

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
BRASESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	179.572,06	0,60%	201	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.640.839,88	8,84%	198	0,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	75.762,83	0,25%	712	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	606.112,50	2,03%	223	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	81.564,77	0,27%	722	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	167.257,36	0,56%	193	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.082.737,67	3,62%	619	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	3.770.292,75	12,62%	588	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	D+1471	Não há	659.818,79	2,21%	26	0,72%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	63.162,49	0,21%	757	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	D+1009	Não há	1.622.074,49	5,43%			Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	2.145.650,96	7,18%	748	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.487.507,14	11,67%	632	0,28%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TOWER BRIDGE RENDA FIXA FI IMA-B 5	D+1471	Não há	2.328.240,91	7,79%		0,45%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	26.193,68	0,09%	98	0,03%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	8.517,62	0,03%	70	0,14%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	2.827.878,91	9,47%	38	0,85%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
FRANKLIN TEMPLETON VALOR E FVL FI AÇÕES	D+4	Não há	613.625,55	2,05%	1.974	0,24%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
PERFIN INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	568.026,99	1,90%	2.138	0,39%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
META VALOR FI AÇÕES	D+4	Não há	1.786.607,47	5,98%	31	2,07%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	1.213.572,56	4,06%	1.923	1,76%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	1.390.208,69	4,65%	60	1,47%	Artigo 8º, Inciso III

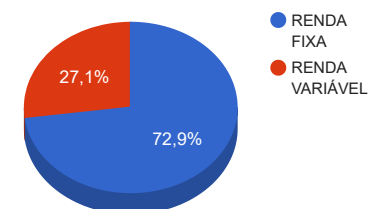
Carteira consolidada de investimentos - base (dezembro / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
MÉRITO DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - MFII11	Não se aplica	Não se aplica	1.545.658,03	5,17%		1,69%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
OSASCO PROPERTIES FII	Não se aplica	Não se aplica	986.270,06	3,30%			Desenquadrado - RV
		TOTAL -	29.877.154,16				

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

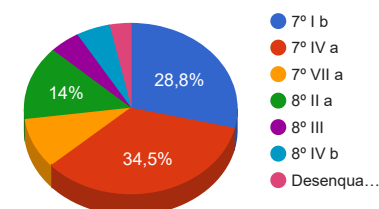
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	8.604.139,82	28,80%	30,00%	35,00%	70,00%	12.309.868,09
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	15,00%	20,00%	60,00%	17.926.292,50
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	10.306.454,78	34,50%	0,00%	5,00%	30,00%	-1.343.308,53
Artigo 7º, Inciso VI	0,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	4.481.573,12
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	2.862.590,21	9,58%	0,00%	2,50%	5,00%	-1.368.732,50
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	1.493.857,71
Total Renda Fixa	100,00%	21.773.184,81	72,88%	50,00	75,00	185,00	-

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	4.181.832,57	14,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-4.181.832,57
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	1.390.208,69	4,65%	0,00%	10,00%	15,00%	3.091.364,43
Artigo 8º, Inciso IV	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	1.493.857,71
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	1.545.658,03	5,17%	0,00%	0,00%	0,00%	-1.545.658,03
Artigo 8º, Inciso V	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	1.493.857,71
Artigo 8º, Inciso VI	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	1.493.857,71
Desenquadrado - RV	0,00%	986.270,06	3,30%	0,00%	0,00%	0,00%	-986.270,06
Total Renda Variável	30,00%	8.103.969,35	27,12%	0,00	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 "	8.604.139,82	28,80%	30,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	10.306.454,78	34,50%	0,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	0,00	0,00%	5,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	2.862.590,21	9,58%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	21.773.184,81	72,88%	50,00	185,00

Artigos - Renda Variável	Base: dezembro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	4.181.832,57	14,00%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso III	1.390.208,69	4,65%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	1.545.658,03	5,17%	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%
Desenquadrado - RV	986.270,06	3,30%	0,00%	0,00%
Total Renda Variável	8.103.969,35	27,12%	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
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	7.563.982,57	25,32%	0,00%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	6.556.905,78	21,95%	0,00%
BRIDGE TRUST	2.988.059,70	10,00%	0,24%
Horus GGR	2.827.878,91	9,47%	0,58%
META ASSET MANAGEMENT	1.786.607,47	5,98%	1,93%
Graphen Investimentos	1.622.074,49	5,43%	0,13%
MÉRITO INVESTIMENTOS	1.545.658,03	5,17%	-
INFINITY ASSET MANAGEMENT	1.390.208,69	4,65%	0,33%
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	1.213.572,56	4,06%	0,97%
CADENCE GESTORA	986.270,06	3,30%	0,12%
FRANKLIN TEMPLETON INVESTIMENTOS	613.625,55	2,05%	0,03%
PERFIN INVESTIMENTOS	568.026,99	1,90%	0,02%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	179.572,06	0,60%	0,00%
FINAXIS CORRETORA	26.193,68	0,09%	0,03%
BRIDGE TRUST	8.517,62	0,03%	0,00%

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
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%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,35%	10,19%	1,57%	4,46%	10,19%	24,79%	0,20%	0,130%	1,72%
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%	1,65%	5,095%	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-27,62%	-95,67%	-92,16%	-91,76%	-95,67%	-98,34%	0,00%	40,466%	-
IMA-B 5	0,88%	12,58%	1,48%	6,74%	12,58%	30,01%	-	-	-
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	0,36%	9,57%	3,46%	4,62%	9,57%	-	0,70%	0,467%	5,70%
TOWER BRIDGE RENDA FIXA FI IMA-B 5	0,24%	5,39%	-1,76%	2,66%	5,39%	14,91%	0,70%	2,982%	5,18%
101,50% do IPCA + 5,75% ao ano	0,84%	8,15%	2,38%	4,30%	8,15%	20,85%	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1,29%	-4,86%	0,96%	-1,82%	-4,86%	-17,69%	0,15%	2,629%	1,84%
IMA-B	0,83%	12,79%	-0,32%	6,96%	12,79%	40,78%	-	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,81%	12,52%	-0,38%	6,80%	12,52%	40,11%	0,20%	1,420%	9,25%
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%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,35%	4,26%	1,58%	1,65%	4,26%	13,21%	0,20%	0,131%	4,33%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	-	-100,00%	-	-100,00%	-100,00%	-100,00%	0,00%	-	-

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

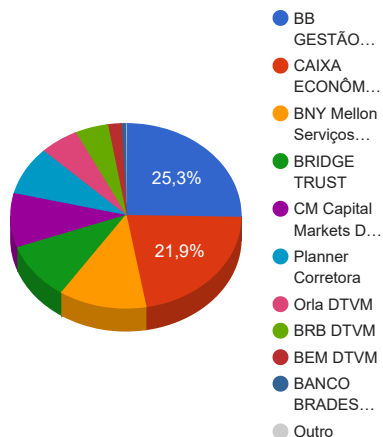
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5+	0,79%	12,75%	-1,63%	6,87%	12,75%	47,75%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,75%	12,44%	-1,70%	6,68%	12,44%	46,79%	0,20%	2,064%	11,96%
IRF-M 1	0,57%	11,12%	1,82%	4,59%	11,12%	27,47%	-	-	-
BRABESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,55%	10,92%	1,77%	4,50%	10,92%	27,03%	0,20%	0,042%	0,68%
CDI	0,54%	9,93%	1,76%	4,05%	9,93%	25,31%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	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%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,45%	8,87%	1,49%	3,51%	8,87%	23,14%	1,00%	0,010%	0,12%

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

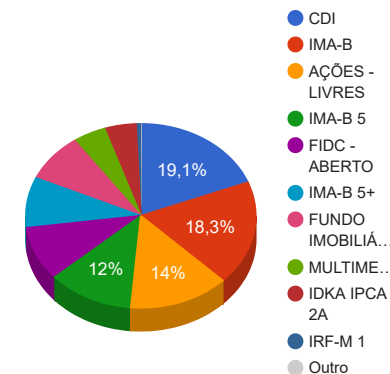
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IBX	6,35%	27,55%	2,62%	21,00%	27,55%	74,36%	-	-	-
META VALOR FI AÇÕES	6,92%	40,18%	1,47%	28,43%	40,18%	93,48%	2,50%	7,081%	23,15%
Ibovespa	6,16%	26,86%	2,84%	21,47%	26,86%	76,25%	-	-	-
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	6,63%	32,51%	0,91%	21,54%	32,51%	79,42%	2,00%	5,047%	15,53%
PERFIN INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	6,16%	27,06%	2,08%	15,65%	27,06%	78,09%	1,85%	4,531%	11,67%
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%
CDI	0,54%	9,93%	1,76%	4,05%	9,93%	25,31%	-	-	-
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	0,53%	11,63%	1,84%	4,51%	11,63%	30,26%	1,00%	0,093%	5,74%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
MÉRITO DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - MFII11	4,90%	31,41%	16,01%	17,13%	31,41%	37,35%	0,15%	6,837%	14,17%
OSASCO PROPERTIES FII	-	-	-	-	-	-	0,24%	-	-

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	7.563.982,57	25,32%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	6.556.905,78	21,95%
BNY Mellon Serviços Financeiros	3.613.805,58	12,10%
BRIDGE TRUST	2.988.059,70	10,00%
CM Capital Markets DTVM	2.827.878,91	9,47%
Planner Corretora	2.531.928,09	8,47%
Orla DTVM	1.630.592,11	5,46%
BRB DTVM	1.390.208,69	4,65%
BEM DTVM	568.026,99	1,90%
BANCO BRADESCO	179.572,06	0,60%
FINAXIS Corretora	26.193,68	0,09%



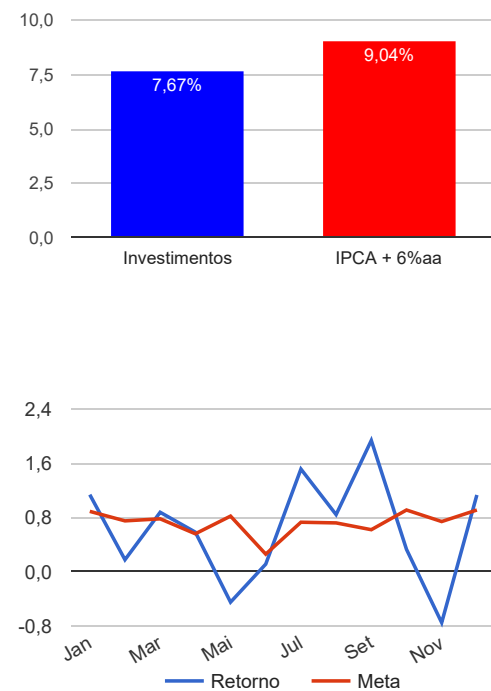
Sub-segmento	Valor	%
CDI	5.696.320,59	19,07%
IMA-B	5.473.932,01	18,32%
AÇÕES - LIVRES	4.181.832,57	14,00%
IMA-B 5	3.594.172,20	12,03%
FIDC - ABERTO	2.836.396,53	9,49%
IMA-B 5+	2.640.839,88	8,84%
FUNDO IMOBILIÁRIO	2.531.928,09	8,47%
MULTIMERCADO	1.390.208,69	4,65%
IDKA IPCA 2A	1.325.757,86	4,44%
IRF-M 1	179.572,06	0,60%
FIDC - FECHADO	26.193,68	0,09%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	23.410.196,81	229.291,64	289.085,54	23.616.357,12	265.954,21	1,14%	0,89%	127,37%	224,29%
Fevereiro	23.616.357,12	11.334.837,72	11.117.670,82	23.875.949,34	42.425,32	0,18%	0,75%	23,78%	3,40%
Março	23.875.949,34	1.065.137,44	328.424,08	24.828.416,08	215.753,38	0,88%	0,78%	111,73%	1,77%
Abril	24.828.416,08	1.111.311,81	682.062,56	25.405.087,65	147.422,32	0,58%	0,56%	104,67%	2,03%
Mai	25.405.087,65	1.253.370,17	649.178,56	25.893.111,55	-116.167,71	-0,45%	0,82%	-54,36%	9,93%
Junho	25.893.111,55	1.784.133,13	1.328.854,19	26.378.185,84	29.795,35	0,11%	0,26%	44,24%	2,66%
Julho	26.378.185,84	1.304.079,48	806.650,28	27.282.136,65	406.521,61	1,51%	0,73%	207,80%	2,36%
Agosto	27.282.136,65	4.117.370,44	3.845.358,60	27.786.187,40	232.038,91	0,84%	0,72%	116,27%	2,22%
Setembro	27.786.187,40	556.350,45	295.452,16	28.589.543,93	542.458,24	1,93%	0,62%	309,82%	2,17%
Outubro	28.589.543,93	2.555.697,89	2.343.690,47	28.896.744,53	95.193,18	0,33%	0,91%	36,37%	2,43%
Novembro	28.896.744,53	555.877,08	309.053,29	28.925.456,20	-218.112,12	-0,75%	0,74%	-101,14%	3,97%
Dezembro	28.925.456,20	980.237,68	362.762,23	29.877.154,16	334.222,51	1,13%	0,91%	124,93%	2,51%
Acumulado no ano					1.977.505,20	7,67%	9,04%	84,78%	

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(%)
PREMIUM FIDC SÊNIOR	25.860,42	0,00	24,66	26.193,68	357,92	1,38%	2,63%	1,29%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.073.394,69	0,00	0,00	1.082.737,67	9.342,98	0,87%	0,45%	0,87%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	75.114,53	0,00	0,00	75.762,83	648,30	0,86%	0,46%	0,86%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.740.050,85	0,00	0,00	3.770.292,75	30.241,90	0,81%	1,42%	0,81%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	80.912,19	0,00	0,00	81.564,77	652,58	0,81%	1,42%	0,81%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.621.099,41	0,00	0,00	2.640.839,88	19.740,47	0,75%	2,06%	0,75%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	2.808.259,96	0,00	0,00	2.827.878,91	19.618,95	0,70%	5,09%	0,70%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	62.796,45	0,00	0,00	63.162,49	366,04	0,58%	0,07%	0,58%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	178.581,70	0,00	0,00	179.572,06	990,36	0,55%	0,04%	0,55%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.872.129,12	263.279,91	0,00	2.145.650,96	10.241,93	0,48%	0,02%	0,52%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	1.615.093,41	0,00	0,00	1.622.074,49	6.981,08	0,43%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.115.351,51	716.957,77	359.417,90	3.487.507,14	14.615,76	0,38%	0,01%	0,45%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	657.446,48	0,00	0,00	659.818,79	2.372,31	0,36%	0,47%	0,36%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	166.672,01	0,00	0,00	167.257,36	585,35	0,35%	0,13%	0,35%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	603.993,00	0,00	0,00	606.112,50	2.119,50	0,35%	0,13%	0,35%
TOWER BRIDGE RENDA FIXA FI IMA-B 5	2.322.719,56	0,00	0,00	2.328.240,91	5.521,35	0,24%	2,98%	0,24%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	106.279,01	0,00	3.319,67	8.517,62	-94.441,72	-88,86%	40,47%	-27,62%
Total Renda Fixa					29.955,06	0,14%	1,67%	

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(%)
META VALOR FI AÇÕES	1.670.978,81	0,00	0,00	1.786.607,47	115.628,66	6,92%	7,08%	6,92%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	1.138.082,49	0,00	0,00	1.213.572,56	75.490,07	6,63%	5,05%	6,63%
PERFIN INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	535.086,57	0,00	0,00	568.026,99	32.940,42	6,16%	4,53%	6,16%
FRANKLIN TEMPLETON VALOR E FVL FI AÇÕES	578.386,18	0,00	0,00	613.625,55	35.239,37	6,09%	4,46%	6,09%
MÉRITO DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - MFII11	1.506.626,82	0,00	0,00	1.545.658,03	39.031,21	2,59%	6,84%	2,59%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	1.382.946,96	0,00	0,00	1.390.208,69	7.261,73	0,53%	0,09%	0,53%
OSASCO PROPERTIES FII	987.594,07	0,00	0,00	986.270,06	-1.324,01	-0,13%	-	-
Total Renda Variável					304.267,45	3,90%	4,89%	

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 FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.886.591,35	1.565.929,22	1.012.143,29	3.487.507,14	47.129,86	1,36%	1,49%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.140.747,01	975.883,43	0,00	2.145.650,96	29.020,52	1,53%	1,74%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	637.756,52	0,00	0,00	659.818,79	22.062,27	3,46%	3,46%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.063.038,83	0,00	0,00	1.082.737,67	19.698,84	1,85%	1,85%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	596.703,00	0,00	0,00	606.112,50	9.409,50	1,58%	1,58%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	176.440,72	0,00	0,00	179.572,06	3.131,34	1,77%	1,77%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	164.667,30	0,00	0,00	167.257,36	2.590,06	1,57%	1,57%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	74.339,80	0,00	0,00	75.762,83	1.423,03	1,91%	1,91%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	62.026,15	0,00	0,00	63.162,49	1.136,34	1,83%	1,83%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	1.621.418,16	0,00	0,00	1.622.074,49	656,33	0,04%	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	25.945,17	0,00	43,03	26.193,68	291,54	1,12%	0,96%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	2.827.710,02	0,00	0,00	2.827.878,91	168,89	0,01%	0,00%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	81.886,64	0,00	0,00	81.564,77	-321,87	-0,39%	-0,39%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.784.505,01	0,00	0,00	3.770.292,75	-14.212,26	-0,38%	-0,38%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.671.634,85	0,00	2.000.000,00	2.640.839,88	-30.794,97	-0,95%	-1,70%
TOWER BRIDGE RENDA FIXA FI IMA-B 5	2.370.015,05	0,00	0,00	2.328.240,91	-41.774,14	-1,76%	-1,76%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	108.632,50	0,00	3.319,67	8.517,62	-96.795,21	-89,10%	-92,16%
				Total Renda Fixa	-47.179,93	-0,22%	

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 (%)
MÉRITO DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - MFII11	1.332.368,50	0,00	0,00	1.545.658,03	213.289,53	16,01%	16,01%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	1.016.593,79	350.000,00	0,00	1.390.208,69	23.614,90	1,73%	1,84%
PERFIN INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	556.436,72	0,00	0,00	568.026,99	11.590,27	2,08%	2,08%
FRANKLIN TEMPLETON VALOR E FVL FI AÇÕES	603.992,86	0,00	0,00	613.625,55	9.632,69	1,59%	1,59%
META VALOR FI AÇÕES	1.184.026,20	600.000,00	0,00	1.786.607,47	2.581,27	0,14%	1,47%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	611.791,29	600.000,00	0,00	1.213.572,56	1.781,27	0,15%	0,91%
OSASCO PROPERTIES FII	990.276,49	0,00	0,00	986.270,06	-4.006,43	-0,40%	-
Total Renda Variável					258.483,50	3,29%	

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 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	4.321.763,62	2.000.000,00	2.640.839,88	319.076,26	7,07%	12,44%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	3.500.000,00	0,00	3.770.292,75	270.292,75	7,72%	12,52%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.952.867,88	0,00	2.100.000,00	75.762,83	222.894,95	14,74%	12,40%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.581.705,36	1.209.163,62	1.860.708,15	1.082.737,67	152.576,84	10,89%	12,34%
TOWER BRIDGE RENDA FIXA FI IMA-B 5	2.209.211,94	0,00	0,00	2.328.240,91	119.028,97	5,39%	5,39%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	137.806,71	8.009.066,23	4.768.242,28	3.487.507,14	108.876,48	5,94%	8,87%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	2.722.357,49	0,00	0,00	2.827.878,91	105.521,42	3,88%	3,87%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.569.449,57	0,00	5.667.435,86	0,00	97.986,29	1,76%	10,93%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	1.500.000,00	1.500.000,00	81.564,77	81.564,77	6,84%	12,55%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	581.321,50	0,00	32.837,44	606.112,50	57.628,44	10,20%	4,26%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	602.201,47	0,00	0,00	659.818,79	57.617,32	9,57%	9,57%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	2.302.130,47	0,00	2.278.466,43	63.162,49	39.498,45	9,56%	10,08%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	2.107.701,46	0,00	2.145.650,96	37.949,50	2,36%	9,94%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.600.899,91	0,00	1.628.263,42	0,00	27.363,51	1,71%	10,86%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	161.900,35	0,00	0,00	179.572,06	17.671,71	10,92%	10,92%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	160.627,48	0,00	9.229,34	167.257,36	15.859,22	10,16%	10,19%
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	502.962,20	0,00	509.079,92	0,00	6.117,72	1,22%	11,29%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	27.531,67	0,00	660,27	26.193,68	-677,72	-2,47%	-4,86%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	196.654,85	0,00	3.319,67	8.517,62	-184.817,56	-93,98%	-95,67%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	1.817.727,59	0,00	0,00	1.622.074,49	-195.653,10	-10,76%	-
INCENTIVO I FIDC MULTISSETORIAL 1	280.256,59	0,00	0,00	0,00	-280.256,59	-100,00%	-100,00%
Total Renda Fixa					1.076.119,63	4,92%	

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 (%)
MÉRITO DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - MFII11	0,00	1.150.000,00	0,00	1.545.658,03	395.658,03	34,41%	31,41%
META VALOR FI AÇÕES	0,00	1.600.000,00	0,00	1.786.607,47	186.607,47	23,95%	40,18%
FRANKLIN TEMPLETON VALOR E FVL FI AÇÕES	0,00	500.000,00	0,00	613.625,55	113.625,55	22,73%	32,97%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	0,00	1.100.000,00	0,00	1.213.572,56	113.572,56	22,54%	32,51%
PERFIN INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,00	500.000,00	0,00	568.026,99	68.026,99	13,61%	27,06%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	0,00	1.350.000,00	0,00	1.390.208,69	40.208,69	3,65%	11,63%
OSASCO PROPERTIES FII	1.002.583,78	0,00	0,00	986.270,06	-16.313,72	-1,63%	-
Total Renda Variável					901.385,57	19,05%	