

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-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.461.030,98	10,20%	722	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.137.383,75	2,58%	712	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.534.663,86	1,85%	198	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	11.227.410,69	13,54%	1.412	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	8.372.976,45	10,09%	588	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.384.684,97	5,29%	619	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	550.241,39	0,66%	224	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	9.191.436,63	11,08%	107	1,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	270.469,40	0,33%	23	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	4.360.870,33	5,26%	1.226	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	4.744,82	0,01%	102	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	7.455.279,89	8,99%	76	2,30%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.408.035,33	4,11%	757	0,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	1.059.924,65	1,28%		0,20%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	6.981.974,02	8,42%	99	0,85%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.251.973,18	1,51%	40	0,43%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TOWER BRIDGE II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	300.380,51	0,36%	26	0,33%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	651.999,54	0,79%	8.162	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	360.606,98	0,43%	518	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	2.168.020,33	2,61%	98	2,14%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	23.618,76	0,03%		1,10%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	D+90 ou D+150 a D+450	18 meses	934.685,49	1,13%	14	8,35%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "

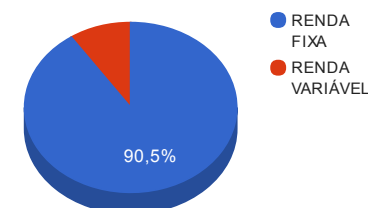
Carteira consolidada de investimentos - base (dezembro / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	23/08/2017	1.450.002,25	1,75%	116	0,38%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	D+4382	Não há	0,01	0,00%	5	-0,00%	Artigo 8º, Inciso III
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	Não se aplica	Não se aplica	3.062.815,22	3,69%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se aplica	Não se aplica	3.340.874,72	4,03%		8,03%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
		TOTAL -	82.946.104,15				

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

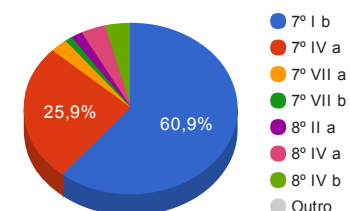
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	50.491.168,45	60,87%	30,00%	35,00%	70,00%	7.571.104,46
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	15,00%	20,00%	60,00%	49.767.662,49
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	21.474.918,92	25,89%	5,00%	5,00%	30,00%	3.408.912,33
Artigo 7º, Inciso VI	0,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	12.441.915,62
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	2.191.639,09	2,64%	0,00%	3,00%	5,00%	1.955.666,12
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	934.685,49	1,13%	0,00%	2,00%	5,00%	3.212.619,72
Total Renda Fixa	100,00%	75.092.411,95	90,53%	55,00	75,00	185,00	-

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso I	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	4.147.305,21
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	1.450.002,25	1,75%	0,00%	0,00%	0,00%	-1.450.002,25
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,01	0,00%	5,00%	9,00%	15,00%	12.441.915,61
Artigo 8º, Inciso IV	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	4.147.305,21
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	3.062.815,22	3,69%	0,00%	0,00%	0,00%	-3.062.815,22
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	3.340.874,72	4,03%	0,00%	0,00%	0,00%	-3.340.874,72
Artigo 8º, Inciso V	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	4,50%	5,00%	4.147.305,21
Artigo 8º, Inciso VI	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	4,50%	5,00%	4.147.305,21
Total Renda Variável	30,00%	7.853.692,20	9,47%	11,00	25,00	35,00	-

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 "	50.491.168,45	60,87%	30,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	21.474.918,92	25,89%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	0,00	0,00%	5,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	2.191.639,09	2,64%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	934.685,49	1,13%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	75.092.411,95	90,53%	55,00	185,00

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 II, Alínea " a "	1.450.002,25	1,75%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso III	0,01	0,00%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	3.062.815,22	3,69%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	3.340.874,72	4,03%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso V	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Total Renda Variável	7.853.692,20	9,47%	11,00	35,00

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

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

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	26.259.790,04	31,66%	0,01%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	25.516.484,92	30,76%	0,00%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	18.829.507,25	22,70%	0,00%
AQ3 ASSET MANAGEMENT	3.340.874,72	4,03%	2,49%
ROMA ASSET	3.062.815,22	3,69%	2,91%
FINAXIS CORRETORA	2.168.020,33	2,61%	2,14%
VINCI PARTNERS	1.450.002,25	1,75%	0,01%
BRIDGE TRUST	1.360.305,16	1,64%	0,11%
SECURITY ADMINISTRADORA DE RECURSOS	934.685,49	1,13%	8,35%
BRASIL PLURAL	23.618,77	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 PRÉ 2 ANOS	1,35%	16,42%	2,13%	7,26%	16,42%	44,07%	-	-	-
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	1,36%	15,82%	2,00%	7,00%	15,82%	-	0,20%	0,614%	3,90%
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%
IMA-B 5	0,88%	12,58%	1,48%	6,74%	12,58%	30,01%	-	-	-
BRADESCO 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%
TOWER BRIDGE II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,36%	9,57%	3,46%	4,62%	9,57%	-	0,70%	0,467%	5,70%
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	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%	0,25%	2,629%	1,84%
IMA-B	0,83%	12,79%	-0,32%	6,96%	12,79%	40,78%	-	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	0,85%	12,96%	-0,39%	7,01%	12,96%	40,80%	0,20%	1,450%	9,38%
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%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	0,81%	12,22%	-0,40%	6,79%	12,22%	39,77%	0,20%	1,425%	9,27%
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%
CDI + 3,50% ao ano	0,81%	13,73%	2,61%	5,84%	13,73%	34,17%	-	-	-

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

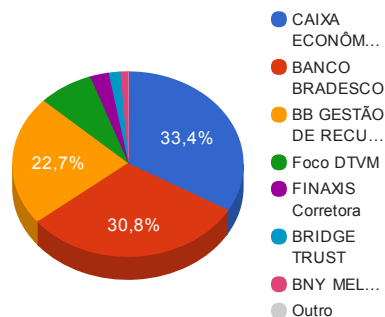
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	143,59%	-79,95%	147,60%	269,17%	-79,95%	-56,89%	0,20%	341,477%	298,63%
IMA-B 5+	0,79%	12,75%	-1,63%	6,87%	12,75%	47,75%	-	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	0,77%	12,39%	-1,71%	6,66%	12,39%	46,61%	0,20%	2,062%	12,26%
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%
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%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,56%	10,86%	1,77%	4,48%	10,86%	26,92%	0,10%	0,040%	0,68%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,56%	10,92%	1,78%	4,50%	10,92%	27,08%	0,20%	0,042%	0,68%
Selic	0,54%	9,94%	1,76%	4,06%	9,94%	25,35%	-	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,53%	10,35%	1,75%	4,28%	10,35%	26,08%	0,20%	0,007%	0,14%
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%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,52%	9,88%	1,72%	3,97%	9,88%	25,33%	0,25%	0,012%	0,13%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	0,26%	4,53%	0,83%	1,96%	4,53%	-21,59%	1,00%	0,033%	0,29%

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

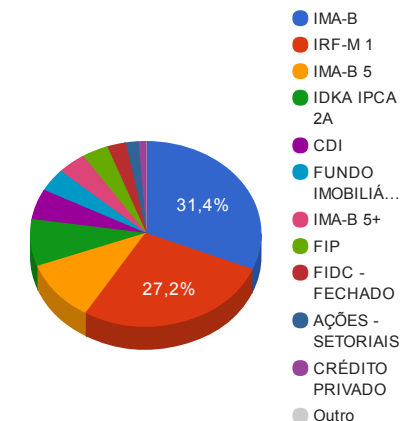
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDIV	4,94%	25,30%	-1,77%	16,88%	25,30%	101,09%	-	-	-
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	5,23%	19,71%	1,25%	14,58%	19,71%	34,53%	1,72%	5,093%	16,92%
IPCA + 8,00% ao ano	1,06%	11,08%	3,05%	5,70%	11,08%	27,47%	-	-	-
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	9,16%	-100,29%	-101,45%	-100,52%	-100,29%	-100,31%	0,12%	0,320%	115,94%
IFIX	0,60%	19,41%	0,24%	7,34%	19,41%	58,02%	-	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	0,00%	-15,86%	-5,40%	-15,86%	-15,86%	-	1,50%	0,000%	17,91%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	-	-	-	-	-	-	0,30%	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	27.709.792,29	33,41%
BANCO BRADESCO	25.516.484,92	30,76%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	18.829.507,25	22,70%
Foco DTVM	6.403.689,94	7,72%
FINAXIS Corretora	2.168.020,33	2,61%
BRIDGE TRUST	1.360.305,17	1,64%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	934.685,49	1,13%
Geração Futuro	23.618,76	0,03%



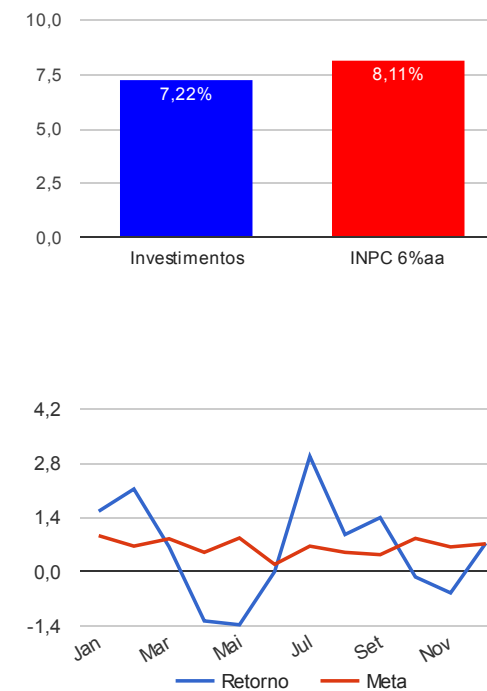
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	26.030.188,88	31,38%
IRF-M 1	22.570.255,04	27,21%
IMA-B 5	8.815.585,05	10,63%
IDKA IPCA 2A	6.792.538,12	8,19%
CDI	4.420.641,85	5,33%
FUNDO IMOBILIÁRIO	3.340.874,72	4,03%
IMA-B 5+	3.336.878,43	4,02%
FIP	3.062.815,22	3,69%
FIDC - FECHADO	2.191.639,09	2,64%
AÇÕES - SETORIAIS	1.450.002,25	1,75%
CRÉDITO PRIVADO	934.685,49	1,13%
MULTIMERCADO	0,01	0,00%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	80.243.090,02	465.586,99	1.496.916,24	80.462.675,95	1.250.915,18	1,56%	0,93%	167,24%	2,51%
Fevereiro	80.462.675,95	900.000,00	20.603.556,22	62.474.568,52	1.715.448,79	2,13%	0,66%	323,97%	1,96%
Março	62.474.568,52	20.269.735,67	1.369.893,58	81.897.302,99	522.892,38	0,64%	0,85%	75,16%	2,33%
Abril	81.897.302,99	2.574.868,03	1.734.064,29	81.689.738,99	-1.048.367,74	-1,27%	0,50%	-254,74%	2,30%
Mai	81.689.738,99	1.786.122,92	1.382.820,02	80.971.126,03	-1.121.915,86	-1,37%	0,87%	-156,76%	11,87%
Junho	80.971.126,03	2.092.316,37	1.902.013,66	81.164.262,19	2.833,45	0,00%	0,19%	1,88%	2,60%
Julho	81.164.262,19	1.588.877,62	1.429.012,84	83.743.103,57	2.418.976,60	2,97%	0,66%	452,34%	3,13%
Agosto	83.743.103,57	6.335.762,24	6.198.824,70	84.684.787,97	804.746,86	0,96%	0,50%	190,71%	3,11%
Setembro	84.684.787,97	0,00	1.444.473,86	84.422.360,51	1.182.046,40	1,40%	0,44%	314,78%	2,23%
Outubro	84.422.360,51	30.552.146,05	29.945.819,87	84.914.789,64	-113.897,05	-0,13%	0,86%	-15,60%	1,43%
Novembro	84.914.789,64	942.453,27	1.573.971,80	83.820.420,50	-462.850,61	-0,55%	0,64%	-85,17%	1,20%
Dezembro	83.820.420,50	1.363.758,37	2.855.314,80	82.946.104,15	617.240,08	0,74%	0,72%	101,61%	0,98%
Acumulado no ano					5.768.068,48	7,22%	8,11%	89,05%	

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(%)
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	9.696,00	0,00	0,00	23.618,76	13.922,76	143,59%	341,48%	143,59%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	2.140.437,14	0,00	2.041,02	2.168.020,33	29.624,21	1,38%	2,63%	1,29%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	266.846,99	0,00	0,00	270.469,40	3.622,41	1,36%	0,61%	1,36%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	7.391.214,30	0,00	0,00	7.455.279,89	64.065,59	0,87%	0,72%	0,87%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.119.094,15	0,00	0,00	2.137.383,75	18.289,60	0,86%	0,46%	0,86%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	4.705,04	0,00	0,00	4.744,82	39,78	0,85%	1,45%	0,85%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.305.815,96	0,00	0,00	8.372.976,45	67.160,49	0,81%	1,42%	0,81%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.714.439,62	681.879,19	0,00	8.461.030,98	64.712,17	0,77%	1,42%	0,81%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	546.152,35	0,00	0,00	550.241,39	4.089,04	0,75%	2,05%	0,75%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.713.568,01	0,00	1.370.361,62	4.384.684,97	41.478,58	0,73%	0,45%	0,87%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.579.644,56	0,00	56.275,27	1.534.663,86	11.294,57	0,72%	2,06%	0,75%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	9.157.793,38	681.879,18	718.266,09	9.191.436,63	70.030,16	0,71%	1,42%	0,81%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.388.285,03	0,00	0,00	3.408.035,33	19.750,30	0,58%	0,07%	0,58%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	11.164.018,07	0,00	0,00	11.227.410,69	63.392,62	0,57%	0,03%	0,57%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.336.639,21	0,00	0,00	4.360.870,33	24.231,12	0,56%	0,04%	0,56%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	6.943.389,86	0,00	0,00	6.981.974,02	38.584,16	0,56%	0,04%	0,56%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	358.703,11	0,00	0,00	360.606,98	1.903,87	0,53%	0,01%	0,53%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	648.624,74	0,00	0,00	651.999,54	3.374,80	0,52%	0,01%	0,52%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	1.952.825,37	0,00	708.370,80	1.251.973,18	7.518,61	0,39%	2,06%	0,77%
TOWER BRIDGE II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	299.300,52	0,00	0,00	300.380,51	1.079,99	0,36%	0,47%	0,36%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	932.274,48	0,00	0,00	934.685,49	2.411,01	0,26%	0,03%	0,26%
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.057.411,07	0,00	0,00	1.059.924,65	2.513,58	0,24%	2,98%	0,24%
Total Renda Fixa					553.089,42	0,73%	0,94%	

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(%)
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.377.893,11	0,00	0,00	1.450.002,25	72.109,14	5,23%	5,09%	5,23%
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	0,32%	9,16%
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	3.064.087,06	0,00	0,00	3.062.815,22	-1.271,84	-0,04%	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	3.347.561,36	0,00	0,00	3.340.874,72	-6.686,64	-0,20%	0,00%	0,00%
Total Renda Variável					64.150,66	0,82%	1,54%	

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 (%)
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	11.086.675,02	0,00	11.227.410,69	140.735,67	1,27%	1,79%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.428.199,95	266.153,43	1.403.906,37	4.384.684,97	94.237,96	1,70%	1,85%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,00	6.895.896,94	0,00	6.981.974,02	86.077,08	1,25%	1,78%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.346.722,33	0,00	0,00	3.408.035,33	61.313,00	1,83%	1,83%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	537.839,35	6.895.896,94	31.487,25	7.455.279,89	53.030,85	0,72%	1,33%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	4.308.458,28	0,00	4.360.870,33	52.412,05	1,22%	1,77%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.097.237,88	0,00	0,00	2.137.383,75	40.145,87	1,91%	1,91%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	2.147.451,42	0,00	2.041,02	2.168.020,33	22.609,93	1,05%	0,96%
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	9.539,12	0,00	0,00	23.618,76	14.079,64	147,60%	147,60%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	640.947,16	0,00	0,00	651.999,54	11.052,38	1,72%	1,72%
TOWER BRIDGE II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	290.336,73	0,00	0,00	300.380,51	10.043,78	3,46%	3,46%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	926.993,09	0,00	0,00	934.685,49	7.692,40	0,83%	0,83%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	354.411,86	0,00	0,00	360.606,98	6.195,12	1,75%	1,75%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	0,00	266.153,43	0,00	270.469,40	4.315,97	1,62%	2,00%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	4.763,41	0,00	0,00	4.744,82	-18,59	-0,39%	-0,39%
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.078.942,19	0,00	0,00	1.059.924,65	-19.017,54	-1,76%	-1,76%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.506.597,39	681.879,19	701.768,76	8.461.030,98	-25.676,84	-0,36%	-0,39%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.404.538,70	0,00	0,00	8.372.976,45	-31.562,25	-0,38%	-0,38%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	15.686.298,62	887.682,65	15.287.150,58	1.251.973,18	-34.857,51	-0,80%	-1,71%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	12.611.098,37	887.682,63	11.927.878,69	1.534.663,86	-36.238,45	-0,45%	-1,70%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.891.678,30	0,00	4.302.607,71	550.241,39	-38.829,20	-1,41%	-1,68%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	9.269.035,12	681.879,18	718.266,09	9.191.436,63	-41.211,58	-0,50%	-0,40%
Total Renda Fixa					376.529,74	0,50%	

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 (%)
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.432.157,43	0,00	0,00	1.450.002,25	17.844,82	1,25%	1,25%
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	3.066.407,67	0,00	0,00	3.062.815,22	-3.592,45	-0,12%	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	3.360.935,00	0,00	0,00	3.340.874,72	-20.060,28	-0,60%	-5,40%
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	330.229,42	0,00	0,00	0,01	-330.229,41	-100,00%	-101,45%
Total Renda Variável					-336.037,32	-4,10%	

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.923.964,94	2.130.134,78	6.863.111,95	8.461.030,98	1.270.043,21	12,36%	12,55%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	11.356.092,97	2.727.785,59	6.094.197,82	9.191.436,63	1.201.755,89	11,79%	12,22%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.441.319,63	0,00	0,00	8.372.976,45	931.656,82	12,52%	12,52%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	427.076,48	16.218.078,72	16.225.164,46	1.251.973,18	831.982,44	11,87%	12,39%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.713.963,52	266.153,43	4.261.281,66	4.384.684,97	665.849,68	12,01%	12,34%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	427.015,87	12.511.670,81	12.045.620,98	1.534.663,86	641.598,16	12,75%	12,44%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	9.476.365,65	6.895.896,94	9.274.915,21	7.455.279,89	357.932,51	11,70%	12,66%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.811.377,86	0,00	4.000.000,00	2.137.383,75	326.005,89	12,31%	12,40%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.212.737,42	900.000,00	0,00	3.408.035,33	295.297,91	9,83%	10,08%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	43.483,36	4.558.826,00	4.302.607,71	550.241,39	250.539,74	12,33%	12,17%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	11.086.675,02	0,00	11.227.410,69	140.735,67	1,27%	10,93%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	546.605,54	6.895.896,94	558.306,46	6.981.974,02	97.778,00	3,42%	10,92%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.175.949,42	4.308.458,28	1.201.068,25	4.360.870,33	77.530,88	3,38%	10,86%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	593.347,76	0,00	0,00	651.999,54	58.651,78	9,88%	9,88%
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.005.737,06	0,00	0,00	1.059.924,65	54.187,59	5,39%	5,39%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.945.757,57	0,00	1.989.296,61	0,00	43.539,04	2,24%	12,38%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	894.138,56	0,00	0,00	934.685,49	40.546,93	4,53%	4,53%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	326.773,14	0,00	0,00	360.606,98	33.833,84	10,35%	10,35%
TOWER BRIDGE II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	274.150,40	0,00	0,00	300.380,51	26.230,11	9,57%	9,57%
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	117.794,02	0,00	105.891,07	23.618,76	11.715,81	70,21%	-79,95%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	142.560,41	105.897,59	253.342,37	0,00	4.884,37	1,97%	12,42%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	0,00	266.153,43	0,00	270.469,40	4.315,97	1,62%	15,82%

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 (%)
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	4.200,29	0,00	0,00	4.744,82	544,53	12,96%	12,96%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	2.278.764,35	0,00	19.778,32	2.168.020,33	-90.965,70	-4,00%	-4,86%
			Total Renda Fixa		7.276.191,07	10,84%	

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 (%)
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.211.230,03	0,00	18.790,19	1.450.002,25	257.562,41	21,52%	19,71%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FIAÇÕES	2.869.194,37	0,00	2.924.845,96	0,00	55.651,59	1,94%	-0,58%
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESP AATIVO FIAÇÕES	1.765.101,99	0,00	1.798.462,86	0,00	33.360,87	1,89%	0,90%
ÁQUILLA FII - AQLL11	3.459.142,22	0,00	0,00	3.340.874,72	-118.267,50	-3,42%	-15,86%
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	3.818.274,32	0,00	0,00	3.062.815,22	-755.459,10	-19,79%	-
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	980.970,87	0,00	0,00	0,01	-980.970,86	-100,00%	-100,29%
Total Renda Variável					-1.508.122,59	-12,71%	