

# 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
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	32.725.148,73	11,45%	193	2,71%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	5.713.752,90	2,00%	143	0,54%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	25.679.788,37	8,98%	224	2,72%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2020	1.544.515,96	0,54%	122	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	33.474.038,29	11,71%	712	0,62%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	9.112.369,66	3,19%	722	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2030	18.279.268,00	6,40%	34	9,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
DAYCOVAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+3	Não há	8.288.826,26	2,90%	161	15,76%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	21.996.837,33	7,70%	1.412	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	10.601.847,00	3,71%	38	6,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	6.351.574,98	2,22%	588	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SICREDI INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	11.627.508,48	4,07%	66	6,99%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	412.676,52	0,14%	61	0,39%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	34.459.440,75	12,06%	757	0,82%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	9.143.177,06	3,20%	50	9,93%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	15.086.032,91	5,28%	76	4,66%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	1.030.332,02	0,36%	98	1,02%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
SUL INVEST FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 6	Não se aplica	Não se aplica	1.008.025,97	0,35%	22	1,27%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
AZ QUEST LUCE FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	D+1	Não há	813.457,07	0,28%	30.365	0,03%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	D+15	Não há	4.792.870,50	1,68%	447	11,93%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	9.525.525,68	3,33%	3.378	2,25%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BB INDEXADO IBRX FIC AÇÕES	D+4	Não há	2.472.234,47	0,86%	5.033	1,81%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "

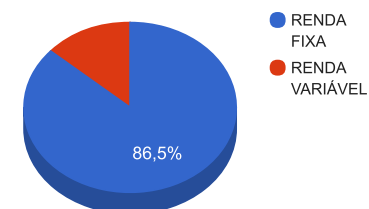
Carteira consolidada de investimentos - base (dezembro / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	3.919.442,29	1,37%	19	10,40%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	D+4	Não há	981.717,03	0,34%	6.967	0,65%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	6.779.558,64	2,37%	501	12,52%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
META VALOR FI AÇÕES	D+4	Não há	202.083,67	0,07%	31	0,23%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	D+2	Não há	5.605.581,52	1,96%	10	2,55%	Artigo 8º, Inciso III
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	4.192.466,05	1,47%	60	4,43%	Artigo 8º, Inciso III
		<b>TOTAL -</b>	<b>285.820.098,11</b>				

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

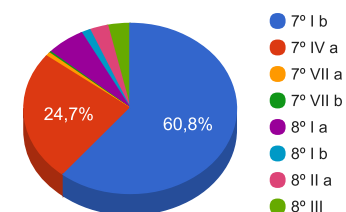
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	173.767.967,48	60,80%	30,00%	35,00%	70,00%	26.306.101,20
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	10,00%	15,00%	60,00%	171.492.058,87
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	70.728.835,72	24,75%	5,00%	15,00%	30,00%	15.017.193,71
Artigo 7º, Inciso VI	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	15,00%	42.873.014,72
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	2.038.357,99	0,71%	0,00%	2,50%	5,00%	12.252.646,92
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	813.457,07	0,28%	0,00%	2,50%	5,00%	13.477.547,84
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>247.348.618,26</b>	<b>86,54%</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	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	5,00%	14.291.004,91
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	16.790.630,65	5,87%	0,00%	0,00%	0,00%	-16.790.630,65
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	30,00%	3.919.442,29	1,37%	0,00%	0,00%	0,00%	-3.919.442,29
Artigo 8º, Inciso II	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	3,00%	8.574.602,94
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	7.963.359,34	2,79%	0,00%	0,00%	0,00%	-7.963.359,34
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	9.798.047,57	3,43%	1,00%	10,00%	10,00%	18.783.962,24
Artigo 8º, Inciso IV	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	4,00%	11.432.803,92
Artigo 8º, Inciso V	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	4,00%	11.432.803,92
Artigo 8º, Inciso VI	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	4,00%	11.432.803,92
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>38.471.479,85</b>	<b>13,46%</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: dezembro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	173.767.967,48	60,80%	30,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	10,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	70.728.835,72	24,75%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	2.038.357,99	0,71%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	813.457,07	0,28%	0,00%	5,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>247.348.618,26</b>	<b>86,54%</b>	<b>45,00</b>	<b>185,00</b>

Artigos - Renda Variável	Base: dezembro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	16.790.630,65	5,87%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	3.919.442,29	1,37%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00%	0,00%	3,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	7.963.359,34	2,79%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso III	9.798.047,57	3,43%	1,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV	0,00	0,00%	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>38.471.479,85</b>	<b>13,46%</b>	<b>1,00</b>	<b>30,00</b>

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	110.677.062,75	38,72%	0,01%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	103.414.471,65	36,18%	0,03%
SICREDI	20.770.685,54	7,27%	0,07%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	15.086.032,91	5,28%	0,00%
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	13.081.696,76	4,58%	0,60%
AZ QUEST INVESTIMENTOS	10.338.982,75	3,62%	0,07%
SAFRA ASSET MANAGEMENT	5.605.581,52	1,96%	0,00%
INFINITY ASSET MANAGEMENT	4.605.142,57	1,61%	1,09%
FINAXIS CORRETORA	1.030.332,02	0,36%	1,02%
BRZ Investimentos	1.008.025,97	0,35%	0,03%
META ASSET MANAGEMENT	202.083,67	0,07%	0,22%

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%	-	-	-
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	1,23%	14,85%	1,34%	6,28%	14,85%	40,59%	0,20%	0,843%	4,78%
IDKA IPCA 2 Anos	1,16%	13,61%	2,24%	6,80%	13,61%	30,90%	-	-	-
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 + 7,50% ao ano	1,02%	10,57%	2,93%	5,46%	10,57%	26,30%	-	-	-
SUL INVEST FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 6	0,77%	-2,87%	2,81%	-7,45%	-2,87%	-3,82%	0,18%	0,277%	-
IPCA + 6,00% ao ano	0,91%	9,05%	2,58%	4,73%	9,05%	22,83%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,71%	9,30%	2,44%	4,44%	9,30%	23,99%	0,20%	0,109%	0,31%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,71%	2,67%	2,42%	1,35%	2,67%	9,70%	0,20%	0,111%	4,08%
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,70%	2,82%	2,40%	1,37%	2,82%	9,86%	0,20%	0,111%	3,99%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,70%	11,86%	1,60%	5,67%	11,86%	29,52%	0,15%	0,326%	2,73%
IMA-B 5	0,88%	12,58%	1,48%	6,74%	12,58%	30,01%	-	-	-
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	0,87%	12,66%	1,33%	6,76%	12,66%	29,92%	0,20%	0,722%	3,75%
DAYCOVAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,83%	12,07%	1,32%	6,35%	12,07%	28,17%	0,50%	0,672%	3,54%
IMA Geral	0,88%	12,82%	1,02%	5,88%	12,82%	36,50%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,87%	12,59%	0,95%	5,67%	12,59%	36,17%	0,20%	0,702%	4,47%
101,50% do IPCA + 5,75% ao ano	0,84%	8,15%	2,38%	4,30%	8,15%	20,85%	-	-	-

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
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1,29%	-4,86%	0,96%	-1,82%	-4,86%	-17,69%	0,25%	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%
SICREDI INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	0,80%	12,34%	-0,46%	6,66%	12,34%	39,12%	0,20%	1,448%	9,14%
IMA-B 5+	0,79%	12,75%	-1,63%	6,87%	12,75%	47,75%	-	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,75%	12,17%	-1,68%	6,74%	12,17%	46,64%	0,20%	2,052%	12,09%
IRF-M 1	0,57%	11,12%	1,82%	4,59%	11,12%	27,47%	-	-	-
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 PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,58%	10,08%	1,83%	4,14%	10,08%	25,36%	0,20%	0,068%	0,13%
AZ QUEST LUCE FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	0,54%	10,53%	1,77%	4,15%	10,53%	27,32%	0,40%	0,056%	0,19%
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	0,52%	11,29%	1,82%	4,11%	11,29%	28,56%	0,75%	0,112%	9,09%

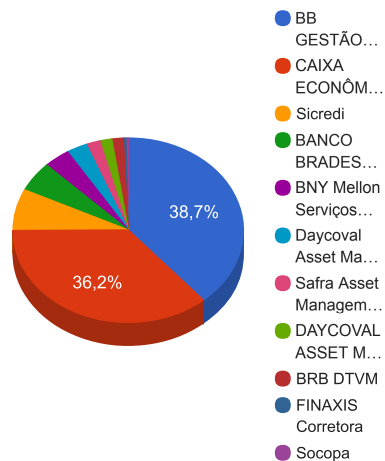


Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (dezembro / 2017)

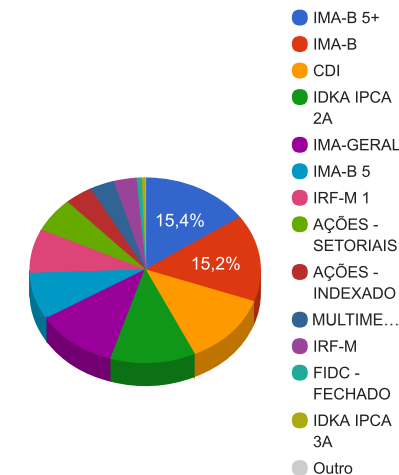
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
SMLL	7,03%	49,36%	2,89%	25,25%	49,36%	96,78%	-	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	5,02%	40,89%	0,99%	28,26%	40,89%	69,18%	2,00%	5,576%	20,19%
IBX	6,35%	27,55%	2,62%	21,00%	27,55%	74,36%	-	-	-
META VALOR FI AÇÕES	6,92%	40,18%	1,47%	28,43%	40,18%	93,48%	2,50%	7,081%	23,15%
BB INDEXADO IBRX FIC AÇÕES	6,22%	24,45%	2,04%	19,52%	24,45%	66,47%	1,50%	6,268%	18,46%
Ibovespa	6,16%	26,86%	2,84%	21,47%	26,86%	76,25%	-	-	-
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	6,19%	25,83%	2,51%	20,76%	25,83%	74,08%	0,50%	7,280%	19,06%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	5,80%	26,61%	0,04%	17,41%	26,61%	63,73%	2,80%	6,929%	19,32%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	4,28%	23,75%	0,78%	16,78%	23,75%	66,74%	2,00%	5,602%	18,89%
BBSEGURIDADE ON NM - BBSE3	5,99%	6,87%	-0,49%	2,53%	6,87%	32,18%	-	-	-
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	5,84%	4,91%	-0,85%	1,53%	4,91%	27,49%	1,5%	4,538%	25,01%
CDI	0,54%	9,93%	1,76%	4,05%	9,93%	25,31%	-	-	-
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	1,71%	30,13%	8,07%	14,57%	30,13%	59,94%	1,00%	2,893%	6,50%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	0,53%	11,63%	1,84%	4,51%	11,63%	30,26%	1,00%	0,093%	5,74%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	110.677.062,75	38,72%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	103.414.471,65	36,18%
Sicredi	20.770.685,54	7,27%
BANCO BRADESCO	15.086.032,91	5,28%
BNY Mellon Serviços Financeiros	10.541.066,42	3,69%
Daycoval Asset Management	8.288.826,26	2,90%
Safra Asset Management	5.605.581,52	1,96%
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT ADMINISTRAÇÃO DE RECURSOS	4.792.870,50	1,68%
BRB DTVM	4.605.142,57	1,61%
FINAXIS Corretora	1.030.332,02	0,36%
Socopa	1.008.025,97	0,35%



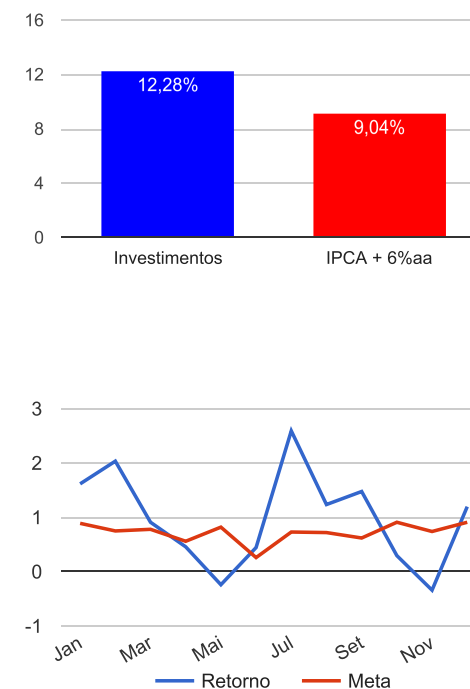
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5+	43.959.056,37	15,38%
IMA-B	43.407.053,02	15,19%
CDI	35.685.574,34	12,49%
IDKA IPCA 2A	33.474.038,29	11,71%
IMA-GERAL	32.725.148,73	11,45%
IMA-B 5	23.374.859,17	8,18%
IRF-M 1	21.996.837,33	7,70%
AÇÕES - SETORIAIS	17.286.801,35	6,05%
AÇÕES - INDEXADO	11.184.547,26	3,91%
MULTIMERCADO	9.798.047,57	3,43%
IRF-M	9.143.177,06	3,20%
FIDC - FECHADO	2.038.357,99	0,71%
IDKA IPCA 3A	1.544.515,96	0,54%
AÇÕES - LIVRES	202.083,67	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	2.857.034,03	279.696.039,91	3.415.136,32	1,24%	0,72%	170,67%	1,80%
Setembro	279.696.039,91	3.870.500,00	2.761.250,27	284.950.422,14	4.145.132,50	1,48%	0,62%	236,46%	1,27%
Outubro	284.950.422,14	2.072.744,00	4.535.855,00	283.330.253,07	842.941,93	0,30%	0,91%	32,55%	1,58%
Novembro	283.330.253,07	1.647.820,00	512.362,63	283.499.098,31	-966.612,13	-0,34%	0,74%	-45,92%	1,88%
Dezembro	283.499.098,31	6.705.338,12	7.778.420,28	285.820.098,11	3.394.081,96	1,20%	0,91%	132,21%	1,24%
Acumulado no ano					30.441.869,55	12,28%	9,04%	135,78%	

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	1.017.223,36	0,00	969,97	1.030.332,02	14.078,63	1,38%	2,63%	1,29%	
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	9.031.715,57	0,00	0,00	9.143.177,06	111.461,49	1,23%	0,84%	1,23%	
BRASESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	14.956.393,87	0,00	0,00	15.086.032,91	129.639,04	0,87%	0,72%	0,87%	
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	32.444.222,88	0,00	0,00	32.725.148,73	280.925,85	0,87%	0,70%	0,87%	
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	33.187.600,78	0,00	0,00	33.474.038,29	286.437,51	0,86%	0,46%	0,86%	
DAYCOVAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	8.220.291,59	0,00	0,00	8.288.826,26	68.534,67	0,83%	0,67%	0,83%	
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.300.628,36	0,00	0,00	6.351.574,98	50.946,62	0,81%	1,42%	0,81%	
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.039.464,07	0,00	0,00	9.112.369,66	72.905,59	0,81%	1,42%	0,81%	
SICREDI INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	11.534.876,02	0,00	0,00	11.627.508,48	92.632,46	0,80%	1,45%	0,80%	
SUL INVEST FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 6	1.000.322,06	0,00	0,00	1.008.025,97	7.703,91	0,77%	0,28%	0,77%	
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	25.488.952,68	0,00	0,00	25.679.788,37	190.835,69	0,75%	2,05%	0,75%	
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.673.405,69	0,00	0,00	5.713.752,90	40.347,21	0,71%	0,11%	0,71%	
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	18.150.972,00	0,00	0,00	18.279.268,00	128.296,00	0,71%	0,11%	0,71%	
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.527.999,30	0,00	0,00	10.601.847,00	73.847,70	0,70%	0,11%	0,70%	
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.533.845,98	0,00	0,00	1.544.515,96	10.669,98	0,70%	0,33%	0,70%	
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	21.872.637,95	0,00	0,00	21.996.837,33	124.199,38	0,57%	0,03%	0,57%	
AZ QUEST LUCE FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	809.112,60	0,00	0,00	813.457,07	4.344,47	0,54%	0,06%	0,54%	
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	410.527,96	0,00	0,00	412.676,52	2.148,56	0,52%	0,11%	0,52%	
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	35.337.846,38	3.400.480,81	4.472.593,00	34.459.440,75	193.706,56	0,50%	0,07%	0,58%	
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	3.306.161,19	0,00	3.304.857,31	0,00	-1.303,88	-0,04%	1,52%	0,84%	
<b>Total Renda Fixa</b>						<b>1.882.357,44</b>	<b>0,75%</b>	<b>0,67%</b>	

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	189.004,88	0,00	0,00	202.083,67	13.078,79	6,92%	7,08%	6,92%
BB INDEXADO IBRX FIC AÇÕES	2.327.553,41	0,00	0,00	2.472.234,47	144.681,06	6,22%	6,27%	6,22%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	3.690.966,16	0,00	0,00	3.919.442,29	228.476,13	6,19%	7,28%	6,19%
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	927.565,32	0,00	0,00	981.717,03	54.151,71	5,84%	4,54%	5,84%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	4.530.257,24	0,00	0,00	4.792.870,50	262.613,26	5,80%	6,93%	5,80%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	9.069.859,15	0,00	0,00	9.525.525,68	455.666,53	5,02%	5,58%	5,02%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	6.501.574,03	0,00	0,00	6.779.558,64	277.984,61	4,28%	5,60%	4,28%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	3.243.952,55	2.304.857,31	0,00	5.605.581,52	56.771,66	1,02%	2,89%	1,71%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	3.174.165,28	1.000.000,00	0,00	4.192.466,05	18.300,77	0,44%	0,09%	0,53%
Total Renda Variável					1.511.724,52	4,09%	4,96%	

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	32.845.304,93	0,00	0,00	33.474.038,29	628.733,36	1,91%	1,91%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	36.834.771,12	6.521.044,81	9.520.088,00	34.459.440,75	623.712,82	1,67%	1,83%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	17.847.060,00	0,00	0,00	18.279.268,00	432.208,00	2,42%	2,42%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	21.609.883,34	0,00	0,00	21.996.837,33	386.953,99	1,79%	1,79%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	32.418.136,38	0,00	0,00	32.725.148,73	307.012,35	0,95%	0,95%
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.352.861,10	0,00	0,00	10.601.847,00	248.985,90	2,40%	2,40%
BRASECO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	14.888.066,30	0,00	0,00	15.086.032,91	197.966,61	1,33%	1,33%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.577.504,58	0,00	0,00	5.713.752,90	136.248,32	2,44%	2,44%
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	9.022.193,48	0,00	0,00	9.143.177,06	120.983,58	1,34%	1,34%
DAYCOVAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	8.180.963,01	0,00	0,00	8.288.826,26	107.863,25	1,32%	1,32%
SUL INVEST FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 6	980.486,91	0,00	0,00	1.008.025,97	27.539,06	2,81%	2,81%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.520.136,39	0,00	0,00	1.544.515,96	24.379,57	1,60%	1,60%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.020.556,84	0,00	1.692,60	1.030.332,02	11.467,78	1,12%	0,96%
AZ QUEST LUCE FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	201.991,86	600.000,00	0,00	813.457,07	11.465,21	1,48%	1,77%
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	405.289,50	0,00	0,00	412.676,52	7.387,02	1,82%	1,82%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.375.517,48	0,00	0,00	6.351.574,98	-23.942,50	-0,38%	-0,38%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.148.328,45	0,00	0,00	9.112.369,66	-35.958,79	-0,39%	-0,39%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	3.349.620,95	0,00	3.304.857,31	0,00	-44.763,64	-1,34%	-0,46%
SICREDI INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	11.680.831,64	0,00	0,00	11.627.508,48	-53.323,16	-0,46%	-0,46%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	26.119.165,32	0,00	0,00	25.679.788,37	-439.376,95	-1,68%	-1,68%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>2.675.541,78</b>	<b>1,07%</b>	

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 (%)
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	3.052.968,54	2.304.857,31	0,00	5.605.581,52	247.755,67	7,34%	8,07%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	3.823.485,09	0,00	0,00	3.919.442,29	95.957,20	2,51%	2,51%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	9.432.190,79	0,00	0,00	9.525.525,68	93.334,89	0,99%	0,99%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	3.133.067,83	1.000.000,00	0,00	4.192.466,05	59.398,22	1,76%	1,84%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	6.726.803,96	0,00	0,00	6.779.558,64	52.754,68	0,78%	0,78%
BB INDEXADO IBRX FIC AÇÕES	2.422.886,22	0,00	0,00	2.472.234,47	49.348,25	2,04%	2,04%
META VALOR FI AÇÕES	199.159,80	0,00	0,00	202.083,67	2.923,87	1,47%	1,47%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	4.791.032,93	0,00	0,00	4.792.870,50	1.837,57	0,04%	0,04%
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	990.157,40	0,00	0,00	981.717,03	-8.440,37	-0,85%	-0,85%
Total Renda Variável					594.869,98	1,33%	

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 (%)
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	29.781.345,50	0,00	0,00	33.474.038,29	3.692.692,79	12,40%	12,40%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	29.066.831,80	0,00	0,00	32.725.148,73	3.658.316,93	12,59%	12,59%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	32.752.448,32	15.600.992,32	29.258.120,00	21.996.837,33	2.901.516,69	10,02%	10,93%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	20.984.480,33	2.000.000,00	0,00	25.679.788,37	2.695.308,04	12,39%	12,17%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	20.533.781,34	26.330.379,45	14.961.238,00	34.459.440,75	2.556.517,96	9,47%	10,08%
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	11.480.806,51	2.000.000,00	0,00	15.086.032,91	1.605.226,40	12,70%	12,66%
SICREDI INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	10.350.161,29	0,00	0,00	11.627.508,48	1.277.347,19	12,34%	12,34%
SICREDI INSTITUCIONAL IRF-M FI RENDA FIXA LP	7.960.767,47	0,00	0,00	9.143.177,06	1.182.409,59	14,85%	14,85%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.117.078,11	1.000.000,00	0,00	9.112.369,66	995.291,55	12,26%	12,55%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	17.803.450,00	0,00	518.246,60	18.279.268,00	994.064,60	5,71%	2,67%
DAYCOVAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	7.395.851,96	0,00	0,00	8.288.826,26	892.974,30	12,07%	12,07%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.665.614,79	1.000.000,00	0,00	6.351.574,98	685.960,19	12,11%	12,52%
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.310.895,00	0,00	294.140,11	10.601.847,00	585.092,11	5,79%	2,82%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.536.028,21	0,00	319.328,87	5.713.752,90	497.053,56	9,28%	9,30%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	2.967.836,07	0,00	3.304.857,31	0,00	337.021,24	11,36%	12,34%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.460.016,82	0,00	83.407,16	1.544.515,96	167.906,30	11,83%	11,86%
SUL INVEST FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 6	1.037.762,62	0,00	131.525,52	1.008.025,97	101.788,87	10,24%	-2,87%
AZ QUEST LUCE FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	0,00	800.000,00	0,00	813.457,07	13.457,07	3,08%	10,53%
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	0,00	400.000,00	0,00	412.676,52	12.676,52	3,63%	11,29%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.082.962,13	0,00	21.900,71	1.030.332,02	-30.729,40	-2,85%	-4,86%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>24.821.892,50</b>	<b>10,98%</b>	



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 (%)
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	2.210.162,91	5.278.742,00	0,00	9.525.525,68	2.036.620,77	36,74%	40,89%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	2.245.122,87	3.500.000,00	0,00	6.779.558,64	1.034.435,77	25,88%	23,75%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	3.114.972,84	0,00	0,00	3.919.442,29	804.469,45	25,83%	25,83%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	1.054.272,14	3.000.000,00	0,00	4.792.870,50	738.598,36	28,93%	26,61%
BB INDEXADO IBRX FIC AÇÕES	1.806.094,15	201.464,00	0,00	2.472.234,47	464.676,32	23,96%	24,45%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	0,00	5.304.857,31	0,00	5.605.581,52	300.724,21	10,32%	30,13%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	0,00	4.000.000,00	0,00	4.192.466,05	192.466,05	6,27%	11,63%
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	935.814,58	0,00	0,00	981.717,03	45.902,45	4,91%	4,91%
META VALOR FI AÇÕES	0,00	200.000,00	0,00	202.083,67	2.083,67	1,04%	40,18%
Total Renda Variável					5.619.977,05	25,57%	