

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
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.183.843,84	0,68%	701	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.544.270,01	0,48%	1.382	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	586.910,96	0,18%	601	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.409.868,55	1,05%	205	0,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	7.021.519,87	2,17%	696	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	7.579.857,73	2,35%	349	0,58%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.780.420,81	1,79%	196	0,39%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	4.209.745,66	1,30%	193	1,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.375.857,73	0,43%	1.221	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	15.565.254,34	4,82%	771	0,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2024	773.662,63	0,24%	17	0,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	41.923.136,03	12,97%	222	1,31%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	884.969,45	0,27%	711	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	11.848.016,84	3,67%	113	1,52%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	3.005.398,50	0,93%	27	9,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	4.381.584,11	1,36%	23	1,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	16.384.521,33	5,07%	259	1,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	887.142,26	0,27%	7	0,56%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	26.345.716,81	8,15%	262	2,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	21.569.822,83	6,67%	329	0,80%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADERCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.140.872,60	0,35%	86	0,14%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	34.370.081,11	10,63%	53	6,99%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "

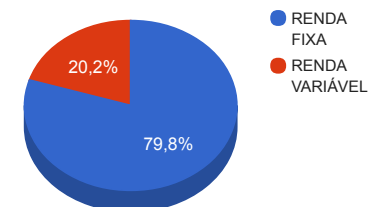
Carteira consolidada de investimentos - base (setembro / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	D+1	Não há	2.820.693,47	0,87%	14	0,85%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.689.584,42	0,83%	229	0,78%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	16/05/2023	4.325.909,06	1,34%	52	1,49%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	6.593.350,17	2,04%	763	0,15%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	2.593.095,22	0,80%	143	0,25%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	22.314.031,60	6,90%	442	1,16%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	869.615,35	0,27%	536	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	1.367.443,00	0,42%	100	0,61%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+30 a D+2880	Não há	1.729.835,43	0,54%	61	0,40%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	D+4	Não há	6.030.776,77	1,87%	4.176	6,63%	Artigo 8º, Inciso III
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	4.078.792,01	1,26%	629	0,63%	Artigo 8º, Inciso III
XP INVESTOR FI AÇÕES	D+4	Não há	2.528.755,68	0,78%	5.407	0,51%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	21.201.003,44	6,56%	1.889	15,35%	Artigo 8º, Inciso III
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	D+4	Não há	3.206.965,76	0,99%	7.285	2,04%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	3.275.961,88	1,01%	374	7,11%	Artigo 8º, Inciso III
BB CIELO FI AÇÕES	D+4	Não há	1.613.676,11	0,50%	5.007	1,37%	Artigo 8º, Inciso III
BB PIPE FIC AÇÕES	D+4	03/06/2018	1.333.828,18	0,41%	43	1,13%	Artigo 8º, Inciso III
BB CONSUMO FIC AÇÕES	D+4	Não há	3.955.643,22	1,22%	2.642	3,26%	Artigo 8º, Inciso III
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	2.931.485,63	0,91%	27	6,39%	Artigo 8º, Inciso III
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	1.675.712,82	0,52%	7.264	0,45%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	11.027.455,39	3,41%	4.790	2,36%	Artigo 8º, Inciso IV
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	D+5	Não há	2.282.716,35	0,71%	32	1,05%	Artigo 8º, Inciso IV
TOTAL -			323.218.804,96				

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

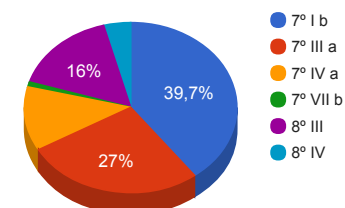
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	128.458.838,39	39,74%	50,00%	58,00%	75,00%	113.955.265,33
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	87.134.329,08	26,96%	10,00%	20,00%	50,00%	74.475.073,40
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	39.385.585,82	12,19%	5,00%	8,00%	30,00%	57.580.055,67
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	3.097.278,43	0,96%	0,00%	1,00%	5,00%	13.063.661,82
Total Renda Fixa	100,00%	258.076.031,72	79,85%	85,00	87,00	210,00	-

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	51.832.601,50	16,04%	5,00%	9,00%	15,00%	-3.349.780,76
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	13.310.171,74	4,12%	2,00%	4,00%	5,00%	2.850.768,51
Total Renda Variável	30,00%	65.142.773,24	20,15%	7,00	13,00	35,00	-

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 "	0,00	0,00%	20,00%	50,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	128.458.838,39	39,74%	50,00%	75,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	87.134.329,08	26,96%	10,00%	50,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	39.385.585,82	12,19%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	3.097.278,43	0,96%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	258.076.031,72	79,85%	85,00	210,00

Artigos - Renda Variável	Base: setembro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso III	51.832.601,50	16,04%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	13.310.171,74	4,12%	2,00%	5,00%
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	65.142.773,24	20,15%	7,00	35,00

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
IDKA IPCA 20 Anos	3,75%	17,34%	11,59%	4,03%	20,78%	88,79%	-	-	-
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,17%	15,49%	10,05%	4,35%	18,77%	69,42%	0,20%	2,855%	18,62%
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%
BRDESCO 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%
IMA-B	1,81%	13,16%	7,30%	5,86%	15,76%	48,59%	-	-	-
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	1,88%	14,18%	7,70%	6,15%	16,50%	49,70%	0,50%	1,487%	10,89%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,84%	13,20%	7,34%	5,84%	15,81%	47,99%	0,30%	1,357%	9,80%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	1,81%	12,86%	7,68%	5,68%	15,23%	45,03%	0,45%	1,413%	10,15%
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%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1,79%	12,67%	7,22%	5,53%	15,28%	47,27%	0,20%	1,344%	9,80%
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%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,46%	7,83%	4,37%	4,21%	9,80%	32,00%	0,20%	1,293%	8,52%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,50%	2,65%	0,07%	2,15%	4,86%	17,80%	0,20%	0,279%	4,41%
IRF-M 1+	1,73%	15,17%	5,69%	7,83%	19,22%	51,80%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,68%	14,89%	5,59%	7,62%	18,92%	51,25%	0,20%	1,331%	6,40%
IRF-M	1,48%	13,57%	4,92%	7,23%	17,44%	43,51%	-	-	-

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,45%	13,36%	4,87%	7,06%	17,16%	43,01%	0,20%	1,005%	4,84%
IMA Geral	1,33%	11,68%	4,82%	5,99%	14,81%	40,15%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,28%	11,53%	4,68%	5,95%	14,83%	39,64%	0,20%	0,749%	4,75%
IMA-B 5	1,01%	10,94%	5,18%	6,58%	13,45%	34,82%	-	-	-
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	0,99%	10,77%	5,13%	6,45%	13,24%	34,28%	0,10%	0,648%	3,64%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,99%	10,80%	5,13%	6,49%	13,27%	34,14%	0,20%	0,646%	3,63%
IDKA IPCA 2 Anos	0,91%	11,13%	4,46%	6,74%	13,66%	34,61%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,89%	10,30%	4,32%	6,24%	12,77%	33,38%	0,20%	0,491%	2,83%
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%	-	-	-
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	0,80%	9,36%	2,87%	5,42%	12,97%	29,46%	0,50%	0,165%	1,17%
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%
BRADERCO 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%	-	-	-

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
BRDESCO 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%	-	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,65%	8,02%	2,29%	4,79%	11,48%	27,22%	0,20%	0,030%	0,16%
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 DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,57%	7,38%	2,04%	4,43%	10,63%	25,21%	0,80%	0,012%	0,11%
IPCA + 6,00% ao ano	0,62%	6,30%	2,09%	3,77%	8,64%	24,92%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,30%	13,03%	6,90%	6,81%	15,31%	44,79%	0,15%	1,186%	6,93%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,52%	6,70%	1,95%	4,00%	8,97%	26,25%	0,20%	0,232%	0,33%
IPCA	0,16%	1,78%	0,59%	0,81%	2,54%	11,23%	-	-	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1,25%	13,08%	5,63%	7,24%	15,92%	42,90%	0,20%	0,703%	4,63%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,51%	7,75%	2,41%	4,47%	10,03%	32,90%	0,20%	0,234%	1,57%

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

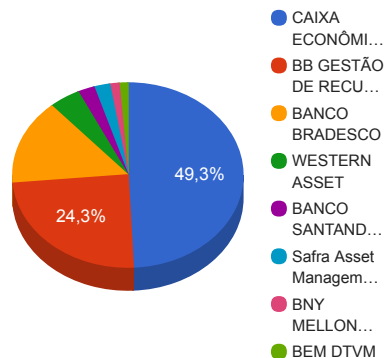
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
ICON	7,21%	32,60%	23,58%	26,89%	20,21%	40,72%	-	-	-
BB CONSUMO FIC AÇÕES	7,05%	31,06%	23,07%	25,82%	18,59%	36,83%	1,00%	6,203%	18,60%
IFNC	6,50%	27,56%	18,29%	13,15%	32,21%	85,09%	-	-	-
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	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 FI AÇÕES	3,76%	28,06%	15,14%	10,71%	33,53%	66,36%	1,50%	6,056%	19,85%
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	2,85%	24,11%	10,79%	13,45%	22,99%	83,59%	3,00%	5,739%	18,53%
Ibovespa	4,88%	23,36%	18,12%	14,33%	27,29%	64,88%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	7,12%	18,70%	18,97%	11,29%	20,59%	45,14%	1,00%	6,455%	20,26%
BB PIPE FIC AÇÕES	6,99%	30,98%	18,95%	22,24%	27,87%	55,84%	1,20%	6,158%	16,01%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	4,08%	22,79%	15,87%	10,83%	19,08%	63,61%	2,00%	5,679%	21,47%
XP INVESTOR FI AÇÕES	3,71%	26,83%	17,63%	17,56%	27,69%	100,95%	2,00%	6,217%	19,65%
SMLL	3,68%	45,17%	21,74%	25,04%	41,48%	87,27%	-	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	4,39%	44,58%	22,48%	25,31%	42,06%	75,23%	1,50%	7,491%	19,29%
BBSEGURIDADE ON NM - BBSE3	3,28%	7,40%	3,03%	1,09%	1,72%	30,26%	-	-	-
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	3,15%	5,81%	2,40%	0,12%	-0,12%	25,65%	1,5%	7,647%	27,78%
S&P 500	1,93%	12,53%	3,96%	6,63%	16,19%	31,21%	-	-	-

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

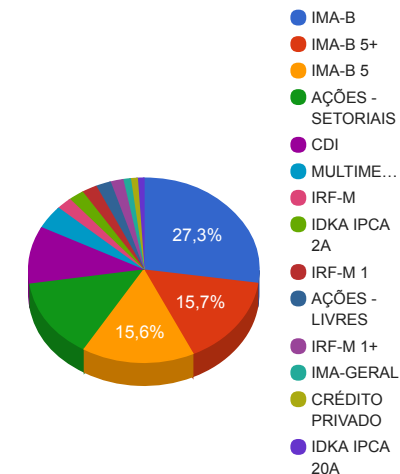
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	2,06%	19,90%	5,85%	11,15%	28,22%	63,74%	1,00%	2,218%	6,99%
CDI	0,64%	8,03%	2,25%	4,85%	11,53%	27,29%	-	-	-
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	1,17%	7,28%	2,83%	3,63%	12,58%	29,88%	2,00%	0,774%	1,69%
CIELO ON NM - CIEL3	-0,43%	-2,46%	-9,21%	-4,87%	-16,33%	-9,45%	-	-	-
BB CIELO FI AÇÕES	-0,48%	-3,35%	-9,36%	-5,32%	-17,20%	-12,11%	1,50%	12,609%	28,37%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	159.270.861,28	49,28%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	78.456.647,96	24,27%
BANCO BRADESCO	48.228.585,90	14,92%
WESTERN ASSET	14.197.314,00	4,39%
BANCO SANTANDER	7.579.857,73	2,35%
Safra Asset Management	7.202.277,58	2,23%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	4.204.468,50	1,30%
BEM DTVM	4.078.792,01	1,26%



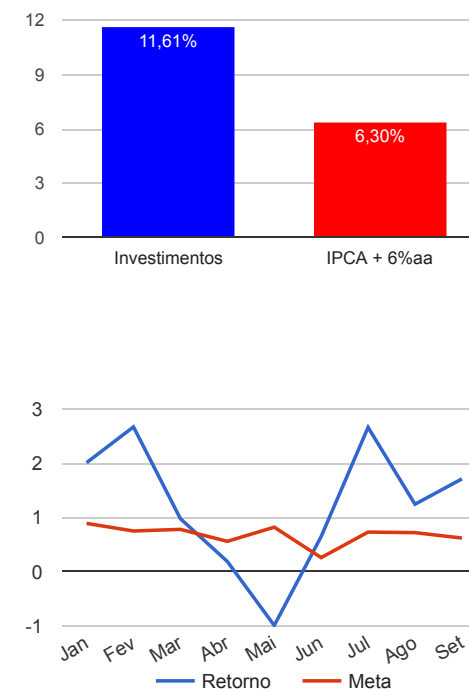
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	88.290.204,10	27,32%
IMA-B 5+	50.754.602,44	15,70%
IMA-B 5	50.387.963,21	15,59%
AÇÕES - SETORIAIS	45.038.532,01	13,93%
CDI	32.466.581,54	10,04%
MULTIMERCADO	13.310.171,74	4,12%
IRF-M	7.021.519,87	2,17%
IDKA IPCA 2A	6.980.500,46	2,16%
IRF-M 1	6.881.693,81	2,13%
AÇÕES - LIVRES	6.794.069,49	2,10%
IRF-M 1+	5.780.420,81	1,79%
IMA-GERAL	3.409.868,55	1,05%
CRÉDITO PRIVADO	3.097.278,43	0,96%
IDKA IPCA 20A	3.005.398,50	0,93%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	289.253.086,32	79.253.804,09	79.346.450,27	294.967.303,19	5.806.863,05	2,01%	0,89%	225,08%	2,71%
Fevereiro	294.967.303,19	19.962.969,81	19.256.670,24	303.557.146,11	7.883.543,35	2,67%	0,75%	356,24%	2,49%
Março	303.557.146,11	20.627.199,18	20.913.377,84	306.235.719,08	2.964.751,63	0,98%	0,78%	124,48%	2,15%
Abril	306.235.719,08	6.721.648,38	6.833.156,79	306.703.491,71	579.281,04	0,19%	0,56%	33,92%	1,95%
Mai	306.703.491,71	70.417.662,46	69.907.597,82	304.178.474,77	-3.035.081,58	-0,99%	0,82%	-120,25%	8,10%
Junho	304.178.474,77	7.155.613,40	7.706.564,30	305.599.542,75	1.972.018,88	0,65%	0,26%	253,61%	1,95%
Julho	305.599.542,75	7.095.270,35	7.065.123,69	313.752.973,86	8.123.284,45	2,66%	0,73%	365,13%	1,67%
Agosto	313.752.973,86	9.636.247,16	9.276.903,51	318.016.065,46	3.903.747,95	1,24%	0,72%	171,60%	2,21%
Setembro	318.016.065,46	83.899.223,63	84.131.136,15	323.218.804,96	5.434.652,02	1,71%	0,62%	273,75%	2,04%
Acumulado no ano					33.633.060,79	11,61%	6,30%	184,18%	

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(%)
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.912.978,88	0,00	0,00	3.005.398,50	92.419,62	3,17%	2,86%	3,17%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	33.577.541,97	0,00	0,00	34.370.081,11	792.539,14	2,36%	2,01%	2,36%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.226.006,83	14.800.000,00	0,00	16.384.521,33	358.514,50	2,24%	2,00%	2,37%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	4.303.517,68	0,00	0,00	4.381.584,11	78.066,43	1,81%	1,41%	1,81%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	11.639.123,15	0,00	0,00	11.848.016,84	208.893,69	1,79%	1,34%	1,79%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	15.199.220,69	91.908,99	0,00	15.565.254,34	274.124,66	1,79%	1,35%	1,80%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	21.176.318,45	14.281,92	0,00	21.569.822,83	379.222,46	1,79%	1,31%	1,79%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	762.552,75	0,00	0,00	773.662,63	11.109,88	1,46%	1,29%	1,46%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	26.000.000,00	0,00	26.345.716,81	345.716,81	1,33%	1,36%	1,84%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.270.499,67	0,00	0,00	4.325.909,06	55.409,39	1,30%	1,19%	1,30%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.366.691,21	0,00	0,00	3.409.868,55	43.177,34	1,28%	0,75%	1,28%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1.708.400,64	0,00	0,00	1.729.835,43	21.434,79	1,25%	0,70%	1,25%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	7.505.264,57	0,00	0,00	7.579.857,73	74.593,16	0,99%	0,65%	0,99%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	876.278,24	0,00	0,00	884.969,45	8.691,21	0,99%	0,65%	0,99%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.165.284,82	0,00	0,00	2.183.843,84	18.559,02	0,86%	0,48%	0,86%
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	0,00	879.969,36	0,00	887.142,26	7.172,90	0,82%	1,49%	1,88%
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	2.798.440,68	0,00	0,00	2.820.693,47	22.252,79	0,80%	0,16%	0,80%
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	863.844,75	0,00	0,00	869.615,35	5.770,60	0,67%	0,01%	0,67%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.550.793,63	0,00	0,00	6.593.350,17	42.556,54	0,65%	0,01%	0,65%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	28.165.076,23	0,00	6.000.000,00	22.314.031,60	148.955,37	0,53%	0,03%	0,65%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.579.772,78	0,00	0,00	2.593.095,22	13.322,44	0,52%	0,23%	0,52%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.360.529,00	0,00	0,00	1.367.443,00	6.914,00	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 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	32.855.877,44	0,00	26.000.000,00	7.021.519,87	165.642,43	0,50%	1,00%	1,45%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	41.714.821,18	0,00	0,00	41.923.136,03	208.314,85	0,50%	0,28%	0,50%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.188.841,91	0,00	0,00	4.209.745,66	20.903,75	0,50%	0,28%	0,50%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	20.682.105,30	0,00	15.000.000,00	5.780.420,81	98.315,51	0,48%	1,33%	1,68%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.365.533,50	0,00	1.000.000,00	1.375.857,73	10.324,23	0,44%	0,07%	0,71%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	2.132.251,11	0,00	1.000.000,00	1.140.872,60	8.621,49	0,40%	0,08%	0,71%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.531.460,28	0,00	3.000.000,00	1.544.270,01	12.809,73	0,28%	0,07%	0,71%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	1.017.264,62	13.613.063,36	11.955.405,09	2.689.584,42	14.661,53	0,10%	0,01%	0,57%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	14.076.710,93	0,00	13.500.000,00	586.910,96	10.200,03	0,07%	0,49%	0,89%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	879.460,24	0,00	879.969,36	0,00	509,12	0,06%	1,39%	1,78%
Total Renda Fixa					3.559.719,41	1,28%	1,03%	

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(%)
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	2.736.586,75	0,00	0,00	2.931.485,63	194.898,88	7,12%	6,46%	7,12%
BB PIPE FIC AÇÕES	1.246.720,77	0,00	0,00	1.333.828,18	87.107,41	6,99%	6,16%	6,99%
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	4.691.514,83	1.000.000,00	0,00	6.030.776,77	339.261,94	5,96%	7,25%	6,27%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	3.147.582,42	0,00	0,00	3.275.961,88	128.379,46	4,08%	5,68%	4,08%
XP INVESTOR FI AÇÕES	2.438.402,96	0,00	0,00	2.528.755,68	90.352,72	3,71%	6,22%	3,71%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	1.776.032,17	0,00	1.832.211,06	0,00	56.178,89	3,16%	5,21%	2,38%
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	3.109.176,70	0,00	0,00	3.206.965,76	97.789,06	3,15%	7,65%	3,15%
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.629.207,16	0,00	0,00	1.675.712,82	46.505,66	2,85%	5,74%	2,85%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	1.194.569,37	19.500.000,00	0,00	21.201.003,44	506.434,07	2,45%	7,49%	4,39%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	10.804.708,49	0,00	0,00	11.027.455,39	222.746,90	2,06%	2,22%	2,06%
BRDESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	0,00	4.000.000,00	0,00	4.078.792,01	78.792,01	1,97%	6,06%	3,76%
GERAÇÃO FI AÇÕES	1.615.369,42	0,00	1.638.856,16	0,00	23.486,74	1,45%	6,15%	4,00%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.295.981,41	0,00	2.324.694,48	0,00	28.713,07	1,25%	5,58%	2,04%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	2.256.358,03	0,00	0,00	2.282.716,35	26.358,32	1,17%	0,77%	1,17%
BB CIELO FI AÇÕES	1.621.391,85	0,00	0,00	1.613.676,11	-7.715,74	-0,48%	12,61%	-0,48%
BB CONSUMO FIC AÇÕES	0,00	4.000.000,00	0,00	3.955.643,22	-44.356,78	-1,11%	6,20%	7,05%
Total Renda Variável					1.874.932,61	2,96%	6,05%	

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 (%)
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	31.673.422,43	0,00	0,00	34.370.081,11	2.696.658,68	8,51%	8,51%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	20.091.704,85	56.787,00	0,00	21.569.822,83	1.421.330,98	7,06%	7,07%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	31.785.643,39	0,00	26.000.000,00	7.021.519,87	1.235.876,48	3,89%	4,87%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	41.892.503,56	0,00	1.157.844,52	41.923.136,03	1.188.476,99	2,85%	0,07%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	14.247.536,43	275.726,97	0,00	15.565.254,34	1.041.990,94	7,24%	7,25%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	19.915.963,76	0,00	15.000.000,00	5.780.420,81	864.457,05	4,34%	5,59%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	11.050.588,18	0,00	0,00	11.848.016,84	797.428,66	7,22%	7,22%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	27.914.866,48	0,00	6.200.000,00	22.314.031,60	599.165,12	2,16%	2,29%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	13.613.881,40	0,00	13.500.000,00	586.910,96	473.029,56	3,47%	4,32%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.156.574,20	14.800.000,00	0,00	16.384.521,33	427.947,13	8,37%	8,52%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	7.210.199,85	0,00	0,00	7.579.857,73	369.657,88	5,13%	5,13%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	26.000.000,00	0,00	26.345.716,81	345.716,81	1,33%	7,34%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	4.069.022,49	0,00	0,00	4.381.584,11	312.561,62	7,68%	7,68%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.046.564,98	0,00	0,00	4.325.909,06	279.344,08	6,90%	6,90%
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.730.928,10	0,00	0,00	3.005.398,50	274.470,40	10,05%	10,05%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.257.532,52	0,00	0,00	3.409.868,55	152.336,03	4,68%	4,68%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.447.318,11	0,00	0,00	6.593.350,17	146.032,06	2,27%	2,27%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.209.609,43	0,00	118.597,30	4.209.745,66	118.733,53	2,83%	2,84%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.445.148,82	0,00	3.000.000,00	1.544.270,01	99.121,19	2,23%	2,67%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1.637.588,62	0,00	0,00	1.729.835,43	92.246,81	5,63%	5,63%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.093.201,14	0,00	0,00	2.183.843,84	90.642,70	4,33%	4,33%
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	2.741.998,65	0,00	0,00	2.820.693,47	78.694,82	2,87%	2,87%

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.320.462,82	0,00	1.000.000,00	1.375.857,73	55.394,91	2,39%	2,67%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	741.287,88	0,00	20.127,22	773.662,63	52.501,97	7,12%	4,37%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.617.488,75	0,00	74.651,53	2.593.095,22	50.258,00	1,93%	1,95%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	2.091.464,28	0,00	1.000.000,00	1.140.872,60	49.408,32	2,36%	2,68%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	835.151,06	0,00	879.969,36	0,00	44.818,30	5,37%	7,18%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	841.783,26	0,00	0,00	884.969,45	43.186,19	5,13%	5,13%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.335.254,00	0,00	0,00	1.367.443,00	32.189,00	2,41%	2,41%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	610.726,95	28.588.583,76	26.532.786,50	2.689.584,42	23.060,21	0,20%	2,04%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	848.526,63	0,00	0,00	869.615,35	21.088,72	2,49%	2,49%
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	0,00	879.969,36	0,00	887.142,26	7.172,90	0,82%	7,70%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	193.248,83	193.425,22	0,00	176,39	0,09%	1,99%
				Total Renda Fixa	13.485.174,43	5,03%	

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 (%)
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	4.054.487,50	1.193.425,22	0,00	6.030.776,77	782.864,05	17,23%	17,82%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	10.418.115,59	0,00	0,00	11.027.455,39	609.339,80	5,85%	5,85%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	0,00	20.643.000,00	0,00	21.201.003,44	558.003,44	7,07%	22,48%
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	2.464.156,22	0,00	0,00	2.931.485,63	467.329,41	18,97%	18,97%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	2.827.279,33	0,00	0,00	3.275.961,88	448.682,55	15,87%	15,87%
XP INVESTOR FI AÇÕES	2.149.681,70	0,00	0,00	2.528.755,68	379.073,98	17,63%	17,63%
BB PIPE FIC AÇÕES	1.121.336,06	0,00	0,00	1.333.828,18	212.492,12	18,95%	18,95%
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.512.570,52	0,00	0,00	1.675.712,82	163.142,30	10,79%	10,79%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	1.669.721,19	0,00	1.832.211,06	0,00	162.489,87	9,73%	8,90%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.225.580,36	0,00	2.324.694,48	0,00	99.114,12	4,45%	5,27%
GERAÇÃO FI AÇÕES	1.550.814,43	0,00	1.638.856,16	0,00	88.041,73	5,68%	8,33%
BRDESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	0,00	4.000.000,00	0,00	4.078.792,01	78.792,01	1,97%	15,14%
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	3.131.676,26	0,00	0,00	3.206.965,76	75.289,50	2,40%	2,40%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	2.219.876,43	0,00	0,00	2.282.716,35	62.839,92	2,83%	2,83%
BB CONSUMO FIC AÇÕES	0,00	4.000.000,00	0,00	3.955.643,22	-44.356,78	-1,11%	23,07%
BB CIELO FI AÇÕES	1.780.304,14	0,00	0,00	1.613.676,11	-166.628,03	-9,36%	-9,36%
Total Renda Variável					3.976.509,99	8,70%	