

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
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	951.287,05	0,44%	67	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	9.741.604,71	4,46%	712	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	252.269,15	0,12%	63	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.481.729,06	3,88%	619	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	72.362.912,09	33,14%	1.412	0,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	853.308,12	0,39%	193	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	3.733.838,32	1,71%	677	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	29.268.346,41	13,40%	1.226	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	10.435.143,78	4,78%	703	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.285.991,11	1,50%	722	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.292.292,52	1,97%	313	0,17%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADERCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.457.716,70	1,58%	99	0,42%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	D+31 ou D+1461	Não há	634.940,62	0,29%	17	0,32%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	5.259.622,55	2,41%	114	0,77%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	53.605.380,74	24,55%	748	0,94%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	810.337,29	0,37%	757	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	78.715,09	0,04%		0,31%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	101.650,07	0,05%	47	0,42%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
PRASS II FIDC SÊNIOR	D+540	Não há	1.589.920,94	0,73%	1	1,05%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	2.366.036,80	1,08%	3.209	0,88%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.108.808,94	0,51%	19	2,94%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.062.687,02	0,49%	501	1,96%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "

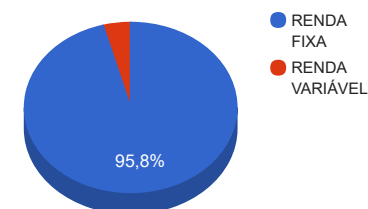
Carteira consolidada de investimentos - base (dezembro / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	1.096.082,69	0,50%	1.189	1,39%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	D+5	Não há	1.214.402,60	0,56%	33	0,57%	Artigo 8º, Inciso III
ÁTICO FLORESTAL MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	1.243.173,62	0,57%	21	0,71%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se aplica	Não se aplica	1.070.000,00	0,49%		0,63%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
		TOTAL -	218.358.197,99				

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

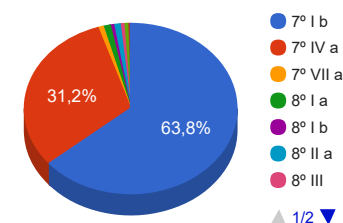
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	10,00%	21.835.819,80
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	139.366.429,80	63,82%	0,00%	90,00%	90,00%	57.155.948,39
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	10.917.909,90
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	20,00%	20,00%	43.671.639,60
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	68.060.290,42	31,17%	0,00%	30,00%	30,00%	-2.552.831,02
Artigo 7º, Inciso VI	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	10.917.909,90
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	1.770.286,10	0,81%	0,00%	3,00%	3,00%	4.780.459,84
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	2,00%	4.367.163,96
Total Renda Fixa	100,00%	209.197.006,32	95,80%	0,00	165,00	165,00	-

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%	10,00%	10,00%	21.835.819,80
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	2.366.036,80	1,08%	0,00%	0,00%	0,00%	-2.366.036,80
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	30,00%	1.108.808,94	0,51%	0,00%	0,00%	0,00%	-1.108.808,94
Artigo 8º, Inciso II	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	10.917.909,90
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	2.158.769,71	0,99%	0,00%	0,00%	0,00%	-2.158.769,71
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	1.214.402,60	0,56%	0,00%	15,00%	15,00%	31.539.327,10
Artigo 8º, Inciso IV	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	10.917.909,90
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	1.243.173,62	0,57%	0,00%	0,00%	0,00%	-1.243.173,62
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	1.070.000,00	0,49%	0,00%	0,00%	0,00%	-1.070.000,00
Artigo 8º, Inciso V	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	10.917.909,90
Artigo 8º, Inciso VI	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	10.917.909,90
Total Renda Variável	30,00%	9.161.191,67	4,20%	0,00	45,00	45,00	-

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 "	139.366.429,80	63,82%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	68.060.290,42	31,17%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	1.770.286,10	0,81%	0,00%	0,00%
Total Renda Fixa	209.197.006,32	95,80%	0,00	0,00

Artigos - Renda Variável	Base: dezembro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	2.366.036,80	1,08%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	1.108.808,94	0,51%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	2.158.769,71	0,99%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso III	1.214.402,60	0,56%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	1.243.173,62	0,57%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	1.070.000,00	0,49%	0,00%	0,00%
Total Renda Variável	9.161.191,67	4,20%	0,00	0,00

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	164.426.687,30	75,30%	0,04%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	44.407.434,85	20,34%	0,00%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	3.457.716,70	1,58%	0,00%
QUATÁ INVESTIMENTOS	1.589.920,94	0,73%	0,22%
ÁTICO ASSET MANAGEMENT	1.243.173,62	0,57%	0,24%
WESTERN ASSET	1.214.402,60	0,56%	0,00%
ITAÚ UNIBANCO	1.203.556,20	0,55%	0,00%
TMJ CAPITAL	634.940,62	0,29%	0,20%
VILA RICA CAPITAL	101.650,07	0,05%	0,09%
BRASIL PLURAL	78.715,09	0,04%	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
IRF-M	1,24%	15,20%	1,44%	6,42%	15,20%	42,12%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,22%	14,91%	1,37%	6,31%	14,91%	41,58%	0,20%	0,842%	4,57%
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%	-	-	-
PRASS II FIDC SÊNIOR	0,72%	13,52%	2,36%	5,47%	13,52%	29,91%	1,70%	0,008%	-
IMA-B 5	0,88%	12,58%	1,48%	6,74%	12,58%	30,01%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,87%	12,38%	1,42%	6,63%	12,38%	29,45%	0,20%	0,671%	3,50%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	0,85%	12,14%	1,38%	6,52%	12,14%	28,98%	0,40%	0,671%	3,50%
IMA-B	0,83%	12,79%	-0,32%	6,96%	12,79%	40,78%	-	-	-
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	1,26%	12,62%	0,94%	6,77%	12,62%	29,75%	1,30%	1,175%	4,64%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	0,82%	12,36%	-0,31%	6,73%	12,36%	39,48%	0,20%	1,392%	8,83%
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%	-	-	-
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	884,19%	327,12%	1.139,30%	1.042,57%	327,12%	473,23%	0,20%	1.245,422%	985,81%

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

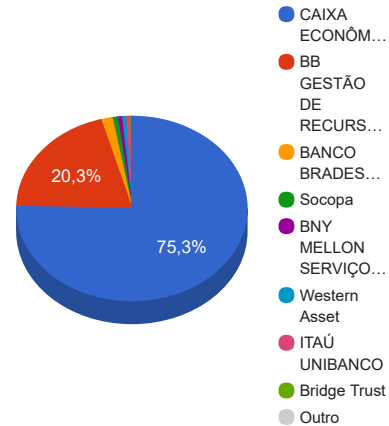
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	38,62%	2,25%	28,17%	-5,76%	2,25%	-73,00%	0,39%	72,989%	50,92%
IRF-M 1	0,57%	11,12%	1,82%	4,59%	11,12%	27,47%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,57%	10,93%	1,79%	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%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,56%	10,89%	1,78%	4,50%	10,89%	26,85%	0,20%	0,039%	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%
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%
IPCA	0,44%	2,95%	1,14%	1,74%	2,95%	9,42%	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,80%	11,22%	1,49%	5,54%	11,22%	-	0,002	0,423%	4,29%

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

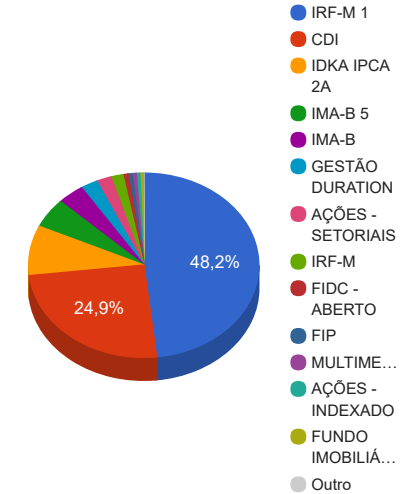
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
SMLL	7,03%	49,36%	2,89%	25,25%	49,36%	96,78%	-	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	7,19%	49,07%	3,11%	26,28%	49,07%	78,82%	1,50%	5,291%	18,53%
Ibovespa	6,16%	26,86%	2,84%	21,47%	26,86%	76,25%	-	-	-
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	6,19%	25,83%	2,51%	20,76%	25,83%	74,08%	0,50%	7,280%	19,06%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	4,28%	23,75%	0,78%	16,78%	23,75%	66,74%	2,00%	5,602%	18,89%
IDIV	4,94%	25,30%	-1,77%	16,88%	25,30%	101,09%	-	-	-
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	7,74%	23,73%	1,90%	18,87%	23,73%	42,09%	1,50%	5,564%	18,34%
IFIX	0,60%	19,41%	0,24%	7,34%	19,41%	58,02%	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	0,00%	4,90%	-2,72%	0,00%	4,90%	33,75%	1,20%	8,878%	23,30%
CDI	0,54%	9,93%	1,76%	4,05%	9,93%	25,31%	-	-	-
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	0,57%	8,66%	1,28%	4,15%	8,66%	27,66%	2,00%	0,807%	1,67%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ÁTICO FLORESTAL MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,50%	0,001%	0,01%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	164.426.687,30	75,30%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	44.407.434,85	20,34%
BANCO BRADESCO	3.457.716,70	1,58%
Socopa	1.589.920,94	0,73%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	1.243.173,62	0,57%
Western Asset	1.214.402,60	0,56%
ITAÚ UNIBANCO	1.203.556,20	0,55%
Bridge Trust	634.940,62	0,29%
BRL Trust Investimentos	101.650,07	0,05%
Geração Futuro	78.715,09	0,04%

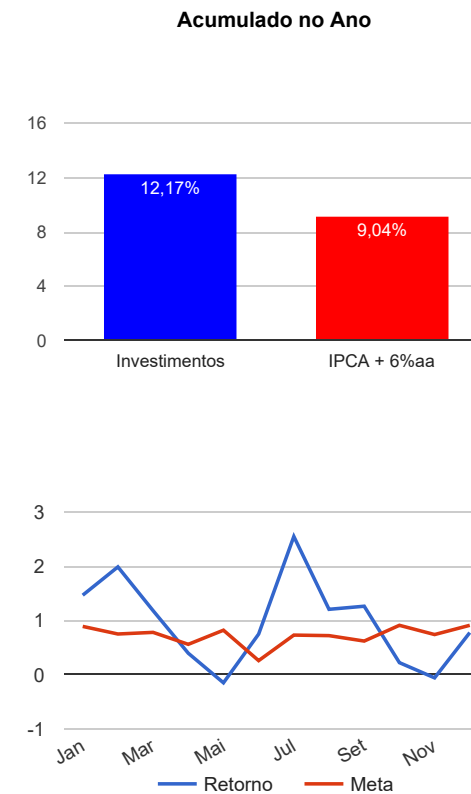


Sub-segmento	Valor	%
IRF-M 1	105.341.244,35	48,24%
CDI	54.415.718,03	24,92%
IDKA IPCA 2A	19.076.641,89	8,74%
IMA-B 5	11.386.430,83	5,21%
IMA-B	8.213.224,25	3,76%
GESTÃO DURATION	5.259.622,55	2,41%
AÇÕES - SETORIAIS	4.524.806,51	2,07%
IRF-M	3.733.838,32	1,71%
FIDC - ABERTO	1.589.920,94	0,73%
FIP	1.243.173,62	0,57%
MULTIMERCADO	1.214.402,60	0,56%
AÇÕES - INDEXADO	1.108.808,94	0,51%
FUNDO IMOBILIÁRIO	1.070.000,00	0,49%
FIDC - FECHADO	180.365,16	0,08%



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%
Maio	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%	1,25%
Dezembro	215.779.389,88	109.947.517,04	109.049.328,50	218.358.197,99	1.680.619,57	0,78%	0,91%	85,65%	0,85%
Acumulado no ano					22.783.534,77	12,17%	9,04%	134,61%	



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 III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	7.997,98	0,00	3.002,55	78.715,09	73.719,66	921,73%	1.245,42%	884,19%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	73.327,68	0,00	3.241,01	101.650,07	31.563,40	43,04%	72,99%	38,62%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	627.067,10	0,00	0,00	634.940,62	7.873,52	1,26%	1,18%	1,26%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.408.539,94	0,00	0,00	8.481.729,06	73.189,12	0,87%	0,45%	0,87%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.658.245,75	0,00	0,00	9.741.604,71	83.358,96	0,86%	0,46%	0,86%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	943.257,54	0,00	0,00	951.287,05	8.029,51	0,85%	0,67%	0,85%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	5.218.121,63	0,00	0,00	5.259.622,55	41.500,92	0,80%	0,42%	0,80%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	30.510.830,04	0,00	27.000.000,00	3.733.838,32	223.008,28	0,73%	0,84%	1,22%
PRASS II FIDC SÊNIOR	1.578.525,00	0,00	0,00	1.589.920,94	11.395,94	0,72%	0,01%	0,72%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	805.641,21	0,00	0,00	810.337,29	4.696,08	0,58%	0,07%	0,58%
BRADERCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	3.438.608,48	0,00	0,00	3.457.716,70	19.108,22	0,56%	0,04%	0,56%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	250.876,02	0,00	0,00	252.269,15	1.393,13	0,56%	0,04%	0,56%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.169.157,80	0,00	3.185.198,14	0,00	16.040,34	0,51%	1,10%	1,38%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	31.263.778,64	22.947.517,04	816.976,21	53.605.380,74	211.061,27	0,39%	0,02%	0,52%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	50.256.061,08	0,00	40.000.000,00	10.435.143,78	179.082,70	0,36%	0,67%	0,87%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	850.321,80	0,00	0,00	853.308,12	2.986,32	0,35%	0,13%	0,35%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.165.874,85	60.000.000,00	0,00	72.362.912,09	197.037,24	0,27%	0,03%	0,57%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	16.253.382,75	0,00	12.000.000,00	4.292.292,52	38.909,77	0,24%	1,39%	0,82%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.211.973,57	27.000.000,00	0,00	29.268.346,41	56.372,84	0,19%	0,04%	0,56%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	27.256.405,48	0,00	24.000.000,00	3.285.991,11	29.585,63	0,11%	1,42%	0,81%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.036.287,67	0,00	2.033.410,59	0,00	-2.877,08	-0,14%	2,06%	0,75%
Total Renda Fixa					1.307.035,77	0,63%	0,68%	

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 DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.017.318,32	0,00	0,00	1.096.082,69	78.764,37	7,74%	5,56%	7,74%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	2.207.357,09	0,00	0,00	2.366.036,80	158.679,71	7,19%	5,29%	7,19%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	1.044.173,11	0,00	0,00	1.108.808,94	64.635,83	6,19%	7,28%	6,19%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	1.019.113,29	0,00	0,00	1.062.687,02	43.573,73	4,28%	5,60%	4,28%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.055.000,00	0,00	7.500,00	1.070.000,00	22.500,00	2,13%	8,88%	1,42%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	1.207.463,87	0,00	0,00	1.214.402,60	6.938,73	0,57%	0,81%	0,57%
ÁTICO FLORESTAL MULTISTRATÉGIA FIP	1.244.682,19	0,00	0,00	1.243.173,62	-1.508,57	-0,12%	0,00%	-0,12%
Total Renda Variável					373.583,80	4,25%	4,71%	

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 FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	29.473.367,16	25.500.328,99	1.947.538,83	53.605.380,74	579.223,42	1,58%	1,74%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	49.980.558,37	0,00	40.000.000,00	10.435.143,78	454.585,41	0,91%	1,42%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.019.726,97	60.000.000,00	0,00	72.362.912,09	343.185,12	1,49%	1,79%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	30.466.951,01	0,00	27.000.000,00	3.733.838,32	266.887,31	0,88%	1,37%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.558.630,92	0,00	0,00	9.741.604,71	182.973,79	1,91%	1,91%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.327.416,39	0,00	0,00	8.481.729,06	154.312,67	1,85%	1,85%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.185.699,76	27.000.000,00	0,00	29.268.346,41	82.646,65	1,40%	1,77%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	5.182.475,68	0,00	0,00	5.259.622,55	77.146,87	1,49%	1,49%
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	6.351,60	0,00	4.219,09	78.715,09	76.582,58	1.458,45%	1.139,30%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	3.397.359,79	0,00	0,00	3.457.716,70	60.356,91	1,78%	1,78%
PRASS II FIDC SÊNIOR	1.553.201,39	0,00	0,00	1.589.920,94	36.719,55	2,36%	2,36%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	79.310,65	0,00	9.250,38	101.650,07	31.589,80	43,10%	28,17%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	795.758,74	0,00	0,00	810.337,29	14.578,55	1,83%	1,83%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	840.094,24	0,00	0,00	853.308,12	13.213,88	1,57%	1,57%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	938.351,19	0,00	0,00	951.287,05	12.935,86	1,38%	1,38%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.178.303,84	0,00	3.185.198,14	0,00	6.894,30	0,22%	1,09%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	629.010,65	0,00	0,00	634.940,62	5.929,97	0,94%	0,94%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	247.868,59	0,00	0,00	252.269,15	4.400,56	1,78%	1,78%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.087.003,13	0,00	2.033.410,59	0,00	-53.592,54	-2,57%	-1,70%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	16.438.742,90	0,00	12.000.000,00	4.292.292,52	-146.450,38	-0,89%	-0,31%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	27.584.660,74	0,00	24.000.000,00	3.285.991,11	-298.669,63	-1,08%	-0,39%
Total Renda Fixa					1.905.450,65	0,92%	

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 SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	2.294.690,91	0,00	0,00	2.366.036,80	71.345,89	3,11%	3,11%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	1.081.662,67	0,00	0,00	1.108.808,94	27.146,27	2,51%	2,51%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.075.629,36	0,00	0,00	1.096.082,69	20.453,33	1,90%	1,90%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	1.199.000,74	0,00	0,00	1.214.402,60	15.401,86	1,28%	1,28%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	1.054.417,79	0,00	0,00	1.062.687,02	8.269,23	0,78%	0,78%
ÁTICO FLORESTAL MULTIELSTRATÉGIA FIP	1.247.828,67	0,00	0,00	1.243.173,62	-4.655,05	-0,37%	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.099.970,00	0,00	22.500,00	1.070.000,00	-7.470,00	-0,66%	-2,72%
Total Renda Variável					130.491,53	1,45%	

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	49.851.995,35	0,00	45.000.000,00	10.435.143,78	5.583.148,43	11,86%	12,38%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	26.877.056,00	0,00	27.000.000,00	3.733.838,32	3.856.782,32	14,35%	14,91%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	29.031.871,14	0,00	29.000.000,00	3.285.991,11	3.254.119,97	12,28%	12,55%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	16.248.898,60	50.049.169,81	15.080.089,74	53.605.380,74	2.387.402,07	9,02%	9,94%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	14.584.646,51	0,00	12.000.000,00	4.292.292,52	1.707.646,01	11,71%	12,36%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.666.958,35	0,00	0,00	9.741.604,71	1.074.646,36	12,40%	12,40%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.332.545,23	64.000.000,00	0,00	72.362.912,09	1.030.366,86	10,28%	10,93%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.549.948,68	0,00	0,00	8.481.729,06	931.780,38	12,34%	12,34%
BRANCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	3.117.324,26	0,00	0,00	3.457.716,70	340.392,44	10,92%	10,92%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	3.090.450,01	0,00	3.403.310,70	0,00	312.860,69	10,12%	14,67%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.006.396,04	27.000.000,00	0,00	29.268.346,41	261.950,37	10,46%	10,86%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,00	5.000.000,00	0,00	5.259.622,55	259.622,55	5,19%	11,22%
PRASS II FIDC SÊNIOR	1.400.523,35	0,00	0,00	1.589.920,94	189.397,59	13,52%	13,52%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	3.000.000,00	3.185.198,14	0,00	185.198,14	6,17%	16,15%
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	18.429,42	0,00	49.671,71	78.715,09	109.957,38	9.053,23%	327,12%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	848.328,43	0,00	0,00	951.287,05	102.958,62	12,14%	12,14%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	819.484,01	0,00	47.085,93	853.308,12	80.910,04	10,16%	10,19%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	691.016,43	47.085,93	0,00	810.337,29	72.234,93	10,04%	10,08%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	563.197,29	0,00	0,00	634.940,62	71.743,33	12,74%	12,62%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	99.411,02	0,00	56.941,36	101.650,07	59.180,41	89,39%	2,25%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	2.000.000,00	2.033.410,59	0,00	33.410,59	1,67%	12,44%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	227.499,98	0,00	0,00	252.269,15	24.769,17	10,89%	10,89%
Total Renda Fixa					21.930.478,65	12,12%	

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 SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	0,00	2.000.000,00	0,00	2.366.036,80	366.036,80	18,30%	49,07%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.020.000,00	0,00	92.147,71	1.070.000,00	142.147,71	14,43%	4,90%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	0,00	1.000.000,00	0,00	1.108.808,94	108.808,94	10,88%	25,83%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	1.117.631,18	0,00	0,00	1.214.402,60	96.771,42	8,66%	8,66%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	0,00	1.000.000,00	0,00	1.096.082,69	96.082,69	9,61%	23,73%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	0,00	1.000.000,00	0,00	1.062.687,02	62.687,02	6,27%	23,75%
ÁTICO FLORESTAL MULTISTRATÉGIA FIP	1.262.652,08	0,00	0,00	1.243.173,62	-19.478,46	-1,54%	-
Total Renda Variável					853.056,12	11,48%	