,24%	5,54%	15,30%	47,55%	0,50%	1,378%	10,01%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,78%	12,94%	7,21%	5,71%	15,46%	47,78%	0,20%	1,328%	9,80%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	1,78%	12,25%	7,18%	4,95%	14,94%	46,61%	0,15%	1,393%	10,28%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,46%	7,78%	4,36%	4,21%	9,73%	31,14%	0,20%	1,293%	8,54%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,28%	12,82%	6,44%	6,88%	15,13%	-	0,20%	0,963%	6,14%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,12%	5,71%	2,42%	3,75%	7,94%	24,10%	0,20%	0,663%	5,89%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,88%	10,51%	4,45%	5,97%	12,92%	33,75%	0,20%	0,487%	3,55%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,50%	2,65%	0,07%	2,15%	4,86%	17,80%	0,20%	0,279%	4,41%
IRF-M	1,48%	13,57%	4,92%	7,23%	17,44%	43,51%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,44%	13,36%	4,83%	7,06%	17,22%	43,02%	0,20%	1,010%	4,86%
IDKA IPCA 5 Anos	1,35%	13,67%	7,27%	7,35%	16,06%	44,97%	-	-	-

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,22%	12,68%	6,59%	6,94%	15,04%	-	0,20%	1,007%	6,27%
IMA Geral	1,33%	11,68%	4,82%	5,99%	14,81%	40,15%	-	-	-
BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	1,37%	12,09%	5,05%	6,04%	15,38%	41,26%	0,25%	0,817%	5,29%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,28%	11,53%	4,68%	5,95%	14,83%	39,64%	0,20%	0,749%	4,75%
IMA-B 5	1,01%	10,94%	5,18%	6,58%	13,45%	34,82%	-	-	-
BRASESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	1,02%	11,18%	5,36%	6,61%	13,68%	34,84%	0,20%	0,708%	3,92%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	0,99%	10,77%	5,13%	6,45%	13,24%	34,28%	0,10%	0,648%	3,64%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,99%	10,80%	5,13%	6,49%	13,27%	34,14%	0,20%	0,646%	3,63%
DAYCOVAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,95%	10,62%	4,97%	6,26%	12,90%	32,88%	0,50%	0,645%	3,72%
IDKA IPCA 2 Anos	0,91%	11,13%	4,46%	6,74%	13,66%	34,61%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,89%	10,30%	4,32%	6,24%	12,77%	33,38%	0,20%	0,491%	2,83%
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,73%	7,29%	3,95%	3,07%	6,38%	-	0,20%	0,403%	5,09%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,50%	8,48%	2,84%	4,98%	10,90%	28,86%	0,20%	0,276%	1,89%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,50%	8,50%	2,85%	4,99%	10,90%	-	0,20%	0,278%	1,91%
CDI	0,64%	8,03%	2,25%	4,85%	11,53%	27,29%	-	-	-
WESTERN ASSET ATIVO FI RENDA FIXA	0,76%	9,20%	2,78%	5,17%	12,49%	30,85%	0,40%	0,213%	1,39%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
WESTERN ASSET CRÉDITO CORPORATIVO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,75%	8,88%	2,77%	5,69%	11,06%	25,64%	0,50%	0,096%	1,02%
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,65%	8,20%	2,31%	4,98%	11,74%	27,55%	0,20%	0,035%	0,11%
RIO BRAVO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,64%	8,48%	2,30%	5,12%	12,16%	28,54%	0,45%	0,020%	0,04%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,63%	8,06%	2,23%	4,86%	11,56%	27,32%	0,20%	0,017%	0,12%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,57%	7,38%	2,04%	4,43%	10,63%	25,21%	0,80%	0,012%	0,11%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,56%	7,26%	1,99%	4,33%	10,54%	25,16%	1,00%	0,013%	0,11%

IPCA + 6,00% ao ano	0,62%	6,30%	2,09%	3,77%	8,64%	24,92%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,30%	13,03%	6,90%	6,81%	15,31%	44,79%	0,15%	1,186%	6,93%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,81%	10,10%	4,00%	5,78%	12,51%	34,33%	0,15%	0,424%	3,00%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,50%	0,57%	-0,98%	0,95%	2,64%	12,00%	0,20%	0,237%	3,95%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,49%	6,40%	1,84%	3,82%	8,58%	25,31%	0,20%	0,237%	0,33%

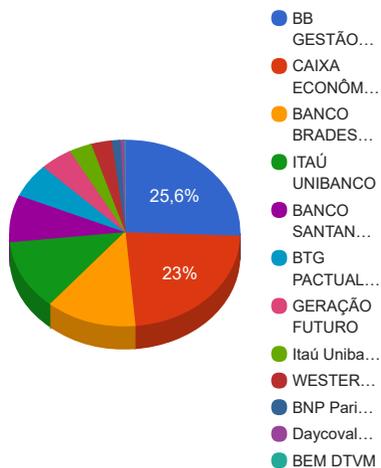
IPCA	0,16%	1,78%	0,59%	0,81%	2,54%	11,23%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,51%	11,79%	5,30%	5,36%	15,04%	39,85%	0,40%	1,032%	6,22%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	1,51%	11,77%	5,30%	5,35%	-	-	0,40%	1,032%	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1,25%	13,08%	5,63%	7,24%	15,92%	42,90%	0,20%	0,703%	4,63%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,51%	7,75%	2,41%	4,47%	10,03%	32,90%	0,20%	0,234%	1,57%

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

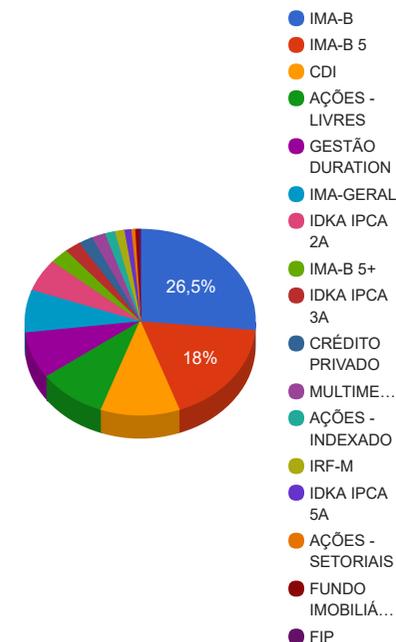
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	6,58%	19,16%	7,09%	9,30%	22,30%	58,65%	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	7,95%	7,84%	2,80%	4,76%	11,22%	39,24%	1,20%	11,303%	22,79%
IDIV	6,12%	27,55%	18,99%	11,86%	42,02%	93,80%	-	-	-
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	4,99%	22,24%	13,90%	14,38%	17,73%	41,97%	2,50%	4,854%	14,32%
Ibovespa	4,88%	23,36%	18,12%	14,33%	27,29%	64,88%	-	-	-
SANTANDER SELEÇÃO TOP FIC AÇÕES	8,32%	33,03%	21,22%	17,80%	33,37%	67,60%	2,00%	7,275%	19,59%
BB PIPE FIC AÇÕES	6,99%	30,98%	18,95%	22,24%	27,87%	55,84%	1,20%	6,158%	16,01%
WESTERN ASSET VALUATION FI AÇÕES	5,32%	26,04%	17,12%	17,58%	26,13%	73,18%	2,50%	6,356%	17,92%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5,23%	29,56%	16,92%	19,66%	23,44%	44,44%	3,00%	5,132%	16,57%
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	3,49%	5,23%	8,04%	0,53%	11,86%	11,60%	4,00%	6,198%	20,62%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	2,79%	16,80%	8,18%	9,91%	25,33%	54,03%	2,00%	3,070%	9,46%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	2,38%	7,56%	8,90%	3,33%	11,32%	19,79%	2,00%	5,213%	20,22%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IBOVESPA CÍCLICO I FIC MULTIMERCADO	1,68%	7,06%	5,63%	7,27%	14,30%	41,35%	1,60%	1,237%	6,09%
S&P 500	1,93%	12,53%	3,96%	6,63%	16,19%	31,21%	-	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	2,06%	19,90%	5,85%	11,15%	28,22%	63,74%	1,00%	2,218%	6,99%
IPCA + 8,00% ao ano	0,77%	7,80%	2,58%	4,73%	10,67%	29,66%	-	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	-	-	-	-	-	-	2,00%	-	-

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	88.942.297,31	25,62%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	79.924.512,46	23,02%
BANCO BRADESCO	43.225.012,34	12,45%
ITAÚ UNIBANCO	42.263.026,42	12,17%
BANCO SANTANDER	28.509.643,47	8,21%
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS	20.670.014,32	5,95%
GERAÇÃO FUTURO	15.845.648,33	4,56%
Itaú Unibanco S.A.	11.075.782,81	3,19%
WESTERN ASSET	10.070.266,18	2,90%
BNP Paribas	4.183.084,42	1,20%
Daycoval Asset Management	1.965.488,81	0,57%
BEM DTVM	550.654,65	0,16%



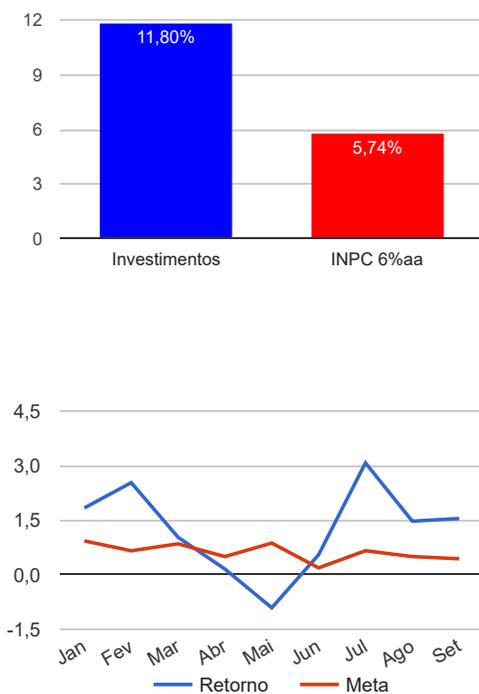
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	92.080.591,13	26,52%
IMA-B 5	62.661.099,95	18,05%
CDI	37.749.314,80	10,87%
AÇÕES - LIVRES	33.096.300,80	9,53%
GESTÃO DURATION	28.141.467,44	8,10%
IMA-GERAL	25.719.881,88	7,41%
IDKA IPCA 2A	19.551.031,10	5,63%
IMA-B 5+	9.329.665,64	2,69%
IDKA IPCA 3A	7.801.631,02	2,25%
CRÉDITO PRIVADO	6.881.552,34	1,98%
MULTIMERCADO	6.615.327,88	1,91%
AÇÕES - INDEXADO	4.924.681,45	1,42%
IRF-M	4.654.948,50	1,34%
IDKA IPCA 5A	3.308.251,76	0,95%
AÇÕES - SETORIAIS	1.932.008,23	0,56%
FUNDO IMOBILIÁRIO	1.649.955,00	0,48%
FIP	1.127.722,60	0,32%



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%
Acumulado no ano					34.342.745,08	11,80%	5,74%	205,43%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BTG PACTUAL TESOURO IPCA LONGO FI RENDA FIXA	4.166.765,40	0,00	0,00	4.265.839,30	99.073,90	2,38%	2,01%	2,38%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.516.539,88	0,00	0,00	3.585.266,01	68.726,13	1,95%	1,58%	1,95%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.450.243,59	0,00	0,00	1.478.560,33	28.316,74	1,95%	1,58%	1,95%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	18.242.505,45	0,00	0,00	18.575.529,38	333.023,93	1,83%	1,38%	1,83%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	19.055.186,74	0,00	0,00	19.402.010,80	346.824,06	1,82%	1,38%	1,82%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	18.016.954,00	215.611,82	0,00	18.557.248,23	324.682,41	1,78%	1,33%	1,78%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	2.521.934,33	0,00	0,00	2.566.817,24	44.882,91	1,78%	1,39%	1,78%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	16.812.146,98	0,00	0,00	17.065.684,63	253.537,65	1,51%	1,03%	1,51%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.561.690,02	0,00	0,00	6.657.369,18	95.679,16	1,46%	1,29%	1,46%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.588.870,23	0,00	0,00	4.654.948,50	66.078,27	1,44%	1,01%	1,44%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	4.743.270,87	6.178.217,68	0,00	11.075.782,81	154.294,26	1,41%	1,03%	1,51%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	22.029.618,80	1.362.444,18	0,00	23.713.379,86	321.316,88	1,37%	0,82%	1,37%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.202.874,76	0,00	0,00	3.244.431,80	41.557,04	1,30%	1,19%	1,30%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.981.094,76	0,00	0,00	2.006.502,02	25.407,26	1,28%	0,75%	1,28%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.518.783,23	0,00	0,00	6.602.180,52	83.397,29	1,28%	0,96%	1,28%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	3.277.208,86	0,00	0,00	3.318.327,02	41.118,16	1,25%	0,70%	1,25%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.268.297,69	0,00	0,00	3.308.251,76	39.954,07	1,22%	1,01%	1,22%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.280.486,13	0,00	0,00	2.306.107,29	25.621,16	1,12%	0,66%	1,12%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	926.695,46	0,00	0,00	936.103,10	9.407,64	1,02%	0,71%	1,02%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	21.178.473,40	0,00	0,00	21.388.961,62	210.488,22	0,99%	0,65%	0,99%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	21.521.481,17	0,00	0,00	21.734.938,27	213.457,10	0,99%	0,65%	0,99%
DAYCOVAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.946.896,35	0,00	0,00	1.965.488,81	18.592,46	0,95%	0,65%	0,95%

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.411.587,23	0,00	0,00	6.468.758,28	57.171,05	0,89%	0,49%	0,89%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.065.522,23	0,00	0,00	15.197.426,19	131.903,96	0,88%	0,49%	0,88%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.990.240,80	0,00	0,00	2.006.300,03	16.059,23	0,81%	0,42%	0,81%
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.753.067,82	0,00	0,00	5.795.330,99	42.263,17	0,73%	0,40%	0,73%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	20.706.758,50	0,00	215.611,82	20.605.088,89	113.942,21	0,55%	0,01%	0,56%
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	6.100.966,25	800.000,00	835.807,56	6.101.653,68	36.494,99	0,53%	0,03%	0,65%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.746.625,88	524.621,61	0,00	2.283.109,76	11.862,27	0,52%	0,02%	0,63%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	2.448.952,20	0,00	0,00	2.461.397,40	12.445,20	0,51%	0,23%	0,51%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.335.838,32	0,00	0,00	12.397.440,86	61.602,54	0,50%	0,28%	0,50%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.459.790,98	0,00	0,00	2.472.066,18	12.275,20	0,50%	0,28%	0,50%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.557.529,54	0,00	0,00	10.610.206,64	52.677,10	0,50%	0,28%	0,50%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.922.502,00	0,00	0,00	1.932.060,00	9.558,00	0,50%	0,24%	0,50%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.271.313,79	0,00	0,00	1.277.577,79	6.264,00	0,49%	0,24%	0,49%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	7.986.245,97	10.474.822,56	10.413.067,02	8.108.609,04	60.607,53	0,33%	0,01%	0,57%
WESTERN ASSET CRÉDITO CORPORATIVO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIV...	0,00	550.000,00	0,00	551.173,27	1.173,27	0,21%	0,10%	0,75%
WESTERN ASSET ATIVO FI RENDA FIXA	0,00	650.000,00	0,00	650.853,43	853,43	0,13%	0,21%	0,76%
RIO BRAVO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,00	550.000,00	0,00	550.654,65	654,65	0,12%	0,02%	0,64%
Total Renda Fixa					3.473.244,50	1,18%	0,77%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.528.500,00	0,00	11.250,00	1.649.955,00	132.705,00	8,68%	11,30%	7,95%
BB PIPE FIC AÇÕES	1.629.350,78	0,00	0,00	1.743.192,26	113.841,48	6,99%	6,16%	6,99%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	13.314.324,67	466.414,41	0,00	14.472.166,79	691.427,71	5,02%	5,13%	5,23%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	1.840.096,93	0,00	0,00	1.932.008,23	91.911,30	4,99%	4,85%	4,99%
WESTERN ASSET VALUATION FI AÇÕES	2.550.396,40	650.000,00	0,00	3.324.679,52	124.283,12	3,88%	6,36%	5,32%
SANTANDER SELEÇÃO TOP FIC AÇÕES	484.473,66	500.000,00	0,00	1.019.028,17	34.554,51	3,51%	7,28%	8,32%
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	4.758.681,80	0,00	0,00	4.924.681,45	165.999,65	3,49%	6,20%	3,49%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	3.684.246,04	400.000,00	0,00	4.183.084,42	98.838,38	2,42%	3,07%	2,79%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	8.160.090,79	0,00	0,00	8.354.149,64	194.058,85	2,38%	5,21%	2,38%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	1.415.868,19	4.000.000,00	0,00	5.543.559,96	127.691,77	2,36%	2,22%	2,06%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IBOVESPA CÍCLICO I FIC MULTIMERCADO	1.054.049,29	0,00	0,00	1.071.767,92	17.718,63	1,68%	1,24%	1,68%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	1.115.180,22	0,00	0,00	1.127.722,60	12.542,38	1,12%	-	-
Total Renda Variável					1.805.572,78	3,80%	5,02%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre / 2017

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	18.091.517,95	0,00	0,00	19.402.010,80	1.310.492,85	7,24%	7,24%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	16.637.029,41	686.271,45	0,00	18.575.529,38	1.252.228,52	7,39%	7,43%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	20.674.280,99	0,00	0,00	21.734.938,27	1.060.657,28	5,13%	5,13%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	20.345.855,18	0,00	0,00	21.388.961,62	1.043.106,44	5,13%	5,13%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.477.948,28	0,00	16.421.465,58	0,00	943.517,30	6,10%	8,56%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.271.420,13	6.360.197,33	0,00	18.557.248,23	925.630,77	6,73%	7,21%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	16.206.154,72	0,00	0,00	17.065.684,63	859.529,91	5,30%	5,30%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-GERAL FIC RENDA FIXA	9.302.219,19	13.729.138,95	0,00	23.713.379,86	682.021,72	4,52%	5,05%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	11.989.780,61	1.070.000,00	13.729.138,94	0,00	669.358,33	5,51%	8,51%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.962.958,08	0,00	424.804,18	15.197.426,19	659.272,29	4,43%	4,45%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.379.379,90	0,00	174.063,02	6.657.369,18	452.052,30	7,13%	4,36%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.369.214,33	0,00	173.259,43	6.602.180,52	406.225,62	6,41%	6,44%
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.962.707,71	0,00	6.360.197,33	0,00	397.489,62	6,67%	10,05%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.388.382,26	0,00	342.395,88	12.397.440,86	351.454,48	2,85%	0,07%
BIG PACTUAL TESOURO IPCA LONGO FI RENDA FIXA	3.929.669,20	0,00	0,00	4.265.839,30	336.170,10	8,55%	8,55%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.611.758,64	0,00	301.849,74	10.610.206,64	300.297,74	2,84%	2,85%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	2.910.770,96	7.874.796,34	0,00	11.075.782,81	290.215,51	4,80%	5,30%
ITAÚ IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	5.094.012,77	0,00	5.378.217,68	0,00	284.204,91	5,58%	8,50%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.200.780,03	0,00	0,00	6.468.758,28	267.978,25	4,32%	4,32%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.422.406,76	0,00	92.737,68	3.585.266,01	255.596,93	7,52%	4,76%
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.575.096,68	0,00	0,00	5.795.330,99	220.234,31	3,95%	3,95%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.034.923,74	0,00	0,00	3.244.431,80	209.508,06	6,90%	6,90%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre / 2017

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.188.121,96	0,00	88.067,70	3.308.251,76	208.197,50	6,56%	6,59%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.082.368,20	366.000,00	0,00	4.654.948,50	206.580,30	4,64%	4,83%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	5.184.543,95	24.277.433,91	21.544.246,87	8.108.609,04	190.878,05	1,36%	2,04%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	3.141.370,83	0,00	0,00	3.318.327,02	176.956,19	5,63%	5,63%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	2.394.873,65	0,00	0,00	2.566.817,24	171.943,59	7,18%	7,18%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.875.780,15	17.785.860,23	215.611,82	20.605.088,89	159.060,33	1,39%	1,99%
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	5.971.702,21	2.401.184,30	2.401.162,56	6.101.653,68	129.929,73	1,91%	2,31%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.251.639,19	0,00	61.567,11	2.306.107,29	116.035,21	5,18%	2,42%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.410.897,82	0,00	37.652,94	1.478.560,33	105.315,45	7,52%	4,80%
DAYCOVAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.872.478,98	0,00	0,00	1.965.488,81	93.009,83	4,97%	4,97%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.982.403,53	0,00	54.717,88	2.006.300,03	78.614,38	3,99%	4,00%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.471.986,18	0,00	69.643,25	2.472.066,18	69.723,25	2,83%	2,84%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	839.498,90	1.101.000,00	0,00	2.006.502,02	66.003,12	3,40%	4,68%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	2.403.457,20	0,00	0,00	2.461.397,40	57.940,20	2,41%	2,41%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.719.402,20	524.621,61	0,00	2.283.109,76	39.085,95	2,11%	2,23%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.951.144,50	0,00	54.796,28	1.932.060,00	35.711,78	1,84%	-0,98%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.290.589,52	0,00	36.440,65	1.277.577,79	23.428,92	1,83%	1,84%
BRASESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	0,00	919.728,55	0,00	936.103,10	16.374,55	1,78%	5,36%
WESTERN ASSET CRÉDITO CORPORATIVO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIV...	0,00	550.000,00	0,00	551.173,27	1.173,27	0,21%	2,77%
WESTERN ASSET ATIVO FI RENDA FIXA	0,00	650.000,00	0,00	650.853,43	853,43	0,13%	2,78%
RIO BRAVO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,00	550.000,00	0,00	550.654,65	654,65	0,12%	2,30%
Total Renda Fixa					15.124.712,92	5,46%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre / 2017

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	11.588.481,12	894.414,41	0,00	14.472.166,79	1.989.271,26	16,54%	16,92%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	7.671.638,33	0,00	0,00	8.354.149,64	682.511,31	8,90%	8,90%
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	8.385.716,64	0,00	4.000.000,00	4.924.681,45	538.964,81	8,09%	8,04%
WESTERN ASSET VALUATION FI AÇÕES	1.892.789,00	1.078.000,00	0,00	3.324.679,52	353.890,52	14,71%	17,12%
BB PIPE FIC AÇÕES	1.465.484,36	0,00	0,00	1.743.192,26	277.707,90	18,95%	18,95%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	2.597.109,00	1.331.000,00	0,00	4.183.084,42	254.975,42	7,19%	8,18%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	1.696.284,65	0,00	0,00	1.932.008,23	235.723,58	13,90%	13,90%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	923.492,71	4.450.000,00	0,00	5.543.559,96	170.067,25	5,52%	5,85%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.605.000,00	0,00	33.975,00	1.649.955,00	78.930,00	4,99%	2,80%
SANTANDER SELEÇÃO TOP FIC AÇÕES	0,00	950.000,00	0,00	1.019.028,17	69.028,17	11,44%	21,22%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO IBOVESPA CÍCLICO I FIC MULTIMERCADO	1.014.618,57	0,00	0,00	1.071.767,92	57.149,35	5,63%	5,63%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	1.025.818,69	120.000,00	0,00	1.127.722,60	-18.096,09	-1,64%	-
Total Renda Variável					4.690.123,48	11,06%	