

Relatório Analítico dos Investimentos em outubro 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 (outubro / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
TÍTULOS PÚBLICOS			118.209.935,95	11,75%			Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	6.372.969,39	0,63%	6	13,63%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	10.257.039,33	1,02%	23	2,55%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	3.538.508,29	0,35%	107	0,37%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	16.655.802,88	1,66%	167	1,45%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2030	13.064.228,02	1,30%	26	5,25%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	4.212.550,07	0,42%	223	0,13%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	11.359.316,64	1,13%	347	0,56%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	40.686.460,22	4,05%	35	7,51%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	135.659.634,58	13,49%	780	2,56%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	5.766.913,17	0,57%	60	5,74%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	10.062.287,41	1,00%	437	0,53%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	12.594.018,20	1,25%	72	1,27%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	834.504,92	0,08%	193	0,23%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	10.026.931,82	1,00%	12	8,64%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	26.031.344,62	2,59%	62	1,71%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	13.329.322,55	1,33%	70	0,75%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	6.488.417,28	0,65%	11	7,14%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	72.369.513,45	7,19%	350	6,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	6.955.704,79	0,69%	274	0,53%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.866.299,44	0,78%	330	0,29%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	52.315.111,72	5,20%	262	4,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "

Carteira consolidada de investimentos - base (outubro / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	D+5	Não há	8.707.907,87	0,87%	76	1,55%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	31.420.198,56	3,12%	699	0,82%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	700.498,39	0,07%	639	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SUL AMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	D+2	Não há	54.884.581,35	5,46%	2.950	13,14%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	149.063.768,68	14,82%	103	10,25%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
GÁVEA SUL FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1 LP	Não se aplica	Não se aplica	1.679.619,79	0,17%	17	5,20%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
SILVERADO MAXIMUM II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	Não se aplica	Não se aplica	94.430,30	0,01%			Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
SUL INVEST FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 6	Não se aplica	Não se aplica	905.295,56	0,09%	22	1,16%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
HSBC NILO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	D+4	Não há	24.275.124,59	2,41%	9	4,87%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BRADESCO H REGIMES DE PREVIDÊNCIA IBOVESPA FIC AÇÕES	D+5	Não há	13.683.291,25	1,36%	10	15,41%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	10.033.876,13	1,00%	2.884	4,67%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	6.157.643,61	0,61%	2.939	1,65%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	10.276.393,87	1,02%	39	1,77%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	D+13	Não há	5.688.438,07	0,57%	495	6,90%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
APEX AÇÕES 30 FIC AÇÕES	D+4 ou D+33	Não há	7.986.852,45	0,79%	221	3,42%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
KONDOR EQUITIES INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+33	Não há	13.321.238,24	1,32%	563	6,82%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
AZ LEGAN BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	8.890.123,68	0,88%	73	9,20%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.960.207,20	0,29%	7.099	0,78%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
SUL AMÉRICA CRÉDITO ATIVO FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+30	Não há	4.122.191,95	0,41%	307	0,87%	Artigo 8º, Inciso III
SUL AMÉRICA HIGH YIELD FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+361	2 anos	4.194.508,07	0,42%	10	11,37%	Artigo 8º, Inciso III
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+180	Não há	1.271.941,32	0,13%	21	0,91%	Artigo 8º, Inciso III
XP LONG SHORT FIC MULTIMERCADO	D+2 ou D+16	Não há	3.440.111,92	0,34%	4.298	0,77%	Artigo 8º, Inciso III

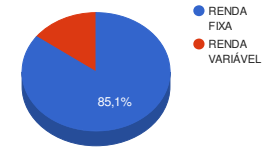
Carteira consolidada de investimentos - base (outubro / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	D+5	Não há	7.082.388,23	0,70%	32	3,19%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	14.321.990,48	1,42%	6.041	2,48%	Artigo 8º, Inciso III
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	4.934.859,01	0,49%	55	5,93%	Artigo 8º, Inciso III
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	5.256.367,18	0,52%	1.110	0,45%	Artigo 8º, Inciso III
LSH FIP	Não se aplica	Não se aplica	4.636.000,54	0,46%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	4.886.149,69	0,49%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	840.999,57	0,08%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
RIO BRAVO ENERGIA I FIP	Não se aplica	Não se aplica	119.713,50	0,01%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS12	S/Info	Não se aplica	7.632.967,37	0,76%		11,81%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
MÉRITO DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - MFII11	Não se aplica	Não se aplica	6.317.186,40	0,63%		7,37%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
REAG RENDA IMOBILIÁRIA FII - DOMC11	Não se aplica	Não se aplica	1.400.000,00	0,14%		1,14%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
		TOTAL -	1.005.843.679,56				

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

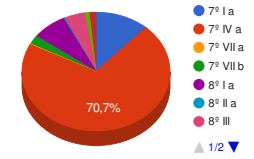
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	118.209.935,95	11,75%	8,00%	10,00%	15,00%	32.666.615,98
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	0,00	0,00%	39,00%	40,00%	60,00%	603.506.207,74
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	8,00%	10,00%	30,00%	301.753.103,87
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	711.223.833,64	70,71%	5,00%	6,50%	30,00%	-409.470.729,77
Artigo 7º, Inciso VI	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,50%	10,00%	100.584.367,96
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	2.679.345,65	0,27%	0,00%	5,00%	5,00%	47.612.838,33
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	24.275.124,59	2,41%	0,00%	5,00%	5,00%	26.017.059,39
Total Renda Fixa	100,00%	856.388.239,83	85,14%	60,00	80,00	155,00	-

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso I	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	10,00%	100.584.367,96
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	76.037.857,30	7,56%	0,00%	0,00%	0,00%	-76.037.857,30
Artigo 8º, Inciso II	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	5,00%	50.292.183,98
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	2.960.207,20	0,29%	0,00%	0,00%	0,00%	-2.960.207,20
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	44.624.358,16	4,44%	1,00%	3,00%	10,00%	55.960.009,80
Artigo 8º, Inciso IV	0,00%	0,00	0,00%	3,00%	5,00%	5,00%	50.292.183,98
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	10.482.863,30	1,04%	0,00%	0,00%	0,00%	-10.482.863,30
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	15.350.153,77	1,53%	0,00%	0,00%	0,00%	-15.350.153,77
Artigo 8º, Inciso V	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	5,00%	50.292.183,98
Artigo 8º, Inciso VI	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	5,00%	50.292.183,98
Total Renda Variável	30,00%	149.455.439,73	14,86%	6,00	19,50	40,00	-

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: outubro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	118.209.935,95	11,75%	8,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	0,00	0,00%	39,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	8,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	711.223.833,64	70,71%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	2.679.345,65	0,27%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	24.275.124,59	2,41%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	856.388.239,83	85,14%	60,00	155,00

Artigos - Renda Variável	Base: outubro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I	0,00	0,00%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	76.037.857,30	7,56%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	2.960.207,20	0,29%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso III	44.624.358,16	4,44%	1,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV	0,00	0,00%	3,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	10.482.863,30	1,04%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	15.350.153,77	1,53%	0,00%	0,00%
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	149.455.439,73	14,86%	6,00	40,00

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA + 7,50% ao ano	1,03%	8,53%	2,64%	4,88%	10,37%	27,96%	-	-	-
SUL INVEST FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 6	1,12%	-4,46%	-9,54%	-7,71%	-2,86%	-2,27%	0,18%	0,122%	-
135% do CDI	0,87%	11,95%	2,84%	6,40%	15,24%	37,64%	-	-	-
GÁVEA SUL FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1 LP	-5,85%	-34,68%	-15,30%	-25,51%	-32,76%	-19,68%	0,40%	10,970%	-
130% do CDI	0,84%	11,48%	2,73%	6,16%	14,64%	36,02%	-	-	-
SILVERADO MAXIMUM II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	2,50%	-	-
IDKA IPCA 2 Anos	0,80%	12,02%	2,70%	6,61%	14,10%	31,77%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,00%	9,57%	2,20%	5,20%	11,55%	27,34%	0,20%	0,368%	1,85%
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,90%	8,26%	2,53%	3,08%	6,92%	-	0,20%	0,464%	5,07%
CDI	0,64%	8,72%	2,10%	4,70%	11,08%	26,70%	-	-	-
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	0,71%	10,07%	2,31%	5,13%	12,79%	30,45%	0,75%	0,187%	9,10%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,63%	8,70%	2,10%	4,64%	11,03%	26,63%	0,20%	0,029%	0,17%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,56%	7,86%	1,83%	4,15%	10,07%	24,57%	1,00%	0,010%	0,12%
IMA-B 5	0,48%	11,48%	2,77%	6,34%	13,48%	32,18%	-	-	-
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	0,46%	11,29%	2,72%	6,21%	13,27%	31,66%	0,10%	0,902%	3,64%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,46%	11,35%	2,71%	6,28%	13,30%	31,71%	0,20%	0,903%	3,65%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	0,45%	11,11%	2,66%	6,12%	13,04%	31,14%	0,40%	0,900%	3,64%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	0,20%	13,07%	2,59%	6,70%	14,63%	36,77%	0,40%	1,273%	5,17%
IPCA	0,42%	2,21%	0,77%	1,09%	2,70%	10,79%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	0,04%	11,82%	2,74%	5,18%	-	-	0,40%	1,206%	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,04%	11,84%	2,74%	5,18%	13,95%	38,31%	0,40%	1,207%	6,19%
IRF-M	0,10%	13,68%	2,66%	6,77%	16,15%	42,35%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,08%	13,44%	2,59%	6,60%	15,82%	41,81%	0,20%	1,104%	4,83%
IMA-B 5+	-1,01%	13,46%	2,74%	5,58%	15,27%	52,38%	-	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,99%	12,95%	2,66%	5,31%	14,65%	51,23%	0,20%	2,512%	12,74%
IMA-B	-0,38%	12,73%	2,78%	5,80%	14,59%	44,31%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,01%	3,68%	-0,56%	2,37%	5,50%	15,35%	0,20%	0,373%	4,39%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,67%	11,25%	2,56%	5,97%	13,17%	31,67%	0,20%	0,676%	3,52%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,61%	6,35%	0,09%	3,68%	8,11%	22,15%	0,20%	0,741%	5,86%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,11%	7,66%	0,41%	4,01%	9,32%	29,25%	0,20%	1,827%	8,51%
SUL AMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	-0,19%	15,13%	3,32%	8,16%	17,15%	48,63%	0,40%	1,825%	9,48%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	-0,39%	12,27%	2,77%	5,74%	14,09%	42,80%	0,20%	1,745%	9,32%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,41%	12,53%	2,73%	5,69%	14,41%	43,66%	0,20%	1,825%	9,75%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA	-0,42%	12,29%	2,66%	5,54%	14,05%	42,93%	0,40%	1,824%	9,73%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	-0,42%	12,93%	2,81%	5,87%	14,85%	44,26%	0,20%	1,855%	9,91%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,43%	12,72%	2,76%	5,75%	14,57%	43,84%	0,30%	1,830%	9,76%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	-0,54%	12,26%	2,69%	5,40%	13,89%	41,07%	0,45%	1,957%	10,12%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,63%	6,54%	0,17%	3,02%	8,23%	33,15%	0,20%	2,217%	12,10%
HSBC NILO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	-0,71%	14,51%	3,56%	6,35%	16,43%	49,23%	0,30%	2,111%	11,42%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,14%	7,23%	0,49%	4,07%	9,10%	26,58%	0,15%	1,336%	7,05%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
S&P 500	2,22%	15,03%	4,25%	8,01%	21,12%	23,85%	-	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	2,74%	23,19%	5,99%	12,40%	32,80%	53,79%	1,00%	2,245%	6,86%
IPCA + 8,00% ao ano	1,07%	8,95%	2,76%	5,12%	10,88%	29,14%	-	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	-	-	-	-	-	-	2,00%	-	-
CDI	0,64%	8,72%	2,10%	4,70%	11,08%	26,70%	-	-	-
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	0,80%	6,54%	0,43%	2,69%	8,79%	24,92%	0,55%	0,385%	1,92%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	0,76%	8,10%	2,62%	3,85%	10,76%	30,18%	2,00%	0,791%	1,67%
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	0,72%	9,61%	2,52%	5,22%	11,66%	28,89%	0,50%	0,474%	1,63%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	0,71%	10,38%	2,41%	5,26%	13,26%	32,54%	1,00%	0,158%	9,42%
SUL AMÉRICA CRÉDITO ATIVO FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	0,64%	9,84%	2,20%	5,25%	12,55%	28,18%	0,60%	0,036%	0,48%
XP LONG SHORT FIC MULTIMERCADO	0,24%	3,84%	1,22%	4,71%	5,14%	35,25%	2,00%	1,992%	4,44%
IPCA	0,42%	2,21%	0,77%	1,09%	2,70%	10,79%	-	-	-
SUL AMÉRICA HIGH YIELD FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	0,57%	10,97%	2,43%	5,62%	13,32%	21,47%	1,50%	0,280%	1,74%
IDIV	0,29%	27,92%	13,84%	11,16%	23,99%	82,58%	-	-	-
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	-3,85%	19,33%	1,78%	11,16%	9,08%	69,65%	3,00%	4,923%	18,57%
IFIX	0,23%	19,43%	7,76%	9,40%	18,10%	55,68%	-	-	-
REAG RENDA IMOBILIÁRIA FII - DOMC11	-6,67%	44,63%	70,73%	55,04%	29,62%	42,28%	0,95%	48,606%	88,07%

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

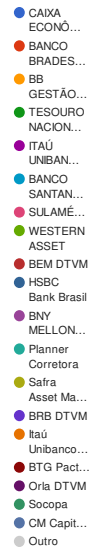
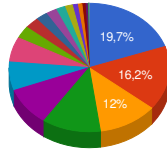
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS12	-	-100,00%	-	-100,00%	-100,00%	-100,00%	0,14%	-	-
Ibovespa	0,02%	23,38%	12,73%	13,62%	14,45%	62,01%	-	-	-
KONDOR EQUITIES INSTITUCIONAL FI AÇÕES	1,58%	26,04%	15,72%	16,44%	18,20%	84,31%	1,50%	6,696%	20,46%
APEX AÇÕES 30 FIC AÇÕES	-0,64%	22,89%	13,92%	13,80%	14,33%	54,23%	1,90%	8,007%	20,83%
BRADESCO H REGIMES DE PREVIDÊNCIA IBOVESPA FIC AÇÕES	-0,66%	20,75%	9,67%	10,79%	11,34%	45,32%	1,00%	6,867%	17,77%
AZ LEGAN BRASIL FI AÇÕES	-0,80%	19,48%	9,79%	11,26%	13,30%	49,13%	2,00%	7,067%	17,68%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	-0,85%	24,16%	11,00%	12,64%	14,87%	55,86%	1,50%	7,279%	18,35%
SMLL	-1,48%	43,01%	10,90%	19,12%	30,25%	74,95%	-	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	0,19%	39,76%	15,01%	20,49%	30,64%	62,59%	2,00%	8,697%	20,70%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	-1,27%	42,74%	12,11%	19,73%	30,60%	69,26%	1,50%	7,565%	19,56%
IBX	-0,13%	24,13%	12,24%	13,79%	14,91%	60,54%	-	-	-
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	-1,12%	19,54%	8,44%	10,51%	10,04%	42,60%	2,00%	5,952%	14,86%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
MÉRITO DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - MFII11	9,05%	23,52%	5,11%	14,26%	24,67%	28,55%	0,15%	5,939%	14,80%
RIO BRAVO ENERGIA I FIP	-	-	-	-	-	-	1,65%	-	-
LSH FIP	-	-	-	-	-	-	0,08%	-	-

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

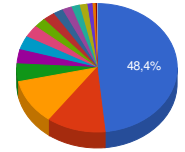
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,50%	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	197.992.115,21	19,68%
BANCO BRADESCO	162.747.059,93	16,18%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	120.241.137,90	11,95%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	118.209.935,95	11,75%
ITAÚ UNIBANCO	96.811.938,54	9,62%
BANCO SANTANDER	72.369.513,45	7,19%
SULAMÉRICA INVESTIMENTOS	63.201.281,37	6,28%
WESTERN ASSET	31.431.310,53	3,12%
BEM DTVM	27.899.799,99	2,77%
HSBC Bank Brasil	24.275.124,59	2,41%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	21.816.756,50	2,17%
Planner Corretora	18.836.303,46	1,87%
Safra Asset Management	15.513.406,51	1,54%
BRB DTVM	10.701.772,18	1,06%
Itaú Unibanco S.A.	8.707.907,87	0,87%
BTG Pactual Serviços Financeiros	6.372.969,39	0,63%
Orla DTVM	4.636.000,54	0,46%
Socopa	2.584.915,35	0,26%
CM Capital Markets DTVM	1.400.000,00	0,14%
Gradual Investimentos	94.430,30	0,01%



Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	486.355.685,79	48,35%
TÍTULOS PÚBLICOS	118.209.935,95	11,75%
IMA-B 5	114.836.142,82	11,42%
MULTIMERCADO	44.624.358,16	4,44%
AÇÕES - LIVRES	35.886.652,44	3,57%
GESTÃO DURATION	34.739.252,49	3,45%
IRF-M	31.420.198,56	3,12%
CRÉDITO PRIVADO	24.275.124,59	2,41%
AÇÕES - INDEXADO	23.959.685,12	2,38%
IMA-B 5+	20.019.932,81	1,99%
AÇÕES - SETORIAIS	19.151.726,94	1,90%
CDI	16.529.698,97	1,64%
FUNDO IMOBILIÁRIO	15.350.153,77	1,53%
FIP	10.482.863,30	1,04%
IDKA IPCA 3A	6.488.417,28	0,65%
FIDC - FECHADO	2.679.345,65	0,27%
IDKA IPCA 2A	834.504,92	0,08%

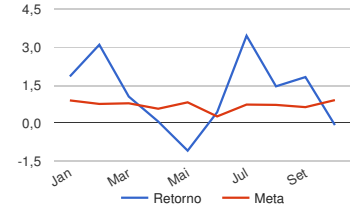
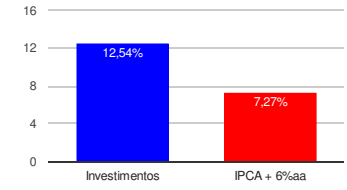


Carteira de Títulos Públicos - base (outubro / 2017)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde.	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	GAP (Atual - Pago)
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2017	21/11/2016	1362	2.936,992217	0,000000	4.000.183,40	0,00	-4.000.183,40
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2019	25/08/2015	7659	2.636,195170	3.241,737077	20.190.618,81	24.828.464,27	4.637.845,47
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2021	17/08/2016	4750	2.964,257204	3.278,814078	14.080.221,72	15.574.366,87	1.494.145,15
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2023	03/09/2015	6730	2.515,509771	3.291,245512	16.929.380,76	22.150.082,30	5.220.701,54
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	14/03/2014	6185	2.315,991673	3.277,066615	14.324.408,50	20.268.657,01	5.944.248,52
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2026	27/04/2016	2200	2.838,144079	3.275,799025	6.243.916,97	7.206.757,86	962.840,88
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	21/12/2015	8310	2.412,107871	3.391,288525	20.044.616,41	28.181.607,64	8.136.991,23

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
SUL INVEST FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 6	895.278,72	0,00	0,00	905.295,56	10.016,84	1,12%	0,12%	1,12%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.170.506,24	0,00	0,00	4.212.550,07	42.043,83	1,01%	0,37%	1,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	826.229,45	0,00	0,00	834.504,92	8.275,47	1,00%	0,37%	1,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.430.468,14	0,00	0,00	6.488.417,28	57.949,14	0,90%	0,46%	0,90%
GÁVEA SUL FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1 LP	1.784.019,18	0,00	119.184,17	1.679.619,79	14.784,78	0,83%	10,97%	-5,85%
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	5.726.506,21	0,00	0,00	5.766.913,17	40.406,96	0,71%	0,19%	0,71%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	16.545.235,52	0,00	0,00	16.655.802,88	110.567,36	0,67%	0,68%	0,67%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.517.063,45	0,00	0,00	3.538.508,29	21.444,84	0,61%	0,74%	0,61%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	72.034.712,11	0,00	0,00	72.369.513,45	334.801,34	0,46%	0,90%	0,46%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	11.307.509,78	0,00	0,00	11.359.316,64	51.806,86	0,46%	0,90%	0,46%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	13.269.502,91	0,00	0,00	13.329.322,55	59.819,64	0,45%	0,90%	0,45%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	12.552.819,27	18.468.273,78	21.046.900,18	10.062.287,41	88.094,54	0,28%	0,03%	0,63%
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	3.351.879,12	0,00	3.360.133,87	0,00	8.254,75	0,25%	0,01%	0,65%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.647.100,24	2.635.888,47	4.594.920,88	700.498,39	12.430,56	0,24%	0,01%	0,56%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	10.006.441,72	0,00	0,00	10.026.931,82	20.490,10	0,20%	1,27%	0,20%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.364.261,90	0,00	0,00	6.372.969,39	8.707,49	0,14%	1,34%	0,14%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	28.766.708,83	2.628.484,43	0,00	31.420.198,56	25.005,30	0,08%	1,10%	0,08%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	8.704.624,19	0,00	0,00	8.707.907,87	3.283,68	0,04%	1,21%	0,04%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	26.021.690,55	0,00	0,00	26.031.344,62	9.654,07	0,04%	1,21%	0,04%
TÍTULOS PÚBLICOS	118.266.326,04	0,00	0,00	118.209.935,95	-56.390,09	-0,05%	-	-
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.607.565,02	0,00	0,00	12.594.018,20	-13.546,82	-0,11%	1,83%	-0,11%
SUL AMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	54.987.711,44	0,00	0,00	54.884.581,35	-103.130,09	-0,19%	1,83%	-0,19%

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	7.897.388,70	0,00	0,00	7.866.299,44	-31.089,26	-0,39%	1,74%	-0,39%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	136.221.585,95	0,00	0,00	135.659.634,58	-561.951,37	-0,41%	1,83%	-0,41%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA	40.857.154,04	0,00	0,00	40.686.460,22	-170.693,82	-0,42%	1,82%	-0,42%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	149.689.556,43	0,00	0,00	149.063.768,68	-625.787,75	-0,42%	1,85%	-0,42%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	52.541.081,52	0,00	0,00	52.315.111,72	-225.969,80	-0,43%	1,83%	-0,43%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	10.312.235,16	0,00	0,00	10.257.039,33	-55.195,83	-0,54%	1,96%	-0,54%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	13.146.696,10	0,00	0,00	13.064.228,02	-82.468,08	-0,63%	2,22%	-0,63%
HSBC NILO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	24.448.024,13	0,00	0,00	24.275.124,59	-172.899,54	-0,71%	2,11%	-0,71%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.025.443,01	0,00	0,00	6.955.704,79	-69.738,22	-0,99%	2,51%	-0,99%
SILVERADO MAXIMUM II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	98.715,48	0,00	0,00	94.430,30	-4.285,18	-4,34%	-	-
				Total Renda Fixa	-1.245.308,30	-0,14%	1,59%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
MÉRITO DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - MFI11	5.793.158,00	0,00	0,00	6.317.186,40	524.028,40	9,05%	5,94%	9,05%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	13.939.687,24	0,00	0,00	14.321.990,48	382.303,24	2,74%	2,25%	2,74%
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.261.863,84	0,00	0,00	1.271.941,32	10.077,48	0,80%	0,39%	0,80%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	7.028.712,52	0,00	0,00	7.082.388,23	53.675,71	0,76%	0,79%	0,76%
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	5.218.844,37	0,00	0,00	5.256.367,18	37.522,81	0,72%	0,47%	0,72%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	4.900.095,42	0,00	0,00	4.934.859,01	34.763,59	0,71%	0,16%	0,71%
KONDOR EQUITIES INSTITUCIONAL FI AÇÕES	10.235.260,35	3.000.000,00	0,00	13.321.238,24	85.977,89	0,85%	6,70%	1,58%
SUL AMÉRICA CRÉDITO ATIVO FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	4.095.957,07	0,00	0,00	4.122.191,95	26.234,88	0,64%	0,04%	0,64%
SUL AMÉRICA HIGH YIELD FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	4.170.752,32	0,00	0,00	4.194.508,07	23.755,75	0,57%	0,28%	0,57%
XP LONG SHORT FIC MULTIMERCADO	3.431.723,27	0,00	0,00	3.440.111,92	8.388,65	0,24%	1,99%	0,24%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	6.146.190,98	0,00	0,00	6.157.643,61	11.452,63	0,19%	8,70%	0,19%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS12	7.625.900,09	0,00	0,00	7.632.967,37	7.067,28	0,09%	-	0,00%
RIO BRAVO ENERGIA I FIP	119.715,81	0,00	0,00	119.713,50	-2,31	0,00%	-	-
LSH FIP	4.636.996,87	0,00	0,00	4.636.000,54	-996,33	-0,02%	-	-
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	4.889.519,47	0,00	0,00	4.886.149,69	-3.369,78	-0,07%	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	845.791,95	0,00	0,00	840.999,57	-4.792,38	-0,57%	-	-
APEX AÇÕES 30 FIC AÇÕES	8.038.454,22	0,00	0,00	7.986.852,45	-51.601,77	-0,64%	8,01%	-0,64%
BRDESCO H REGIMES DE PREVIDÊNCIA IBOVESPA FIC AÇÕES	13.773.571,37	0,00	0,00	13.683.291,25	-90.280,12	-0,66%	6,87%	-0,66%
AZ LEGAN BRASIL FI AÇÕES	8.961.759,31	0,00	0,00	8.890.123,68	-71.635,63	-0,80%	7,07%	-0,80%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	10.364.666,03	0,00	0,00	10.276.393,87	-88.272,16	-0,85%	7,28%	-0,85%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	5.752.609,04	0,00	0,00	5.688.438,07	-64.170,97	-1,12%	5,95%	-1,12%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	7.232.814,61	3.000.000,00	0,00	10.033.876,13	-198.938,48	-1,94%	7,56%	-1,27%

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	3.078.844,43	0,00	0,00	2.960.207,20	-118.637,23	-3,85%	4,92%	-3,85%
REAG RENDA IMOBILIÁRIA FII - DOMC11	1.500.000,00	0,00	0,00	1.400.000,00	-100.000,00	-6,67%	48,61%	-6,67%
				Total Renda Variável	412.551,15	0,28%	5,47%	

