

Relatório Analítico dos Investimentos em outubro de 2017



Carteira consolidada de investimentos - base (outubro / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
TÍTULOS PÚBLICOS			243.665.773,47	42,45%			Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	7.029.903,79	1,22%	700	0,14%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	9.594.935,18	1,67%	1.377	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	50.963.248,12	8,88%	545	0,44%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	671.014,59	0,12%	274	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2022	9.672.375,00	1,69%	17	12,91%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	18/08/2020	6.372.350,00	1,11%	19	5,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADERCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	D+1	16/05/2019	120.330,70	0,02%	11	0,15%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.506.597,43	0,79%	255	0,36%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	9.668.902,50	1,68%	38	5,58%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	36.554.148,87	6,37%	610	0,68%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.540.180,61	0,97%	715	0,09%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	24.108.740,00	4,20%	223	0,75%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	1.360.349,42	0,24%	193	0,38%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	20.662.384,21	3,60%	780	0,39%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	11.382.230,30	1,98%	54	2,76%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	25.716.516,05	4,48%	1.223	0,23%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADERCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	20.238.474,18	3,53%	193	2,89%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	96.282,13	0,02%	756	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	14.466.721,96	2,52%	95	3,67%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADERCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.211,87	0,00%	148	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	51.978,87	0,01%	42	3,01%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "

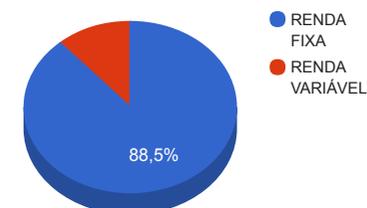
Carteira consolidada de investimentos - base (outubro / 2017)

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	5.512.944,00	0,96%	100	2,44%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	3.233.629,79	0,56%	90	1,61%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	5.138.275,36	0,90%	39	0,89%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	D+43	5 anos	4.712.100,34	0,82%	56	4,31%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	4.619.714,78	0,80%	24	14,75%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	5.944.998,44	1,04%	2.939	1,60%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	D+13	Não há	12.041.429,81	2,10%	495	14,62%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
KINEA PIPE FI AÇÕES	D+363 a D+723 ou D+30 a D+1830	Não há	3.256.379,05	0,57%	23	1,26%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	D+33	Não há	5.331.950,75	0,93%	485	8,25%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB CONSUMO FIC AÇÕES	D+4	Não há	5.972.583,12	1,04%	2.901	4,84%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	Não se aplica	Não se aplica	4.878.251,04	0,85%		0,20%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS12	S/Info	Não se aplica	10.871.105,95	1,89%		16,82%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
TOTAL -			573.960.011,68				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	243.665.773,47	42,45%	0,00%	46,70%	80,00%	215.502.235,87
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	32,80%	80,00%	459.168.009,34
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	8,10%	60,00%	344.376.007,01
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	258.728.896,91	45,08%	0,00%	0,00%	30,00%	-86.540.893,41
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	51.978,87	0,01%	0,00%	0,05%	5,00%	28.646.021,71
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5.512.944,00	0,96%	0,00%	1,05%	5,00%	23.185.056,58
Total Renda Fixa	100,00%	507.959.593,25	88,50%	0,00	88,70	280,00	-

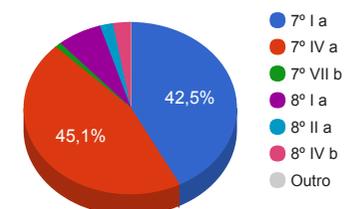
Distribuição por Segmento



 O Somatório dos incisos "a" e "b" do Artigo 7º IV não podem ultrapassar 40% (quarenta por cento).

Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso I	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,73%	10,00%	57.396.001,17
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	38.946.527,57	6,79%	0,00%	0,00%	0,00%	-38.946.527,57
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	11.304.533,87	1,97%	0,00%	0,00%	0,00%	-11.304.533,87
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	4,56%	15,00%	86.094.001,75
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	15.749.356,99	2,74%	0,00%	0,00%	0,00%	-15.749.356,99
Artigo 8º, Inciso VI	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,01%	5,00%	28.698.000,58
Total Renda Variável	30,00%	66.000.418,43	11,50%	0,00	11,30	40,00	-

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: outubro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	243.665.773,47	42,45%	0,00%	80,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	80,00%
Artigo 7º, Inciso II	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	258.728.896,91	45,08%	0,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	51.978,87	0,01%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5.512.944,00	0,96%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	507.959.593,25	88,50%	0,00	280,00

Artigos - Renda Variável	Base: outubro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	38.946.527,57	6,79%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	11.304.533,87	1,97%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	15.749.356,99	2,74%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso V	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Total Renda Variável	66.000.418,43	11,50%	0,00	40,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (outubro / 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	100.259.123,71	17,47%	0,03%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	95.101.149,72	16,57%	0,01%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	82.707.495,17	14,41%	0,01%
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	22.912.535,76	3,99%	13,91%
AZ QUEST INVESTIMENTOS	5.944.998,44	1,04%	0,04%
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS	5.331.950,75	0,93%	0,02%
ITAÚ DTVM	5.138.275,36	0,90%	0,00%
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	4.878.251,04	0,85%	0,36%
VINCI PARTNERS	4.712.100,34	0,82%	0,03%
KINEA INVESTIMENTOS	3.256.379,05	0,57%	0,00%
BRASIL PLURAL	51.978,87	0,01%	0,00%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI + 3,50% ao ano	0,93%	11,87%	2,99%	6,55%	14,95%	35,69%	-	-	-
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-14,70%	-70,60%	-10,21%	-23,58%	-45,64%	-63,25%	0,20%	3,242%	651,96%
IPCA + 6,00% ao ano	0,91%	7,27%	2,27%	4,13%	8,84%	24,42%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,87%	1,39%	-0,52%	1,20%	2,86%	11,57%	0,20%	0,093%	3,94%
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,87%	1,28%	-0,55%	1,17%	2,75%	11,43%	0,20%	0,093%	3,98%
CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,86%	1,31%	-0,54%	1,16%	2,77%	11,38%	0,20%	0,093%	3,94%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,00%	12,88%	2,86%	6,71%	14,66%	41,80%	0,15%	1,517%	6,42%
IDKA IPCA 2 Anos	0,80%	12,02%	2,70%	6,61%	14,10%	31,77%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,00%	9,57%	2,20%	5,20%	11,55%	27,34%	0,20%	0,368%	1,85%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,76%	11,12%	2,62%	6,18%	13,11%	30,79%	0,20%	0,577%	2,89%
Selic	0,64%	8,73%	2,10%	4,71%	11,10%	26,74%	-	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,65%	9,16%	2,32%	4,98%	11,62%	27,50%	0,20%	0,012%	0,13%
CDI	0,64%	8,72%	2,10%	4,70%	11,08%	26,70%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,68%	8,83%	2,13%	4,75%	11,22%	26,72%	0,20%	0,029%	0,12%
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	0,63%	8,63%	2,05%	4,69%	10,92%	26,17%	0,20%	0,008%	0,11%
IRF-M 1	0,62%	9,81%	2,28%	5,22%	12,29%	28,83%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,62%	9,66%	2,24%	5,14%	12,09%	28,45%	0,20%	0,091%	0,67%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,61%	9,60%	2,21%	5,11%	12,01%	28,25%	0,10%	0,077%	0,68%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,60%	9,63%	2,21%	5,13%	12,05%	28,29%	0,20%	0,079%	0,68%
IMA-B 5	0,48%	11,48%	2,77%	6,34%	13,48%	32,18%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,46%	11,31%	2,72%	6,25%	13,27%	31,57%	0,20%	0,898%	3,64%
IPCA	0,42%	2,21%	0,77%	1,09%	2,70%	10,79%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,79%	8,60%	1,89%	4,55%	10,71%	29,91%	0,20%	0,230%	1,49%
IMA-B 5+	-1,01%	13,46%	2,74%	5,58%	15,27%	52,38%	-	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,99%	12,95%	2,66%	5,31%	14,65%	51,23%	0,20%	2,512%	12,74%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,03%	13,20%	2,67%	5,53%	14,99%	51,06%	0,20%	2,529%	12,65%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	-1,05%	13,15%	2,63%	5,34%	14,89%	50,99%	0,20%	2,539%	12,96%
IMA-B	-0,38%	12,73%	2,78%	5,80%	14,59%	44,31%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,01%	3,68%	-0,56%	2,37%	5,50%	15,35%	0,20%	0,373%	4,39%
BRDESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	0,90%	8,32%	2,51%	3,15%	3,92%	15,94%	0,20%	0,464%	6,79%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,40%	12,49%	2,71%	5,65%	14,29%	43,59%	0,20%	1,821%	9,76%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,41%	12,53%	2,73%	5,69%	14,41%	43,66%	0,20%	1,825%	9,75%

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

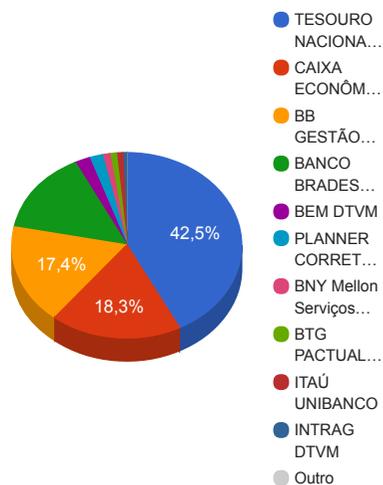
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDIV	0,29%	27,92%	13,84%	11,16%	23,99%	82,58%	-	-	-
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	-1,57%	20,33%	9,32%	10,53%	10,77%	37,18%	2,50%	7,097%	14,62%
IFIX	0,23%	19,43%	7,76%	9,40%	18,10%	55,68%	-	-	-
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	0,00%	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%	-	-
Ibovespa	0,02%	23,38%	12,73%	13,62%	14,45%	62,01%	-	-	-
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	-0,01%	22,62%	12,46%	13,19%	14,06%	61,23%	0,50%	7,798%	20,71%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	-0,85%	24,16%	11,00%	12,64%	14,87%	55,86%	1,50%	7,279%	18,35%
ICON	-2,56%	29,20%	13,91%	16,01%	16,64%	39,21%	-	-	-
BB CONSUMO FIC AÇÕES	-2,70%	27,52%	13,43%	15,04%	15,18%	35,69%	1,00%	9,296%	19,06%
SMLL	-1,48%	43,01%	10,90%	19,12%	30,25%	74,95%	-	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	0,19%	39,76%	15,01%	20,49%	30,64%	62,59%	2,00%	8,697%	20,70%
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	-2,49%	28,31%	13,00%	15,57%	10,49%	5,02%	1,72%	7,877%	18,51%
IGC	-0,94%	26,77%	11,29%	13,69%	17,84%	55,80%	-	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	-0,99%	25,92%	11,05%	13,28%	16,96%	54,24%	1,00%	7,450%	18,72%
IVBX-2	-0,41%	21,75%	12,44%	14,62%	13,94%	43,78%	-	-	-
KINEA PIPE FI AÇÕES	-0,85%	38,23%	11,76%	18,43%	27,60%	74,97%	1,50%	8,025%	19,02%

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

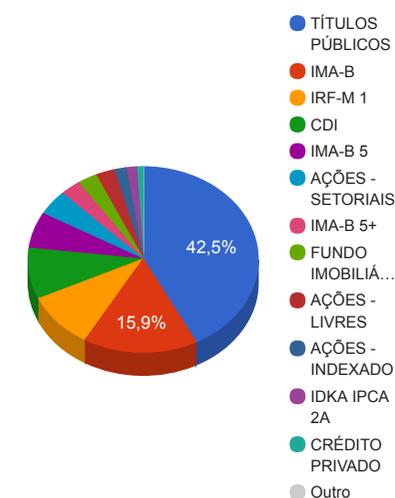
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IBX	-0,13%	24,13%	12,24%	13,79%	14,91%	60,54%	-	-	-
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	-1,12%	19,54%	8,44%	10,51%	10,04%	42,60%	2,00%	5,952%	14,86%

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

Administrador	Valor	%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	243.665.773,47	42,45%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	104.971.224,05	18,29%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	99.979.400,76	17,42%
BANCO BRADESCO	82.707.495,17	14,41%
BEM DTVM	12.041.429,81	2,10%
PLANNER CORRETORA	10.871.105,95	1,89%
BNY Mellon Serviços Financeiros	5.944.998,44	1,04%
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS	5.331.950,75	0,93%
ITAÚ UNIBANCO	5.138.275,36	0,90%
INTRAG DTVM	3.256.379,05	0,57%
Geração Futuro	51.978,87	0,01%



Sub-segmento	Valor	%
TÍTULOS PÚBLICOS	243.665.773,47	42,45%
IMA-B	91.144.863,24	15,88%
IRF-M 1	55.549.925,41	9,68%
CDI	51.062.742,12	8,90%
IMA-B 5	36.021.270,61	6,28%
AÇÕES - SETORIAIS	25.195.262,44	4,39%
IMA-B 5+	16.559.842,32	2,89%
FUNDO IMOBILIÁRIO	15.749.356,99	2,74%
AÇÕES - LIVRES	15.297.808,86	2,67%
AÇÕES - INDEXADO	9.757.990,14	1,70%
IDKA IPCA 2A	8.390.253,21	1,46%
CRÉDITO PRIVADO	5.512.944,00	0,96%
FIDC - FECHADO	51.978,87	0,01%

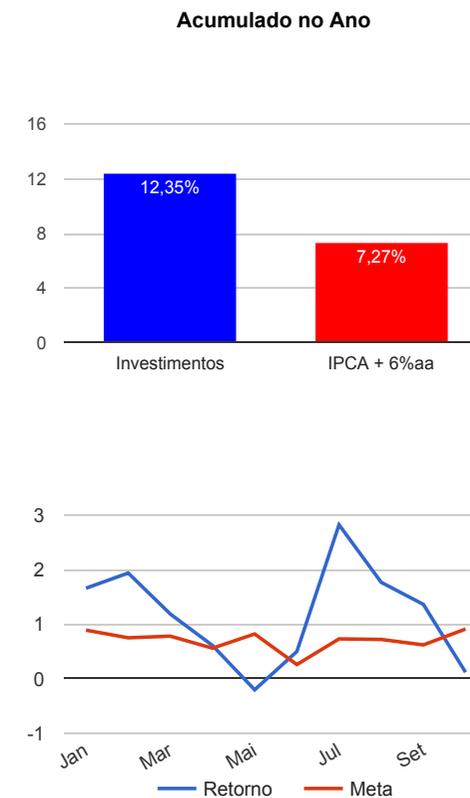


Carteira de Títulos Públicos - base (outubro / 2017)

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	3.278,814078	21.206.395,86	22.951.698,55	1.745.302,69
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2021	29/08/2016	10000	2.967,972738	3.278,814078	29.679.727,38	32.788.140,78	3.108.413,40
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2021	12/09/2016	10000	2.980,886631	3.278,814078	29.808.866,31	32.788.140,78	2.979.274,47
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2021	14/09/2016	10000	2.971,010111	3.278,814078	29.710.101,11	32.788.140,78	3.078.039,67
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2022	27/07/2016	15000	2.963,303079	3.236,763296	44.449.546,19	48.551.449,44	4.101.903,26
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2022	04/08/2016	13000	2.979,58205	3.236,763296	38.734.566,65	42.077.922,85	3.343.356,20
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2022	30/06/2016	9800	2.911,042410	3.236,763296	28.528.215,62	31.720.280,30	3.192.064,68

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%
Outubro	570.099.616,20	5.136.705,38	1.965.878,36	573.960.011,68	689.568,46	0,12%	0,91%	13,24%	1,82%
Acumulado no ano					61.466.920,69	12,35%	7,27%	169,83%	



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	23.868.120,00	0,00	0,00	24.108.740,00	240.620,00	1,01%	0,37%	1,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.346.859,35	0,00	0,00	1.360.349,42	13.490,07	1,00%	0,37%	1,00%
BRADESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	119.262,31	0,00	0,00	120.330,70	1.068,39	0,90%	0,46%	0,90%
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.317.640,00	0,00	0,00	6.372.350,00	54.710,00	0,87%	0,09%	0,87%
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.585.982,50	0,00	0,00	9.668.902,50	82.920,00	0,87%	0,09%	0,87%
CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.590.047,50	0,00	0,00	9.672.375,00	82.327,50	0,86%	0,09%	0,86%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	5.469.772,00	0,00	0,00	5.512.944,00	43.172,00	0,79%	0,23%	0,79%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.977.207,70	0,00	0,00	7.029.903,79	52.696,09	0,76%	0,58%	0,76%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	95.635,27	0,00	0,00	96.282,13	646,86	0,68%	0,03%	0,68%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	50.634.111,55	0,00	0,00	50.963.248,12	329.136,57	0,65%	0,01%	0,65%
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	3.191,65	0,00	0,00	3.211,87	20,22	0,63%	0,01%	0,63%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	25.560.816,09	0,00	0,00	25.716.516,05	155.699,96	0,61%	0,08%	0,61%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	20.118.602,42	0,00	0,00	20.238.474,18	119.871,76	0,60%	0,08%	0,60%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.625.113,57	1.844.383,05	1.937.438,36	9.594.935,18	62.876,92	0,55%	0,09%	0,62%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.514.730,50	0,00	0,00	5.540.180,61	25.450,11	0,46%	0,90%	0,46%
TÍTULOS PÚBLICOS	243.210.227,03	0,00	0,00	243.665.773,47	455.546,44	0,19%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.467.009,84	0,00	0,00	14.466.721,96	-287,88	0,00%	1,52%	-0,00%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	36.701.955,11	0,00	0,00	36.554.148,87	-147.806,24	-0,40%	1,82%	-0,40%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	20.524.397,45	224.312,50	0,00	20.662.384,21	-86.325,74	-0,42%	1,83%	-0,41%
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	60.936,92	0,00	8.440,00	51.978,87	-518,05	-0,85%	3,24%	-0,91%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	657.844,17	40.000,00	20.000,00	671.014,59	-6.829,58	-0,98%	2,51%	-0,99%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	10.287.566,52	1.209.682,94	0,00	11.382.230,30	-115.019,16	-1,00%	2,54%	-1,05%

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.744.984,93	1.818.326,89	0,00	4.506.597,43	-56.714,39	-1,24%	2,53%	-1,03%
				Total Renda Fixa	1.306.751,85	0,26%	0,74%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	5.933.941,31	0,00	0,00	5.944.998,44	11.057,13	0,19%	8,70%	0,19%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS12	10.861.040,52	0,00	0,00	10.871.105,95	10.065,43	0,09%	-	0,00%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	4.620.129,59	0,00	0,00	4.619.714,78	-414,81	-0,01%	7,80%	-0,01%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	4.905.324,55	0,00	0,00	4.878.251,04	-27.073,51	-0,55%	-	0,00%
KINEA PIPE FI AÇÕES	3.284.132,29	0,00	0,00	3.256.379,05	-27.753,24	-0,85%	8,03%	-0,85%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	5.182.412,12	0,00	0,00	5.138.275,36	-44.136,76	-0,85%	7,28%	-0,85%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	3.265.975,85	0,00	0,00	3.233.629,79	-32.346,06	-0,99%	7,45%	-0,99%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	12.177.268,54	0,00	0,00	12.041.429,81	-135.838,73	-1,12%	5,95%	-1,12%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	5.416.795,91	0,00	0,00	5.331.950,75	-84.845,16	-1,57%	7,10%	-1,57%
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	4.832.257,85	0,00	0,00	4.712.100,34	-120.157,51	-2,49%	7,88%	-2,49%
BB CONSUMO FIC AÇÕES	6.138.323,29	0,00	0,00	5.972.583,12	-165.740,17	-2,70%	9,30%	-2,70%
Total Renda Variável					-617.183,39	-0,93%	7,51%	