

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



Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

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 IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	7.152.517,37	1,93%	283	0,45%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.079.567,71	0,29%	613	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	29.457.748,85	7,93%	259	2,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	21.829.827,92	5,88%	1.221	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	10.517.282,67	2,83%	711	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	12.862.986,89	3,46%	113	1,65%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.278.536,32	1,42%	601	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	21.048.430,36	5,67%	701	0,41%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	17.805.861,44	4,79%	1.382	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	31.245.160,55	8,41%	771	0,56%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	D+1471	Não há	2.511.454,11	0,68%	29	2,19%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1461	Não há	5.191.241,21	1,40%	9	19,54%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1901	Não há	3.737.801,22	1,01%	10	6,12%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	9.333.003,85	2,51%	34	1,63%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
MULTINVEST GRAU DE INVESTIMENTO FIC FI DE RENDA FIXA	D+4	Não há	5.235.030,76	1,41%	5	17,12%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	4.339.376,79	1,17%	20	14,58%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	511.425,03	0,14%	442	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	12.926.098,18	3,48%	62	0,85%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	16/05/2023	11.535.757,53	3,11%	52	3,97%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	47.037.501,52	12,66%	776	0,80%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	13.660.917,64	3,68%	60	14,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	14.034.529,96	3,78%	35	4,38%	Artigo 7º, Inciso VI

Carteira consolidada de investimentos - base (setembro / 2017)

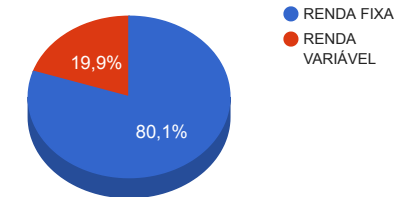
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	2.739.123,20	0,74%	70	3,49%	Artigo 7º, Inciso VI
TRX CORPORATIVO I FIDC SÊNIOR	D+1401	Não Informado	966.160,48	0,26%	7	20,78%	Artigo 7º, Inciso VI
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	Não possui	1008 dias úteis	5.578.531,07	1,50%	8	18,34%	Artigo 7º, Inciso VI
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	5.239.157,65	1,41%	1.836	3,92%	Artigo 8º, Inciso III
META VALOR FI AÇÕES	D+4	Não há	4.254.716,14	1,15%	22	6,21%	Artigo 8º, Inciso III
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	4.876.281,74	1,31%	129	5,36%	Artigo 8º, Inciso III
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	3.724.238,35	1,00%	1.664	6,98%	Artigo 8º, Inciso III
CONSTÂNCIA BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	6.461.144,54	1,74%	76	6,72%	Artigo 8º, Inciso III
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	D+13	Não há	3.499.026,08	0,94%	424	4,35%	Artigo 8º, Inciso III
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	3.824.945,52	1,03%	51	5,61%	Artigo 8º, Inciso IV
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+180	Não há	6.306.367,38	1,70%	21	4,54%	Artigo 8º, Inciso IV
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	10.124.014,04	2,73%			Artigo 8º, Inciso V
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	14.683.505,04	3,95%	8	14,08%	Artigo 8º, Inciso V
GGR ESTRATÉGIA FII - GGRF11	Não se aplica	Não se aplica	2.001.540,79	0,54%		25,94%	Artigo 8º, Inciso VI
CSHG BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	Não se aplica	Não se aplica	1.435.138,11	0,39%		0,11%	Artigo 8º, Inciso VI
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	Não se aplica	Não se aplica	7.450.072,28	2,01%		4,91%	Artigo 8º, Inciso VI
Total			371.496.020,29				

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

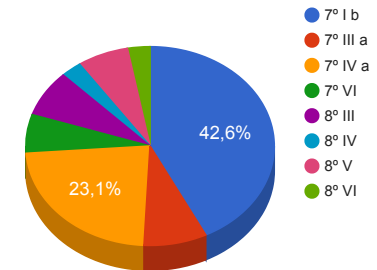
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	158.277.920,08	42,61%	30,00%	35,00%	70,00%	101.769.294,12
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	30.347.907,94	8,17%	15,00%	20,00%	60,00%	192.549.704,23
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	85.671.699,90	23,06%	5,00%	5,00%	30,00%	25.777.106,19
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	23.318.344,71	6,28%	5,00%	10,00%	15,00%	32.406.058,33
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	18.574.801,01
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	18.574.801,01
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	28.054.564,50	7,55%	5,00%	10,00%	15,00%	27.669.838,54
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	10.131.312,90	2,73%	2,00%	5,00%	5,00%	8.443.488,11
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	24.807.519,08	6,68%	2,00%	5,00%	5,00%	-6.232.718,07
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	10.886.751,18	2,93%	2,00%	5,00%	5,00%	7.688.049,83
Total Carteira		371.496.020,29					

RENDA FIXA	297.615.872,63	80,11%
RENDA VARIÁVEL	73.880.147,66	19,89%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: setembro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	158.277.920,08	42,61%	30,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	30.347.907,94	8,17%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	85.671.699,90	23,06%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	23.318.344,71	6,28%	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%
Artigo 8º, Inciso III	28.054.564,50	7,55%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	10.131.312,90	2,73%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	24.807.519,08	6,68%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	10.886.751,18	2,93%	2,00%	5,00%
Total	371.496.020,29	100,00%	66,00	215,00

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%	-	-	-
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	2,44%	15,23%	7,05%	8,96%	22,59%	80,25%	0,50%	1,033%	6,22%
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%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1,79%	12,67%	7,22%	5,53%	15,28%	47,27%	0,20%	1,344%	9,80%
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%
MULTINVEST GRAU DE INVESTIMENTO FIC FI DE RENDA FIXA	0,83%	13,13%	6,18%	4,91%	16,17%	-	0,65%	0,305%	10,15%

IMA-B 5	1,01%	10,94%	5,18%	6,58%	13,45%	34,82%	-	-	-
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1,16%	12,22%	4,94%	7,84%	14,73%	34,47%	0,97%	0,808%	3,36%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1,02%	7,28%	4,50%	5,22%	9,73%	11,24%	0,70%	0,737%	4,54%
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%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,86%	10,12%	4,62%	5,86%	13,85%	28,17%	0,70%	1,099%	4,09%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	-0,51%	5,90%	1,12%	2,29%	8,18%	-	0,70%	1,521%	7,28%

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%
IPCA + 8,00% ao ano	0,77%	7,80%	2,58%	4,73%	10,67%	29,66%	-	-	-
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	0,78%	8,00%	1,95%	4,80%	-	-	0,35%	0,084%	-
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%
IPCA + 7,00% ao ano	0,70%	7,05%	2,33%	4,25%	9,66%	27,28%	-	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	2,49%	-44,76%	5,12%	-46,12%	-58,31%	-78,58%	0,00%	6,295%	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1,19%	3,87%	-0,15%	1,23%	6,51%	23,31%	1,65%	3,277%	2,75%
CDI	0,64%	8,03%	2,25%	4,85%	11,53%	27,29%	-	-	-
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	0,68%	9,30%	2,25%	5,56%	13,12%	31,15%	0,75%	0,282%	9,17%
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 + 6,00% ao ano	0,62%	6,30%	2,09%	3,77%	8,64%	24,92%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,30%	13,03%	6,90%	6,81%	15,31%	44,79%	0,15%	1,186%	6,93%
IPCA	0,16%	1,78%	0,59%	0,81%	2,54%	11,23%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,51%	11,79%	5,30%	5,36%	15,04%	39,85%	0,40%	1,032%	6,22%

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
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,65%	8,02%	2,29%	4,79%	11,48%	27,22%	0,20%	0,030%	0,16%
TRX CORPORATIVO I FIDC SÊNIOR	-12,37%	-83,18%	-42,97%	-61,74%	-90,74%	-	1,55%	16,384%	-

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
IDIV	6,12%	27,55%	18,99%	11,86%	42,02%	93,80%	-	-	-
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	4,40%	24,71%	19,00%	18,38%	17,97%	57,73%	2,00%	5,563%	13,08%

Ibovespa	4,88%	23,36%	18,12%	14,33%	27,29%	64,88%	-	-	-
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	5,62%	31,32%	20,45%	18,55%	36,28%	71,65%	2,00%	6,231%	15,98%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4,64%	24,47%	13,29%	13,03%	30,42%	72,59%	1,85%	5,003%	12,22%
CONSTÂNCIA BRASIL FI AÇÕES	3,48%	20,44%	15,02%	12,70%	24,61%	52,29%	2,00%	5,527%	17,54%

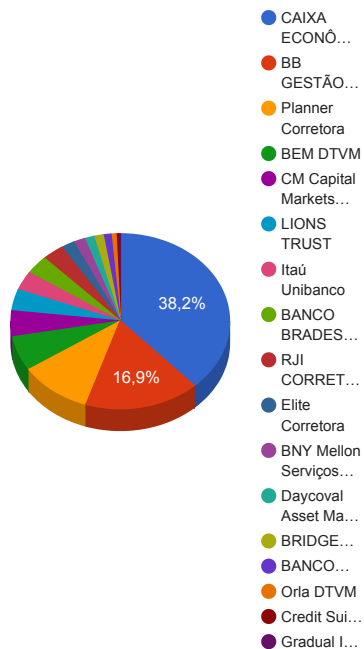
IBX	4,69%	24,29%	17,91%	14,93%	27,43%	62,93%	-	-	-
META VALOR FI AÇÕES	8,11%	38,16%	26,57%	22,59%	46,55%	83,68%	2,50%	7,184%	24,81%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	4,19%	20,89%	14,17%	13,81%	18,13%	46,09%	2,00%	5,932%	14,70%

CDI	0,64%	8,03%	2,25%	4,85%	11,53%	27,29%	-	-	-
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	0,69%	9,61%	2,61%	5,61%	13,70%	33,54%	1,00%	0,306%	10,35%
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-0,05%	5,69%	0,67%	2,48%	9,09%	25,62%	0,55%	1,613%	1,95%

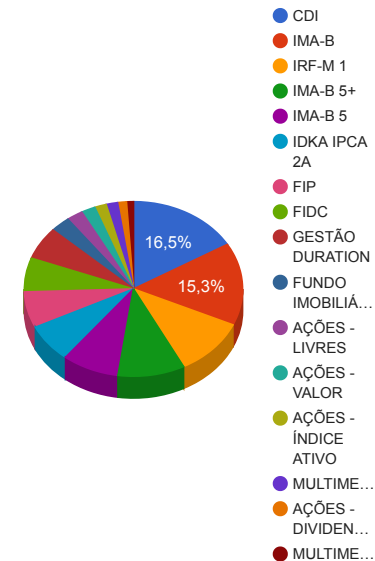
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CSHG BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	9,09%	18,23%	11,01%	9,09%	20,48%	-	0,60%	9,010%	17,58%
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	0,09%	129,01%	126,42%	126,95%	102,48%	85,70%	0,00%	0,087%	127,66%
GGR ESTRATÉGIA FII - GGRF11	-	-	-	-	-	-	0,20%	-	-
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	-	-	-	-	-	-	1,35%	0,000%	0,00%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	141.853.516,38	38,18%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	62.646.100,89	16,86%
Planner Corretora	39.529.325,85	10,64%
BEM DTVM	23.799.848,36	6,41%
CM Capital Markets DTVM	17.772.331,18	4,78%
LIONS TRUST	14.683.505,04	3,95%
Itaú Unibanco	12.926.098,18	3,48%
BANCO BRADESCO	12.862.986,89	3,46%
RJI CORRETORA DE VALORES	11.844.457,96	3,19%
Elite Corretora	7.450.072,28	2,01%
BNY Mellon Serviços Financeiros	6.306.367,38	1,70%
Daycoval Asset Management	5.235.030,76	1,41%
BRIDGE ADMINISTRADORA DE RECURSOS	5.191.241,21	1,40%
BANCO DAYCOVAL	4.254.716,14	1,15%
Orla DTVM	2.739.123,20	0,74%
Credit Suisse Hedging-Griffo Corretora	1.435.138,11	0,39%
Gradual Investimentos	966.160,48	0,26%



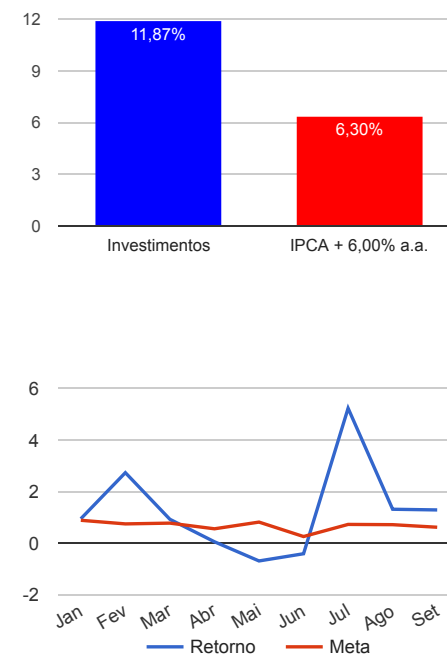
Sub-segmento	Valor	%
CDI	61.209.844,19	16,48%
IMA-B	56.723.472,68	15,27%
IRF-M 1	39.635.689,36	10,67%
IMA-B 5+	36.610.266,22	9,85%
IMA-B 5	31.290.783,06	8,42%
IDKA IPCA 2A	26.326.966,68	7,09%
FIP	24.807.519,08	6,68%
FIDC	23.318.344,71	6,28%
GESTÃO DURATION	22.500.505,73	6,06%
FUNDO IMOBILIÁRIO	10.886.751,18	2,93%
AÇÕES - LIVRES	8.963.396,00	2,41%
AÇÕES - VALOR	7.753.742,22	2,09%
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	6.461.144,54	1,74%
MULTIMERCADO - CRÉDITO PRIVADO	6.306.367,38	1,70%
AÇÕES - DIVIDENDOS	4.876.281,74	1,31%
MULTIMERCADO - MODERADO	3.824.945,52	1,03%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	333.191.383,73	50.805.024,13	50.784.536,34	336.373.007,09	3.161.135,57	0,95%	0,89%	106,36%	3,77%
Fevereiro	336.373.007,09	4.383.044,13	4.286.869,69	345.675.439,19	9.206.257,66	2,74%	0,75%	365,57%	1,99%
Março	345.675.439,19	6.995.766,92	6.873.075,36	349.006.074,13	3.207.943,38	0,93%	0,78%	118,24%	2,54%
Abril	349.006.074,13	15.352.991,65	15.257.588,01	349.300.105,27	198.627,50	0,06%	0,56%	10,20%	1,98%
Maio	349.300.105,27	6.301.198,84	6.303.707,04	346.899.240,40	-2.398.356,67	-0,69%	0,82%	-83,57%	10,57%
Junho	346.899.240,40	10.500.098,33	10.679.315,80	345.307.845,94	-1.412.176,99	-0,41%	0,26%	-159,24%	2,76%
Julho	345.307.845,94	10.537.265,29	10.443.369,99	363.480.150,15	18.078.408,91	5,23%	0,73%	719,04%	11,02%
Agosto	363.480.150,15	86.068.892,19	87.324.843,80	367.014.148,20	4.789.949,66	1,32%	0,72%	181,95%	1,22%
Setembro	367.014.148,20	10.666.280,25	10.924.292,97	371.496.020,29	4.739.884,81	1,29%	0,62%	206,88%	1,34%
Acumulado no ano					39.571.673,83	11,87%	6,30%	188,35%	

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(%)
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	2.672.616,48	0,00	0,00	2.739.123,20	66.506,72	2,49%	6,29%	2,49%
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	4.235.862,76	0,00	0,00	4.339.376,79	103.514,03	2,44%	1,03%	2,44%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	28.775.064,36	0,00	0,00	29.457.748,85	682.684,49	2,37%	2,00%	2,37%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.990.008,37	0,00	0,00	7.152.517,37	162.509,00	2,32%	1,97%	2,32%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	30.692.734,62	0,00	0,00	31.245.160,55	552.425,93	1,80%	1,35%	1,80%
BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	12.636.198,15	0,00	0,00	12.862.986,89	226.788,74	1,79%	1,34%	1,79%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.060.679,52	0,00	0,00	1.079.567,71	18.888,19	1,78%	1,33%	1,78%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	12.734.060,63	0,00	0,00	12.926.098,18	192.037,55	1,51%	1,03%	1,51%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.387.999,16	0,00	0,00	11.535.757,53	147.758,37	1,30%	1,19%	1,30%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	13.869.371,17	0,00	0,00	14.034.529,96	165.158,79	1,19%	3,28%	1,19%
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	3.695.038,93	0,00	0,00	3.737.801,22	42.762,29	1,16%	0,81%	1,16%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	9.238.605,28	0,00	0,00	9.333.003,85	94.398,57	1,02%	0,74%	1,02%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.413.993,28	0,00	0,00	10.517.282,67	103.289,39	0,99%	0,65%	0,99%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.231.884,47	0,00	0,00	5.278.536,32	46.651,85	0,89%	0,49%	0,89%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	5.146.936,71	0,00	0,00	5.191.241,21	44.304,50	0,86%	1,10%	0,86%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	20.869.553,91	0,00	0,00	21.048.430,36	178.876,45	0,86%	0,48%	0,86%
MULTINVEST GRAU DE INVESTIMENTO FIC FI DE RENDA FIXA	5.191.704,39	0,00	0,00	5.235.030,76	43.326,37	0,83%	0,30%	0,83%
TRX CORPORATIVO I FIDC SÊNIOR	1.102.579,81	0,00	144.410,83	966.160,48	7.991,50	0,72%	16,38%	-12,37%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	17.679.515,73	0,00	0,00	17.805.861,44	126.345,71	0,71%	0,07%	0,71%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	21.747.691,13	0,00	72.518,98	21.829.827,92	154.655,77	0,71%	0,07%	0,71%
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	13.568.124,65	0,00	0,00	13.660.917,64	92.792,99	0,68%	0,28%	0,68%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	508.099,74	0,00	0,00	511.425,03	3.325,29	0,65%	0,03%	0,65%

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 FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	57.251.310,54	140.248,74	10.698.830,16	47.037.501,52	344.772,40	0,60%	0,02%	0,63%
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	3.051.869,35	2.500.000,00	0,00	5.578.531,07	26.661,72	0,48%	0,08%	0,78%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	2.524.273,67	0,00	0,00	2.511.454,11	-12.819,56	-0,51%	1,52%	-0,51%
Total Renda Fixa					3.615.607,05	1,20%	0,98%	

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(%)
CSHG BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	1.316.500,17	0,00	7.427,60	1.435.138,11	126.065,54	9,58%	9,01%	9,09%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	3.525.929,44	0,00	0,00	3.724.238,35	198.308,91	5,62%	6,23%	5,62%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5.006.854,76	0,00	0,00	5.239.157,65	232.302,89	4,64%	5,00%	4,64%
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	4.670.907,36	0,00	0,00	4.876.281,74	205.374,38	4,40%	5,56%	4,40%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	3.358.225,90	0,00	0,00	3.499.026,08	140.800,18	4,19%	5,93%	4,19%
META VALOR FI AÇÕES	1.104.504,16	3.043.115,18	0,00	4.254.716,14	107.096,80	2,58%	7,18%	8,11%
CONSTÂNCIA BRASIL FI AÇÕES	3.385.970,24	2.982.916,33	0,00	6.461.144,54	92.257,97	1,45%	5,53%	3,48%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	3.798.767,69	0,00	0,00	3.824.945,52	26.177,83	0,69%	0,31%	0,69%
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	14.671.033,72	0,00	1.105,40	14.683.505,04	13.576,72	0,09%	0,09%	0,09%
GGR ESTRATÉGIA FII - GGRF11	0,00	2.000.000,00	0,00	2.001.540,79	1.540,79	0,08%	-	1,14%
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	7.452.313,36	0,00	0,00	7.450.072,28	-2.241,08	-0,03%	0,00%	-0,03%
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	6.309.336,11	0,00	0,00	6.306.367,38	-2.968,73	-0,05%	1,61%	-0,05%
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	10.138.028,48	0,00	0,00	10.124.014,04	-14.014,44	-0,14%	-	-
Total Renda Variável					1.124.277,76	1,55%	3,06%	

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 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	71.211.206,41	0,00	44.000.000,00	31.245.160,55	4.033.954,14	6,78%	7,25%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	43.833.781,69	0,00	17.585.457,91	29.457.748,85	3.209.425,07	8,27%	8,52%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	24.533.746,39	0,00	19.000.000,00	7.152.517,37	1.618.770,98	8,40%	8,56%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	20.174.793,41	0,00	0,00	21.048.430,36	873.636,95	4,33%	4,33%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	11.997.245,84	0,00	0,00	12.862.986,89	865.741,05	7,22%	7,22%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	11.251.457,91	54.410.948,31	19.393.429,34	47.037.501,52	768.524,64	1,78%	2,23%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.790.839,98	0,00	0,00	11.535.757,53	744.917,55	6,90%	6,90%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	12.275.062,55	0,00	0,00	12.926.098,18	651.035,63	5,30%	5,30%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.004.043,01	0,00	0,00	10.517.282,67	513.239,66	5,13%	5,13%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	8.930.844,29	0,00	0,00	9.333.003,85	402.159,56	4,50%	4,50%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	12.604.377,86	0,00	7.658.870,52	5.278.536,32	333.028,98	3,77%	4,32%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.792.332,21	19.000.000,00	265.006,73	21.829.827,92	302.502,44	2,33%	2,67%
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	13.360.771,86	0,00	0,00	13.660.917,64	300.145,78	2,25%	2,25%
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	4.053.511,82	0,00	0,00	4.339.376,79	285.864,97	7,05%	7,05%
MULTINVEST GRAU DE INVESTIMENTO FIC FI DE RENDA FIXA	2.511.582,38	2.500.000,00	0,00	5.235.030,76	223.448,38	4,46%	6,18%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	17.585.457,91	0,00	17.805.861,44	220.403,53	1,25%	2,67%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2.505.834,92	2.500.000,00	0,00	5.191.241,21	185.406,29	3,70%	4,62%
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	3.561.900,39	0,00	0,00	3.737.801,22	175.900,83	4,94%	4,94%
LME REC IPCA FIDC MULTISSECTORIAL SÊNIOR	2.605.753,60	0,00	0,00	2.739.123,20	133.369,60	5,12%	5,12%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.006.990,68	0,00	0,00	1.079.567,71	72.577,03	7,21%	7,21%
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	3.016.889,66	2.500.000,00	0,00	5.578.531,07	61.641,41	1,65%	1,95%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	2.483.516,35	0,00	0,00	2.511.454,11	27.937,76	1,12%	1,12%

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 (%)
TRX CORPORATIVO I FIDC SÊNIOR	1.694.087,27	0,00	753.221,96	966.160,48	25.295,17	1,83%	-42,97%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	499.983,43	0,00	0,00	511.425,03	11.441,60	2,29%	2,29%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	14.054.987,25	0,00	0,00	14.034.529,96	-20.457,29	-0,15%	-0,15%
Total Renda Fixa					16.019.911,71	5,50%	

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 (%)
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	6.484.995,60	0,00	14.237,50	14.683.505,04	8.212.746,94	126,64%	126,42%
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	4.097.647,46	0,00	0,00	4.876.281,74	778.634,28	19,00%	19,00%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	3.092.003,18	0,00	0,00	3.724.238,35	632.235,17	20,45%	20,45%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4.624.565,50	0,00	0,00	5.239.157,65	614.592,15	13,29%	13,29%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	3.064.690,58	0,00	0,00	3.499.026,08	434.335,50	14,17%	14,17%
CONSTÂNCIA BRASIL FI AÇÕES	3.046.221,14	2.982.916,33	0,00	6.461.144,54	432.007,07	12,76%	15,02%
META VALOR FI AÇÕES	235.945,41	3.793.115,18	0,00	4.254.716,14	225.655,55	14,92%	26,57%
CSHG BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	1.292.647,99	0,00	22.282,80	1.435.138,11	164.772,92	12,88%	11,01%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	3.727.500,00	0,00	0,00	3.824.945,52	97.445,52	2,61%	2,61%
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	6.264.109,58	0,00	0,00	6.306.367,38	42.257,80	0,67%	0,67%
GGR ESTRATÉGIA FII - GGRF11	0,00	2.000.000,00	0,00	2.001.540,79	1.540,79	0,08%	-
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	7.449.744,68	0,00	0,00	7.450.072,28	327,60	0,00%	-
W7 MULTIELSTRATÉGIA FIP	10.172.233,66	0,00	0,00	10.124.014,04	-48.219,62	-0,47%	-
Total Renda Variável					11.588.331,67	21,12%	