

Relatório Analítico dos Investimentos em novembro 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 (novembro / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	16/05/2023	11.174.604,55	3,04%	52	3,97%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	22.243.980,44	6,05%	1.230	0,19%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	28.336.210,68	7,70%	712	0,52%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	517.549,16	0,14%	434	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1461	Não há	5.240.993,70	1,42%	9	19,54%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
MULTINVEST GRAU DE INVESTIMENTO FIC FI DE RENDA FIXA	D+4	Não há	5.169.417,53	1,41%	6	17,29%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	30.873.345,63	8,39%	748	0,66%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	4.344.768,54	1,18%	17	16,61%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	10.575.256,01	2,87%	713	0,16%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	9.146.756,54	2,49%	32	1,67%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1901	Não há	3.742.601,07	1,02%	10	6,12%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.066.886,72	0,29%	602	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	12.708.612,57	3,45%	110	1,69%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	D+1471	Não há	2.588.992,23	0,70%	27	2,26%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	9.814.301,33	2,67%	613	0,25%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	12.947.728,41	3,52%	62	0,89%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	13.837.488,11	3,76%	60	13,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	25.761.094,75	7,00%	226	2,35%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	45.277.085,99	12,31%	758	0,76%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	18.022.362,93	4,90%	1.401	0,11%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	13.937.995,16	3,79%	38	4,21%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	296.724,30	0,08%	70	3,49%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "

Carteira consolidada de investimentos - base (novembro / 2017)

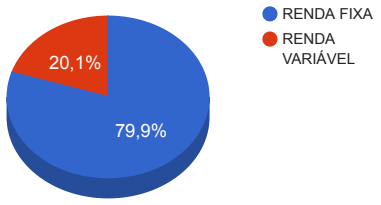
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
TRX CORPORATIVO I FIDC SÊNIOR	D+1401	Não Informado	684.465,29	0,19%	7	20,78%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	Não possui	1008 dias úteis	5.684.852,18	1,55%	8	18,34%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
CONSTÂNCIA BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	6.157.070,75	1,67%	75	6,55%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	D+13	Não há	3.361.482,02	0,91%	480	3,77%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	5.038.134,26	1,37%	2.132	3,72%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	5.492.735,92	1,49%	1.954	9,03%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
META VALOR FI AÇÕES	D+4	Não há	4.037.773,17	1,10%	28	5,32%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	5.917.956,20	1,61%	131	6,39%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+180	Não há	6.366.376,78	1,73%	21	4,55%	Artigo 8º, Inciso III
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	3.875.118,56	1,05%	56	4,16%	Artigo 8º, Inciso III
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	14.766.470,04	4,01%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	10.095.761,62	2,74%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	Não se aplica	Não se aplica	7.420.101,42	2,02%		4,91%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
CSHG BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	Não se aplica	Não se aplica	1.374.094,02	0,37%		0,11%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
		Total	367.897.148,58				

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

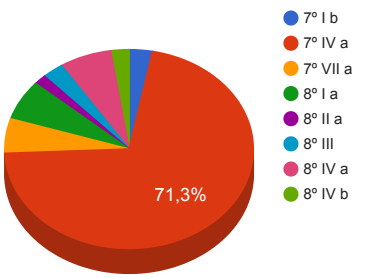
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	11.174.604,55	3,04%	30,00%	35,00%	70,00%	246.353.399,46
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	15,00%	20,00%	60,00%	220.738.289,15
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	262.215.432,34	71,27%	5,00%	5,00%	30,00%	-151.846.287,77
Artigo 7º, Inciso VI	0,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	55.184.572,29
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	20.604.036,93	5,60%	0,00%	2,50%	5,00%	-2.209.179,50
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	18.394.857,43
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	24.087.196,12	6,55%	0,00%	0,00%	0,00%	-24.087.196,12
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	5.917.956,20	1,61%	0,00%	0,00%	0,00%	-5.917.956,20
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	10.241.495,34	2,78%	5,00%	10,00%	15,00%	44.943.076,95
Artigo 8º, Inciso IV	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	18.394.857,43
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	24.862.231,66	6,76%	0,00%	0,00%	0,00%	-24.862.231,66
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	8.794.195,44	2,39%	0,00%	0,00%	0,00%	-8.794.195,44
Artigo 8º, Inciso V	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	18.394.857,43
Artigo 8º, Inciso VI	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	18.394.857,43
Total Carteira		367.897.148,58					

RENDA FIXA	293.994.073,82	79,91%
RENDA VARIÁVEL	73.903.074,76	20,09%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: novembro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	11.174.604,55	3,04%	30,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	262.215.432,34	71,27%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	0,00	0,00%	5,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	20.604.036,93	5,60%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	24.087.196,12	6,55%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	5.917.956,20	1,61%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso III	10.241.495,34	2,78%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	24.862.231,66	6,76%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	8.794.195,44	2,39%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso V	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Total	367.897.148,58	100,00%	66,00	215,00

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (novembro / 2017)

Artigo 14º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR)

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	140.840.995,80	38,28%	0,04%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	62.821.682,39	17,08%	0,00%
INFINITY ASSET MANAGEMENT	22.057.375,21	6,00%	5,33%
Aurora Capital	17.680.596,23	4,81%	-
KINEA INVESTIMENTOS	14.766.470,04	4,01%	0,00%
GRAPHEN INVESTIMENTOS LTDA	13.401.677,90	3,64%	-
ITAÚ UNIBANCO	12.947.728,41	3,52%	0,00%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	12.708.612,57	3,45%	0,00%
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	11.649.806,67	3,17%	11,80%
MULTINVEST CAPITAL	10.410.411,23	2,83%	8,77%
A5 CAPITAL PARTNERS	10.095.761,62	2,74%	-
BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUTURADOS LTDA	9.146.756,54	2,49%	0,06%
CAPITÂNIA	6.366.376,78	1,73%	0,15%
4UM GESTAO DE RECURSOS LTDA	5.917.956,20	1,61%	-
PERFIN INVESTIMENTOS	5.038.134,26	1,37%	0,15%

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
META ASSET MANAGEMENT	4.037.773,17	1,10%	4,99%%
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	3.361.482,02	0,91%	1,90%%
RJI CORRETORA DE VALORES	2.588.992,23	0,70%	-%
CREDIT SUISSE HEDGING-GRIFFO CORRETORA	1.374.094,02	0,37%	-%
TRX	684.465,29	0,19%	0,12%%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA + 8,00% ao ano	0,89%	9,92%	2,76%	5,03%	10,99%	28,21%	-	-	-
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	1,02%	10,06%	2,70%	4,92%	-	-	0,35%	0,103%	-
IPCA + 7,00% ao ano	0,82%	9,00%	2,53%	4,54%	9,97%	25,86%	-	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	-1,36%	3,16%	0,49%	0,09%	4,04%	19,53%	1,65%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-89,10%	-94,02%	-88,90%	-94,19%	-93,97%	-97,72%	0,00%	150,002%	-
IPCA + 6,00% ao ano	0,74%	8,07%	2,30%	4,05%	8,95%	23,52%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,48%	12,46%	0,78%	6,54%	14,43%	40,95%	0,15%	1,670%	6,65%
IRF-M 1	0,62%	10,49%	2,00%	4,92%	11,82%	28,26%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,59%	10,31%	1,94%	4,82%	11,61%	27,86%	0,20%	0,042%	0,67%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,59%	10,25%	1,92%	4,80%	11,53%	27,67%	0,10%	0,041%	0,67%
CDI	0,57%	9,34%	1,86%	4,33%	10,56%	26,09%	-	-	-
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	0,58%	10,71%	1,99%	4,47%	12,22%	29,68%	0,75%	0,233%	9,09%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,55%	9,37%	1,85%	4,32%	10,58%	26,11%	0,20%	0,019%	0,13%
IPCA	0,28%	2,50%	0,86%	1,06%	2,80%	9,99%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,13%	11,98%	1,68%	6,50%	14,36%	37,36%	0,40%	0,742%	5,92%
IDKA IPCA 2 Anos	0,26%	12,31%	1,98%	6,41%	13,75%	31,84%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,28%	11,44%	1,91%	6,06%	12,83%	30,57%	0,20%	0,520%	2,81%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,23%	11,37%	1,87%	6,00%	12,74%	30,53%	0,20%	0,505%	2,73%
IMA-B 5	0,10%	11,59%	1,60%	6,36%	13,15%	31,60%	-	-	-
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	2,45%	9,17%	2,56%	4,68%	10,36%	-	0,70%	3,691%	6,61%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,30%	11,17%	1,83%	6,11%	12,93%	27,08%	0,70%	0,820%	3,76%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,09%	11,41%	1,55%	6,25%	12,95%	30,96%	0,20%	0,890%	3,55%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,20%	5,14%	-0,99%	2,86%	6,74%	5,79%	0,70%	1,164%	4,94%
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,26%	12,36%	1,29%	6,37%	13,95%	31,45%	0,97%	0,996%	3,31%
IMA-B 5+	-1,40%	11,87%	-0,06%	5,98%	16,02%	48,25%	-	-	-
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	-0,13%	15,37%	2,57%	7,89%	17,83%	84,02%	0,50%	1,418%	5,32%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,42%	11,60%	-0,12%	5,81%	15,73%	47,09%	0,20%	3,227%	12,23%
IMA-B	-0,76%	11,87%	0,65%	6,25%	15,12%	41,75%	-	-	-
MULTINVEST GRAU DE INVESTIMENTO FIC FI DE RENDA FIXA	-0,66%	11,71%	-0,43%	4,64%	16,88%	-	0,65%	1,385%	9,35%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,78%	11,62%	0,59%	6,10%	14,84%	41,03%	0,20%	2,214%	9,44%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,78%	11,65%	0,59%	6,13%	14,86%	41,10%	0,20%	2,219%	9,43%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	-0,79%	11,32%	0,57%	5,94%	14,53%	40,69%	0,20%	2,222%	9,45%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

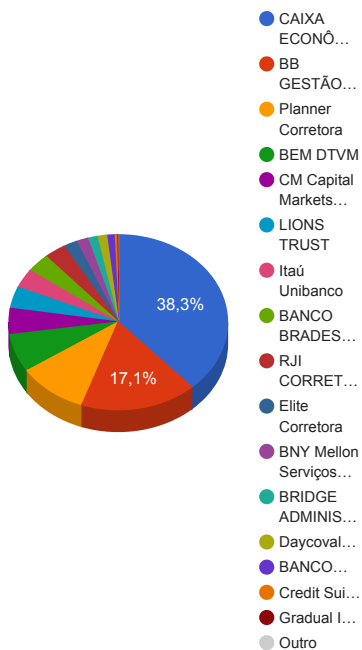
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,57%	9,32%	1,86%	4,35%	10,53%	26,07%	0,20%	0,021%	0,17%
TRX CORPORATIVO I FIDC SÊNIOR	-8,77%	-88,08%	-37,92%	-62,09%	-93,54%	-	1,55%	11,576%	-

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

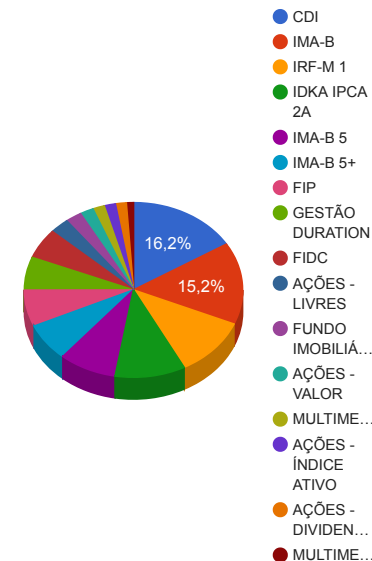
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	0,57%	9,34%	1,86%	4,33%	10,56%	26,09%	-	-	-
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	0,60%	11,04%	2,01%	4,87%	12,43%	31,51%	1,00%	0,108%	6,95%
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	0,15%	6,70%	0,90%	2,42%	8,08%	23,85%	0,55%	0,788%	1,95%
IDIV	-6,67%	19,39%	-0,67%	10,02%	18,34%	84,42%	-	-	-
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	1,21%	25,89%	5,39%	19,34%	25,33%	52,89%	2,00%	8,423%	13,41%
IBX	-3,38%	19,93%	1,02%	14,12%	16,87%	57,73%	-	-	-
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	-2,85%	16,14%	0,10%	10,90%	15,55%	37,17%	2,00%	7,567%	14,27%
META VALOR FI AÇÕES	-5,72%	31,11%	2,60%	20,62%	25,92%	71,55%	2,50%	12,882%	23,95%
Ibovespa	-3,15%	19,50%	1,60%	14,77%	16,26%	59,51%	-	-	-
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-3,39%	19,70%	0,62%	9,24%	21,09%	63,22%	1,85%	7,337%	12,20%
CONSTÂNCIA BRASIL FI AÇÕES	-3,94%	14,77%	-1,39%	10,36%	14,14%	45,15%	2,00%	9,956%	17,45%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	-5,38%	24,26%	-0,05%	14,56%	23,31%	61,18%	2,00%	8,619%	16,00%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CSHG BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	-6,11%	13,50%	4,73%	4,82%	15,26%	-	0,60%	11,230%	19,09%
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	0,00%	-	-
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	-	-	-	-	-	-	1,35%	0,000%	0,00%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	140.840.995,80	38,28%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	62.821.682,39	17,08%
Planner Corretora	37.837.989,01	10,28%
BEM DTVM	25.967.379,15	7,06%
CM Capital Markets DTVM	17.680.596,23	4,81%
LIONS TRUST	14.766.470,04	4,01%
Itaú Unibanco	12.947.728,41	3,52%
BANCO BRADESCO	12.708.612,57	3,45%
RJI CORRETORA DE VALORES	11.735.748,77	3,19%
Elite Corretora	7.420.101,42	2,02%
BNY Mellon Serviços Financeiros	6.366.376,78	1,73%
BRIDGE ADMINISTRADORA DE RECURSOS	5.240.993,70	1,42%
Daycoval Asset Management	5.169.417,53	1,41%
BANCO DAYCOVAL	4.037.773,17	1,10%
Credit Suisse Hedging-Griffo Corretora	1.374.094,02	0,37%
Gradual Investimentos	684.465,29	0,19%
Orla DTVM	296.724,30	0,08%



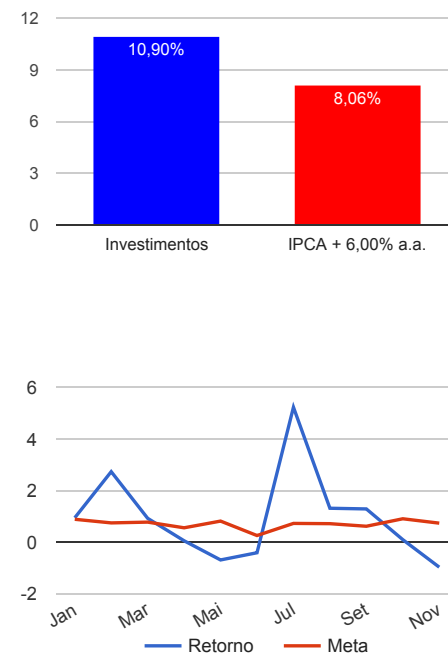
Sub-segmento	Valor	%
CDI	59.632.123,26	16,21%
IMA-B	55.823.449,47	15,17%
IRF-M 1	40.266.343,37	10,95%
IDKA IPCA 2A	38.150.512,01	10,37%
IMA-B 5	31.294.599,55	8,51%
IMA-B 5+	25.761.094,75	7,00%
FIP	24.862.231,66	6,76%
GESTÃO DURATION	22.461.914,48	6,11%
FIDC	20.604.036,93	5,60%
AÇÕES - LIVRES	10.530.870,18	2,86%
FUNDO IMOBILIÁRIO	8.794.195,44	2,39%
AÇÕES - VALOR	7.399.255,19	2,01%
MULTIMERCADO - CRÉDITO PRIVADO	6.366.376,78	1,73%
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	6.157.070,75	1,67%
AÇÕES - DIVIDENDOS	5.917.956,20	1,61%
MULTIMERCADO - MODERADO	3.875.118,56	1,05%



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%
Mai	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%
Outubro	371.496.020,29	2.871.589,37	3.044.979,66	371.694.312,23	371.682,23	0,10%	0,91%	11,01%	1,49%
Novembro	371.694.312,23	31.181.698,66	31.385.518,04	367.897.148,58	-3.593.344,27	-0,97%	0,74%	-130,64%	1,93%
Acumulado no ano					36.350.011,79	10,90%	8,06%	135,21%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	2.527.065,79	0,00	0,00	2.588.992,23	61.926,44	2,45%	3,69%	2,45%
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	5.625.477,73	0,00	0,00	5.684.852,18	59.374,45	1,06%	0,10%	1,02%
TRX CORPORATIVO I FIDC SÊNIOR	750.240,52	0,00	72.724,87	684.465,29	6.949,64	0,93%	11,58%	-8,77%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	17.916.222,72	0,00	0,00	18.022.362,93	106.140,21	0,59%	0,04%	0,59%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	21.887.007,23	302.650,22	75.468,91	22.243.980,44	129.791,90	0,58%	0,04%	0,59%
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	13.757.310,83	0,00	0,00	13.837.488,11	80.177,28	0,58%	0,23%	0,58%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	514.638,09	0,00	0,00	517.549,16	2.911,07	0,57%	0,02%	0,57%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	47.535.657,94	243.610,42	2.765.534,76	45.277.085,99	263.352,39	0,55%	0,02%	0,55%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	5.225.555,54	0,00	0,00	5.240.993,70	15.438,16	0,30%	0,82%	0,30%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	21.207.400,85	7.077.326,93	0,00	28.336.210,68	51.482,90	0,18%	0,52%	0,28%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	12.930.893,74	0,00	0,00	12.947.728,41	16.834,67	0,13%	0,74%	0,13%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.317.820,68	4.485.070,49	0,00	9.814.301,33	11.410,16	0,12%	0,51%	0,23%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.565.819,21	0,00	0,00	10.575.256,01	9.436,80	0,09%	0,89%	0,09%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.081.517,76	0,00	7.077.326,93	0,00	-4.190,83	-0,06%	3,24%	-1,43%
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	4.350.503,26	0,00	0,00	4.344.768,54	-5.734,72	-0,13%	1,42%	-0,13%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	9.165.342,48	0,00	0,00	9.146.756,54	-18.585,94	-0,20%	1,16%	-0,20%
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	3.752.230,77	0,00	0,00	3.742.601,07	-9.629,70	-0,26%	1,00%	-0,26%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.532.939,85	0,00	302.650,22	11.174.604,55	-55.685,08	-0,48%	1,67%	-0,48%
MULTINVEST GRAU DE INVESTIMENTO FIC FI DE RENDA FIXA	5.203.930,18	0,00	0,00	5.169.417,53	-34.512,65	-0,66%	1,39%	-0,66%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.075.220,08	0,00	0,00	1.066.886,72	-8.333,36	-0,78%	2,21%	-0,78%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	31.116.265,70	0,00	0,00	30.873.345,63	-242.920,07	-0,78%	2,22%	-0,78%
BRAPRESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	12.809.500,83	0,00	0,00	12.708.612,57	-100.888,26	-0,79%	2,22%	-0,79%

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	29.155.375,35	16.073.040,60	19.073.040,60	25.761.094,75	-394.280,60	-0,87%	3,23%	-1,42%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	14.129.587,69	0,00	0,00	13.937.995,16	-191.592,53	-1,36%	-	-1,36%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	2.721.637,16	0,00	0,00	296.724,30	-2.424.912,86	-89,10%	150,00%	-89,10%
				Total Renda Fixa	-2.676.040,53	-0,90%	1,21%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	4.863.804,50	1.000.000,00	0,00	5.917.956,20	54.151,70	0,92%	8,42%	1,21%
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	14.672.576,42	0,00	0,00	14.766.470,04	93.893,62	0,64%	-	-
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	3.852.081,49	0,00	0,00	3.875.118,56	23.037,07	0,60%	0,11%	0,60%
GGR ESTRATÉGIA FII - GGRF11	2.009.258,42	0,00	2.012.781,75	0,00	3.523,33	0,18%	-	0,00%
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	6.356.731,24	0,00	0,00	6.366.376,78	9.645,54	0,15%	0,79%	0,15%
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	10.117.036,74	0,00	0,00	10.095.761,62	-21.275,12	-0,21%	-	-
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	7.438.965,22	0,00	0,00	7.420.101,42	-18.863,80	-0,25%	0,00%	-0,25%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	3.459.994,08	0,00	0,00	3.361.482,02	-98.512,06	-2,85%	7,57%	-2,85%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5.214.688,89	0,00	0,00	5.038.134,26	-176.554,63	-3,39%	7,34%	-3,39%
CONSTÂNCIA BRASIL FI AÇÕES	6.409.497,53	0,00	0,00	6.157.070,75	-252.426,78	-3,94%	9,96%	-3,94%
CSHG BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	1.437.354,41	0,00	5.990,00	1.374.094,02	-57.270,39	-3,98%	11,23%	-6,11%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	3.724.533,36	2.000.000,00	0,00	5.492.735,92	-231.797,44	-4,05%	8,62%	-5,38%
META VALOR FI AÇÕES	4.282.627,95	0,00	0,00	4.037.773,17	-244.854,78	-5,72%	12,88%	-5,72%
Total Renda Variável					-917.303,74	-1,23%	5,99%	