

# 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	32.845.304,93	11,53%	701	0,64%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	26.119.165,32	9,17%	283	1,63%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
DAYCOVAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+3	Não há	8.180.963,01	2,87%	137	15,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	6.375.517,48	2,24%	613	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	21.609.883,34	7,58%	1.382	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	3.349.620,95	1,18%	23	0,82%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2020	1.520.136,39	0,53%	122	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	9.148.328,45	3,21%	771	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	32.418.136,38	11,38%	205	2,53%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	14.888.066,30	5,22%	77	4,91%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	9.022.193,48	3,17%	49	11,45%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
SICREDI INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	11.680.831,64	4,10%	66	6,94%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2030	17.847.060,00	6,26%	34	9,15%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	36.834.771,12	12,93%	763	0,86%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	5.577.504,58	1,96%	143	0,54%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	10.352.861,10	3,63%	38	6,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	405.289,50	0,14%	60	0,42%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SUL INVEST FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 6	Não se aplica	Não se aplica	980.486,91	0,34%	22	1,27%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	1.020.556,84	0,36%	98	1,02%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
AZ QUEST LUCE FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	D+1	Não há	201.991,86	0,07%	25.588	0,01%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BB INDEXADO IBRX FIC AÇÕES	D+4	Não há	2.422.886,22	0,85%	4.999	1,82%	Artigo 8º, Inciso I
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	D+15	Não há	4.791.032,93	1,68%	378	12,98%	Artigo 8º, Inciso I

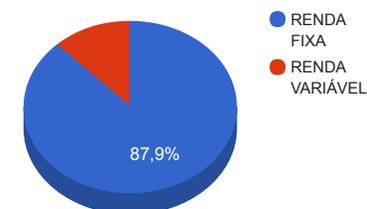
Carteira consolidada de investimentos - base (setembro / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	3.823.485,09	1,34%	17	12,62%	Artigo 8º, Inciso II
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	9.432.190,79	3,31%	2.112	2,80%	Artigo 8º, Inciso III
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	D+4	Não há	990.157,40	0,35%	7.285	0,63%	Artigo 8º, Inciso III
META VALOR FI AÇÕES	D+4	Não há	199.159,80	0,07%	22	0,29%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	6.726.803,96	2,36%	374	14,59%	Artigo 8º, Inciso III
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	3.133.067,83	1,10%	51	4,60%	Artigo 8º, Inciso IV
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	D+2	Não há	3.052.968,54	1,07%	8	3,01%	Artigo 8º, Inciso IV
		<b>TOTAL -</b>	<b>284.950.422,14</b>				

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

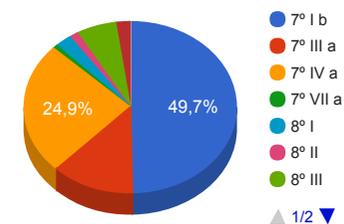
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	141.567.056,25	49,68%	30,00%	35,00%	70,00%	57.898.239,25
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	35.591.091,42	12,49%	10,00%	15,00%	60,00%	135.379.161,86
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	71.017.486,30	24,92%	5,00%	15,00%	30,00%	14.467.640,34
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	15,00%	42.742.563,32
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	2.001.043,75	0,70%	0,00%	2,50%	5,00%	12.246.477,36
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	201.991,86	0,07%	0,00%	2,50%	5,00%	14.045.529,25
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>250.378.669,58</b>	<b>87,87%</b>	<b>45,00</b>	<b>75,00</b>	<b>185,00</b>	<b>-</b>

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	7.213.919,15	2,53%	0,00%	3,00%	5,00%	7.033.601,96
Artigo 8º, Inciso II	20,00%	3.823.485,09	1,34%	0,00%	3,00%	3,00%	4.725.027,57
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	17.348.311,95	6,09%	1,00%	10,00%	10,00%	11.146.730,26
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	6.186.036,37	2,17%	0,00%	3,00%	4,00%	5.211.980,52
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	4,00%	11.398.016,89
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	4,00%	11.398.016,89
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>34.571.752,56</b>	<b>12,13%</b>	<b>1,00</b>	<b>25,00</b>	<b>30,00</b>	<b>-</b>

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 " b "	141.567.056,25	49,68%	30,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	35.591.091,42	12,49%	10,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	71.017.486,30	24,92%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	2.001.043,75	0,70%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	201.991,86	0,07%	0,00%	5,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>250.378.669,58</b>	<b>87,87%</b>	<b>45,00</b>	<b>185,00</b>

Artigos - Renda Variável	Base: setembro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I	7.213.919,15	2,53%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso II	3.823.485,09	1,34%	0,00%	3,00%
Artigo 8º, Inciso III	17.348.311,95	6,09%	1,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV	6.186.036,37	2,17%	0,00%	4,00%
Artigo 8º, Inciso V	0,00	0,00%	0,00%	4,00%
Artigo 8º, Inciso VI	0,00	0,00%	0,00%	4,00%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>34.571.752,56</b>	<b>12,13%</b>	<b>1,00</b>	<b>30,00</b>

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5+	2,40%	14,62%	8,64%	5,79%	17,29%	57,99%	-	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,32%	14,08%	8,56%	5,48%	16,64%	56,75%	0,20%	1,967%	12,79%
IMA-B	1,81%	13,16%	7,30%	5,86%	15,76%	48,59%	-	-	-
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%
SICREDI INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	1,80%	12,86%	7,15%	5,57%	15,58%	47,07%	0,20%	1,334%	9,68%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,78%	12,94%	7,21%	5,71%	15,46%	47,78%	0,20%	1,328%	9,80%
IRF-M	1,48%	13,57%	4,92%	7,23%	17,44%	43,51%	-	-	-
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	1,46%	13,33%	4,87%	7,01%	17,11%	42,04%	0,20%	1,006%	5,04%
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%	-	-	-
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	1,02%	11,18%	5,36%	6,61%	13,68%	34,84%	0,20%	0,708%	3,92%
DAYCOVAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,95%	10,62%	4,97%	6,26%	12,90%	32,88%	0,50%	0,645%	3,72%
IDKA IPCA 2 Anos	0,91%	11,13%	4,46%	6,74%	13,66%	34,61%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,86%	10,29%	4,33%	6,18%	12,73%	33,31%	0,20%	0,476%	2,90%
IRF-M 1	0,74%	9,14%	2,72%	5,49%	12,65%	29,70%	-	-	-

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

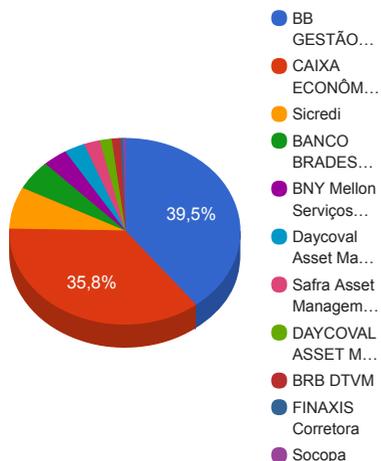
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,71%	8,98%	2,67%	5,39%	12,45%	29,31%	0,20%	0,071%	0,67%
IPCA + 7,50% ao ano	0,74%	7,43%	2,46%	4,49%	10,16%	28,47%	-	-	-
SUL INVEST FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 6	0,56%	-5,52%	-9,97%	-8,10%	-3,22%	-2,03%	0,18%	0,293%	-
CDI	0,64%	8,03%	2,25%	4,85%	11,53%	27,29%	-	-	-
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	0,68%	9,30%	2,25%	5,56%	13,12%	31,15%	0,75%	0,282%	9,17%
AZ QUEST LUCE FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	0,67%	8,60%	2,34%	5,04%	12,38%	-	0,40%	0,032%	0,19%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,65%	8,10%	2,27%	4,86%	11,65%	27,28%	0,20%	0,014%	0,11%
IPCA + 6,00% ao ano	0,62%	6,30%	2,09%	3,77%	8,64%	24,92%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,81%	10,10%	4,00%	5,78%	12,51%	34,33%	0,15%	0,424%	3,00%
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%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,50%	0,24%	-1,05%	0,89%	2,34%	11,63%	0,20%	0,237%	4,07%
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,50%	0,41%	-1,01%	0,92%	2,48%	11,78%	0,20%	0,238%	3,98%
101,50% do IPCA + 5,75% ao ano	0,56%	5,64%	1,87%	3,33%	7,74%	22,92%	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,51%	-5,76%	-2,76%	-4,50%	-8,11%	-18,17%	0,25%	0,349%	1,01%

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
Ibovespa	4,88%	23,36%	18,12%	14,33%	27,29%	64,88%	-	-	-
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	5,26%	26,56%	17,37%	15,42%	31,03%	55,11%	2,80%	5,766%	20,60%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	4,78%	22,75%	17,80%	14,02%	26,72%	63,49%	0,50%	6,322%	20,67%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	4,08%	22,79%	15,87%	10,83%	19,08%	63,61%	2,00%	5,679%	21,47%
IBX	4,69%	24,29%	17,91%	14,93%	27,43%	62,93%	-	-	-
META VALOR FI AÇÕES	8,11%	38,16%	26,57%	22,59%	46,55%	83,68%	2,50%	7,184%	24,81%
BB INDEXADO IBRX FIC AÇÕES	4,46%	21,97%	17,13%	13,54%	24,44%	56,48%	1,50%	6,116%	19,98%
SMLL	3,68%	45,17%	21,74%	25,04%	41,48%	87,27%	-	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	5,82%	39,50%	27,00%	22,37%	42,82%	68,53%	2,00%	7,488%	20,27%
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%
CDI	0,64%	8,03%	2,25%	4,85%	11,53%	27,29%	-	-	-
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	2,13%	20,41%	6,01%	11,41%	28,84%	64,88%	1,00%	2,294%	7,15%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	0,69%	9,61%	2,61%	5,61%	13,70%	33,54%	1,00%	0,306%	10,35%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	112.685.443,44	39,55%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	101.926.558,32	35,77%
Sicredi	20.703.025,12	7,27%
BANCO BRADESCO	14.888.066,30	5,22%
BNY Mellon Serviços Financeiros	9.833.342,45	3,45%
Daycoval Asset Management	8.180.963,01	2,87%
Safrá Asset Management	6.402.589,49	2,25%
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT ADMINISTRAÇÃO DE RECURSOS	4.791.032,93	1,68%
BRB DTVM	3.538.357,33	1,24%
FINAXIS Corretora	1.020.556,84	0,36%
Socopa	980.486,91	0,34%



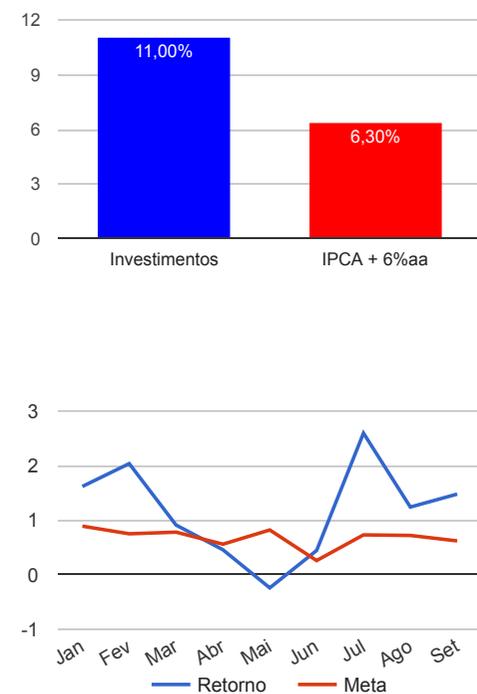
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	46.484.664,20	16,31%
IMA-B 5+	43.966.225,32	15,43%
CDI	37.442.052,48	13,14%
IDKA IPCA 2A	32.845.304,93	11,53%
IMA-GERAL	32.418.136,38	11,38%
IMA-B 5	23.069.029,31	8,10%
IRF-M 1	21.609.883,34	7,58%
AÇÕES - SETORIAIS	17.149.152,15	6,02%
AÇÕES - INDEXADO	11.037.404,24	3,87%
IRF-M	9.022.193,48	3,17%
MULTIMERCADO	6.186.036,37	2,17%
FIDC - FECHADO	2.001.043,75	0,70%
IDKA IPCA 3A	1.520.136,39	0,53%
AÇÕES - LIVRES	199.159,80	0,07%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	233.654.557,76	4.288.800,00	2.359.839,23	239.392.072,45	3.808.553,92	1,62%	0,89%	181,25%	1,85%
Fevereiro	239.392.072,45	6.000.206,00	2.987.505,78	247.336.459,83	4.931.687,16	2,03%	0,75%	271,83%	1,81%
Março	247.336.459,83	4.795.917,00	1.967.000,00	252.441.642,67	2.276.265,84	0,91%	0,78%	115,98%	1,44%
Abril	252.441.642,67	6.646.065,00	3.987.913,14	256.267.435,31	1.167.640,78	0,46%	0,56%	82,08%	1,30%
Mai	256.267.435,31	17.946.343,85	16.757.800,00	256.838.535,75	-617.443,41	-0,24%	0,82%	-29,19%	7,04%
Junho	256.838.535,75	4.925.770,00	310.439,95	262.616.691,79	1.162.825,99	0,44%	0,26%	173,98%	1,59%
Julho	262.616.691,79	4.970.070,00	2.077.343,97	272.391.076,51	6.881.658,69	2,59%	0,73%	356,06%	1,36%
Agosto	272.391.076,51	6.746.861,11	2.866.366,05	279.696.039,92	3.424.468,35	1,24%	0,72%	171,15%	1,80%
Setembro	279.696.039,92	3.870.500,00	2.761.250,27	284.950.422,14	4.145.132,49	1,48%	0,62%	236,46%	1,27%
Acumulado no ano					27.180.789,81	11,00%	6,30%	174,54%	

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 IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	25.525.723,98	0,00	0,00	26.119.165,32	593.441,34	2,32%	1,97%	2,32%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	3.289.940,94	0,00	0,00	3.349.620,95	59.680,01	1,81%	1,41%	1,81%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.986.582,64	0,00	0,00	9.148.328,45	161.745,81	1,80%	1,35%	1,80%
SICREDI INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	11.474.809,44	0,00	0,00	11.680.831,64	206.022,20	1,80%	1,33%	1,80%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.263.970,94	0,00	0,00	6.375.517,48	111.546,54	1,78%	1,33%	1,78%
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	8.892.745,69	0,00	0,00	9.022.193,48	129.447,79	1,46%	1,01%	1,46%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	32.007.642,91	0,00	0,00	32.418.136,38	410.493,47	1,28%	0,75%	1,28%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	14.738.444,35	0,00	0,00	14.888.066,30	149.621,95	1,02%	0,71%	1,02%
DAYCOVAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	8.103.575,48	0,00	0,00	8.180.963,01	77.387,53	0,95%	0,65%	0,95%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	32.566.174,77	0,00	0,00	32.845.304,93	279.130,16	0,86%	0,48%	0,86%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.507.968,61	0,00	0,00	1.520.136,39	12.167,78	0,81%	0,42%	0,81%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	23.772.146,70	0,00	2.318.000,00	21.609.883,34	155.736,64	0,66%	0,07%	0,71%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	35.569.928,47	1.470.500,00	441.150,00	36.834.771,12	235.492,65	0,64%	0,01%	0,65%
SUL INVEST FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 6	974.982,40	0,00	0,00	980.486,91	5.504,51	0,56%	0,29%	0,56%
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	303.043,24	100.000,00	0,00	405.289,50	2.246,26	0,56%	0,28%	0,68%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.548.849,26	0,00	0,00	5.577.504,58	28.655,32	0,52%	0,23%	0,52%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	17.758.006,00	0,00	0,00	17.847.060,00	89.054,00	0,50%	0,24%	0,50%
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.301.750,10	0,00	0,00	10.352.861,10	51.111,00	0,50%	0,24%	0,50%
AZ QUEST LUCE FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	101.152,61	100.000,00	0,00	201.991,86	839,25	0,42%	0,03%	0,67%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.025.795,10	0,00	2.100,27	1.020.556,84	-3.137,99	-0,31%	0,35%	-0,51%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>2.756.186,22</b>	<b>1,11%</b>	<b>0,67%</b>	

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(%)
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	8.913.110,03	0,00	0,00	9.432.190,79	519.080,76	5,82%	7,49%	5,82%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	4.551.635,80	0,00	0,00	4.791.032,93	239.397,13	5,26%	5,77%	5,26%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	3.648.903,54	0,00	0,00	3.823.485,09	174.581,55	4,78%	6,32%	4,78%
BB INDEXADO IBRX FIC AÇÕES	2.319.396,35	0,00	0,00	2.422.886,22	103.489,87	4,46%	6,12%	4,46%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	6.463.191,78	0,00	0,00	6.726.803,96	263.612,18	4,08%	5,68%	4,08%
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	959.964,82	0,00	0,00	990.157,40	30.192,58	3,15%	7,65%	3,15%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	1.014.978,78	2.000.000,00	0,00	3.052.968,54	37.989,76	1,26%	2,29%	2,13%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	3.111.625,19	0,00	0,00	3.133.067,83	21.442,64	0,69%	0,31%	0,69%
META VALOR FI AÇÕES	0,00	200.000,00	0,00	199.159,80	-840,20	-0,42%	7,18%	8,11%
Total Renda Variável					1.388.946,27	4,19%	5,57%	

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 IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	24.059.109,32	0,00	0,00	26.119.165,32	2.060.056,00	8,56%	8,56%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	30.969.854,71	0,00	0,00	32.418.136,38	1.448.281,67	4,68%	4,68%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	31.482.026,45	0,00	0,00	32.845.304,93	1.363.278,48	4,33%	4,33%
SICREDI INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	10.901.845,17	0,00	0,00	11.680.831,64	778.986,47	7,15%	7,15%
BRASESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	14.131.018,03	0,00	0,00	14.888.066,30	757.048,27	5,36%	5,36%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	25.692.884,14	10.868.979,64	441.150,00	36.834.771,12	714.057,34	2,11%	2,27%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	26.881.365,28	1.018.451,47	6.911.965,00	21.609.883,34	622.031,59	2,43%	2,67%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.530.015,25	0,00	0,00	9.148.328,45	618.313,20	7,25%	7,25%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.946.905,05	0,00	0,00	6.375.517,48	428.612,43	7,21%	7,21%
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	8.602.869,99	0,00	0,00	9.022.193,48	419.323,49	4,87%	4,87%
DAYCOVAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	7.793.827,72	0,00	0,00	8.180.963,01	387.135,29	4,97%	4,97%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	3.110.674,73	0,00	0,00	3.349.620,95	238.946,22	7,68%	7,68%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.629.972,79	0,00	160.568,44	5.577.504,58	108.100,23	1,93%	1,95%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.502.030,45	0,00	41.458,72	1.520.136,39	59.564,66	3,99%	4,00%
SUL INVEST FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 6	1.089.123,76	0,00	131.525,52	980.486,91	22.888,67	2,17%	-9,97%
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	100.087,74	300.000,00	0,00	405.289,50	5.201,76	1,69%	2,25%
AZ QUEST LUCE FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	0,00	200.000,00	0,00	201.991,86	1.991,86	1,57%	2,34%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.049.475,88	0,00	18.292,61	1.020.556,84	-10.626,43	-1,02%	-2,76%
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.458.590,40	0,00	0,00	10.352.861,10	-105.729,30	-1,01%	-1,01%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	18.036.284,00	0,00	0,00	17.847.060,00	-189.224,00	-1,05%	-1,05%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>9.728.237,90</b>	<b>4,05%</b>	

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 (%)
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	7.426.890,32	0,00	0,00	9.432.190,79	2.005.300,47	27,00%	27,00%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	5.805.486,89	0,00	0,00	6.726.803,96	921.317,07	15,87%	15,87%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	4.082.081,23	0,00	0,00	4.791.032,93	708.951,70	17,37%	17,37%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	3.245.651,68	0,00	0,00	3.823.485,09	577.833,41	17,80%	17,80%
BB INDEXADO IBRX FIC AÇÕES	2.068.460,40	0,00	0,00	2.422.886,22	354.425,82	17,13%	17,13%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	3.053.248,80	0,00	0,00	3.133.067,83	79.819,03	2,61%	2,61%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	0,00	3.000.000,00	0,00	3.052.968,54	52.968,54	2,78%	6,01%
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	966.911,61	0,00	0,00	990.157,40	23.245,79	2,40%	2,40%
META VALOR FI AÇÕES	0,00	200.000,00	0,00	199.159,80	-840,20	-0,42%	26,57%
Total Renda Variável					4.723.021,63	17,00%	