

# 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 / 4.392 / 4.604
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	671.040,52	0,88%	1.221	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	308.406,78	0,40%	259	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	2.094.115,40	2,74%	222	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.833.137,48	8,93%	771	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	1.599.961,51	2,09%	283	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	1.087.206,75	1,42%	107	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.610.993,46	9,94%	303	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.626.320,97	2,12%	613	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	678.146,88	0,89%	1.788	0,79%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.669.912,63	3,49%	1.382	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.240.017,27	2,93%	601	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.740.161,00	8,80%	711	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	1.114.062,75	1,46%	72	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	680.089,35	0,89%	701	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.948.923,66	9,08%	329	0,26%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	723.350,50	0,94%	95	0,18%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRASESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	790.866,94	1,03%	536	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	D+5	Não há	2.077.310,44	2,71%	66	0,42%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	1.277.577,80	1,67%	116	0,26%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2030	1.274.790,00	1,67%	34	0,65%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	4.174.181,20	5,45%	763	0,10%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	10.466.822,43	13,67%	6.957	0,10%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "

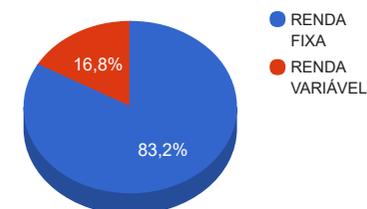
Carteira consolidada de investimentos - base (setembro / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	578.690,36	0,76%	20	1,96%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	D+4	Não há	3.121.485,26	4,08%	1.387	14,64%	Artigo 8º, Inciso III
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.754.297,79	2,29%	6	2,69%	Artigo 8º, Inciso III
BRDESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.470.499,09	3,23%	629	0,38%	Artigo 8º, Inciso III
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FI AÇÕES	D+24	Não há	996.514,07	1,30%	37	0,37%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	2.476.701,65	3,24%	374	5,37%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	D+43	5 anos	1.170.062,71	1,53%	53	1,12%	Artigo 8º, Inciso III
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	Não se aplica	Não se aplica	294.319,47	0,38%		0,01%	Artigo 8º, Inciso VI
		<b>TOTAL -</b>	<b>76.549.966,12</b>				

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

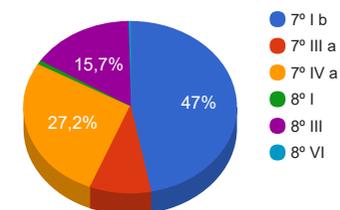
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	35.953.572,75	46,97%	30,00%	35,00%	85,00%	29.113.898,45
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	6.948.923,66	9,08%	15,00%	20,00%	60,00%	38.981.056,01
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	20.784.899,31	27,15%	5,00%	5,00%	30,00%	2.180.090,53
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	11.482.494,92
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	3.827.498,31
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	3.827.498,31
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>63.687.395,72</b>	<b>83,20%</b>	<b>55,00</b>	<b>75,00</b>	<b>200,00</b>	<b>-</b>

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	578.690,36	0,76%	1,00%	2,00%	5,00%	3.248.807,95
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	11.989.560,57	15,66%	5,00%	10,00%	15,00%	-507.065,65
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	3.827.498,31
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	4,00%	5,00%	3.827.498,31
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	294.319,47	0,38%	2,00%	4,00%	5,00%	3.533.178,84
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>12.862.570,40</b>	<b>16,80%</b>	<b>12,00</b>	<b>25,00</b>	<b>35,00</b>	<b>-</b>

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 "	35.953.572,75	46,97%	30,00%	85,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	6.948.923,66	9,08%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	20.784.899,31	27,15%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	0,00	0,00%	5,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>63.687.395,72</b>	<b>83,20%</b>	<b>55,00</b>	<b>200,00</b>

Artigos - Renda Variável	Base: setembro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I	578.690,36	0,76%	1,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso III	11.989.560,57	15,66%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	294.319,47	0,38%	2,00%	5,00%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>12.862.570,40</b>	<b>16,80%</b>	<b>12,00</b>	<b>35,00</b>

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%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,32%	14,08%	8,56%	5,48%	16,64%	56,75%	0,20%	1,967%	12,79%
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%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,78%	12,94%	7,21%	5,71%	15,46%	47,78%	0,20%	1,328%	9,80%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	1,78%	12,25%	7,18%	4,95%	14,94%	46,61%	0,15%	1,393%	10,28%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,46%	7,78%	4,36%	4,21%	9,73%	31,14%	0,20%	1,293%	8,54%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,12%	5,71%	2,42%	3,75%	7,94%	24,10%	0,20%	0,663%	5,89%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,50%	2,65%	0,07%	2,15%	4,86%	17,80%	0,20%	0,279%	4,41%
IRF-M	1,48%	13,57%	4,92%	7,23%	17,44%	43,51%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,44%	13,36%	4,83%	7,06%	17,22%	43,02%	0,20%	1,010%	4,86%
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%
IDKA IPCA 2 Anos	0,91%	11,13%	4,46%	6,74%	13,66%	34,61%	-	-	-
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%

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

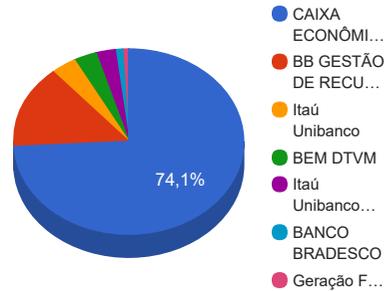
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,86%	10,29%	4,33%	6,18%	12,73%	33,31%	0,20%	0,476%	2,90%
IRF-M 1	0,74%	9,14%	2,72%	5,49%	12,65%	29,70%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,71%	8,98%	2,67%	5,39%	12,45%	29,31%	0,20%	0,071%	0,67%
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%
Selic	0,64%	8,04%	2,26%	4,86%	11,54%	27,33%	-	-	-
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,67%	8,46%	2,49%	5,25%	12,20%	28,08%	0,20%	0,006%	0,13%
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 MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,63%	8,02%	2,21%	4,83%	11,54%	27,35%	0,25%	0,013%	0,12%
IPCA + 6,00% ao ano	0,62%	6,30%	2,09%	3,77%	8,64%	24,92%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,24%	12,88%	6,74%	7,03%	15,31%	43,57%	0,15%	1,036%	6,43%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,50%	0,24%	-1,05%	0,89%	2,34%	11,63%	0,20%	0,237%	4,07%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,49%	6,40%	1,84%	3,82%	8,58%	25,31%	0,20%	0,237%	0,33%
IPCA	0,16%	1,78%	0,59%	0,81%	2,54%	11,23%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	1,51%	11,77%	5,30%	5,35%	-	-	0,40%	1,032%	-

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

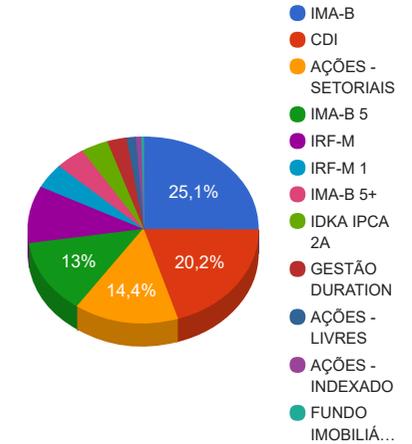
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
ICON	7,21%	32,60%	23,58%	26,89%	20,21%	40,72%	-	-	-
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	7,68%	32,57%	23,91%	26,94%	21,57%	31,32%	1,60%	6,403%	18,63%
IFIX	6,58%	19,16%	7,09%	9,30%	22,30%	58,65%	-	-	-
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-	-	0,30%	-	-
IDIV	6,12%	27,55%	18,99%	11,86%	42,02%	93,80%	-	-	-
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	3,76%	28,06%	15,14%	10,71%	33,53%	66,36%	1,50%	6,056%	19,85%
Ibovespa	4,88%	23,36%	18,12%	14,33%	27,29%	64,88%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FI AÇÕES	5,09%	32,14%	19,96%	16,61%	30,27%	-	2,50%	6,667%	19,18%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	4,79%	22,63%	17,81%	13,97%	26,54%	63,29%	0,50%	6,319%	20,57%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	4,08%	22,79%	15,87%	10,83%	19,08%	63,61%	2,00%	5,679%	21,47%
IGCT	4,05%	27,99%	17,76%	16,17%	32,45%	66,39%	-	-	-
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA FI AÇÕES	4,02%	27,51%	17,59%	15,92%	31,91%	65,53%	0,90%	6,493%	19,59%
SMLL	3,68%	45,17%	21,74%	25,04%	41,48%	87,27%	-	-	-
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	6,78%	31,58%	21,55%	20,09%	17,25%	10,78%	1,72%	8,311%	18,03%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	56.735.489,59	74,12%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	11.046.841,32	14,43%
Itaú Unibanco	2.750.811,86	3,59%
BEM DTVM	2.470.499,09	3,23%
Itaú Unibanco S.A.	2.077.310,44	2,71%
BANCO BRADESCO	790.866,94	1,03%
Geração Futuro	678.146,88	0,89%



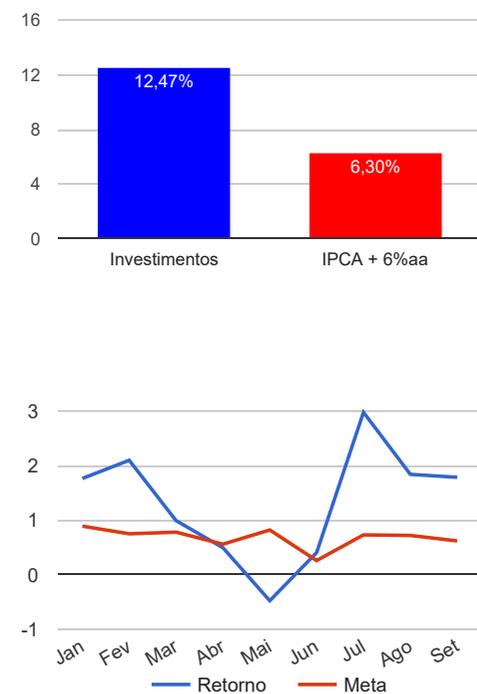
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	19.201.520,04	25,08%
CDI	15.431.870,57	20,16%
AÇÕES - SETORIAIS	10.993.046,50	14,36%
IMA-B 5	9.921.483,15	12,96%
IRF-M	7.610.993,46	9,94%
IRF-M 1	3.340.953,15	4,36%
IMA-B 5+	3.183.158,29	4,16%
IDKA IPCA 2A	2.920.106,62	3,81%
GESTÃO DURATION	2.077.310,44	2,71%
AÇÕES - LIVRES	996.514,07	1,30%
AÇÕES - INDEXADO	578.690,36	0,76%
FUNDO IMOBILIÁRIO	294.319,47	0,38%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	67.163.512,71	7.014.108,42	7.291.540,11	68.069.728,53	1.183.647,51	1,76%	0,89%	197,59%	1,95%
Fevereiro	68.069.728,53	5.152.660,24	5.326.071,97	69.322.645,25	1.426.328,45	2,10%	0,75%	279,96%	1,81%
Março	69.322.645,25	6.627.494,43	7.527.639,13	69.109.336,77	686.836,22	0,99%	0,78%	126,28%	1,87%
Abril	69.109.336,77	5.025.461,99	875.866,66	73.621.661,68	362.729,58	0,50%	0,56%	88,79%	1,56%
Mai	73.621.661,68	4.436.691,45	3.968.770,50	73.737.801,50	-351.781,13	-0,47%	0,82%	-57,79%	8,08%
Junho	73.737.801,50	7.441.430,30	7.323.294,51	74.155.478,64	299.541,35	0,41%	0,26%	158,65%	1,91%
Julho	74.155.478,64	2.253.102,45	3.660.464,18	74.952.921,74	2.204.804,83	2,97%	0,73%	408,45%	1,74%
Agosto	74.952.921,74	2.067.729,33	2.381.517,20	76.016.796,89	1.377.663,02	1,84%	0,72%	253,79%	1,93%
Setembro	76.016.796,89	13.683.124,39	14.506.068,82	76.549.966,12	1.356.113,66	1,78%	0,62%	285,77%	1,65%
Acumulado no ano					8.545.883,49	12,47%	6,30%	197,74%	

Acumulado no Ano



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(%)
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.167.769,38	0,00	616.130,77	1.599.961,51	48.322,90	2,23%	1,97%	2,32%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.658.796,20	0,00	4.451.623,99	308.406,78	101.234,57	2,17%	2,00%	2,37%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.597.866,74	0,00	0,00	1.626.320,97	28.454,23	1,78%	1,33%	1,78%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	666.288,92	0,00	0,00	678.146,88	11.857,96	1,78%	1,39%	1,78%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	7.411.255,99	0,00	590.647,92	6.948.923,66	128.315,59	1,73%	1,31%	1,79%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.705.338,57	0,00	1.003.261,78	6.833.137,48	131.060,69	1,70%	1,35%	1,80%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.098.051,53	0,00	0,00	1.114.062,75	16.011,22	1,46%	1,29%	1,46%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.502.953,34	0,00	0,00	7.610.993,46	108.040,12	1,44%	1,01%	1,44%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	714.456,67	0,00	0,00	723.350,50	8.893,83	1,24%	1,04%	1,24%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.075.127,73	0,00	0,00	1.087.206,75	12.079,02	1,12%	0,66%	1,12%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.624.986,27	0,00	5.000.000,00	6.740.161,00	115.174,73	0,99%	0,65%	0,99%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.220.219,93	0,00	0,00	2.240.017,27	19.797,34	0,89%	0,49%	0,89%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	674.309,73	0,00	0,00	680.089,35	5.779,62	0,86%	0,48%	0,86%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	666.301,36	0,00	0,00	671.040,52	4.739,16	0,71%	0,07%	0,71%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	0,00	2.062.646,43	0,00	2.077.310,44	14.664,01	0,71%	1,03%	1,51%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.083.824,31	0,00	300.000,00	790.866,94	7.042,63	0,65%	0,01%	0,67%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.107.978,55	345.237,46	305.916,79	4.174.181,20	26.881,98	0,60%	0,01%	0,65%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.268.429,00	0,00	0,00	1.274.790,00	6.361,00	0,50%	0,24%	0,50%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.083.709,80	0,00	0,00	2.094.115,40	10.405,60	0,50%	0,28%	0,50%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.271.313,80	0,00	0,00	1.277.577,80	6.264,00	0,49%	0,24%	0,49%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.327.950,22	1.419.429,26	87.179,32	2.669.912,63	9.712,47	0,35%	0,07%	0,71%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	5.196.755,03	7.355.811,24	2.111.978,18	10.466.822,43	26.234,34	0,21%	0,01%	0,63%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>847.327,01</b>	<b>1,28%</b>	<b>0,71%</b>	

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 CONSUMO FI AÇÕES	2.620.343,13	300.000,00	0,00	3.121.485,26	201.142,13	6,89%	6,40%	7,68%
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	814.842,58	300.000,00	0,00	1.170.062,71	55.220,13	4,95%	8,31%	6,78%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	552.246,28	0,00	0,00	578.690,36	26.444,08	4,79%	6,32%	4,79%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	2.091.400,34	300.000,00	0,00	2.476.701,65	85.301,31	3,57%	5,68%	4,08%
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA FI AÇÕES	1.394.488,48	300.000,00	0,00	1.754.297,79	59.809,31	3,53%	6,49%	4,02%
BRDESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.091.814,42	300.000,00	0,00	2.470.499,09	78.684,67	3,29%	6,06%	3,76%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	327.978,59	0,00	39.330,07	294.319,47	5.670,95	1,73%	-	0,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FI AÇÕES	0,00	1.000.000,00	0,00	996.514,07	-3.485,93	-0,35%	6,67%	5,09%
Total Renda Variável					508.786,65	4,12%	6,40%	

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	11.167.364,87	0,00	5.000.000,00	6.740.161,00	572.796,13	5,13%	5,13%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.313.865,38	0,00	1.003.261,78	6.833.137,48	522.533,88	7,14%	7,25%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	7.046.103,66	0,00	590.647,92	6.948.923,66	493.467,92	7,00%	7,07%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.394.953,91	0,00	4.451.623,99	308.406,78	365.076,86	8,31%	8,52%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.260.149,44	0,00	0,00	7.610.993,46	350.844,02	4,83%	4,83%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.043.217,28	0,00	616.130,77	1.599.961,51	172.875,00	8,46%	8,56%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.516.986,89	0,00	0,00	1.626.320,97	109.334,08	7,21%	7,21%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.147.221,11	0,00	0,00	2.240.017,27	92.796,16	4,32%	4,32%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.982.026,84	407.012,68	305.916,79	4.174.181,20	91.058,47	2,21%	2,27%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.613.347,71	9.315.460,57	3.549.686,24	10.466.822,43	87.700,39	1,44%	2,21%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.067.543,25	0,00	29.128,19	1.114.062,75	75.647,69	7,13%	4,36%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.092.585,26	0,00	57.835,85	2.094.115,40	59.365,99	2,85%	0,07%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.061.527,94	0,00	29.025,62	1.087.206,75	54.704,43	5,18%	2,42%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	696.061,80	0,00	19.184,57	723.350,50	46.473,27	6,71%	6,74%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	632.719,79	0,00	0,00	678.146,88	45.427,09	7,18%	7,18%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.985.348,44	3.718.836,49	4.074.100,09	2.669.912,63	39.827,79	1,11%	2,67%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	651.861,54	0,00	0,00	680.089,35	28.227,81	4,33%	4,33%
BRASESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.064.605,43	0,00	300.000,00	790.866,94	26.261,51	2,47%	2,49%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.288.306,00	0,00	37.262,09	1.274.790,00	23.746,09	1,86%	-1,05%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.290.589,54	0,00	36.440,65	1.277.577,80	23.428,91	1,83%	1,84%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	654.510,17	0,00	912,58	671.040,52	17.442,93	2,67%	2,67%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	0,00	2.062.646,43	0,00	2.077.310,44	14.664,01	0,71%	5,30%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>3.313.700,43</b>	<b>5,14%</b>	

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 CONSUMO FI AÇÕES	2.277.001,38	300.000,00	0,00	3.121.485,26	544.483,88	23,00%	23,91%
BRDESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.268.114,78	300.000,00	401.413,00	2.470.499,09	303.797,31	14,61%	15,14%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	1.878.576,04	300.000,00	0,00	2.476.701,65	298.125,61	15,30%	15,87%
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA FI AÇÕES	1.233.480,25	300.000,00	0,00	1.754.297,79	220.817,54	17,04%	17,59%
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	715.794,57	300.000,00	0,00	1.170.062,71	154.268,14	19,48%	21,55%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	491.199,29	0,00	0,00	578.690,36	87.491,07	17,81%	17,81%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	320.416,08	0,00	45.480,07	294.319,47	19.383,46	6,09%	0,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FI AÇÕES	0,00	1.000.000,00	0,00	996.514,07	-3.485,93	-0,35%	19,96%
<b>Total Renda Variável</b>					<b>1.624.881,08</b>	<b>17,09%</b>	