

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
BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.627.636,86	1,45%	19	2,53%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.879.857,18	4,91%	198	0,97%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.446.789,33	1,35%	703	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	25.032.182,12	13,85%	110	5,60%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.774.789,50	1,53%	619	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	10.000.856,25	5,53%	223	0,31%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	17.762.234,30	9,82%	722	0,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	8.574.283,48	4,74%	588	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.479.659,50	1,37%	712	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	12.350.489,13	6,83%	1.412	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BANESTES FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	7.793.407,17	4,31%	31	3,31%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	18.464.125,07	10,21%	193	1,53%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	13.308.881,02	7,36%	313	0,54%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	3.649.278,93	2,02%	354	0,17%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	7.228.004,58	4,00%	54	0,86%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	3.188.214,44	1,76%	235	0,30%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BANESTES INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	D+0	Não há	9.206.065,76	5,09%	45	4,32%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	5.218.860,17	2,89%	757	0,12%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	8.194.770,39	4,53%	748	0,14%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	1.110.958,40	0,61%	100	0,49%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	1.488.688,08	0,82%	29	2,66%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+34	Não há	1.524.228,00	0,84%	19	18,42%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "

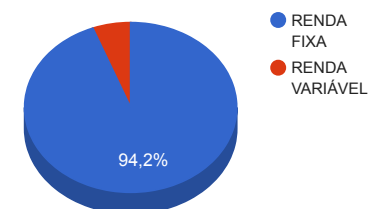
Carteira consolidada de investimentos - base (dezembro / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	23/08/2017	4.899.262,33	2,71%	116	1,28%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	2.595.667,60	1,44%	103	1,58%	Artigo 8º, Inciso III
		TOTAL -	180.799.189,59				

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

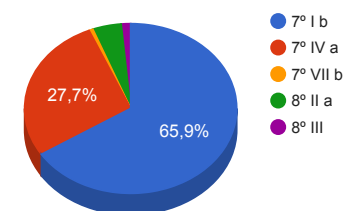
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	18.079.918,96
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	119.186.309,89	65,92%	40,00%	57,00%	85,00%	34.493.001,26
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	8,00%	10,00%	35,00%	63.279.716,36
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	49.994.075,29	27,65%	5,00%	10,00%	30,00%	4.245.681,59
Artigo 7º, Inciso VI	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	18.079.918,96
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	1.110.958,40	0,61%	0,00%	2,00%	5,00%	7.929.001,08
Total Renda Fixa	100,00%	170.291.343,58	94,19%	53,00	86,00	180,00	-

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	7.912.178,41	4,38%	0,00%	0,00%	0,00%	-7.912.178,41
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	2.595.667,60	1,44%	3,50%	9,00%	15,00%	24.524.210,84
Artigo 8º, Inciso IV	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	9.039.959,48
Artigo 8º, Inciso V	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	9.039.959,48
Artigo 8º, Inciso VI	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	9.039.959,48
Total Renda Variável	30,00%	10.507.846,01	5,81%	3,50	14,00	30,00	-

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 " a "	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	119.186.309,89	65,92%	40,00%	85,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	8,00%	35,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	49.994.075,29	27,65%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	1.110.958,40	0,61%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	170.291.343,58	94,19%	53,00	180,00

Artigos - Renda Variável	Base: dezembro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	7.912.178,41	4,38%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso III	2.595.667,60	1,44%	3,50%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Total Renda Variável	10.507.846,01	5,81%	3,50	30,00

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	95.293.750,57	52,71%	0,03%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	52.226.834,32	28,89%	0,00%
BANESTES DTVM	28.379.342,37	15,70%	0,77%
VINCI PARTNERS	4.899.262,33	2,71%	0,03%

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
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%
IMA Geral ex-C	0,89%	12,89%	1,03%	5,83%	12,89%	36,69%	-	-	-
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,86%	12,62%	0,95%	5,69%	12,62%	36,16%	0,20%	0,694%	4,62%
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%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,87%	12,42%	1,42%	6,65%	12,42%	29,60%	0,20%	0,674%	3,51%
IMA Geral	0,88%	12,82%	1,02%	5,88%	12,82%	36,50%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,87%	12,59%	0,95%	5,67%	12,59%	36,17%	0,20%	0,702%	4,47%
IMA-B	0,83%	12,79%	-0,32%	6,96%	12,79%	40,78%	-	-	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,85%	12,80%	-0,36%	6,95%	12,80%	40,39%	0,30%	1,415%	9,26%
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%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,81%	12,52%	-0,38%	6,80%	12,52%	40,11%	0,20%	1,420%	9,25%
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%
BANESTES INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	0,70%	12,32%	-0,88%	7,06%	12,32%	41,95%	0,20%	2,083%	10,60%
BANESTES FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,60%	11,90%	-1,16%	6,81%	11,90%	41,61%	0,20%	2,162%	10,68%

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

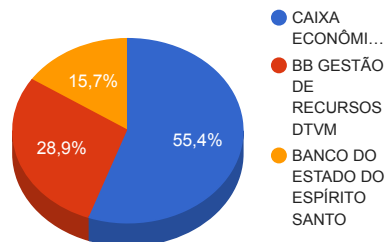
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,35%	4,26%	1,58%	1,65%	4,26%	13,21%	0,20%	0,131%	4,33%
IMA-B 5+	0,79%	12,75%	-1,63%	6,87%	12,75%	47,75%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,75%	12,44%	-1,70%	6,68%	12,44%	46,79%	0,20%	2,064%	11,96%
IRF-M 1	0,57%	11,12%	1,82%	4,59%	11,12%	27,47%	-	-	-
BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,77%	11,53%	1,75%	5,10%	11,53%	28,57%	0,15%	0,210%	2,03%
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%
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%
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,56%	10,58%	1,84%	4,28%	10,58%	26,73%	0,20%	0,024%	0,14%
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 IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,41%	9,42%	1,55%	4,00%	9,42%	27,86%	0,20%	0,118%	1,35%

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

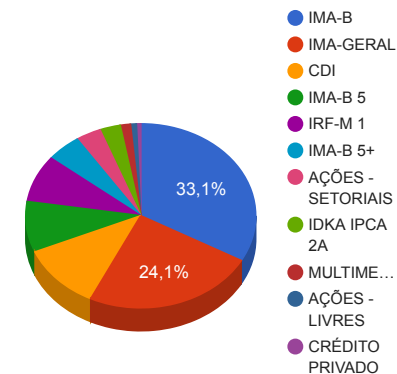
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	6,16%	26,86%	2,84%	21,47%	26,86%	76,25%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	5,35%	20,80%	1,77%	21,07%	20,80%	51,67%	1,00%	6,189%	18,81%
IDIV	4,94%	25,30%	-1,77%	16,88%	25,30%	101,09%	-	-	-
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	5,23%	19,71%	1,25%	14,58%	19,71%	34,53%	1,72%	5,093%	16,92%
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4,92%	23,51%	0,06%	16,87%	23,51%	45,71%	3,00%	4,653%	14,58%
CDI	0,54%	9,93%	1,76%	4,05%	9,93%	25,31%	-	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,81%	12,08%	2,24%	5,49%	12,08%	27,16%	0,60%	0,319%	4,02%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	100.193.012,90	55,42%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	52.226.834,32	28,89%
BANCO DO ESTADO DO ESPÍRITO SANTO	28.379.342,37	15,70%

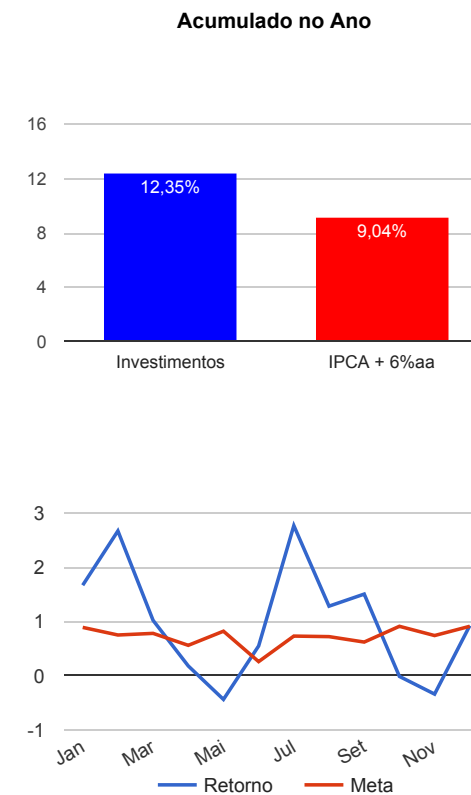


Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	59.833.086,17	33,09%
IMA-GERAL	43.496.307,19	24,06%
CDI	20.641.635,14	11,42%
IMA-B 5	16.096.924,51	8,90%
IRF-M 1	14.978.125,99	8,28%
IMA-B 5+	8.879.857,18	4,91%
AÇÕES - SETORIAIS	6.423.490,33	3,55%
IDKA IPCA 2A	5.254.449,00	2,91%
MULTIMERCADO	2.595.667,60	1,44%
AÇÕES - LIVRES	1.488.688,08	0,82%
CRÉDITO PRIVADO	1.110.958,40	0,61%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	158.582.592,36	2.731.457,30	2.170.283,79	161.795.162,46	2.651.396,59	1,67%	0,89%	186,79%	2,16%
Fevereiro	161.795.162,46	2.890.623,70	2.677.816,77	166.326.227,59	4.318.258,20	2,67%	0,75%	356,13%	1,56%
Março	166.326.227,59	3.185.045,61	2.778.780,72	168.432.074,78	1.699.582,30	1,02%	0,78%	129,92%	1,51%
Abril	167.797.211,99	2.425.235,86	2.220.520,44	168.304.850,89	302.923,48	0,18%	0,56%	32,33%	1,36%
Mai	168.304.850,89	2.272.172,71	2.133.252,13	167.709.737,69	-734.033,78	-0,44%	0,82%	-53,04%	8,11%
Junho	167.709.737,69	2.390.000,00	2.583.858,96	168.435.945,88	920.067,15	0,55%	0,26%	214,60%	1,58%
Julho	168.435.945,88	2.523.937,63	2.341.806,38	173.276.872,38	4.658.795,25	2,76%	0,73%	379,56%	1,51%
Agosto	173.276.872,38	5.184.270,72	6.274.270,72	174.406.253,18	2.219.380,80	1,28%	0,72%	176,85%	1,44%
Setembro	174.406.253,18	3.500.000,00	2.240.000,00	178.306.706,25	2.640.453,07	1,50%	0,62%	240,78%	1,11%
Outubro	178.306.706,25	4.127.075,53	3.655.000,00	178.757.679,31	-21.102,47	-0,01%	0,91%	-1,30%	1,40%
Novembro	178.757.679,31	2.460.933,98	2.300.000,00	178.314.065,24	-604.548,05	-0,34%	0,74%	-45,66%	1,73%
Dezembro	178.314.065,24	2.122.014,68	1.905.000,00	180.177.773,35	1.646.693,43	0,92%	0,91%	101,85%	1,09%
Acumulado no ano					19.697.865,97	12,35%	9,04%	136,57%	



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(%)
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.750.845,73	0,00	0,00	2.774.789,50	23.943,77	0,87%	0,45%	0,87%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.425.714,48	0,00	0,00	2.446.789,33	21.074,85	0,87%	0,67%	0,87%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.617.858,73	0,00	0,00	3.649.278,93	31.420,20	0,87%	0,67%	0,87%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	18.305.621,58	0,00	0,00	18.464.125,07	158.503,49	0,87%	0,70%	0,87%
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	24.817.577,82	0,00	0,00	25.032.182,12	214.604,30	0,86%	0,69%	0,86%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.458.441,04	0,00	0,00	2.479.659,50	21.218,46	0,86%	0,46%	0,86%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.161.442,49	0,00	0,00	3.188.214,44	26.771,95	0,85%	1,41%	0,85%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	13.200.233,20	0,00	0,00	13.308.881,02	108.647,82	0,82%	1,39%	0,82%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.505.508,28	0,00	0,00	8.574.283,48	68.775,20	0,81%	1,42%	0,81%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	17.620.123,50	0,00	0,00	17.762.234,30	142.110,80	0,81%	1,42%	0,81%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.813.479,57	0,00	0,00	8.879.857,18	66.377,61	0,75%	2,06%	0,75%
BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.486.302,62	122.014,68	0,00	2.627.636,86	19.319,56	0,74%	0,21%	0,77%
BANESTES INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	9.141.830,38	0,00	0,00	9.206.065,76	64.235,38	0,70%	2,08%	0,70%
BANESTES FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.747.252,41	0,00	0,00	7.793.407,17	46.154,76	0,60%	2,16%	0,60%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.188.615,75	0,00	0,00	5.218.860,17	30.244,42	0,58%	0,07%	0,58%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.280.755,34	0,00	0,00	12.350.489,13	69.733,79	0,57%	0,03%	0,57%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	8.152.085,85	0,00	0,00	8.194.770,39	42.684,54	0,52%	0,02%	0,52%
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	7.264.411,84	2.000.000,00	2.080.000,00	7.228.004,58	43.592,74	0,47%	0,02%	0,56%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.106.416,00	0,00	0,00	1.110.958,40	4.542,40	0,41%	0,12%	0,41%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.965.884,50	0,00	0,00	10.000.856,25	34.971,75	0,35%	0,13%	0,35%
Total Renda Fixa					1.238.927,79	0,73%	0,91%	

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(%)
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	1.413.031,92	0,00	0,00	1.488.688,08	75.656,16	5,35%	6,19%	5,35%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	4.655.620,25	0,00	0,00	4.899.262,33	243.642,08	5,23%	5,09%	5,23%
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.452.695,13	0,00	0,00	1.524.228,00	71.532,87	4,92%	4,65%	4,92%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	2.574.743,48	0,00	0,00	2.595.667,60	20.924,12	0,81%	0,32%	0,81%
				Total Renda Variável	411.755,23	4,08%	4,01%	

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 (%)
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	26.293.849,69	0,00	1.500.000,00	25.032.182,12	238.332,43	0,95%	0,95%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.133.227,41	0,00	0,00	12.350.489,13	217.261,72	1,79%	1,79%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	18.290.903,11	0,00	0,00	18.464.125,07	173.221,96	0,95%	0,95%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.845.599,50	0,00	0,00	10.000.856,25	155.256,75	1,58%	1,58%
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	7.032.367,15	6.857.000,00	6.815.000,00	7.228.004,58	153.637,43	1,63%	1,84%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	8.054.449,54	0,00	0,00	8.194.770,39	140.320,85	1,74%	1,74%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.124.969,15	0,00	0,00	5.218.860,17	93.891,02	1,83%	1,83%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.598.184,39	0,00	0,00	3.649.278,93	51.094,54	1,42%	1,42%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.724.306,24	0,00	0,00	2.774.789,50	50.483,26	1,85%	1,85%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.433.084,76	0,00	0,00	2.479.659,50	46.574,74	1,91%	1,91%
BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.402.070,08	182.948,66	0,00	2.627.636,86	42.618,12	1,71%	1,75%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.412.416,76	0,00	0,00	2.446.789,33	34.372,57	1,42%	1,42%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.093.954,40	0,00	0,00	1.110.958,40	17.004,00	1,55%	1,55%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.199.665,52	0,00	0,00	3.188.214,44	-11.451,08	-0,36%	-0,36%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.606.604,56	0,00	0,00	8.574.283,48	-32.321,08	-0,38%	-0,38%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	13.350.774,01	0,00	0,00	13.308.881,02	-41.892,99	-0,31%	-0,31%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	17.832.326,78	0,00	0,00	17.762.234,30	-70.092,48	-0,39%	-0,39%
BANESTES INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	9.119.828,86	170.075,53	0,00	9.206.065,76	-83.838,63	-0,90%	-0,88%
BANESTES FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.884.544,93	0,00	0,00	7.793.407,17	-91.137,76	-1,16%	-1,16%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.032.986,73	0,00	0,00	8.879.857,18	-153.129,55	-1,70%	-1,70%
Total Renda Fixa					930.205,82	0,55%	

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 VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	4.838.968,33	0,00	0,00	4.899.262,33	60.294,00	1,25%	1,25%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	2.538.683,72	0,00	0,00	2.595.667,60	56.983,88	2,24%	2,24%
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.523.275,55	0,00	0,00	1.524.228,00	952,45	0,06%	0,06%
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	0,00	1.500.000,00	0,00	1.488.688,08	-11.311,92	-0,75%	1,77%
				Total Renda Variável	106.918,41	1,03%	

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 (%)
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	23.570.531,80	0,00	1.500.000,00	25.032.182,12	2.961.650,32	12,62%	12,62%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	16.400.036,03	0,00	0,00	18.464.125,07	2.064.089,04	12,59%	12,59%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	15.781.670,42	0,00	0,00	17.762.234,30	1.980.563,88	12,55%	12,55%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	11.844.964,09	0,00	0,00	13.308.881,02	1.463.916,93	12,36%	12,36%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	11.133.258,29	0,00	0,00	12.350.489,13	1.217.230,84	10,93%	10,93%
BANESTES INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	8.047.948,20	170.075,53	0,00	9.206.065,76	988.042,03	12,30%	12,32%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.620.227,33	0,00	0,00	8.574.283,48	954.056,15	12,52%	12,52%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.591.804,75	0,00	541.817,63	10.000.856,25	950.869,13	10,20%	4,26%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.118.779,93	820.429,50	0,00	8.879.857,18	940.647,75	12,19%	12,44%
BANESTES FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.964.716,09	0,00	0,00	7.793.407,17	828.691,08	11,90%	11,90%
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	4.975.607,69	28.234.862,79	26.727.677,78	7.228.004,58	745.211,88	9,08%	10,58%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	7.453.861,61	0,00	0,00	8.194.770,39	740.908,78	9,94%	9,94%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.086.311,33	0,00	2.500.000,00	5.218.860,17	632.548,84	9,81%	10,08%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.246.151,52	0,00	0,00	3.649.278,93	403.127,41	12,42%	12,42%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.826.437,56	0,00	0,00	3.188.214,44	361.776,88	12,80%	12,80%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.469.958,43	0,00	0,00	2.774.789,50	304.831,07	12,34%	12,34%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.206.115,54	0,00	0,00	2.479.659,50	273.543,96	12,40%	12,40%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.177.215,21	0,00	0,00	2.446.789,33	269.574,12	12,38%	12,38%
BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.273.180,27	1.182.948,66	0,00	2.627.636,86	171.507,93	11,34%	11,53%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.015.280,80	0,00	0,00	1.110.958,40	95.677,60	9,42%	9,42%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.489,09	1.500.119,67	1.507.808,14	0,00	1.199,38	1,35%	8,87%
Total Renda Fixa					18.349.665,00	11,93%	

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 VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	3.617.974,43	534.270,72	113.934,07	4.899.262,33	860.951,25	22,42%	19,71%
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.086.486,77	0,00	1.000.000,00	1.524.228,00	437.741,23	23,51%	23,51%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,00	2.500.000,00	0,00	2.595.667,60	95.667,60	3,83%	12,08%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	67.585,18	170.060,85	262.352,29	0,00	24.706,26	12,14%	23,73%
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	0,00	1.500.000,00	0,00	1.488.688,08	-11.311,92	-0,75%	20,80%
				Total Renda Variável	1.407.754,42	20,85%	