

# Relatório Analítico dos Investimentos em novembro de 2017



Carteira consolidada de investimentos - base (novembro / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	30.510.830,04	14,14%	677	0,65%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	850.321,80	0,39%	193	0,24%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	D+31 ou D+1461	Não há	627.067,10	0,29%	18	0,31%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	16.253.382,75	7,53%	325	0,64%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	250.876,02	0,12%	61	0,10%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	50.256.061,08	23,29%	713	0,77%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	27.256.405,48	12,63%	748	0,59%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.438.608,48	1,59%	95	0,43%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.408.539,94	3,90%	613	0,21%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	943.257,54	0,44%	70	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	805.641,21	0,37%	763	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.169.157,80	1,47%	190	0,22%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.036.287,67	0,94%	226	0,19%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	5.218.121,63	2,42%	97	0,82%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	31.263.778,64	14,49%	758	0,53%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.211.973,57	1,03%	1.230	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	12.165.874,85	5,64%	1.401	0,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	9.658.245,75	4,48%	712	0,18%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
PRASS II FIDC SÊNIOR	D+540	Não há	1.578.525,00	0,73%	21	1,10%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	7.997,98	0,00%			Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	73.327,68	0,03%	47	0,42%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	2.207.357,09	1,02%	3.027	0,93%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "

Carteira consolidada de investimentos - base (novembro / 2017)

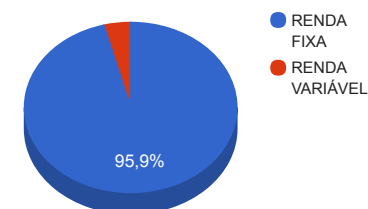
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.044.173,11	0,48%	19	2,95%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	1.017.318,32	0,47%	1.192	1,38%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.019.113,29	0,47%	480	1,98%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	D+5	Não há	1.207.463,87	0,56%	33	0,56%	Artigo 8º, Inciso III
ÁTICO FLORESTAL MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	1.244.682,19	0,58%	21	0,71%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se aplica	Não se aplica	1.055.000,00	0,49%		0,63%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
		<b>TOTAL -</b>	<b>215.779.389,88</b>				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	10,00%	21.577.938,99
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	90,00%	90,00%	194.201.450,89
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	10.788.969,49
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	20,00%	20,00%	43.155.877,98
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	205.324.431,35	95,15%	0,00%	30,00%	30,00%	-140.590.614,39
Artigo 7º, Inciso VI	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	10.788.969,49
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	1.659.850,66	0,77%	0,00%	3,00%	3,00%	4.813.531,04
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	2,00%	4.315.587,80
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>206.984.282,01</b>	<b>95,92%</b>	<b>0,00</b>	<b>165,00</b>	<b>165,00</b>	<b>-</b>

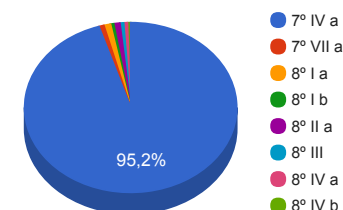
⚠ O Somatório dos incisos "a" e "b" do Artigo 7º IV não podem ultrapassar 40% (quarenta por cento).

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%	10,00%	10,00%	21.577.938,99
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	2.207.357,09	1,02%	0,00%	0,00%	0,00%	-2.207.357,09
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	30,00%	1.044.173,11	0,48%	0,00%	0,00%	0,00%	-1.044.173,11
Artigo 8º, Inciso II	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	10.788.969,49
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	2.036.431,61	0,94%	0,00%	0,00%	0,00%	-2.036.431,61
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	1.207.463,87	0,56%	0,00%	15,00%	15,00%	31.159.444,61
Artigo 8º, Inciso IV	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	10.788.969,49
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	1.244.682,19	0,58%	0,00%	0,00%	0,00%	-1.244.682,19
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	1.055.000,00	0,49%	0,00%	0,00%	0,00%	-1.055.000,00
Artigo 8º, Inciso V	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	10.788.969,49
Artigo 8º, Inciso VI	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	10.788.969,49
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>8.795.107,87</b>	<b>4,08%</b>	<b>0,00</b>	<b>45,00</b>	<b>45,00</b>	<b>-</b>

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: novembro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	205.324.431,35	95,15%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	1.659.850,66	0,77%	0,00%	0,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>206.984.282,01</b>	<b>95,92%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>

Artigos - Renda Variável	Base: novembro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	2.207.357,09	1,02%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	1.044.173,11	0,48%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	2.036.431,61	0,94%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso III	1.207.463,87	0,56%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	1.244.682,19	0,58%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	1.055.000,00	0,49%	0,00%	0,00%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>8.795.107,87</b>	<b>4,08%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (novembro / 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	162.370.571,65	75,25%	0,04%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	44.037.012,37	20,41%	0,00%
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	3.438.608,48	1,59%	0,00%
QUATÁ INVESTIMENTOS	1.578.525,00	0,73%	0,24%
ÁTICO ASSET MANAGEMENT	1.244.682,19	0,58%	0,21%
WESTERN ASSET	1.207.463,87	0,56%	0,00%
ITAÚ UNIBANCO	1.194.133,56	0,55%	0,00%
TMJ CAPITAL	627.067,10	0,29%	0,20%
VILA RICA CAPITAL	73.327,68	0,03%	0,09%
BRASIL PLURAL	7.997,98	0,00%	0,00%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI + 3,50% ao ano	0,84%	12,81%	2,71%	6,14%	14,42%	35,04%	-	-	-
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	47,62%	-56,60%	-80,21%	16,26%	-14,65%	-42,28%	0,20%	-	-
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-4,35%	-26,24%	-10,45%	-16,93%	-27,96%	-78,47%	0,39%	7,700%	26,66%

IPCA + 7,00% ao ano	0,82%	9,00%	2,53%	4,54%	9,97%	25,86%	-	-	-
PRASS II FIDC SÊNIOR	0,76%	12,71%	2,50%	5,85%	13,92%	31,19%	1,70%	0,000%	-

IRF-M 1	0,62%	10,49%	2,00%	4,92%	11,82%	28,26%	-	-	-
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,61%	10,31%	1,94%	4,86%	11,60%	27,84%	0,20%	0,048%	0,68%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,61%	10,28%	1,94%	4,86%	11,57%	27,60%	0,20%	0,046%	0,67%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,59%	10,31%	1,94%	4,82%	11,61%	27,86%	0,20%	0,042%	0,67%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,59%	10,25%	1,92%	4,80%	11,53%	27,67%	0,10%	0,041%	0,67%

CDI	0,57%	9,34%	1,86%	4,33%	10,56%	26,09%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,56%	9,44%	1,90%	4,38%	10,68%	26,10%	0,20%	0,040%	0,12%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,55%	9,37%	1,85%	4,32%	10,58%	26,11%	0,20%	0,019%	0,13%

IPCA	0,28%	2,50%	0,86%	1,06%	2,80%	9,99%	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,27%	10,34%	1,50%	5,15%	11,77%	-	0,002	0,614%	4,31%

IDKA IPCA 2 Anos	0,26%	12,31%	1,98%	6,41%	13,75%	31,84%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,28%	11,44%	1,91%	6,06%	12,83%	30,57%	0,20%	0,520%	2,81%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,23%	11,37%	1,87%	6,00%	12,74%	30,53%	0,20%	0,505%	2,73%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,21%	9,80%	1,72%	4,69%	11,03%	26,51%	0,20%	0,259%	1,77%
IMA-B 5	0,10%	11,59%	1,60%	6,36%	13,15%	31,60%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,09%	11,41%	1,55%	6,25%	12,95%	30,96%	0,20%	0,890%	3,55%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	0,07%	11,19%	1,50%	6,17%	12,71%	30,56%	0,40%	0,889%	3,55%
IRF-M	0,09%	13,78%	1,67%	6,54%	15,88%	41,17%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,07%	13,52%	1,60%	6,41%	15,57%	40,63%	0,20%	1,242%	4,66%
IMA-B 5+	-1,40%	11,87%	-0,06%	5,98%	16,02%	48,25%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,42%	11,60%	-0,12%	5,81%	15,73%	47,09%	0,20%	3,227%	12,23%
IMA-B	-0,76%	11,87%	0,65%	6,25%	15,12%	41,75%	-	-	-
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	-0,18%	11,23%	0,95%	5,65%	13,78%	26,76%	1,30%	1,531%	4,84%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	-0,74%	11,44%	0,64%	5,98%	14,57%	40,01%	0,20%	2,162%	9,01%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,78%	11,65%	0,59%	6,13%	14,86%	41,10%	0,20%	2,219%	9,43%
IRF-M 1+	-0,08%	15,00%	1,57%	7,12%	17,42%	49,32%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,08%	14,56%	1,39%	6,85%	16,95%	48,60%	0,20%	1,682%	6,13%

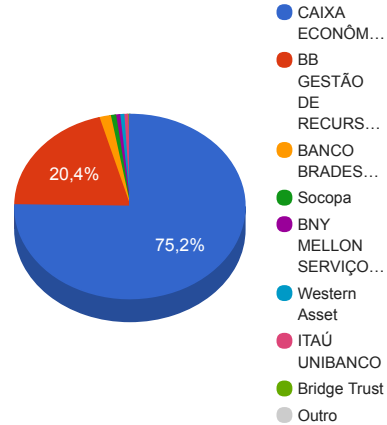


Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (novembro / 2017)

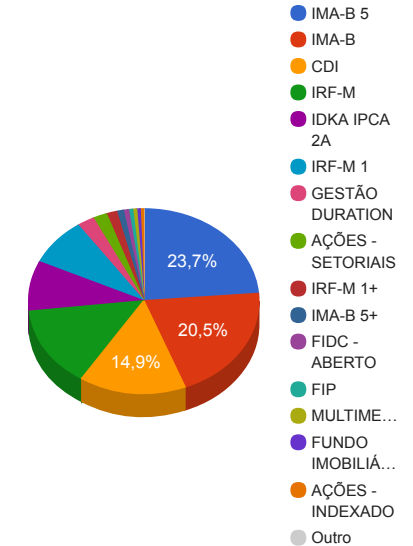
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	0,57%	9,34%	1,86%	4,33%	10,56%	26,09%	-	-	-
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	-0,06%	8,04%	1,88%	4,42%	9,54%	28,84%	2,00%	0,774%	1,65%
IDIV	-6,67%	19,39%	-0,67%	10,02%	18,34%	84,42%	-	-	-
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	-1,26%	14,84%	-2,64%	9,67%	14,73%	27,80%	1,50%	9,912%	18,82%
Ibovespa	-3,15%	19,50%	1,60%	14,77%	16,26%	59,51%	-	-	-
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	-3,47%	18,49%	1,15%	13,89%	15,31%	57,33%	0,50%	10,707%	19,83%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	-4,97%	18,67%	0,59%	11,61%	18,25%	54,55%	2,00%	9,438%	19,79%
SMLL	-2,43%	39,54%	-0,34%	17,47%	38,80%	74,16%	-	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	-2,57%	39,07%	0,41%	17,96%	38,85%	63,64%	1,50%	10,717%	18,98%
IFIX	-0,59%	18,73%	6,19%	7,64%	20,47%	52,42%	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	-0,93%	4,90%	5,00%	5,94%	9,74%	45,18%	1,20%	6,045%	23,68%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ÁTICO FLORESTAL MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,50%	0,002%	0,01%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	162.370.571,65	75,25%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	44.037.012,37	20,41%
BANCO BRADESCO	3.438.608,48	1,59%
Socopa	1.578.525,00	0,73%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	1.244.682,19	0,58%
Western Asset	1.207.463,87	0,56%
ITAÚ UNIBANCO	1.194.133,56	0,55%
Bridge Trust	627.067,10	0,29%
BRL Trust Investimentos	73.327,68	0,03%
Geração Futuro	7.997,98	0,00%



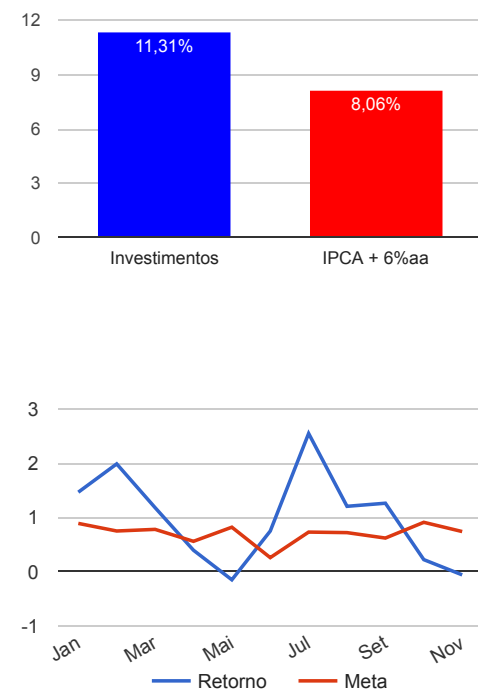
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5	51.199.318,62	23,73%
IMA-B	44.136.855,33	20,45%
CDI	32.069.419,85	14,86%
IRF-M	30.510.830,04	14,14%
IDKA IPCA 2A	18.917.107,49	8,77%
IRF-M 1	18.067.332,92	8,37%
GESTÃO DURATION	5.218.121,63	2,42%
AÇÕES - SETORIAIS	4.243.788,70	1,97%
IRF-M 1+	3.169.157,80	1,47%
IMA-B 5+	2.036.287,67	0,94%
FIDC - ABERTO	1.578.525,00	0,73%
FIP	1.244.682,19	0,58%
MULTIMERCADO	1.207.463,87	0,56%
FUNDO IMOBILIÁRIO	1.055.000,00	0,49%
AÇÕES - INDEXADO	1.044.173,11	0,48%
FIDC - FECHADO	81.325,66	0,04%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	176.426.263,36	3.845.430,28	329.839,39	182.576.997,07	2.635.142,82	1,46%	0,89%	164,19%	1,60%
Fevereiro	182.576.997,07	2.039.022,46	518.458,91	187.752.127,21	3.654.566,59	1,99%	0,75%	265,23%	0,94%
Março	187.752.127,21	2.156.479,69	376.820,07	191.768.083,95	2.236.297,12	1,18%	0,78%	150,39%	1,08%
Abril	191.768.083,95	2.082.428,77	372.191,96	194.245.134,36	766.813,60	0,40%	0,56%	71,07%	0,88%
Mai	194.245.134,36	17.161.249,92	15.393.560,13	195.722.729,50	-290.094,65	-0,15%	0,82%	-18,01%	6,32%
Junho	195.722.729,50	2.073.712,24	419.876,71	198.854.309,25	1.477.744,22	0,75%	0,26%	292,87%	1,45%
Julho	198.854.309,25	2.548.820,82	858.347,64	205.648.671,61	5.103.889,18	2,55%	0,73%	349,63%	1,28%
Agosto	205.648.671,61	9.553.494,18	7.851.155,38	209.848.232,08	2.497.221,67	1,20%	0,72%	166,29%	1,00%
Setembro	209.848.232,08	2.135.288,39	625.488,66	214.024.043,85	2.666.012,04	1,26%	0,62%	202,06%	0,92%
Outubro	214.024.043,85	1.388.513,23	660.225,70	215.231.195,68	478.864,30	0,22%	0,91%	24,54%	1,14%
Novembro	215.231.195,68	1.164.298,72	492.562,83	215.779.389,88	-123.541,69	-0,06%	0,74%	-7,73%	1,24%
Acumulado no ano					21.102.915,20	11,31%	8,06%	140,24%	

Acumulado no Ano



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de novembro / 2017

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	5.417,88	0,00	336,82	7.997,98	2.916,92	53,84%	-	-
PRASS II FIDC SÊNIOR	1.566.628,59	0,00	0,00	1.578.525,00	11.896,41	0,76%	0,00%	0,76%
BRANCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	3.417.637,28	0,00	0,00	3.438.608,48	20.971,20	0,61%	0,05%	0,61%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	249.352,01	0,00	0,00	250.876,02	1.524,01	0,61%	0,05%	0,61%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.094.225,61	0,00	0,00	12.165.874,85	71.649,24	0,59%	0,04%	0,59%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.199.013,63	0,00	0,00	2.211.973,57	12.959,94	0,59%	0,04%	0,59%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	801.141,16	0,00	0,00	805.641,21	4.500,05	0,56%	0,04%	0,56%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	30.409.490,95	1.164.298,72	481.219,20	31.263.778,64	171.208,17	0,54%	0,02%	0,55%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.630.823,48	0,00	0,00	9.658.245,75	27.422,27	0,28%	0,52%	0,28%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	5.203.900,45	0,00	0,00	5.218.121,63	14.221,18	0,27%	0,61%	0,27%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.389.391,38	0,00	0,00	8.408.539,94	19.148,56	0,23%	0,51%	0,23%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	76.660,26	0,00	3.506,81	73.327,68	174,23	0,23%	7,70%	-4,35%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	848.508,57	0,00	0,00	850.321,80	1.813,23	0,21%	0,26%	0,21%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	50.211.215,23	0,00	0,00	50.256.061,08	44.845,85	0,09%	0,89%	0,09%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	942.581,33	0,00	0,00	943.257,54	676,21	0,07%	0,89%	0,07%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	30.490.426,41	0,00	0,00	30.510.830,04	20.403,63	0,07%	1,24%	0,07%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.171.751,33	0,00	0,00	3.169.157,80	-2.593,53	-0,08%	1,68%	-0,08%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	628.190,71	0,00	0,00	627.067,10	-1.123,61	-0,18%	1,53%	-0,18%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	16.374.029,39	0,00	0,00	16.253.382,75	-120.646,64	-0,74%	2,16%	-0,74%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	27.470.866,45	0,00	0,00	27.256.405,48	-214.460,97	-0,78%	2,22%	-0,78%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.065.580,77	0,00	0,00	2.036.287,67	-29.293,10	-1,42%	3,23%	-1,42%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>58.213,25</b>	<b>0,03%</b>	<b>1,00%</b>	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de novembro / 2017

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	1.208.157,07	0,00	0,00	1.207.463,87	-693,20	-0,06%	0,77%	-0,06%
ÁTICO FLORESTAL MULTIELABOR FIP	1.246.195,54	0,00	0,00	1.244.682,19	-1.513,35	-0,12%	0,00%	-0,12%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.030.304,06	0,00	0,00	1.017.318,32	-12.985,74	-1,26%	9,91%	-1,26%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.079.970,00	0,00	7.500,00	1.055.000,00	-17.470,00	-1,62%	6,04%	-0,93%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	2.265.577,08	0,00	0,00	2.207.357,09	-58.219,99	-2,57%	10,72%	-2,57%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	1.081.746,46	0,00	0,00	1.044.173,11	-37.573,35	-3,47%	10,71%	-3,47%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	1.072.412,60	0,00	0,00	1.019.113,29	-53.299,31	-4,97%	9,44%	-4,97%
Total Renda Variável					-181.754,94	-2,02%	7,03%	