

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 3.922/2010 - 4.392/2014
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	408.179,16	0,45%	63	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	17/08/2020	2.053.195,50	2,27%	20	3,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	177.724,30	0,20%	701	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.741.081,67	4,14%	71	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.259.436,19	2,50%	303	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	991.125,35	1,10%	1.382	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	14.760.271,02	16,34%	259	1,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	4.199.227,27	4,65%	1.221	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	3.183.250,30	3,52%	283	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	82.948,01	0,09%	613	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	14.931.682,45	16,53%	771	0,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	1.285.700,00	1,42%	26	0,87%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	3.146.257,68	3,48%	77	1,04%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	58.895,57	0,07%	86	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
INFINITY IMA-B 5+ TIGER FI RENDA FIXA	D+1	Não há	727.395,06	0,81%	20	2,44%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	10.575.045,78	11,71%	329	0,39%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	7.682.587,11	8,51%	776	0,13%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	2.602.949,06	2,88%	536	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	59.350,89	0,07%	60	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.538.652,62	3,92%	763	0,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	951.318,00	1,05%	141	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	683.721,50	0,76%	100	0,31%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "

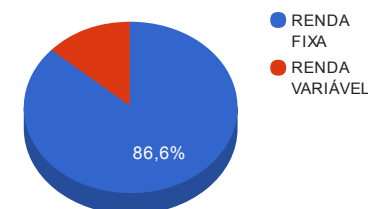
Carteira consolidada de investimentos - base (setembro / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
BB GOVERNANÇA FIAÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	949.575,06	1,05%	86	0,61%	Artigo 8º, Inciso III
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.229.837,24	1,36%	4.176	1,35%	Artigo 8º, Inciso III
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIAÇÕES	D+24	Não há	2.198.246,73	2,43%	37	0,81%	Artigo 8º, Inciso III
BRADESCO DIVIDENDOS FIAÇÕES	D+4	Não há	1.249.787,65	1,38%	629	0,19%	Artigo 8º, Inciso III
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	1.564.330,26	1,73%	51	2,30%	Artigo 8º, Inciso IV
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	1.393.891,90	1,54%	52	0,69%	Artigo 8º, Inciso IV
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	D+0	Não há	1.344.653,87	1,49%	2.876	0,26%	Artigo 8º, Inciso IV
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXR11	Não se aplica	Não se aplica	2.199.940,00	2,44%		1,27%	Artigo 8º, Inciso VI
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	Término do fundo	Não há	76.310,60	0,08%	750	0,63%	Desenquadrado - RF
		TOTAL -	90.306.567,80				

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

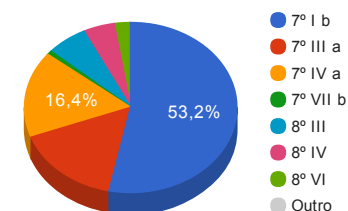
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	48.073.821,22	53,23%	30,00%	35,00%	70,00%	15.140.776,24
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	14.507.594,09	16,06%	15,00%	20,00%	60,00%	39.676.346,59
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	14.834.857,68	16,43%	5,00%	5,00%	30,00%	12.257.112,66
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	13.545.985,17
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	4.515.328,39
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	683.721,50	0,76%	0,00%	2,50%	5,00%	3.831.606,89
Desenquadrado - RF	0,00%	76.310,60	0,08%	0,00%	0,00%	0,00%	-76.310,60
Total Renda Fixa	100,00%	78.176.305,09	86,57%	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 III	15,00%	5.627.446,68	6,23%	5,00%	10,00%	15,00%	7.918.538,49
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	4.302.876,03	4,76%	2,00%	5,00%	5,00%	212.452,36
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	4.515.328,39
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	2.199.940,00	2,44%	2,00%	5,00%	5,00%	2.315.388,39
Total Renda Variável	30,00%	12.130.262,71	13,43%	11,00	25,00	30,00	-

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 "	48.073.821,22	53,23%	30,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	14.507.594,09	16,06%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	14.834.857,68	16,43%	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 "	683.721,50	0,76%	0,00%	5,00%
Desenquadrado - RF	76.310,60	0,08%	0,00%	0,00%
Total Renda Fixa	78.176.305,09	86,57%	55,00	185,00

Artigos - Renda Variável	Base: setembro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso III	5.627.446,68	6,23%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	4.302.876,03	4,76%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	2.199.940,00	2,44%	2,00%	5,00%
Total Renda Variável	12.130.262,71	13,43%	11,00	30,00

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%	-	-	-
INFINITY IMA-B 5+ TIGER FI RENDA FIXA	2,44%	15,23%	7,05%	8,96%	22,59%	80,25%	0,50%	1,033%	6,22%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,37%	14,38%	8,52%	5,75%	16,99%	56,58%	0,20%	2,004%	12,71%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,32%	14,08%	8,56%	5,48%	16,64%	56,75%	0,20%	1,967%	12,79%
IMA-B	1,81%	13,16%	7,30%	5,86%	15,76%	48,59%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,80%	12,99%	7,25%	5,77%	15,63%	47,62%	0,20%	1,346%	9,79%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	1,79%	12,71%	7,07%	5,60%	15,50%	46,97%	0,20%	1,312%	9,37%
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%
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,46%	7,84%	4,37%	4,21%	9,81%	32,10%	0,20%	1,293%	8,51%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,12%	5,85%	2,43%	3,75%	8,10%	24,88%	0,20%	0,662%	5,80%
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%
IMA-B 5	1,01%	10,94%	5,18%	6,58%	13,45%	34,82%	-	-	-
BRADESCO 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%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	0,97%	10,61%	5,07%	6,37%	13,01%	33,74%	0,40%	0,646%	3,63%
IDKA IPCA 2 Anos	0,91%	11,13%	4,46%	6,74%	13,66%	34,61%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,86%	10,29%	4,33%	6,18%	12,73%	33,31%	0,20%	0,476%	2,90%

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

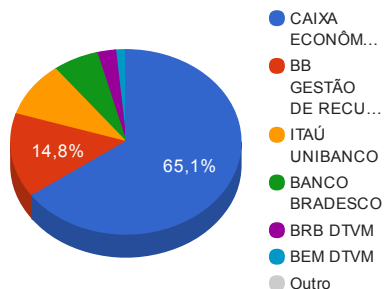
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M 1	0,74%	9,14%	2,72%	5,49%	12,65%	29,70%	-	-	-
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,72%	8,95%	2,68%	5,40%	12,39%	29,11%	0,20%	0,076%	0,67%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,71%	8,98%	2,67%	5,39%	12,45%	29,31%	0,20%	0,071%	0,67%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,71%	8,98%	2,68%	5,40%	12,46%	29,55%	0,20%	0,078%	0,69%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,71%	8,94%	2,67%	5,37%	12,38%	29,13%	0,10%	0,074%	0,68%
Selic	0,64%	8,04%	2,26%	4,86%	11,54%	27,33%	-	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,67%	8,46%	2,49%	5,25%	12,20%	28,08%	0,20%	0,006%	0,13%
CDI	0,64%	8,03%	2,25%	4,85%	11,53%	27,29%	-	-	-
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	0,68%	9,30%	2,25%	5,56%	13,12%	31,15%	0,75%	0,282%	9,17%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,65%	8,10%	2,27%	4,86%	11,65%	27,28%	0,20%	0,014%	0,11%
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%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	0,63%	8,01%	2,22%	4,82%	11,52%	27,37%	0,18%	0,012%	0,11%
IPCA	0,16%	1,78%	0,59%	0,81%	2,54%	11,23%	-	-	-
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%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	5,61%	-21,70%	7,28%	-11,04%	36,10%	65,48%	2,00%	10,633%	68,78%

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

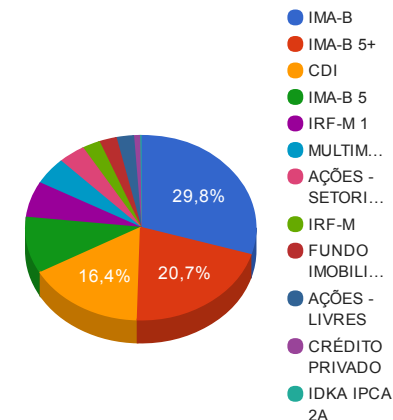
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	6,58%	19,16%	7,09%	9,30%	22,30%	58,65%	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	7,95%	7,84%	2,80%	4,76%	11,22%	39,24%	1,20%	11,303%	22,79%
IFNC	6,50%	27,56%	18,29%	13,15%	32,21%	85,09%	-	-	-
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	6,27%	25,91%	17,82%	12,11%	29,67%	80,76%	1,00%	7,255%	24,19%
IDIV	6,12%	27,55%	18,99%	11,86%	42,02%	93,80%	-	-	-
BRADESCO DIVIDENDOS FIAÇÕES	3,76%	28,06%	15,14%	10,71%	33,53%	66,36%	1,50%	6,056%	19,85%
Ibovespa	4,88%	23,36%	18,12%	14,33%	27,29%	64,88%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIAÇÕES	5,09%	32,14%	19,96%	16,61%	30,27%	-	2,50%	6,667%	19,18%
IGC	4,69%	27,98%	17,57%	16,74%	29,18%	58,91%	-	-	-
BB GOVERNANÇA FIAÇÕES PREVIDENCIÁRIO	4,58%	27,18%	17,31%	16,30%	28,27%	57,49%	1,00%	6,082%	18,56%
CDI	0,64%	8,03%	2,25%	4,85%	11,53%	27,29%	-	-	-
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	0,69%	9,61%	2,61%	5,61%	13,70%	33,54%	1,00%	0,306%	10,35%
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	0,67%	8,17%	2,60%	4,70%	11,64%	30,35%	0,70%	0,143%	0,66%
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	0,65%	7,31%	2,36%	3,98%	10,67%	26,52%	0,35%	0,275%	0,85%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	58.767.358,77	65,08%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	13.361.214,80	14,80%
ITAÚ UNIBANCO	8.692.717,46	9,63%
BANCO BRADESCO	5.808.102,31	6,43%
BRB DTVM	2.351.076,21	2,60%
BEM DTVM	1.249.787,65	1,38%
ICLA Trust	76.310,60	0,08%



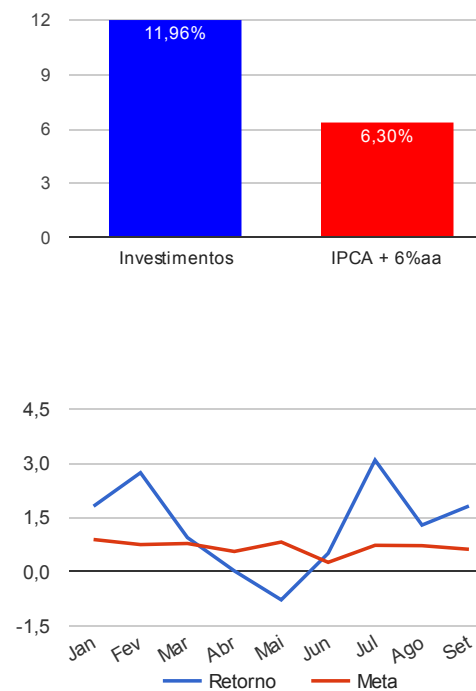
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	26.875.376,24	29,76%
IMA-B 5+	18.670.916,38	20,68%
CDI	14.834.857,68	16,43%
IMA-B 5	8.940.534,85	9,90%
IRF-M 1	5.657.427,35	6,26%
MULTIMERCADO	4.302.876,03	4,76%
AÇÕES - SETORIAIS	3.429.199,95	3,80%
IRF-M	2.259.436,19	2,50%
FUNDO IMOBILIÁRIO	2.199.940,00	2,44%
AÇÕES - LIVRES	2.198.246,73	2,43%
CRÉDITO PRIVADO	760.032,10	0,84%
IDKA IPCA 2A	177.724,30	0,20%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	75.102.528,80	1.059.200,80	414.015,02	77.118.447,26	1.370.732,68	1,81%	0,89%	202,89%	2,63%
Fevereiro	77.118.447,26	1.331.834,76	609.909,46	79.968.658,81	2.128.286,25	2,73%	0,75%	365,31%	1,91%
Março	79.968.658,81	6.468.003,91	5.118.485,98	82.085.798,00	767.621,26	0,94%	0,78%	120,32%	2,09%
Abril	82.085.798,00	8.589.696,50	8.007.337,06	82.688.115,68	19.958,24	0,02%	0,56%	4,33%	1,93%
Mai	82.688.115,68	847.141,68	749.900,00	82.143.176,79	-642.180,57	-0,78%	0,82%	-94,42%	9,80%
Junho	82.143.176,79	8.093.997,48	6.834.477,61	83.827.094,68	424.398,02	0,51%	0,26%	199,05%	2,14%
Julho	83.827.094,68	961.557,95	540.618,29	86.845.134,15	2.597.099,81	3,08%	0,73%	423,49%	2,07%
Agosto	86.845.134,15	1.574.126,64	818.540,40	88.729.848,97	1.129.128,58	1,29%	0,72%	177,97%	1,91%
Setembro	88.729.848,97	4.766.238,22	4.799.805,49	90.306.567,80	1.610.286,10	1,81%	0,62%	290,71%	1,61%
Acumulado no ano					9.405.330,37	11,96%	6,30%	189,73%	

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(%)
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	72.257,03	0,00	0,00	76.310,60	4.053,57	5,61%	10,63%	5,61%
INFINITY IMA-B 5+ TIGER FI RENDA FIXA	710.043,35	0,00	0,00	727.395,06	17.351,71	2,44%	1,03%	2,44%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	14.418.201,16	0,00	0,00	14.760.271,02	342.069,86	2,37%	2,00%	2,37%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.110.925,16	0,00	0,00	3.183.250,30	72.325,14	2,32%	1,97%	2,32%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	14.667.684,81	0,00	0,00	14.931.682,45	263.997,64	1,80%	1,35%	1,80%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	10.389.001,05	0,00	0,00	10.575.045,78	186.044,73	1,79%	1,31%	1,79%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	81.496,75	0,00	0,00	82.948,01	1.451,26	1,78%	1,33%	1,78%
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.267.247,00	0,00	0,00	1.285.700,00	18.453,00	1,46%	1,29%	1,46%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.030.467,50	0,00	0,00	2.053.195,50	22.728,00	1,12%	0,66%	1,12%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	3.114.638,45	0,00	0,00	3.146.257,68	31.619,23	1,02%	0,71%	1,02%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	3.705.009,86	0,00	0,00	3.741.081,67	36.071,81	0,97%	0,65%	0,97%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	405.278,39	0,00	0,00	408.179,16	2.900,77	0,72%	0,08%	0,72%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	984.092,59	0,00	0,00	991.125,35	7.032,76	0,71%	0,07%	0,71%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	58.478,14	0,00	0,00	58.895,57	417,43	0,71%	0,08%	0,71%
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	58.947,74	0,00	0,00	59.350,89	403,15	0,68%	0,28%	0,68%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.585.676,37	0,00	0,00	2.602.949,06	17.272,69	0,67%	0,01%	0,67%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.570.336,44	0,00	54.695,00	3.538.652,62	23.011,18	0,64%	0,01%	0,65%
ITAÚ INSTITUCIONAL L FI REFERENCIADO DI	945.376,66	0,00	0,00	951.318,00	5.941,34	0,63%	0,01%	0,63%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	7.877.190,25	215.274,93	460.000,00	7.682.587,11	50.121,93	0,62%	0,02%	0,63%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.220.970,26	24.064,55	2.258.195,59	0,00	13.160,78	0,59%	0,49%	0,89%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.152.288,00	9.899,08	1.996.888,76	177.724,30	12.425,98	0,57%	0,48%	0,86%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	680.264,50	0,00	0,00	683.721,50	3.457,00	0,51%	0,23%	0,51%

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(%)
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.198.718,08	1.996.888,76	15.026,14	4.199.227,27	18.646,57	0,44%	0,07%	0,71%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	2.258.117,09	0,00	2.259.436,19	1.319,10	0,06%	1,01%	1,44%
Total Renda Fixa					1.152.276,63	1,49%	1,05%	

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	2.038.000,00	0,00	15.000,00	2.199.940,00	176.940,00	8,68%	11,30%	7,95%
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	1.157.243,59	0,00	0,00	1.229.837,24	72.593,65	6,27%	7,25%	6,27%
BB GOVERNANÇA FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	907.954,09	0,00	0,00	949.575,06	41.620,97	4,58%	6,08%	4,58%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.843.404,37	261.993,81	0,00	2.198.246,73	92.848,55	4,41%	6,67%	5,09%
BRADESCO DIVIDENDOS FIC AÇÕES	1.204.480,50	0,00	0,00	1.249.787,65	45.307,15	3,76%	6,06%	3,76%
INFINITY INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	1.553.624,02	0,00	0,00	1.564.330,26	10.706,24	0,69%	0,31%	0,69%
CAIXA JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO LP	1.335.674,25	0,00	0,00	1.344.653,87	8.979,62	0,67%	0,14%	0,67%
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	1.384.878,61	0,00	0,00	1.393.891,90	9.013,29	0,65%	0,28%	0,65%
Total Renda Variável					458.009,47	3,92%	5,18%	

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 (%)
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	13.601.653,02	0,00	0,00	14.760.271,02	1.158.618,00	8,52%	8,52%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	13.922.486,45	0,00	0,00	14.931.682,45	1.009.196,00	7,25%	7,25%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	9.877.135,30	0,00	0,00	10.575.045,78	697.910,48	7,07%	7,07%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.932.182,78	0,00	0,00	3.183.250,30	251.067,52	8,56%	8,56%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	3.560.586,44	0,00	0,00	3.741.081,67	180.495,23	5,07%	5,07%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	7.366.100,85	604.426,49	460.000,00	7.682.587,11	172.059,77	2,20%	2,23%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	2.986.272,58	0,00	0,00	3.146.257,68	159.985,10	5,36%	5,36%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.004.420,00	0,00	54.260,30	2.053.195,50	103.035,80	5,17%	2,43%
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.231.828,00	0,00	33.344,66	1.285.700,00	87.216,66	7,12%	4,37%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.997.018,80	95.685,43	1.996.888,76	177.724,30	81.908,83	4,03%	4,33%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.618.177,16	0,00	159.695,00	3.538.652,62	80.170,46	2,25%	2,27%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.773.495,57	1.305.896,84	3.154.835,22	0,00	75.442,81	3,75%	4,32%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.539.825,91	0,00	0,00	2.602.949,06	63.123,15	2,49%	2,49%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.104.636,53	2.081.832,26	48.131,64	4.199.227,27	60.890,12	2,39%	2,67%
INFINITY IMA-B 5+ TIGER FI RENDA FIXA	679.476,47	0,00	0,00	727.395,06	47.918,59	7,05%	7,05%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	679.348,32	287.462,89	0,00	991.125,35	24.314,14	2,51%	2,67%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	930.634,79	0,00	0,00	951.318,00	20.683,21	2,22%	2,22%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	667.627,00	0,00	0,00	683.721,50	16.094,50	2,41%	2,41%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	397.523,07	0,00	0,00	408.179,16	10.656,09	2,68%	2,68%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	77.371,60	0,00	0,00	82.948,01	5.576,41	7,21%	7,21%
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	71.134,15	0,00	0,00	76.310,60	5.176,45	7,28%	7,28%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	57.359,56	0,00	0,00	58.895,57	1.536,01	2,68%	2,68%

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 (%)
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	2.258.117,09	0,00	2.259.436,19	1.319,10	0,06%	4,83%
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	58.046,88	0,00	0,00	59.350,89	1.304,01	2,25%	2,25%
Total Renda Fixa					4.315.698,44	5,85%	

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 (%)
ITA Ú INSTITUCIONAL PHOENIX FIAÇÕES	1.425.902,74	468.501,81	0,00	2.198.246,73	303.842,18	18,75%	19,96%
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	1.043.791,05	0,00	0,00	1.229.837,24	186.046,19	17,82%	17,82%
BRADESCO DIVIDENDOS FIAÇÕES	1.085.422,46	0,00	0,00	1.249.787,65	164.365,19	15,14%	15,14%
BB GOVERNANÇA FIAÇÕES PREVIDENCIÁRIO	809.458,18	0,00	0,00	949.575,06	140.116,88	17,31%	17,31%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	2.140.000,00	0,00	45.300,00	2.199.940,00	105.240,00	4,99%	2,80%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	1.325.372,90	200.000,00	0,00	1.564.330,26	38.957,36	2,55%	2,61%
CAIXA JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO LP	1.310.606,65	0,00	0,00	1.344.653,87	34.047,22	2,60%	2,60%
ITA Ú INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	1.361.733,27	0,00	0,00	1.393.891,90	32.158,63	2,36%	2,36%
ITA Ú DIVIDENDOS FIAÇÕES	190.466,20	0,00	206.508,60	0,00	16.042,40	8,42%	18,39%
Total Renda Variável					1.020.816,05	9,30%	