

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
TÍTULOS PÚBLICOS			243.210.227,03	42,66%			Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	25.560.816,09	4,48%	1.221	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.744.984,93	0,48%	259	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	36.701.955,11	6,44%	613	0,68%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	20.524.397,45	3,60%	771	0,36%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	657.844,17	0,12%	283	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	1.346.859,35	0,24%	193	0,38%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	23.868.120,00	4,19%	222	0,75%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	9.625.113,57	1,69%	1.382	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADERCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	D+1	16/05/2019	119.262,31	0,02%	11	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.514.730,50	0,97%	711	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADERCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	20.118.602,42	3,53%	195	2,63%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	6.977.207,70	1,22%	701	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	10.287.566,52	1,80%	53	2,09%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2022	9.590.047,50	1,68%	17	12,91%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADERCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.191,65	0,00%	150	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	95.635,27	0,02%	763	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	14.467.009,84	2,54%	95	3,67%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	9.585.982,50	1,68%	38	5,58%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	50.634.111,55	8,88%	536	0,44%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	18/08/2020	6.317.640,00	1,11%	19	5,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	60.936,92	0,01%	42	3,01%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "

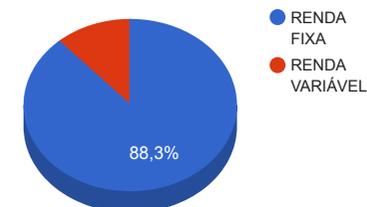
Carteira consolidada de investimentos - base (setembro / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	5.469.772,00	0,96%	100	2,44%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	4.620.129,59	0,81%	20	15,64%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	5.182.412,12	0,91%	38	0,89%	Artigo 8º, Inciso I
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	D+13	Não há	12.177.268,54	2,14%	424	15,15%	Artigo 8º, Inciso III
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	5.933.941,31	1,04%	2.112	1,76%	Artigo 8º, Inciso III
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	D+33	Não há	5.416.795,91	0,95%	383	7,41%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	D+43	5 anos	4.832.257,85	0,85%	53	4,63%	Artigo 8º, Inciso III
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	3.265.975,85	0,57%	86	2,09%	Artigo 8º, Inciso III
BB CONSUMO FIC AÇÕES	D+4	Não há	6.138.323,29	1,08%	2.642	5,06%	Artigo 8º, Inciso III
KINEA PIPE FI AÇÕES	D+363 a D+723 ou D+30 a D+1830	Não há	3.284.132,29	0,58%	23	1,26%	Artigo 8º, Inciso III
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	Não se aplica	Não se aplica	4.905.324,55	0,86%		0,20%	Artigo 8º, Inciso VI
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS12	S/Info	Não se aplica	10.861.040,52	1,91%		16,80%	Artigo 8º, Inciso VI
TOTAL -			570.099.616,20				

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

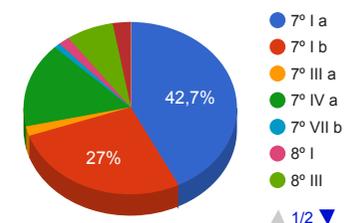
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	243.210.227,03	42,66%	0,00%	46,70%	80,00%	212.869.465,93
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	153.759.893,60	26,97%	0,00%	32,80%	80,00%	302.319.799,36
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	10.287.566,52	1,80%	0,00%	8,10%	60,00%	331.772.203,20
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	90.693.618,31	15,91%	0,00%	0,00%	30,00%	80.336.266,55
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	60.936,92	0,01%	0,00%	0,05%	5,00%	28.444.043,89
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5.469.772,00	0,96%	0,00%	1,05%	5,00%	23.035.208,81
Total Renda Fixa	100,00%	503.482.014,38	88,31%	0,00	88,70	280,00	-

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	9.802.541,71	1,72%	0,00%	3,73%	10,00%	47.207.419,91
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	41.048.695,04	7,20%	0,00%	4,56%	15,00%	44.466.247,39
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	15.766.365,07	2,77%	0,00%	3,01%	5,00%	12.738.615,74
Total Renda Variável	30,00%	66.617.601,82	11,69%	0,00	11,30	40,00	-

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 " a "	243.210.227,03	42,66%	0,00%	80,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	153.759.893,60	26,97%	0,00%	80,00%
Artigo 7º, Inciso II	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	10.287.566,52	1,80%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	90.693.618,31	15,91%	0,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	60.936,92	0,01%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5.469.772,00	0,96%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	503.482.014,38	88,31%	0,00	280,00

Artigos - Renda Variável	Base: setembro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I	9.802.541,71	1,72%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso III	41.048.695,04	7,20%	0,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	15.766.365,07	2,77%	0,00%	5,00%
Total Renda Variável	66.617.601,82	11,69%	0,00	40,00

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%	-	-	-
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%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	2,36%	14,35%	8,51%	5,52%	16,94%	56,62%	0,20%	2,012%	13,02%
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%
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%
BRADERCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	0,73%	7,36%	3,93%	3,14%	3,40%	17,84%	0,20%	0,403%	6,82%
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%
IMA-B 5	1,01%	10,94%	5,18%	6,58%	13,45%	34,82%	-	-	-
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%
CDI + 3,50% ao ano	0,91%	10,83%	3,15%	6,65%	15,40%	36,32%	-	-	-
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-84,28%	-65,54%	-7,80%	-10,62%	-39,72%	-58,48%	0,20%	-	-
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%
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%
IRF-M 1	0,74%	9,14%	2,72%	5,49%	12,65%	29,70%	-	-	-

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
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%
BRASESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,71%	8,98%	2,68%	5,40%	12,45%	29,47%	0,20%	0,077%	0,68%
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%	-	-	-
BRASESCO 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%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,65%	8,10%	2,27%	4,86%	11,65%	27,28%	0,20%	0,014%	0,11%
BRASESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	0,63%	7,95%	2,22%	4,84%	11,35%	26,74%	0,20%	0,011%	0,45%

IPCA + 6,00% ao ano	0,62%	6,30%	2,09%	3,77%	8,64%	24,92%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,24%	12,88%	6,74%	7,03%	15,31%	43,57%	0,15%	1,036%	6,43%
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,50%	0,52%	-0,98%	0,95%	2,59%	11,92%	0,20%	0,237%	3,94%
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,50%	0,41%	-1,01%	0,92%	2,48%	11,78%	0,20%	0,238%	3,98%
CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,49%	0,45%	-1,00%	0,91%	2,50%	11,73%	0,20%	0,237%	3,95%

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%

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

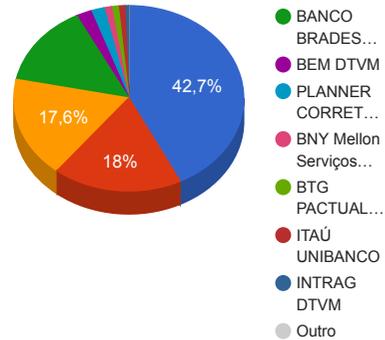
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
ICON	7,21%	32,60%	23,58%	26,89%	20,21%	40,72%	-	-	-
BB CONSUMO FIC AÇÕES	7,05%	31,06%	23,07%	25,82%	18,59%	36,83%	1,00%	6,203%	18,60%
IFIX	6,58%	19,16%	7,09%	9,30%	22,30%	58,65%	-	-	-
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-	-	0,30%	-	-
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS12	-	-100,00%	-	-100,00%	-100,00%	-100,00%	0,14%	-	-
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%
IVBX-2	5,10%	22,24%	17,38%	16,83%	20,48%	46,89%	-	-	-
KINEA PIPE FI AÇÕES	8,18%	39,41%	19,54%	24,97%	32,79%	80,47%	1,50%	5,516%	18,56%
Ibovespa	4,88%	23,36%	18,12%	14,33%	27,29%	64,88%	-	-	-
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	4,93%	25,23%	17,43%	14,95%	26,65%	58,43%	1,50%	5,975%	18,16%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	4,79%	22,63%	17,81%	13,97%	26,54%	63,29%	0,50%	6,319%	20,57%
IBX	4,69%	24,29%	17,91%	14,93%	27,43%	62,93%	-	-	-
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	4,19%	20,89%	14,17%	13,81%	18,13%	46,09%	2,00%	5,932%	14,70%
IGC	4,69%	27,98%	17,57%	16,74%	29,18%	58,91%	-	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	4,58%	27,18%	17,31%	16,30%	28,27%	57,49%	1,00%	6,082%	18,56%
SMLL	3,68%	45,17%	21,74%	25,04%	41,48%	87,27%	-	-	-

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

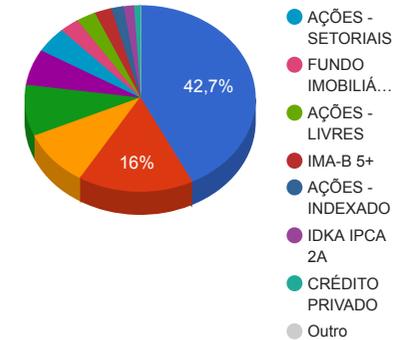
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	6,78%	31,58%	21,55%	20,09%	17,25%	10,78%	1,72%	8,311%	18,03%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	5,82%	39,50%	27,00%	22,37%	42,82%	68,53%	2,00%	7,488%	20,27%

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

Administrador	Valor	%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	243.210.227,03	42,66%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	102.693.175,89	18,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	100.116.951,22	17,56%
BANCO BRADESCO	81.162.734,45	14,24%
BEM DTVM	12.177.268,54	2,14%
PLANNER CORRETORA	10.861.040,52	1,91%
BNY Mellon Serviços Financeiros	5.933.941,31	1,04%
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS	5.416.795,91	0,95%
ITAÚ UNIBANCO	5.182.412,12	0,91%
INTRAG DTVM	3.284.132,29	0,58%
Geração Futuro	60.936,92	0,01%



Sub-segmento	Valor	%
TÍTULOS PÚBLICOS	243.210.227,03	42,66%
IMA-B	90.988.654,71	15,96%
IRF-M 1	55.304.532,08	9,70%
CDI	50.732.938,47	8,90%
IMA-B 5	35.700.490,50	6,26%
AÇÕES - SETORIAIS	25.587.294,21	4,49%
FUNDO IMOBILIÁRIO	15.766.365,07	2,77%
AÇÕES - LIVRES	15.461.400,83	2,71%
IMA-B 5+	13.690.395,62	2,40%
AÇÕES - INDEXADO	9.802.541,71	1,72%
IDKA IPCA 2A	8.324.067,05	1,46%
CRÉDITO PRIVADO	5.469.772,00	0,96%
FIDC - FECHADO	60.936,92	0,01%



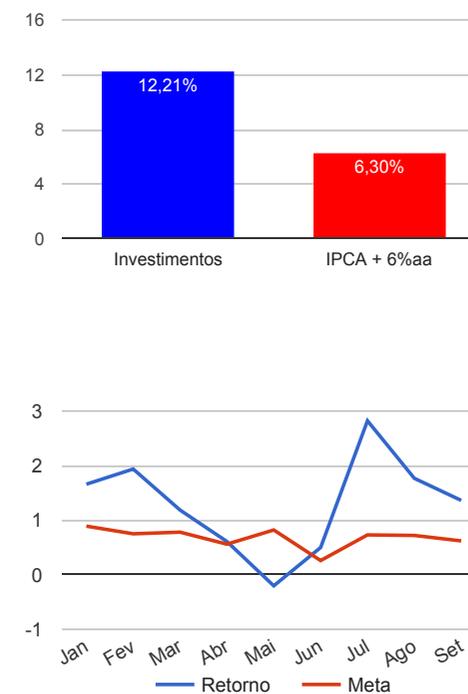
Carteira de Títulos Públicos - base (setembro / 2017)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde.	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	GAP (Atual - Pago)
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2021	10/11/2016	7000	3.029,485123	3.266,896132	21.206.395,86	22.868.272,92	1.661.877,06
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2021	29/08/2016	10000	2.967,972738	3.266,896132	29.679.727,38	32.668.961,32	2.989.233,94
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2021	12/09/2016	10000	2.980,886631	3.266,896132	29.808.866,31	32.668.961,32	2.860.095,01
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2021	14/09/2016	10000	2.971,010111	3.266,896132	29.710.101,11	32.668.961,32	2.958.860,21
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2022	27/07/2016	15000	2.963,303079	3.236,377517	44.449.546,19	48.545.662,76	4.096.116,57
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2022	04/08/2016	13000	2.979,58205	3.236,377517	38.734.566,65	42.072.907,72	3.338.341,07
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2022	30/06/2016	9800	2.911,042410	3.236,377517	28.528.215,62	31.716.499,67	3.188.284,05

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	481.983.217,97	6.210.481,37	2.176.834,83	494.073.851,89	8.056.987,38	1,66%	0,89%	185,86%	2,50%
Fevereiro	494.073.851,89	14.049.236,35	10.223.919,06	507.535.988,06	9.636.818,88	1,94%	0,75%	258,60%	2,62%
Março	507.535.988,06	35.555.957,58	32.519.141,35	516.620.770,95	6.047.966,66	1,18%	0,78%	150,98%	1,71%
Abril	516.620.770,95	3.306.049,90	1.803.184,73	521.276.825,44	3.153.189,32	0,61%	0,56%	109,13%	1,42%
Mai	521.276.825,44	9.096.813,15	5.692.426,57	523.620.415,09	-1.060.796,93	-0,20%	0,82%	-24,61%	5,53%
Junho	523.620.415,09	4.068.727,92	1.927.246,10	528.387.399,93	2.625.503,02	0,50%	0,26%	195,34%	1,39%
Julho	528.387.399,93	4.929.546,36	2.813.656,13	545.453.564,30	14.950.274,14	2,82%	0,73%	387,15%	1,27%
Agosto	545.453.564,30	92.450.501,73	87.939.489,85	559.673.428,58	9.708.852,40	1,77%	0,72%	243,75%	1,98%
Setembro	559.673.428,58	5.800.230,47	3.032.600,21	570.099.616,20	7.658.557,36	1,36%	0,62%	218,12%	1,49%
Acumulado no ano					60.777.352,23	12,21%	6,30%	193,71%	

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(%)
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	10.050.345,70	0,00	0,00	10.287.566,52	237.220,82	2,36%	2,01%	2,36%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	36.059.814,90	0,00	0,00	36.701.955,11	642.140,21	1,78%	1,33%	1,78%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	18.188.157,48	1.996.791,46	0,00	20.524.397,45	339.448,51	1,68%	1,35%	1,80%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.289.133,19	0,00	0,00	14.467.009,84	177.876,65	1,24%	1,04%	1,24%
TÍTULOS PÚBLICOS	240.384.431,60	0,00	0,00	243.210.227,03	2.825.795,43	1,18%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.460.570,78	0,00	0,00	5.514.730,50	54.159,72	0,99%	0,65%	0,99%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.917.913,10	0,00	0,00	6.977.207,70	59.294,60	0,86%	0,48%	0,86%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	2.724.506,49	0,00	2.744.984,93	20.478,44	0,75%	2,00%	2,37%
BRADERCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	118.398,58	0,00	0,00	119.262,31	863,73	0,73%	0,40%	0,73%
BRADERCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	19.976.143,03	0,00	0,00	20.118.602,42	142.459,39	0,71%	0,08%	0,71%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	25.380.295,38	0,00	0,00	25.560.816,09	180.520,71	0,71%	0,07%	0,71%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	11.826.893,35	423.431,32	2.707.151,29	9.625.113,57	81.940,19	0,67%	0,07%	0,71%
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	50.298.112,83	0,00	0,00	50.634.111,55	335.998,72	0,67%	0,01%	0,67%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	95.017,99	0,00	0,00	95.635,27	617,28	0,65%	0,01%	0,65%
BRADERCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	3.171,76	0,00	0,00	3.191,65	19,89	0,63%	0,01%	0,63%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	5.442.116,00	0,00	0,00	5.469.772,00	27.656,00	0,51%	0,23%	0,51%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	23.749.520,00	0,00	0,00	23.868.120,00	118.600,00	0,50%	0,28%	0,50%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.340.171,44	0,00	0,00	1.346.859,35	6.687,91	0,50%	0,28%	0,50%
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.286.390,00	0,00	0,00	6.317.640,00	31.250,00	0,50%	0,24%	0,50%
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.538.657,50	0,00	0,00	9.585.982,50	47.325,00	0,50%	0,24%	0,50%
CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.543.285,00	0,00	0,00	9.590.047,50	46.762,50	0,49%	0,24%	0,49%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	655.501,20	0,00	657.844,17	2.342,97	0,36%	1,97%	2,32%

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(%)
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	387.749,52	0,00	325.448,92	60.936,92	-1.363,68	-0,35%	-	-
Total Renda Fixa					5.378.094,99	1,08%	0,56%	

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(%)
KINEA PIPE FI AÇÕES	3.035.674,39	0,00	0,00	3.284.132,29	248.457,90	8,18%	5,52%	8,18%
BB CONSUMO FIC AÇÕES	5.734.166,61	0,00	0,00	6.138.323,29	404.156,68	7,05%	6,20%	7,05%
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	4.525.569,75	0,00	0,00	4.832.257,85	306.688,10	6,78%	8,31%	6,78%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	5.607.379,34	0,00	0,00	5.933.941,31	326.561,97	5,82%	7,49%	5,82%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	5.159.103,00	0,00	0,00	5.416.795,91	257.692,91	4,99%	4,85%	4,99%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	4.938.705,40	0,00	0,00	5.182.412,12	243.706,72	4,93%	5,98%	4,93%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	4.409.006,21	0,00	0,00	4.620.129,59	211.123,38	4,79%	6,32%	4,79%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	3.122.824,35	0,00	0,00	3.265.975,85	143.151,50	4,58%	6,08%	4,58%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	11.687.257,44	0,00	0,00	12.177.268,54	490.011,10	4,19%	5,93%	4,19%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS12	10.651.143,09	0,00	0,00	10.861.040,52	209.897,43	1,97%	-	1,97%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	5.466.309,87	0,00	0,00	4.905.324,55	-560.985,32	-10,26%	-	0,00%
Total Renda Variável					2.280.462,37	3,54%	6,28%	

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 (%)
TÍTULOS PÚBLICOS	231.594.621,53	0,00	3.352.452,23	243.210.227,03	14.968.057,73	6,48%	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	33.732.135,18	524.135,13	0,00	36.701.955,11	2.445.684,80	7,19%	7,21%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	77.513.323,62	1.306.158,30	60.000.000,00	20.118.602,42	1.299.120,50	2,20%	2,68%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.921.235,68	0,00	383.691,30	14.467.009,84	929.465,46	6,71%	6,74%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.208.073,51	14.615.538,01	0,00	20.524.397,45	700.785,93	6,63%	7,25%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	23.850.680,00	0,00	659.196,20	23.868.120,00	676.636,20	2,85%	0,07%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	24.840.903,58	55.870,56	0,00	25.560.816,09	664.041,95	2,67%	2,67%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,00	50.000.000,00	0,00	50.634.111,55	634.111,55	1,27%	2,49%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	19.529.719,56	17.946.116,64	28.300.045,57	9.625.113,57	449.322,94	2,04%	2,67%
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	66.095,58	0,00	326.381,10	60.936,92	321.222,44	485,99%	-7,80%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.687.611,45	0,00	0,00	6.977.207,70	289.596,25	4,33%	4,33%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	0,00	10.000.000,00	0,00	10.287.566,52	287.566,52	2,88%	8,51%
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.683.880,00	0,00	274.798,37	9.585.982,50	176.900,87	1,84%	-1,01%
CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.686.835,00	0,00	271.840,76	9.590.047,50	175.053,26	1,82%	-1,00%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	5.341.016,00	0,00	0,00	5.469.772,00	128.756,00	2,41%	2,41%
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.380.285,00	0,00	179.396,83	6.317.640,00	116.751,83	1,84%	-0,98%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	58.784,80	5.352.452,23	0,00	5.514.730,50	103.493,47	4,76%	5,13%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.346.815,77	0,00	37.943,83	1.346.859,35	37.987,41	2,83%	2,84%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	2.724.506,49	0,00	2.744.984,93	20.478,44	0,75%	8,52%
BRADESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	114.749,23	0,00	0,00	119.262,31	4.513,08	3,93%	3,93%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	655.501,20	0,00	657.844,17	2.342,97	0,36%	8,56%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	93.517,10	0,00	0,00	95.635,27	2.118,17	2,27%	2,27%

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 (%)
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	3.122,46	0,00	0,00	3.191,65	69,19	2,22%	2,22%
Total Renda Fixa					24.434.076,96	5,15%	

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 (%)
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	10.665.699,35	0,00	0,00	12.177.268,54	1.511.569,19	14,17%	14,17%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	4.672.374,88	0,00	0,00	5.933.941,31	1.261.566,43	27,00%	27,00%
BB CONSUMO FIC AÇÕES	4.987.825,51	0,00	0,00	6.138.323,29	1.150.497,78	23,07%	23,07%
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	3.975.465,06	0,00	0,00	4.832.257,85	856.792,79	21,55%	21,55%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	4.413.140,88	0,00	0,00	5.182.412,12	769.271,24	17,43%	17,43%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	3.921.621,14	0,00	0,00	4.620.129,59	698.508,45	17,81%	17,81%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	4.755.894,74	0,00	0,00	5.416.795,91	660.901,17	13,90%	13,90%
KINEA PIPE FI AÇÕES	2.747.260,65	0,00	0,00	3.284.132,29	536.871,64	19,54%	19,54%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	2.784.056,74	0,00	0,00	3.265.975,85	481.919,11	17,31%	17,31%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS12	10.470.388,00	0,00	0,00	10.861.040,52	390.652,52	3,73%	-
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	5.340.267,93	0,00	0,00	4.905.324,55	-434.943,38	-8,14%	0,00%
Total Renda Variável					7.883.606,94	13,42%	