

Relatório Analítico dos Investimentos em setembro e 3º Trimestre de 2017



Carteira consolidada de investimentos - base (setembro / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.327.416,39	3,89%	601	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	12.019.726,97	5,62%	1.382	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	30.466.951,01	14,24%	696	0,61%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	49.980.558,37	23,35%	711	0,80%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	9.558.630,92	4,47%	701	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.185.699,76	1,02%	1.221	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.087.003,13	0,98%	259	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	840.094,24	0,39%	193	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	938.351,19	0,44%	71	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.178.303,84	1,49%	196	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	247.868,59	0,12%	63	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	27.584.660,74	12,89%	771	0,49%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	D+31 ou D+1461	Não há	629.010,65	0,29%	18	0,31%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADERCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.397.359,79	1,59%	86	0,42%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	16.438.742,90	7,68%	329	0,61%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	5.182.475,68	2,42%	66	1,13%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	29.473.367,16	13,77%	776	0,50%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	795.758,74	0,37%	763	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
PRASS II FIDC SÊNIOR	D+540	Não há	1.553.201,39	0,73%	19	1,09%	Artigo 7º, Inciso VI
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	6.351,60	0,00%	42	0,31%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	79.310,65	0,04%			Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.081.662,67	0,51%	17	3,57%	Artigo 8º, Inciso II

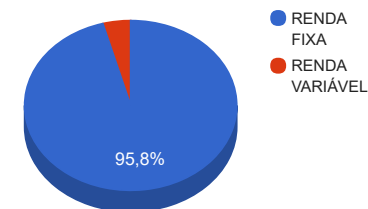
Carteira consolidada de investimentos - base (setembro / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	1.075.629,36	0,50%	1.137	1,86%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	2.294.690,91	1,07%	1.889	1,66%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.054.417,79	0,49%	374	2,29%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	D+5	Não há	1.199.000,74	0,56%	32	0,55%	Artigo 8º, Inciso IV
ÁTICO FLORESTAL MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	1.247.828,67	0,58%	21	0,71%	Artigo 8º, Inciso V
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se aplica	Não se aplica	1.099.970,00	0,51%		0,63%	Artigo 8º, Inciso VI
		TOTAL -	214.024.043,85				

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

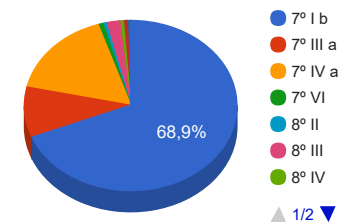
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	10,00%	21.402.404,39
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	147.415.265,15	68,88%	0,00%	90,00%	90,00%	45.206.374,32
Artigo 7º, Inciso II	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	10.701.202,19
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	20.465.113,34	9,56%	0,00%	20,00%	20,00%	22.339.695,43
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	35.451.601,58	16,56%	0,00%	30,00%	30,00%	28.755.611,58
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	1.553.201,39	0,73%	0,00%	5,00%	5,00%	9.148.000,80
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	85.662,25	0,04%	0,00%	3,00%	3,00%	6.335.059,07
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	2,00%	4.280.480,88
Total Renda Fixa	100,00%	204.970.843,71	95,77%	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	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	10,00%	21.402.404,39
Artigo 8º, Inciso II	20,00%	1.081.662,67	0,51%	0,00%	5,00%	5,00%	9.619.539,52
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	4.424.738,06	2,07%	0,00%	15,00%	15,00%	27.678.868,52
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	1.199.000,74	0,56%	0,00%	5,00%	5,00%	9.502.201,45
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	1.247.828,67	0,58%	0,00%	5,00%	5,00%	9.453.373,52
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	1.099.970,00	0,51%	0,00%	5,00%	5,00%	9.601.232,19
Total Renda Variável	30,00%	9.053.200,14	4,23%	0,00	45,00	45,00	-

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: setembro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	147.415.265,15	68,88%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	20.465.113,34	9,56%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	35.451.601,58	16,56%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso VI	1.553.201,39	0,73%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	85.662,25	0,04%	0,00%	0,00%
Total Renda Fixa	204.970.843,71	95,77%	0,00	0,00

Artigos - Renda Variável	Base: setembro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso II	1.081.662,67	0,51%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso III	4.424.738,06	2,07%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso IV	1.199.000,74	0,56%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso V	1.247.828,67	0,58%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso VI	1.099.970,00	0,51%	0,00%	0,00%
Total Renda Variável	9.053.200,14	4,23%	0,00	0,00

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5+	2,40%	14,62%	8,64%	5,79%	17,29%	57,99%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,37%	14,38%	8,52%	5,75%	16,99%	56,58%	0,20%	2,004%	12,71%
IMA-B	1,81%	13,16%	7,30%	5,86%	15,76%	48,59%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,80%	12,99%	7,25%	5,77%	15,63%	47,62%	0,20%	1,346%	9,79%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	1,79%	12,71%	7,07%	5,60%	15,50%	46,97%	0,20%	1,312%	9,37%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	1,26%	11,57%	5,77%	6,04%	13,66%	33,44%	1,30%	0,876%	5,23%
IRF-M 1+	1,73%	15,17%	5,69%	7,83%	19,22%	51,80%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,68%	14,89%	5,59%	7,62%	18,92%	51,25%	0,20%	1,331%	6,40%
IRF-M	1,48%	13,57%	4,92%	7,23%	17,44%	43,51%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,45%	13,36%	4,87%	7,06%	17,16%	43,01%	0,20%	1,005%	4,84%
IMA-B 5	1,01%	10,94%	5,18%	6,58%	13,45%	34,82%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,99%	10,80%	5,13%	6,49%	13,27%	34,14%	0,20%	0,646%	3,63%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	0,97%	10,61%	5,07%	6,37%	13,01%	33,74%	0,40%	0,646%	3,63%
CDI + 3,50% ao ano	0,91%	10,83%	3,15%	6,65%	15,40%	36,32%	-	-	-
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-3,15%	-20,22%	-26,47%	-15,82%	-77,54%	-77,59%	0,39%	-	-
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-84,28%	-65,54%	-7,80%	-10,62%	-39,72%	-58,48%	0,20%	-	-
IDKA IPCA 2 Anos	0,91%	11,13%	4,46%	6,74%	13,66%	34,61%	-	-	-

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

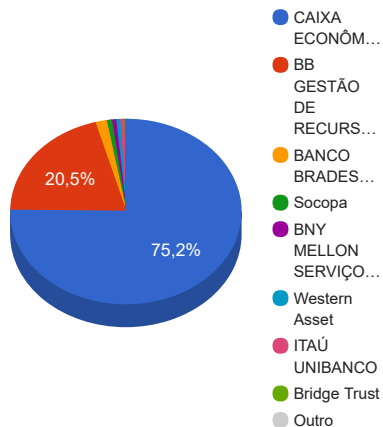
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,89%	10,30%	4,32%	6,24%	12,77%	33,38%	0,20%	0,491%	2,83%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,86%	10,29%	4,33%	6,18%	12,73%	33,31%	0,20%	0,476%	2,90%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,50%	8,48%	2,84%	4,98%	10,90%	28,86%	0,20%	0,276%	1,89%
IRF-M 1	0,74%	9,14%	2,72%	5,49%	12,65%	29,70%	-	-	-
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,72%	8,95%	2,68%	5,40%	12,39%	29,11%	0,20%	0,076%	0,67%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,71%	8,98%	2,67%	5,39%	12,45%	29,31%	0,20%	0,071%	0,67%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,71%	8,98%	2,68%	5,40%	12,46%	29,55%	0,20%	0,078%	0,69%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,71%	8,94%	2,67%	5,37%	12,38%	29,13%	0,10%	0,074%	0,68%
IPCA + 7,00% ao ano	0,70%	7,05%	2,33%	4,25%	9,66%	27,28%	-	-	-
PRASS II FIDC SÊNIOR	0,86%	10,90%	3,03%	6,56%	13,75%	32,50%	1,70%	0,016%	-
CDI	0,64%	8,03%	2,25%	4,85%	11,53%	27,29%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,65%	8,10%	2,27%	4,86%	11,65%	27,28%	0,20%	0,014%	0,11%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,63%	8,06%	2,23%	4,86%	11,56%	27,32%	0,20%	0,017%	0,12%
IPCA	0,16%	1,78%	0,59%	0,81%	2,54%	11,23%	-	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,81%	9,59%	3,99%	5,16%	-	-	0,002	0,441%	-

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

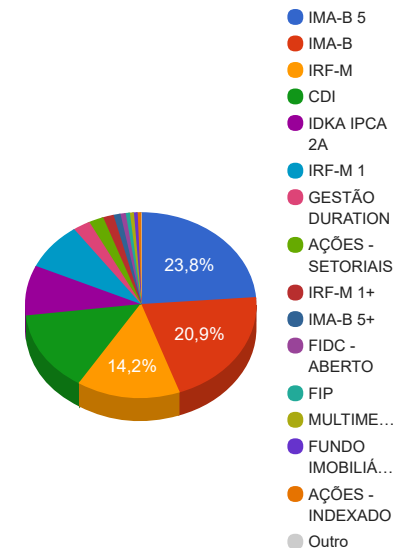
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	6,58%	19,16%	7,09%	9,30%	22,30%	58,65%	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	7,95%	7,84%	2,80%	4,76%	11,22%	39,24%	1,20%	11,303%	22,79%
IDIV	6,12%	27,55%	18,99%	11,86%	42,02%	93,80%	-	-	-
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	2,95%	21,42%	16,65%	12,79%	18,08%	33,16%	1,50%	7,778%	19,67%
Ibovespa	4,88%	23,36%	18,12%	14,33%	27,29%	64,88%	-	-	-
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	4,78%	22,75%	17,80%	14,02%	26,72%	63,49%	0,50%	6,322%	20,67%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	4,08%	22,79%	15,87%	10,83%	19,08%	63,61%	2,00%	5,679%	21,47%
SMLL	3,68%	45,17%	21,74%	25,04%	41,48%	87,27%	-	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	4,39%	44,58%	22,48%	25,31%	42,06%	75,23%	1,50%	7,491%	19,29%
CDI	0,64%	8,03%	2,25%	4,85%	11,53%	27,29%	-	-	-
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	1,17%	7,28%	2,83%	3,63%	12,58%	29,88%	2,00%	0,774%	1,69%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
ÁTICO FLORESTAL MULTIELABORAÇÃO FIP	-	-	-	-	-	-	1,50%	0,000%	0,01%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	160.878.625,91	75,17%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	43.847.134,67	20,49%
BANCO BRADESCO	3.397.359,79	1,59%
Socopa	1.553.201,39	0,73%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	1.247.828,67	0,58%
Western Asset	1.199.000,74	0,56%
ITAÚ UNIBANCO	1.186.219,78	0,55%
Bridge Trust	629.010,65	0,29%
BRL Trust Investimentos	79.310,65	0,04%
Geração Futuro	6.351,60	0,00%

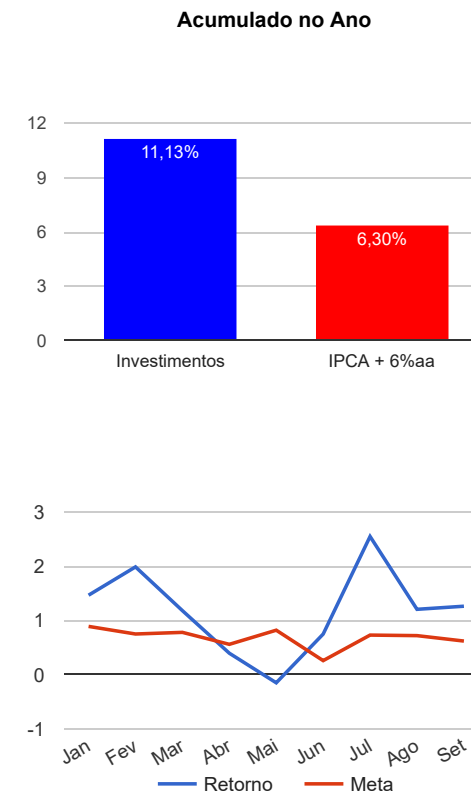


Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5	50.918.909,56	23,79%
IMA-B	44.652.414,29	20,86%
IRF-M	30.466.951,01	14,24%
CDI	30.269.125,90	14,14%
IDKA IPCA 2A	18.726.141,55	8,75%
IRF-M 1	17.850.655,11	8,34%
GESTÃO DURATION	5.182.475,68	2,42%
AÇÕES - SETORIAIS	4.424.738,06	2,07%
IRF-M 1+	3.178.303,84	1,49%
IMA-B 5+	2.087.003,13	0,98%
FIDC - ABERTO	1.553.201,39	0,73%
FIP	1.247.828,67	0,58%
MULTIMERCADO	1.199.000,74	0,56%
FUNDO IMOBILIÁRIO	1.099.970,00	0,51%
AÇÕES - INDEXADO	1.081.662,67	0,51%
FIDC - FECHADO	85.662,25	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%
Acumulado no ano					20.747.592,59	11,13%	6,30%	176,47%	



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.038.636,75	0,00	0,00	2.087.003,13	48.366,38	2,37%	2,00%	2,37%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	27.096.953,79	0,00	0,00	27.584.660,74	487.706,95	1,80%	1,35%	1,80%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	16.149.539,27	0,00	0,00	16.438.742,90	289.203,63	1,79%	1,31%	1,79%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.125.804,75	0,00	0,00	3.178.303,84	52.499,09	1,68%	1,33%	1,68%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	30.030.326,88	0,00	0,00	30.466.951,01	436.624,13	1,45%	1,00%	1,45%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	621.154,51	0,00	0,00	629.010,65	7.856,14	1,26%	0,88%	1,26%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	49.489.703,33	0,00	0,00	49.980.558,37	490.855,04	0,99%	0,65%	0,99%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	929.303,53	0,00	0,00	938.351,19	9.047,66	0,97%	0,65%	0,97%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.253.818,47	0,00	0,00	8.327.416,39	73.597,92	0,89%	0,49%	0,89%
PRASS II FIDC SÊNIOR	1.539.982,19	0,00	0,00	1.553.201,39	13.219,20	0,86%	0,02%	0,86%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.477.398,54	0,00	0,00	9.558.630,92	81.232,38	0,86%	0,48%	0,86%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	5.140.905,00	0,00	0,00	5.182.475,68	41.570,68	0,81%	0,44%	0,81%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	246.107,08	0,00	0,00	247.868,59	1.761,51	0,72%	0,08%	0,72%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	11.934.438,15	0,00	0,00	12.019.726,97	85.288,82	0,71%	0,07%	0,71%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	3.373.280,36	0,00	0,00	3.397.359,79	24.079,43	0,71%	0,08%	0,71%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.170.263,47	0,00	0,00	2.185.699,76	15.436,29	0,71%	0,07%	0,71%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	790.622,54	0,00	0,00	795.758,74	5.136,20	0,65%	0,01%	0,65%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	27.739.737,61	2.135.288,39	581.155,00	29.473.367,16	179.496,16	0,60%	0,02%	0,63%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	835.922,70	0,00	0,00	840.094,24	4.171,54	0,50%	0,28%	0,50%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	81.886,04	0,00	2.911,34	79.310,65	335,95	0,41%	-	-
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	40.416,07	0,00	33.922,32	6.351,60	-142,15	-0,35%	-	-
Total Renda Fixa					2.347.342,95	1,16%	0,70%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.019.000,00	0,00	7.500,00	1.099.970,00	88.470,00	8,68%	11,30%	7,95%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	1.032.273,62	0,00	0,00	1.081.662,67	49.389,05	4,78%	6,32%	4,78%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	2.198.254,47	0,00	0,00	2.294.690,91	96.436,44	4,39%	7,49%	4,39%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	1.013.096,92	0,00	0,00	1.054.417,79	41.320,87	4,08%	5,68%	4,08%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.044.855,18	0,00	0,00	1.075.629,36	30.774,18	2,95%	7,78%	2,95%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	1.185.155,99	0,00	0,00	1.199.000,74	13.844,75	1,17%	0,77%	1,17%
ÁTICO FLORESTAL MULTIELABORATÓRIA FIP	1.249.394,87	0,00	0,00	1.247.828,67	-1.566,20	-0,13%	0,00%	-0,13%
Total Renda Variável					318.669,09	3,65%	5,72%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre / 2017

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	47.541.524,86	0,00	0,00	49.980.558,37	2.439.033,51	5,13%	5,13%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	25.720.280,80	0,00	0,00	27.584.660,74	1.864.379,94	7,25%	7,25%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	29.052.131,18	0,00	0,00	30.466.951,01	1.414.819,83	4,87%	4,87%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	15.353.852,02	0,00	0,00	16.438.742,90	1.084.890,88	7,07%	7,07%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	24.487.552,58	10.213.936,19	5.822.017,63	29.473.367,16	593.896,02	2,02%	2,23%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.161.890,02	0,00	0,00	9.558.630,92	396.740,90	4,33%	4,33%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.982.440,38	0,00	0,00	8.327.416,39	344.976,01	4,32%	4,32%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.783.309,59	4.000.000,00	0,00	12.019.726,97	236.417,38	2,36%	2,67%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	4.983.546,59	0,00	0,00	5.182.475,68	198.929,09	3,99%	3,99%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.010.013,40	0,00	0,00	3.178.303,84	168.290,44	5,59%	5,59%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.923.182,34	0,00	0,00	2.087.003,13	163.820,79	8,52%	8,52%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	3.308.754,48	0,00	0,00	3.397.359,79	88.605,31	2,68%	2,68%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.128.913,29	0,00	0,00	2.185.699,76	56.786,47	2,67%	2,67%
PRASS II FIDC SÊNIOR	1.507.474,76	0,00	0,00	1.553.201,39	45.726,63	3,03%	3,03%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	3.357.985,76	0,00	3.403.310,70	0,00	45.324,94	1,35%	2,54%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	893.078,75	0,00	0,00	938.351,19	45.272,44	5,07%	5,07%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	594.671,94	0,00	0,00	629.010,65	34.338,71	5,77%	5,77%
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	6.889,30	0,00	34.220,95	6.351,60	33.683,25	505,56%	-7,80%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	840.067,05	0,00	23.667,20	840.094,24	23.694,39	2,83%	2,84%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	754.784,87	23.667,20	0,00	795.758,74	17.306,67	2,25%	2,27%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	241.397,63	0,00	0,00	247.868,59	6.470,96	2,68%	2,68%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	107.862,19	0,00	29.125,20	79.310,65	573,66	0,66%	-26,47%
Total Renda Fixa					9.303.978,22	4,81%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre / 2017

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	1.873.596,49	0,00	0,00	2.294.690,91	421.094,42	22,48%	22,48%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	918.193,79	0,00	0,00	1.081.662,67	163.468,88	17,80%	17,80%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	922.062,31	0,00	0,00	1.075.629,36	153.567,05	16,65%	16,65%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	910.002,54	0,00	0,00	1.054.417,79	144.415,25	15,87%	15,87%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.070.000,00	0,00	22.650,00	1.099.970,00	52.620,00	4,99%	2,80%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	1.165.993,97	0,00	0,00	1.199.000,74	33.006,77	2,83%	2,83%
ÁTICO FLORESTAL MULTISTRATÉGIA FIP	1.252.856,37	0,00	0,00	1.247.828,67	-5.027,70	-0,40%	-
Total Renda Variável					963.144,67	11,88%	