

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



Carteira consolidada de investimentos - base (dezembro / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	20.198.088,61	14,93%	712	0,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.016.187,99	1,49%	297	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	17.837.797,29	13,18%	1.412	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	6.539.228,46	4,83%	147	0,33%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	9.966.799,32	7,36%	703	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	2.755.362,27	2,04%	33	0,85%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.900.351,12	2,88%	619	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.829.030,41	3,57%	722	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.255.370,20	2,41%	757	0,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	6.545.378,46	4,84%	114	0,95%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.196.484,92	6,06%	313	0,33%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	D+0	Não há	10.527.940,35	7,78%	126	0,95%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	73.720,33	0,05%	632	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	6.753.239,12	4,99%	748	0,12%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BTG PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA	D+0 ou D+1	Não há	2.516.088,60	1,86%	12	1,69%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	17.433,50	0,01%	235	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BBIF MASTER FIDC LP	Não se aplica	27 meses	270.621,61	0,20%	13	0,93%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	7.845.384,55	5,80%	38	2,35%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
FRANKLIN TEMPLETON VALOR E FVL FI AÇÕES	D+4	Não há	2.313.309,30	1,71%	1.974	0,92%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou D+33	Não há	5.248.743,15	3,88%	1.923	1,17%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	2.316.092,18	1,71%	1.923	3,37%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
HIX CAPITAL INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+63	Não há	2.200.000,00	1,63%	1.023	3,56%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "

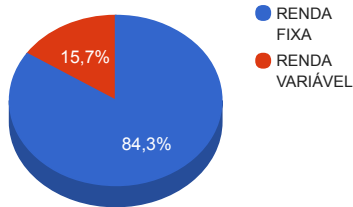
Carteira consolidada de investimentos - base (dezembro / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	2.291.943,10	1,69%	264	0,36%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
SUL AMÉRICA HIGH YIELD FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+361	2 anos	2.785.594,63	2,06%	10	7,48%	Artigo 8º, Inciso III
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	1.208.683,99	0,89%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	2.918.608,91	2,16%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
TOTAL -			135.327.482,37				

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

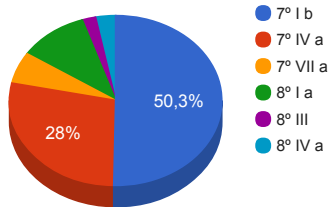
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	68.042.845,47	50,28%	30,00%	35,00%	70,00%	26.686.392,19
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	15,00%	20,00%	60,00%	81.196.489,42
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	37.885.655,48	28,00%	5,00%	5,00%	30,00%	2.712.589,23
Artigo 7º, Inciso VI	0,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	20.299.122,36
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	8.116.006,16	6,00%	0,00%	2,50%	5,00%	-1.349.632,04
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	6.766.374,12
Total Renda Fixa	100,00%	114.044.507,11	84,27%	55,00	75,00	185,00	-

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	14.370.087,73	10,62%	0,00%	0,00%	0,00%	-14.370.087,73
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	2.785.594,63	2,06%	5,00%	10,00%	15,00%	17.513.527,73
Artigo 8º, Inciso IV	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	6.766.374,12
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	4.127.292,90	3,05%	0,00%	0,00%	0,00%	-4.127.292,90
Artigo 8º, Inciso V	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	6.766.374,12
Artigo 8º, Inciso VI	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	6.766.374,12
Total Renda Variável	30,00%	21.282.975,26	15,73%	11,00	25,00	30,00	-

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: dezembro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	68.042.845,47	50,28%	30,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	37.885.655,48	28,00%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	0,00	0,00%	5,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	8.116.006,16	6,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	114.044.507,11	84,27%	55,00	185,00

Artigos - Renda Variável	Base: dezembro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	14.370.087,73	10,62%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso III	2.785.594,63	2,06%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	4.127.292,90	3,05%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso V	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Total Renda Variável	21.282.975,26	15,73%	11,00	30,00

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

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

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	60.062.702,13	44,38%	0,02%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	43.349.710,22	32,03%	0,00%
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS	8.973.515,74	6,63%	0,03%
GGR INVESTIMENTOS	7.845.384,55	5,80%	1,60%
A5 CAPITAL PARTNERS	2.918.608,91	2,16%	-
SULAMÉRICA INVESTIMENTOS	2.785.594,63	2,06%	1,62%
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	2.316.092,18	1,71%	1,84%
FRANKLIN TEMPLETON INVESTIMENTOS	2.313.309,30	1,71%	0,09%
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	2.291.943,10	1,69%	0,01%
HIX CAPITAL	2.200.000,00	1,63%	0,31%
DRACHMA CAPITAL	270.621,61	0,20%	-

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M	1,24%	15,20%	1,44%	6,42%	15,20%	42,12%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,19%	14,80%	1,27%	6,17%	14,80%	41,50%	0,20%	0,843%	4,59%
IDKA IPCA 2 Anos	1,16%	13,61%	2,24%	6,80%	13,61%	30,90%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,87%	12,34%	1,85%	6,25%	12,34%	29,13%	0,20%	0,454%	2,69%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,86%	12,40%	1,91%	6,33%	12,40%	29,14%	0,20%	0,463%	2,75%
IPCA + 7,00% ao ano	0,98%	10,06%	2,81%	5,21%	10,06%	25,14%	-	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	0,70%	3,87%	0,00%	-0,14%	3,87%	18,45%	0,15%	5,095%	-
IPCA + 6,00% ao ano	0,91%	9,05%	2,58%	4,73%	9,05%	22,83%	-	-	-
BTG PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA	0,70%	3,11%	-0,47%	1,37%	3,11%	10,16%	0,15%	0,118%	3,87%
IMA Geral ex-C	0,89%	12,89%	1,03%	5,83%	12,89%	36,69%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,90%	12,26%	0,78%	5,71%	12,26%	-	0,30%	0,804%	4,92%
IMA-B 5	0,88%	12,58%	1,48%	6,74%	12,58%	30,01%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,87%	12,38%	1,42%	6,63%	12,38%	29,45%	0,20%	0,671%	3,50%
IMA-B	0,83%	12,79%	-0,32%	6,96%	12,79%	40,78%	-	-	-
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	0,82%	12,36%	-0,31%	6,73%	12,36%	39,48%	0,20%	1,392%	8,83%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,81%	12,55%	-0,39%	6,83%	12,55%	40,19%	0,20%	1,422%	9,24%
IRF-M 1	0,57%	11,12%	1,82%	4,59%	11,12%	27,47%	-	-	-

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

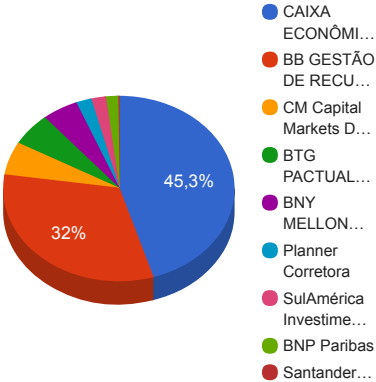
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,57%	10,93%	1,79%	4,51%	10,93%	27,11%	0,20%	0,031%	0,67%
CDI	0,54%	9,93%	1,76%	4,05%	9,93%	25,31%	-	-	-
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	0,59%	10,20%	1,80%	4,14%	10,20%	24,94%	0,20%	0,065%	0,14%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,58%	10,08%	1,83%	4,14%	10,08%	25,36%	0,20%	0,068%	0,13%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,52%	9,94%	1,74%	4,01%	9,94%	25,33%	0,20%	0,021%	0,13%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,47%	9,05%	1,56%	3,63%	9,05%	23,28%	0,80%	0,006%	0,12%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,45%	8,87%	1,49%	3,51%	8,87%	23,14%	1,00%	0,010%	0,12%
IPCA	0,44%	2,95%	1,14%	1,74%	2,95%	9,42%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,93%	13,69%	0,66%	7,38%	13,69%	37,76%	0,20%	1,108%	6,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,80%	11,22%	1,49%	5,54%	11,22%	-	0,002	0,423%	4,29%
Não Possui	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BBIF MASTER FIDC LP	-0,35%	-83,35%	208.958.477.099,00%	528,91%	-83,35%	-85,56%	0,72%	0,027%	19.960.094.729.600,00%

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

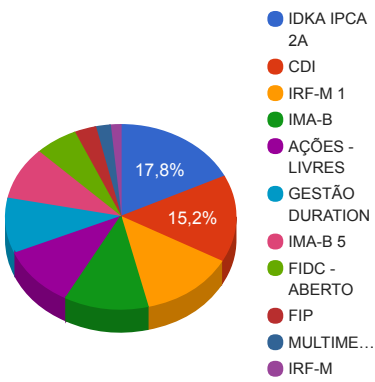
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	6,16%	26,86%	2,84%	21,47%	26,86%	76,25%	-	-	-
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	6,63%	32,51%	0,91%	21,54%	32,51%	79,42%	2,00%	5,047%	15,53%
FRANKLIN TEMPLETON VALOR E FVL FI AÇÕES	6,09%	32,97%	1,59%	21,25%	32,97%	81,47%	2,00%	4,462%	16,26%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	5,79%	17,34%	0,46%	8,67%	17,34%	45,05%	2,00%	4,374%	10,08%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4,95%	29,72%	0,13%	17,07%	29,72%	53,49%	3,00%	4,667%	15,33%
IPCA + 8,00% ao ano	1,06%	11,08%	3,05%	5,70%	11,08%	27,47%	-	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	-	-	-	-	-	-	2,00%	-	-
IPCA	0,44%	2,95%	1,14%	1,74%	2,95%	9,42%	-	-	-
SUL AMÉRICA HIGH YIELD FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	0,67%	12,25%	1,73%	5,56%	12,25%	19,80%	1,50%	0,195%	1,66%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
HIX CAPITAL INSTITUCIONAL FI AÇÕES	2,61%	39,34%	3,95%	20,56%	39,34%	74,99%	2,00%	3,636%	12,65%
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,50%	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	61.271.386,12	45,28%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	43.349.710,22	32,03%
CM Capital Markets DTVM	7.845.384,55	5,80%
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS	7.764.831,75	5,74%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	6.829.401,48	5,05%
Planner Corretora	2.918.608,91	2,16%
SulAmérica Investimentos	2.785.594,63	2,06%
BNP Paribas	2.291.943,10	1,69%
Santander Securities Services	270.621,61	0,20%



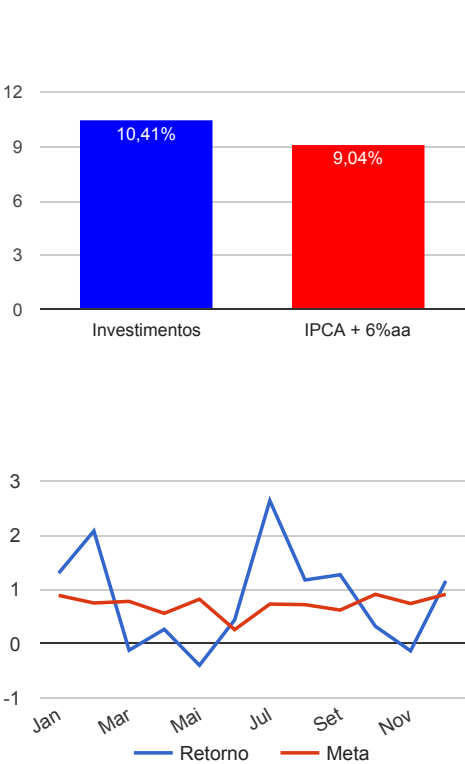
Sub-segmento	Valor	%
IDKA IPCA 2A	24.098.439,73	17,81%
CDI	20.627.703,50	15,24%
IRF-M 1	17.837.797,29	13,18%
IMA-B	15.780.877,60	11,66%
AÇÕES - LIVRES	14.370.087,73	10,62%
GESTÃO DURATION	13.084.606,92	9,67%
IMA-B 5	12.482.887,92	9,22%
FIDC - ABERTO	8.116.006,16	6,00%
FIP	4.127.292,90	3,05%
MULTIMERCADO	2.785.594,63	2,06%
IRF-M	2.016.187,99	1,49%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	118.607.455,25	13.286.011,47	11.410.767,45	122.049.225,15	1.566.525,88	1,30%	0,89%	145,77%	1,80%
Fevereiro	122.049.225,15	14.049.316,58	13.026.915,63	125.625.691,71	2.554.065,61	2,08%	0,75%	277,28%	1,32%
Março	125.625.691,71	8.189.914,65	7.571.868,50	126.093.192,59	-150.545,27	-0,12%	0,78%	-15,20%	1,54%
Abril	126.093.192,59	27.592.702,20	7.321.921,72	146.753.813,08	389.840,01	0,27%	0,56%	47,76%	1,48%
Mai	146.753.813,08	2.982.470,43	22.052.195,11	127.102.657,83	-581.430,57	-0,40%	0,82%	-48,22%	8,75%
Junho	127.102.657,83	11.520.254,57	11.821.044,49	127.359.838,33	557.970,42	0,44%	0,26%	171,73%	1,66%
Julho	127.359.838,33	3.175.288,94	2.376.064,25	131.535.703,78	3.376.640,76	2,63%	0,73%	361,95%	1,59%
Agosto	131.535.703,78	24.311.552,91	24.284.262,41	133.107.309,96	1.544.315,68	1,17%	0,72%	162,07%	0,93%
Setembro	133.107.309,96	2.960.742,36	2.574.883,68	135.188.718,38	1.695.549,74	1,27%	0,62%	203,46%	0,95%
Outubro	135.188.718,38	14.900.521,98	15.239.466,24	135.284.326,09	434.551,97	0,32%	0,91%	35,37%	1,07%
Novembro	135.284.326,09	34.227.162,04	34.587.123,31	134.747.548,94	-176.815,88	-0,13%	0,74%	-17,66%	1,20%
Dezembro	134.747.548,94	9.510.047,77	10.487.564,11	135.327.482,37	1.557.449,77	1,16%	0,91%	127,64%	1,19%
Acumulado no ano					12.768.118,12	10,41%	9,04%	115,11%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.992.506,92	0,00	0,00	2.016.187,99	23.681,07	1,19%	0,84%	1,19%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.729.915,61	0,00	0,00	2.755.362,27	25.446,66	0,93%	1,11%	0,93%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.480.910,79	0,00	0,00	6.539.228,46	58.317,67	0,90%	0,80%	0,90%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.866.694,86	0,00	0,00	3.900.351,12	33.656,26	0,87%	0,45%	0,87%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.880.952,62	0,00	0,00	9.966.799,32	85.846,70	0,87%	0,67%	0,87%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	20.025.253,47	0,00	0,00	20.198.088,61	172.835,14	0,86%	0,46%	0,86%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	8.129.572,44	0,00	0,00	8.196.484,92	66.912,48	0,82%	1,39%	0,82%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	6.493.732,32	0,00	0,00	6.545.378,46	51.646,14	0,80%	0,42%	0,80%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	7.790.955,70	0,00	0,00	7.845.384,55	54.428,85	0,70%	5,09%	0,70%
BTG PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA	2.498.646,20	0,00	0,00	2.516.088,60	17.442,40	0,70%	0,12%	0,70%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.236.504,63	0,00	0,00	3.255.370,20	18.865,57	0,58%	0,07%	0,58%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.989.552,06	0,00	2.200.000,00	4.829.030,41	39.478,35	0,56%	1,42%	0,81%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	18.835.741,90	0,00	1.100.000,00	17.837.797,29	102.055,39	0,54%	0,03%	0,57%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	6.592.725,69	316.085,22	190.000,00	6.753.239,12	34.428,21	0,50%	0,02%	0,52%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	14.863.584,66	0,00	4.400.000,00	10.527.940,35	64.355,69	0,43%	0,06%	0,59%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.932,50	67.074,68	508,82	73.720,33	221,97	0,30%	0,01%	0,45%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	86.542,03	2.526.887,87	2.597.055,29	17.433,50	1.058,89	0,04%	0,01%	0,47%
BBIF MASTER FIDC LP	271.583,46	0,00	0,00	270.621,61	-961,85	-0,35%	0,03%	-0,35%
Total Renda Fixa					849.715,59	0,70%	0,80%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	1.114.967,44	0,00	0,00	1.208.683,99	93.716,55	8,41%	-	-
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	2.166.476,13	0,00	0,00	2.291.943,10	125.466,97	5,79%	4,37%	5,79%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	0,00	2.200.000,00	0,00	2.316.092,18	116.092,18	5,28%	5,05%	6,63%
FRANKLIN TEMPLETON VALOR E FVL FI AÇÕES	0,00	2.200.000,00	0,00	2.313.309,30	113.309,30	5,15%	4,46%	6,09%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5.001.320,15	0,00	0,00	5.248.743,15	247.423,00	4,95%	4,67%	4,95%
SUL AMÉRICA HIGH YIELD FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	2.766.952,60	0,00	0,00	2.785.594,63	18.642,03	0,67%	0,19%	0,67%
HIX CAPITAL INSTITUCIONAL FI AÇÕES	0,00	2.200.000,00	0,00	2.200.000,00	0,00	0,00%	3,64%	2,61%
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	2.925.524,76	0,00	0,00	2.918.608,91	-6.915,85	-0,24%	-	-
Total Renda Variável					707.734,18	3,44%	3,79%	

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.682.901,22	6.185.000,00	0,00	20.198.088,61	330.187,39	1,67%	1,91%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	18.609.469,33	0,00	1.100.000,00	17.837.797,29	328.327,96	1,76%	1,79%
BBIF MASTER FIDC LP	518,66	0,00	0,00	270.621,61	270.102,95	52.077,07%	20.895.847.709.900,00%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	6.977.938,93	10.000.000,00	6.600.000,00	10.527.940,35	150.001,42	1,34%	1,80%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.826.785,44	0,00	0,00	9.966.799,32	140.013,88	1,42%	1,42%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	10.948.964,01	2.080.554,79	6.407.384,35	6.753.239,12	131.104,67	1,46%	1,74%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.829.389,94	0,00	0,00	3.900.351,12	70.961,18	1,85%	1,85%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.196.803,76	0,00	0,00	3.255.370,20	58.566,44	1,83%	1,83%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,00	6.500.000,00	0,00	6.545.378,46	45.378,46	0,70%	1,49%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	6.500.000,00	0,00	6.539.228,46	39.228,46	0,60%	0,78%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.990.836,26	0,00	0,00	2.016.187,99	25.351,73	1,27%	1,27%
SUL AMÉRICA EXCELLENCE FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	5.184.727,32	0,00	5.206.674,04	0,00	21.946,72	0,42%	1,75%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.737.306,32	0,00	0,00	2.755.362,27	18.055,95	0,66%	0,66%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	240.757,24	12.470.072,24	12.643.858,79	73.720,33	6.749,64	0,41%	1,49%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	69.682,49	3.102.104,76	3.156.236,48	17.433,50	1.882,73	0,28%	1,56%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	7.844.916,00	0,00	0,00	7.845.384,55	468,55	0,01%	0,00%
BTG PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA	2.527.913,40	0,00	0,00	2.516.088,60	-11.824,80	-0,47%	-0,47%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	21.285.587,75	0,00	13.000.000,00	8.196.484,92	-89.102,83	0,08%	-0,31%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	17.126.057,75	0,00	12.200.000,00	4.829.030,41	-97.027,34	-0,24%	-0,39%
Total Renda Fixa					1.440.373,16	1,17%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	0,00	2.200.000,00	0,00	2.316.092,18	116.092,18	5,28%	0,91%
FRANKLIN TEMPLETON VALOR E FVL FI AÇÕES	0,00	2.200.000,00	0,00	2.313.309,30	113.309,30	5,15%	1,59%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	0,00	2.200.000,00	0,00	2.291.943,10	91.943,10	4,18%	0,46%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	1.127.722,60	0,00	0,00	1.208.683,99	80.961,39	7,18%	-
SUL AMÉRICA HIGH YIELD FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	2.738.303,04	0,00	0,00	2.785.594,63	47.291,59	1,73%	1,73%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5.242.136,92	0,00	0,00	5.248.743,15	6.606,23	0,13%	0,13%
HIX CAPITAL INSTITUCIONAL FI AÇÕES	0,00	2.200.000,00	0,00	2.200.000,00	0,00	0,00%	3,95%
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	0,00	3.000.000,00	0,00	2.918.608,91	-81.391,09	-2,71%	-
Total Renda Variável					374.812,70	0,79%	

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	24.330.106,05	10.000.000,00	32.200.000,00	4.829.030,41	2.698.924,36	13,14%	12,55%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.745.763,23	8.852.410,72	0,00	20.198.088,61	1.599.914,66	12,07%	12,40%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	18.415.148,20	0,00	10.000.000,00	9.966.799,32	1.551.651,12	12,03%	12,38%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	0,00	20.000.000,00	13.000.000,00	8.196.484,92	1.196.484,92	6,52%	12,36%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	17.500.000,00	18.467.414,04	0,00	967.414,04	6,93%	12,44%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	14.073.762,63	0,00	11.000.000,00	3.900.351,12	826.588,49	11,90%	12,34%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	12.119.874,32	17.120.782,36	23.273.490,67	6.753.239,12	786.073,11	8,23%	9,94%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	18.467.414,04	1.100.000,00	17.837.797,29	470.383,25	2,55%	10,93%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	2.250.918,10	15.281.891,25	7.454.000,00	10.527.940,35	449.131,00	8,76%	10,20%
SUL AMÉRICA EXCELLENCE FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	4.785.911,15	0,00	5.206.674,04	0,00	420.762,89	8,79%	10,23%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.175.279,03	0,00	5.500.000,00	2.016.187,99	340.908,96	14,11%	14,80%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.557.125,83	0,00	142.659,23	2.755.362,27	340.895,67	13,64%	13,69%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	7.552.636,49	0,00	0,00	7.845.384,55	292.748,06	3,88%	3,87%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.123.407,40	2.363.000,00	413.000,00	3.255.370,20	181.962,80	9,04%	10,08%
BTG PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA	2.440.160,00	0,00	0,00	2.516.088,60	75.928,60	3,11%	3,11%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,00	6.500.000,00	0,00	6.545.378,46	45.378,46	0,70%	11,22%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	6.500.000,00	0,00	6.539.228,46	39.228,46	0,60%	12,26%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.805,24	19.731.257,62	19.674.691,53	73.720,33	13.349,00	1,46%	8,87%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	140.382,05	12.437.123,59	12.571.038,73	17.433,50	10.966,59	1,60%	9,05%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VIII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.748.535,35	0,00	2.751.108,66	0,00	2.573,31	0,09%	-
BBIF MASTER FIDC LP	1.593.638,64	32.106,32	0,00	270.621,61	-1.355.123,35	-83,35%	-83,35%
Total Renda Fixa					10.956.144,40	9,56%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4.046.135,99	0,00	0,00	5.248.743,15	1.202.607,16	29,72%	29,72%
SUL AMÉRICA HIGH YIELD FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	2.481.566,07	0,00	0,00	2.785.594,63	304.028,56	12,25%	12,25%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	0,00	2.200.000,00	0,00	2.316.092,18	116.092,18	5,28%	32,51%
FRANKLIN TEMPLETON VALOR E FVL FI AÇÕES	0,00	2.200.000,00	0,00	2.313.309,30	113.309,30	5,15%	32,97%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	0,00	2.200.000,00	0,00	2.291.943,10	91.943,10	4,18%	17,34%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	1.023.299,48	120.000,00	0,00	1.208.683,99	65.384,51	5,68%	-
HIX CAPITAL INSTITUCIONAL FI AÇÕES	0,00	2.200.000,00	0,00	2.200.000,00	0,00	0,00%	39,34%
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	0,00	3.000.000,00	0,00	2.918.608,91	-81.391,09	-2,71%	-
Total Renda Variável					1.811.973,72	19,86%	