

Relatório Analítico dos Investimentos em janeiro de 2018



Carteira consolidada de investimentos - base (janeiro / 2018)

| Produto / Fundo | Disponibilidade Resgate | Carência | Saldo | Particip. S/ Total | Qtde. Cotistas | % S/ PL Fundo | RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604 |
|---|-------------------------|------------|----------------|--------------------|----------------|---------------|------------------------------------|
| TÍTULOS PÚBLICOS | | | 119.314.454,26 | 11,27% | | | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a " |
| CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | D+0 | 15/08/2024 | 12.943.172,37 | 1,22% | 72 | 1,27% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | D+0 | 15/08/2030 | 13.614.141,48 | 1,29% | 26 | 5,25% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+1 | Não há | 76.235.175,31 | 7,20% | 685 | 1,61% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+2 | Não há | 7.246.925,46 | 0,68% | 228 | 0,73% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | D+0 | 15/08/2024 | 6.535.037,08 | 0,62% | 6 | 13,63% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | D+0 | Não há | 102.854.112,20 | 9,72% | 734 | 2,42% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| SAFRA IMA FIC RENDA FIXA | D+4 | Não há | 10.605.649,89 | 1,00% | 22 | 3,04% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | D+1 | 15/05/2019 | 6.438.393,11 | 0,61% | 11 | 7,14% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+0 | 15/08/2018 | 847.931,54 | 0,08% | 193 | 0,23% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA | D+1 | Não há | 10.281.368,41 | 0,97% | 15 | 6,65% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA | D+1 | Não há | 38.205.678,69 | 3,61% | 67 | 2,18% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP | D+2 | Não há | 56.816.817,81 | 5,37% | 2.651 | 12,96% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | D+0 | 15/08/2018 | 4.280.555,47 | 0,40% | 223 | 0,13% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP | D+1 | Não há | 11.618.563,71 | 1,10% | 355 | 0,53% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | D+0 | 16/08/2020 | 3.609.943,11 | 0,34% | 107 | 0,37% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+0 | 15/08/2022 | 16.985.356,76 | 1,60% | 167 | 1,45% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA | D+1 | Não há | 74.040.042,36 | 6,99% | 346 | 5,98% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | D+0 | Não há | 36.569.450,21 | 3,45% | 625 | 0,82% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA | D+1 | Não há | 5.878.250,40 | 0,56% | 61 | 5,50% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA | D+5 | Não há | 39.927.654,82 | 3,77% | 90 | 4,43% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP | D+0 | Não há | 8.123.417,20 | 0,77% | 310 | 0,32% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |

Carteira consolidada de investimentos - base (janeiro / 2018)

| Produto / Fundo | Disponibilidade Resgate | Carência | Saldo | Particip. S/ Total | Qtde. Cotistas | % S/ PL Fundo | RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604 |
|--|-------------------------|---------------|----------------|--------------------|----------------|---------------|-------------------------------------|
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | D+1 | Não há | 12.609.154,29 | 1,19% | 63 | 0,86% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA | D+1 | Não há | 154.152.787,01 | 14,56% | 101 | 10,66% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI | D+0 | Não há | 1.201.557,29 | 0,11% | 689 | 0,02% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+0 | Não há | 1.923.961,24 | 0,18% | 648 | 0,15% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | D+0 | Não há | 30.457.672,96 | 2,88% | 425 | 1,52% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| SILVERADO MAXIMUM II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2 | Não se aplica | Não se aplica | 90.496,95 | 0,01% | 127 | 2,50% | Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a " |
| SUL INVEST FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 6 | Não se aplica | Não se aplica | 931.348,04 | 0,09% | 22 | 1,16% | Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a " |
| GÁVEA SUL FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1 LP | Não se aplica | Não se aplica | 1.350.074,85 | 0,13% | 18 | 5,20% | Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a " |
| HSBC NILO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP | D+4 | Não há | 25.260.830,86 | 2,39% | 9 | 5,17% | Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b " |
| ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES | D+5 | Não há | 17.562.133,36 | 1,66% | 50 | 2,22% | Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a " |
| CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES | D+4 | Não há | 10.957.743,12 | 1,04% | 3.983 | 3,38% | Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a " |
| BRADESCO H REGIMES DE PREVIDÊNCIA IBOVESPA FIC AÇÕES | D+5 | Não há | 15.234.005,11 | 1,44% | 11 | 14,39% | Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a " |
| XP DIVIDENDOS FI AÇÕES | D+4 | Não há | 3.244.581,97 | 0,31% | 6.316 | 0,84% | Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a " |
| KONDOR EQUITIES INSTITUCIONAL FI AÇÕES | D+33 | Não há | 21.310.968,38 | 2,01% | 570 | 8,41% | Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a " |
| AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES | D+30 | Não há | 6.779.064,85 | 0,64% | 3.921 | 1,37% | Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a " |
| AZ LEGAN BRASIL FI AÇÕES | D+4 | Não há | 13.219.974,62 | 1,25% | 72 | 12,12% | Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a " |
| SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO | D+1 | Não há | 5.392.863,34 | 0,51% | 1.639 | 0,29% | Artigo 8º, Inciso III |
| CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO | D+30 ou D+180 | Não há | 1.251.987,86 | 0,12% | 14 | 0,97% | Artigo 8º, Inciso III |
| WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO | D+1 | Não há | 24.906.075,52 | 2,35% | 13.704 | 1,82% | Artigo 8º, Inciso III |
| WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO | D+5 | Não há | 7.198.391,72 | 0,68% | 36 | 3,20% | Artigo 8º, Inciso III |
| SULAMÉRICA HIGH YIELD FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO | D+361 | 2 anos | 4.288.341,94 | 0,41% | 9 | 12,59% | Artigo 8º, Inciso III |
| INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO | D+1 | Não há | 5.022.649,02 | 0,47% | 60 | 5,05% | Artigo 8º, Inciso III |

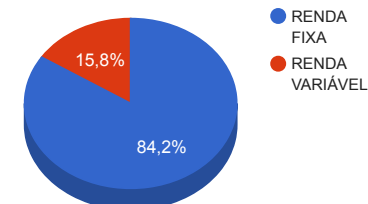
Carteira consolidada de investimentos - base (janeiro / 2018)

| Produto / Fundo | Disponibilidade Resgate | Carência | Saldo | Particip. S/ Total | Qtde. Cotistas | % S/ PL Fundo | RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604 |
|--|-------------------------|---------------|-------------------------|--------------------|----------------|---------------|------------------------------------|
| BRASIL ENERGIA RENOVÁVEL MULTIESTRATÉGIA FIP | Não se aplica | Não se aplica | 472.607,55 | 0,04% | | | Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a " |
| BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP | Não se aplica | Não se aplica | 901.355,93 | 0,09% | | | Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a " |
| W7 MULTIESTRATÉGIA FIP | Não se aplica | Não se aplica | 5.491.168,98 | 0,52% | | | Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a " |
| LSH FIP | Não se aplica | Não se aplica | 4.632.784,58 | 0,44% | | | Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a " |
| MÉRITO DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - MFII11 | Não se aplica | Não se aplica | 6.861.406,72 | 0,65% | | 7,37% | Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b " |
| REAG RENDA IMOBILIÁRIA FII - DOMC11 | Não se aplica | Não se aplica | 1.120.000,00 | 0,11% | | 1,14% | Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b " |
| VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11 | S/Info | Não se aplica | 7.653.305,58 | 0,72% | | 27,41% | Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b " |
| SUL AMÉRICA CRÉDITO ATIVO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP | D+30 | Não há | 4.191.544,51 | 0,40% | 340 | 0,84% | Desenquadrado - RV |
| TOTAL - | | | 1.058.642.929,80 | | | | |

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (janeiro / 2018)

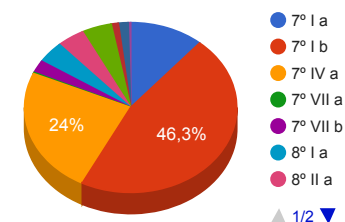
| Artigos - Renda Fixa | Resolução % | Carteira \$ | Carteira % | Estratégia de Alocação | | | GAP Superior |
|-------------------------------------|----------------|-----------------------|---------------|------------------------|--------------|---------------|-----------------|
| | | | | Inferior % | Alvo % | Superior % | |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a " | 100,00% | 119.314.454,26 | 11,27% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | -119.314.454,26 |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " | 100,00% | 489.728.314,97 | 46,26% | 15,00% | 25,00% | 70,00% | 251.321.735,89 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a " | 60,00% | 0,00 | 0,00% | 5,00% | 10,00% | 60,00% | 635.185.757,88 |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " | 40,00% | 254.274.455,21 | 24,02% | 5,00% | 10,00% | 30,00% | 63.318.423,73 |
| Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a " | 15,00% | 0,00 | 0,00% | 7,00% | 15,00% | 15,00% | 158.796.439,47 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a " | 5,00% | 2.371.919,84 | 0,22% | 2,00% | 5,00% | 5,00% | 50.560.226,65 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b " | 5,00% | 25.260.830,86 | 2,39% | 2,00% | 5,00% | 5,00% | 27.671.315,63 |
| Total Renda Fixa | 100,00% | 890.949.975,14 | 84,16% | 36,00 | 70,00 | 190,00 | - |

Distribuição por Segmento



| Artigos - Renda Variável | Resolução % | Carteira \$ | Carteira % | Estratégia de Alocação | | | GAP Superior |
|------------------------------------|---------------|-----------------------|---------------|------------------------|--------------|--------------|---------------|
| | | | | Inferior % | Alvo % | Superior % | |
| Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a " | 30,00% | 43.753.881,59 | 4,13% | 2,00% | 5,00% | 10,00% | 62.110.411,39 |
| Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a " | 20,00% | 44.554.589,82 | 4,21% | 2,00% | 5,00% | 10,00% | 61.309.703,16 |
| Artigo 8º, Inciso III | 10,00% | 48.060.309,40 | 4,54% | 7,00% | 10,00% | 10,00% | 57.803.983,58 |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a " | 5,00% | 11.497.917,04 | 1,09% | 2,00% | 5,00% | 5,00% | 41.434.229,45 |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b " | 5,00% | 15.634.712,30 | 1,48% | 2,00% | 5,00% | 5,00% | 37.297.434,19 |
| Desenquadrado - RV | 0,00% | 4.191.544,51 | 0,40% | 0,00% | 0,00% | 0,00% | -4.191.544,51 |
| Total Renda Variável | 30,00% | 167.692.954,66 | 15,84% | 15,00 | 30,00 | 40,00 | - |

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

| Artigos - Renda Fixa | Base: janeiro / 2018 | | Limite Inferior (%) | Limite Superior (%) |
|-------------------------------------|-----------------------|---------------|---------------------|---------------------|
| | Carteira (\$) | Carteira (%) | | |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a " | 119.314.454,26 | 11,27% | 0,00% | 0,00% |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " | 489.728.314,97 | 46,26% | 15,00% | 70,00% |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a " | 0,00 | 0,00% | 5,00% | 60,00% |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " | 254.274.455,21 | 24,02% | 5,00% | 30,00% |
| Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a " | 0,00 | 0,00% | 7,00% | 15,00% |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a " | 2.371.919,84 | 0,22% | 2,00% | 5,00% |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b " | 25.260.830,86 | 2,39% | 2,00% | 5,00% |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c " | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 5,00% |
| Total Renda Fixa | 890.949.975,14 | 84,16% | 36,00 | 190,00 |

| Artigos - Renda Variável | Base: janeiro / 2018 | | Limite Inferior (%) | Limite Superior (%) |
|------------------------------------|-----------------------|---------------|---------------------|---------------------|
| | Carteira (\$) | Carteira (%) | | |
| Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a " | 43.753.881,59 | 4,13% | 2,00% | 10,00% |
| Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a " | 44.554.589,82 | 4,21% | 2,00% | 10,00% |
| Artigo 8º, Inciso III | 48.060.309,40 | 4,54% | 7,00% | 10,00% |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a " | 11.497.917,04 | 1,09% | 2,00% | 5,00% |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b " | 15.634.712,30 | 1,48% | 2,00% | 5,00% |
| Desenquadrado - RV | 4.191.544,51 | 0,40% | 0,00% | 0,00% |
| Total Renda Variável | 167.692.954,66 | 15,84% | 15,00 | 40,00 |

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (janeiro / 2018)

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 | 223.410.208,12 | 21,10% | 0,06% |
| BRADESCO ASSET MANAGEMENT | 194.647.622,98 | 18,39% | 0,02% |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM | 114.857.914,02 | 10,85% | 0,01% |
| ITAÚ UNIBANCO | 97.180.880,91 | 9,18% | 0,01% |
| SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT | 75.241.599,65 | 7,11% | 0,02% |
| SULAMÉRICA INVESTIMENTOS | 65.296.704,26 | 6,17% | 0,24% |
| WESTERN ASSET | 42.385.835,65 | 4,00% | 0,08% |
| KONDOR INVEST | 21.310.968,38 | 2,01% | 0,78% |
| AZ QUEST INVESTIMENTOS | 19.999.039,47 | 1,89% | 0,12% |
| ITAÚ DTVM | 17.562.133,36 | 1,66% | 0,00% |
| SAFRA ASSET MANAGEMENT | 15.998.513,23 | 1,51% | 0,01% |
| INFINITY ASSET MANAGEMENT | 10.900.899,42 | 1,03% | 2,57% |
| QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS | 7.653.305,58 | 0,72% | 4,59% |
| BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS | 7.436.393,01 | 0,70% | 0,01% |
| MÉRITO INVESTIMENTOS | 6.861.406,72 | 0,65% | - |

| Gestão | Valor | % s/ Carteira | % s/ PL Gestão |
|--------------------------|--------------|---------------|----------------|
| A5 CAPITAL PARTNERS | 5.491.168,98 | 0,52% | -% |
| ROMA ASSET | 4.632.784,58 | 0,44% | 1,58%% |
| XP GESTÃO DE RECURSOS | 3.244.581,97 | 0,31% | 0,00%% |
| BELVEDERE INVESTIMENTOS | 1.350.074,85 | 0,13% | 0,24%% |
| CAPITÂNIA | 1.251.987,86 | 0,12% | 0,03%% |
| REAG GESTORA DE RECURSOS | 1.120.000,00 | 0,11% | 0,09%% |
| BRZ Investimentos | 931.348,04 | 0,09% | 0,03%% |
| BRASIL PLURAL | 472.607,55 | 0,04% | 0,00%% |
| Gradual Investimentos | 90.496,95 | 0,01% | 0,07%% |

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (janeiro / 2018)

| | Mês | Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | Taxa adm | VaR - Mês | Volatilidade - 12 meses |
|---|-------|-------|---------|---------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| IMA-B 5+ | 4,95% | 4,95% | 4,29% | 7,16% | 15,74% | 53,21% | - | - | - |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 4,92% | 4,92% | 4,19% | 6,96% | 15,19% | 52,17% | 0,20% | 2,756% | 11,91% |

| | | | | | | | | | |
|--|-------|-------|-------|-------|--------|--------|-------|--------|--------|
| IMA-B | 3,40% | 3,40% | 3,46% | 6,35% | 14,49% | 42,84% | - | - | - |
| CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 4,46% | 4,46% | 4,21% | 4,38% | 8,99% | 32,60% | 0,20% | 2,005% | 11,34% |
| SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP | 4,08% | 4,08% | 3,52% | 6,95% | 17,03% | 46,74% | 0,40% | 2,133% | 8,98% |
| HSBC NILO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP | 3,47% | 3,47% | 4,06% | 7,77% | 16,34% | 46,44% | 0,30% | 2,030% | 10,67% |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA | 3,39% | 3,39% | 3,41% | 6,32% | 14,58% | 43,05% | 0,20% | 1,833% | 9,23% |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 3,37% | 3,37% | 3,39% | 6,21% | 14,24% | 42,39% | 0,20% | 1,795% | 9,09% |
| SAFRA IMA FIC RENDA FIXA | 3,33% | 3,33% | 3,40% | 6,18% | 14,14% | 39,75% | 0,45% | 1,879% | 9,41% |
| CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP | 3,30% | 3,30% | 3,39% | 6,25% | 13,92% | 41,75% | 0,20% | 1,806% | 8,69% |
| CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 3,05% | 3,05% | 2,77% | 3,19% | 8,72% | 26,19% | 0,20% | 1,550% | 7,95% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,17% | 1,17% | 1,98% | 4,59% | 12,19% | 27,57% | 0,20% | 0,448% | 3,14% |
| CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 1,05% | 1,05% | 1,61% | 1,04% | 4,30% | 10,82% | 0,20% | 0,350% | 4,31% |
| CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 1,01% | 1,01% | 2,02% | 2,11% | 7,18% | 16,70% | 0,20% | 0,569% | 5,52% |

| | | | | | | | | | |
|---|-------|-------|-------|-------|--------|--------|-------|--------|-------|
| IMA-B 5 | 1,33% | 1,33% | 2,33% | 5,17% | 12,77% | 27,94% | - | - | - |
| WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA | 1,60% | 1,60% | 2,54% | 5,19% | 14,21% | 31,76% | 0,40% | 0,954% | 4,89% |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP | 1,31% | 1,31% | 2,28% | 5,06% | 12,61% | 27,54% | 0,20% | 0,611% | 3,44% |

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (janeiro / 2018)

| | Mês | Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | Taxa adm | VaR - Mês | Volatilidade - 12 meses |
|---|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA | 1,31% | 1,31% | 2,31% | 5,09% | 12,57% | 27,47% | 0,10% | 0,609% | 3,44% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA | 1,30% | 1,30% | 2,23% | 4,95% | 12,33% | 26,93% | 0,40% | 0,610% | 3,43% |
| IRF-M | 1,30% | 1,30% | 2,65% | 5,38% | 14,09% | 40,05% | - | - | - |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,29% | 1,29% | 2,59% | 5,25% | 13,78% | 39,58% | 0,20% | 0,887% | 4,50% |
| IPCA + 7,50% ao ano | 0,93% | 0,93% | 2,83% | 5,54% | 10,47% | 25,15% | - | - | - |
| SUL INVEST FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 6 | 1,19% | 1,19% | 2,88% | -6,94% | -2,79% | -4,21% | 0,18% | 0,276% | - |
| 135% do CDI | 0,79% | 0,79% | 2,30% | 5,21% | 12,87% | 34,76% | - | - | - |
| GÁVEA SUL FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1 LP | -7,61% | -7,61% | -19,62% | -31,92% | -46,00% | -38,22% | 0,40% | 13,398% | - |
| IDKA IPCA 2 Anos | 0,77% | 0,77% | 2,20% | 4,96% | 13,25% | 27,12% | - | - | - |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,04% | 1,04% | 1,61% | 3,84% | 10,22% | 23,85% | 0,20% | 0,345% | 1,66% |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0,95% | 0,95% | 2,06% | 4,74% | 12,22% | 26,72% | 0,20% | 0,448% | 2,62% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 0,78% | 0,78% | -0,77% | 1,74% | 6,22% | 13,96% | 0,20% | 0,293% | 4,76% |
| 130% do CDI | 0,76% | 0,76% | 2,21% | 5,01% | 12,36% | 33,28% | - | - | - |
| SILVERADO MAXIMUM II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2 | -1,41% | -1,41% | - | -10,77% | -18,28% | -95,05% | 2,50% | - | - |
| CDI | 0,58% | 0,58% | 1,70% | 3,83% | 9,38% | 24,73% | - | - | - |
| INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA | 0,81% | 0,81% | 1,93% | 4,29% | 10,91% | 28,00% | 0,75% | 0,378% | 8,82% |

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (janeiro / 2018)

| | Mês | Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | Taxa adm | VaR - Mês | Volatilidade - 12 meses |
|--|-------|-------|---------|---------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 0,58% | 0,58% | 1,68% | 3,89% | 9,59% | 25,18% | 0,20% | 0,007% | 0,13% |
| CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0,57% | 0,57% | 1,69% | 3,82% | 9,33% | 24,61% | 0,20% | 0,019% | 0,16% |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,49% | 0,49% | 1,42% | 3,28% | 8,30% | 22,54% | 1,00% | 0,004% | 0,12% |
| IPCA | 0,29% | 0,29% | 1,01% | 1,79% | 2,86% | 8,36% | - | - | - |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 1,49% | 1,49% | 2,43% | 5,24% | 12,18% | 37,23% | 0,40% | 0,827% | 5,65% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA | 1,49% | 1,49% | 2,43% | 5,24% | 12,16% | - | 0,40% | 0,827% | 5,65% |
| Não Informado | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 1,98% | 1,98% | 2,54% | 3,04% | 8,24% | 22,43% | 0,15% | 1,011% | 6,56% |

Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (janeiro / 2018)

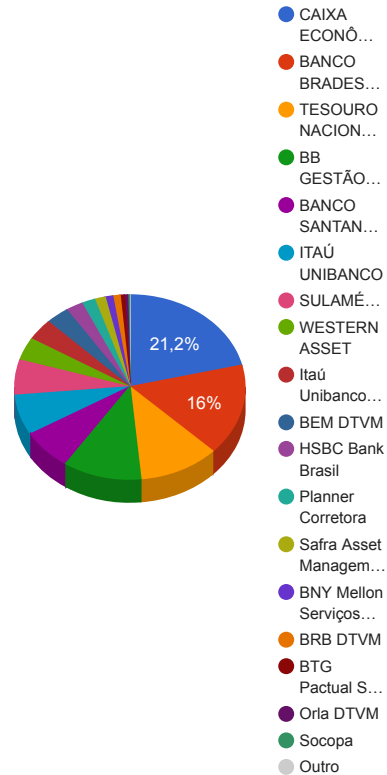
| | Mês | Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | Taxa adm | VaR - Mês | Volatilidade - 12 meses |
|---|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| Ibovespa | 11,14% | 11,14% | 14,27% | 28,81% | 31,30% | 110,15% | - | - | - |
| KONDOR EQUITIES INSTITUCIONAL FI AÇÕES | 13,00% | 13,00% | 13,53% | 31,38% | 31,36% | 127,51% | 1,50% | 8,153% | 18,98% |
| AZ LEGAN BRASIL FI AÇÕES | 11,45% | 11,45% | 13,52% | 24,63% | 28,57% | 83,70% | 2,00% | 8,446% | 16,87% |
| ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES | 9,71% | 9,71% | 11,96% | 24,27% | 29,60% | 86,64% | 1,50% | 8,043% | 17,27% |
| BRDESCO H REGIMES DE PREVIDÊNCIA IBOVESPA FIC AÇÕES | 9,54% | 9,54% | 11,33% | 22,10% | 24,59% | 74,68% | 1,00% | 7,908% | 16,53% |
| IDIV | 9,88% | 9,88% | 7,63% | 22,52% | 26,79% | 144,24% | - | - | - |
| XP DIVIDENDOS FI AÇÕES | 5,48% | 5,48% | 9,61% | 11,56% | 20,05% | 85,51% | 3,00% | 6,865% | 16,53% |
| S&P 500 | 5,62% | 5,62% | 9,65% | 14,31% | 23,91% | 45,54% | - | - | - |
| WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO | 5,38% | 5,38% | 10,74% | 17,37% | 33,69% | 78,17% | 1,00% | 4,064% | 6,53% |
| SMLL | 4,34% | 4,34% | 8,96% | 20,84% | 39,86% | 124,46% | - | - | - |
| AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES | 9,22% | 9,22% | 10,09% | 26,61% | 39,08% | 85,56% | 2,00% | 8,472% | 20,15% |
| CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES | 4,57% | 4,57% | 9,21% | 22,44% | 40,68% | 97,70% | 1,50% | 6,814% | 18,12% |
| IFIX | 2,64% | 2,64% | 2,65% | 10,60% | 18,12% | 72,74% | - | - | - |
| REAG RENDA IMOBILIÁRIA FII - DOMC11 | -9,53% | -9,53% | -20,00% | 36,59% | 14,99% | 4,67% | 0,95% | 32,322% | 88,27% |
| VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11 | - | - | - | - | - | 0,00% | 0,14% | - | - |
| IPCA + 8,00% ao ano | 0,97% | 0,97% | 2,94% | 5,79% | 10,98% | 26,32% | - | - | - |
| BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP | - | - | - | - | - | - | 2,00% | - | - |

Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (janeiro / 2018)

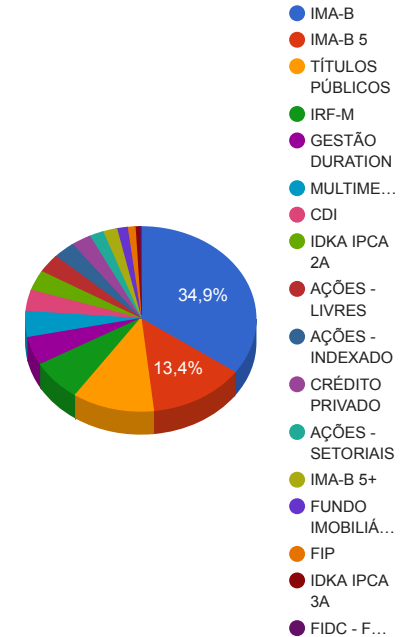
| | Mês | Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | Taxa adm | VaR - Mês | Volatilidade - 12 meses |
|--|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| CDI | 0,58% | 0,58% | 1,70% | 3,83% | 9,38% | 24,73% | - | - | - |
| SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO | 1,25% | 1,25% | 2,60% | 5,19% | 11,00% | 27,31% | 0,50% | 0,485% | 1,44% |
| WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO | 1,12% | 1,12% | 1,64% | 4,30% | 7,83% | 26,25% | 2,00% | 0,643% | 1,65% |
| INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO | 0,65% | 0,65% | 1,78% | 4,23% | 11,21% | 29,74% | 1,00% | 0,218% | 5,14% |
| SUL AMÉRICA CRÉDITO ATIVO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP | 0,60% | 0,60% | 1,68% | 3,92% | 10,50% | 25,91% | 0,60% | 0,031% | 0,42% |
| CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO | -0,19% | -0,19% | -1,57% | -1,14% | 3,49% | 19,63% | 0,55% | 1,323% | 8,82% |
| IPCA | 0,29% | 0,29% | 1,01% | 1,79% | 2,86% | 8,36% | - | - | - |
| SULAMÉRICA HIGH YIELD FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO | 1,07% | 1,07% | 2,24% | 4,72% | 12,01% | 19,07% | 1,50% | 0,218% | 1,61% |
| Não Informado | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| MÉRITO DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - MFII11 | 2,10% | 2,10% | 8,61% | 14,17% | 34,45% | 40,33% | 0,15% | 16,549% | 17,27% |
| BRASIL ENERGIA RENOVÁVEL MULTISTRATÉGIA FIP | - | - | - | - | - | - | 1,65% | - | - |
| LSH FIP | - | - | - | - | - | - | 0,08% | - | - |
| W7 MULTISTRATÉGIA FIP | - | - | - | - | - | - | 1,50% | - | - |

Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (janeiro / 2018)

| Administrador | Valor | % |
|-------------------------------------|----------------|--------|
| CAIXA ECONÔMICA FEDERAL | 224.784.171,60 | 21,23% |
| BANCO BRADESCO | 169.386.792,12 | 16,00% |
| TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS) | 119.314.454,26 | 11,27% |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM | 114.857.914,02 | 10,85% |
| BANCO SANTANDER | 75.241.599,65 | 7,11% |
| ITAÚ UNIBANCO | 74.815.359,45 | 7,07% |
| SULAMÉRICA INVESTIMENTOS | 65.296.704,26 | 6,17% |
| WESTERN ASSET | 42.385.835,65 | 4,00% |
| Itaú Unibanco S.A. | 39.927.654,82 | 3,77% |
| BEM DTVM | 34.530.943,00 | 3,26% |
| HSBC Bank Brasil | 25.260.830,86 | 2,39% |
| Planner Corretora | 20.005.881,28 | 1,89% |
| Safra Asset Management | 15.998.513,23 | 1,51% |
| BNY Mellon Serviços Financeiros | 11.275.634,68 | 1,07% |
| BRB DTVM | 10.900.899,42 | 1,03% |
| BTG Pactual Serviços Financeiros | 6.535.037,08 | 0,62% |
| Orla DTVM | 4.632.784,58 | 0,44% |
| Socopa | 2.281.422,89 | 0,22% |
| CM Capital Markets DTVM | 1.120.000,00 | 0,11% |
| Gradual Investimentos | 90.496,95 | 0,01% |



| Sub-segmento | Valor | % |
|-------------------|----------------|--------|
| IMA-B | 369.016.350,32 | 34,86% |
| IMA-B 5 | 142.036.151,75 | 13,42% |
| TÍTULOS PÚBLICOS | 119.314.454,26 | 11,27% |
| IRF-M | 76.235.175,31 | 7,20% |
| GESTÃO DURATION | 52.536.809,11 | 4,96% |
| MULTIMERCADO | 48.060.309,40 | 4,54% |
| CDI | 39.461.441,89 | 3,73% |
| IDKA IPCA 2A | 37.417.381,75 | 3,53% |
| AÇÕES - LIVRES | 34.530.943,00 | 3,26% |
| AÇÕES - INDEXADO | 32.796.138,47 | 3,10% |
| CRÉDITO PRIVADO | 29.452.375,37 | 2,78% |
| AÇÕES - SETORIAIS | 20.981.389,94 | 1,98% |
| IMA-B 5+ | 20.861.066,94 | 1,97% |
| FUNDO IMOBILIÁRIO | 15.634.712,30 | 1,48% |
| FIP | 11.497.917,04 | 1,09% |
| IDKA IPCA 3A | 6.438.393,11 | 0,61% |
| FIDC - FECHADO | 2.371.919,84 | 0,22% |



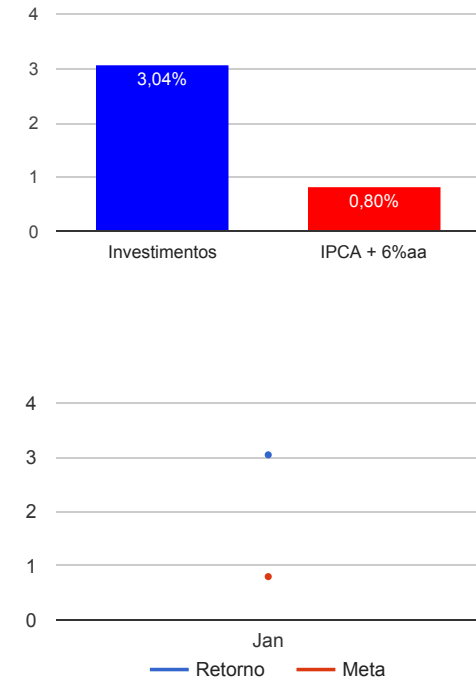
Carteira de Títulos Públicos - base (janeiro / 2018)

| Títulos Públicos | Vencimento | Compra | Qtde. | P.U. Compra | P.U. Atual | \$ Pago | \$ Atual | GAP (Atual - Pago) |
|--|------------|------------|-------|--------------|--------------|---------------|---------------|--------------------|
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2019 | 25/08/2015 | 7659 | 2.636,195170 | 3.218,812146 | 20.190.618,81 | 24.652.882,23 | 4.462.263,42 |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2021 | 17/08/2016 | 4750 | 2.964,257204 | 3.264,469294 | 14.080.221,72 | 15.506.229,15 | 1.426.007,43 |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2023 | 03/09/2015 | 6730 | 2.515,509771 | 3.288,745920 | 16.929.380,76 | 22.133.260,04 | 5.203.879,28 |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2024 | 14/03/2014 | 6185 | 2.315,991673 | 3.369,702596 | 14.324.408,50 | 20.841.610,56 | 6.517.202,06 |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/08/2026 | 27/04/2016 | 2200 | 2.838,144079 | 3.418,734973 | 6.243.916,97 | 7.521.216,94 | 1.277.299,97 |
| NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B | 15/05/2035 | 21/12/2015 | 8310 | 2.412,107871 | 3.448,767190 | 20.044.616,41 | 28.659.255,35 | 8.614.638,94 |

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

| Mês | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (\$) | Retorno (%) | Meta (%) | Gap (%) | VaR (%) |
|------------------|----------------|---------------|---------------|------------------|---------------|-------------|----------|---------|---------|
| Janeiro | 999.461.943,98 | 70.417.723,46 | 49.580.859,52 | 1.051.332.128,94 | 31.033.321,02 | 3,04% | 0,80% | 379,50% | 2,13% |
| Acumulado no ano | | | | | 31.033.321,02 | 3,04% | 0,80% | 379,50% | |

Acumulado no Ano



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de janeiro / 2018

| Ativos de Renda Fixa | Sado Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | VaR - Mês (%) | Instituição(%) |
|---|----------------|--------------|----------|----------------|---------------|-------------|---------------|----------------|
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 6.907.260,91 | 0,00 | 0,00 | 7.246.925,46 | 339.664,55 | 4,92% | 2,76% | 4,92% |
| CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 13.033.186,60 | 0,00 | 0,00 | 13.614.141,48 | 580.954,88 | 4,46% | 2,01% | 4,46% |
| SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP | 54.588.809,13 | 0,00 | 0,00 | 56.816.817,81 | 2.228.008,68 | 4,08% | 2,13% | 4,08% |
| HSBC NILO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP | 24.412.569,92 | 0,00 | 0,00 | 25.260.830,86 | 848.260,94 | 3,47% | 2,03% | 3,47% |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA | 149.105.289,27 | 0,00 | 0,00 | 154.152.787,01 | 5.047.497,74 | 3,39% | 1,83% | 3,39% |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 99.496.958,79 | 0,00 | 0,00 | 102.854.112,20 | 3.357.153,41 | 3,37% | 1,80% | 3,37% |
| SAFRA IMA FIC RENDA FIXA | 10.264.344,06 | 0,00 | 0,00 | 10.605.649,89 | 341.305,83 | 3,33% | 1,88% | 3,33% |
| CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP | 7.863.690,60 | 0,00 | 0,00 | 8.123.417,20 | 259.726,60 | 3,30% | 1,81% | 3,30% |
| CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 12.560.049,01 | 0,00 | 0,00 | 12.943.172,37 | 383.123,36 | 3,05% | 1,55% | 3,05% |
| TÍTULOS PÚBLICOS | 116.135.193,83 | 0,00 | 0,00 | 119.314.454,26 | 3.179.260,43 | 2,74% | - | - |
| BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 6.408.423,70 | 0,00 | 0,00 | 6.535.037,08 | 126.613,38 | 1,98% | 1,01% | 1,98% |
| WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA | 10.119.793,05 | 0,00 | 0,00 | 10.281.368,41 | 161.575,36 | 1,60% | 0,95% | 1,60% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA | 12.424.324,57 | 0,00 | 0,00 | 12.609.154,29 | 184.829,72 | 1,49% | 0,83% | 1,49% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA | 39.343.107,89 | 0,00 | 0,00 | 39.927.654,82 | 584.546,93 | 1,49% | 0,83% | 1,49% |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP | 11.468.077,42 | 0,00 | 0,00 | 11.618.563,71 | 150.486,29 | 1,31% | 0,61% | 1,31% |
| SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA | 73.081.953,70 | 0,00 | 0,00 | 74.040.042,36 | 958.088,66 | 1,31% | 0,61% | 1,31% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA | 37.716.511,41 | 0,00 | 0,00 | 38.205.678,69 | 489.167,28 | 1,30% | 0,61% | 1,30% |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 69.291.925,53 | 6.000.000,00 | 0,00 | 76.235.175,31 | 943.249,78 | 1,25% | 0,89% | 1,29% |
| SUL INVEST FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 6 | 920.424,53 | 0,00 | 0,00 | 931.348,04 | 10.923,51 | 1,19% | 0,28% | 1,19% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 16.788.618,44 | 0,00 | 0,00 | 16.985.356,76 | 196.738,32 | 1,17% | 0,45% | 1,17% |
| CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 4.236.271,58 | 0,00 | 0,00 | 4.280.555,47 | 44.283,89 | 1,05% | 0,35% | 1,05% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 839.225,25 | 0,00 | 0,00 | 847.931,54 | 8.706,29 | 1,04% | 0,34% | 1,04% |

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de janeiro / 2018

| Ativos de Renda Fixa | Sado Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | VaR - Mês (%) | Instituição(%) |
|---|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------|-------------|---------------|----------------|
| CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 3.573.736,38 | 0,00 | 0,00 | 3.609.943,11 | 36.206,73 | 1,01% | 0,57% | 1,01% |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 36.224.017,05 | 0,00 | 0,00 | 36.569.450,21 | 345.433,16 | 0,95% | 0,45% | 0,95% |
| INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA | 5.830.880,59 | 0,00 | 0,00 | 5.878.250,40 | 47.369,81 | 0,81% | 0,38% | 0,81% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 6.388.483,88 | 0,00 | 0,00 | 6.438.393,11 | 49.909,23 | 0,78% | 0,29% | 0,78% |
| GÁVEA SUL FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1 LP | 1.461.289,03 | 0,00 | 121.948,07 | 1.350.074,85 | 10.733,89 | 0,73% | 13,40% | -7,61% |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 2.043.232,90 | 0,00 | 129.000,00 | 1.923.961,24 | 9.728,34 | 0,48% | 0,00% | 0,49% |
| CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 10.451.428,38 | 54.863.975,52 | 34.976.163,51 | 30.457.672,96 | 118.432,57 | 0,18% | 0,02% | 0,57% |
| SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 0,00 | 1.200.000,00 | 0,00 | 1.201.557,29 | 1.557,29 | 0,13% | 0,01% | 0,58% |
| SILVERADO MAXIMUM II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2 | 91.793,32 | 0,00 | 0,00 | 90.496,95 | -1.296,37 | -1,41% | - | - |
| Total Renda Fixa | | | | | 21.042.240,48 | 2,42% | 1,29% | |

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de janeiro / 2018

| Ativos de Renda Variável | Sado Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R\$) | Retorno (%) | VaR - Mês (%) | Instituição(%) |
|--|---------------|--------------|--------------|---------------|----------------------|--------------|---------------|----------------|
| W7 MULTISTRATÉGIA FIP | 4.864.348,19 | 0,00 | 0,00 | 5.491.168,98 | 626.820,79 | 12,89% | - | - |
| KONDOR EQUITIES INSTITUCIONAL FI AÇÕES | 16.185.980,33 | 2.780.315,43 | 0,00 | 21.310.968,38 | 2.344.672,62 | 12,36% | 8,15% | 13,00% |
| BRASESCO H REGIMES DE PREVIDÊNCIA IBOVESPA FIC AÇÕES | 13.907.228,54 | 0,00 | 0,00 | 15.234.005,11 | 1.326.776,57 | 9,54% | 7,91% | 9,54% |
| AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES | 6.207.009,73 | 0,00 | 0,00 | 6.779.064,85 | 572.055,12 | 9,22% | 8,47% | 9,22% |
| ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES | 10.486.629,90 | 5.680.634,72 | 0,00 | 17.562.133,36 | 1.394.868,74 | 8,63% | 8,04% | 9,71% |
| AZ LEGAN BRASIL FI AÇÕES | 11.862.048,39 | 5.892.797,79 | 5.892.797,79 | 13.219.974,62 | 1.357.926,23 | 7,65% | 8,45% | 11,45% |
| XP DIVIDENDOS FI AÇÕES | 3.075.978,16 | 0,00 | 0,00 | 3.244.581,97 | 168.603,81 | 5,48% | 6,87% | 5,48% |
| WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO | 23.633.824,57 | 0,00 | 0,00 | 24.906.075,52 | 1.272.250,95 | 5,38% | 4,06% | 5,38% |
| CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES | 10.478.796,06 | 0,00 | 0,00 | 10.957.743,12 | 478.947,06 | 4,57% | 6,81% | 4,57% |
| APEX AÇÕES 30 FIC AÇÕES | 8.266.908,49 | 0,00 | 8.460.950,15 | 0,00 | 194.041,66 | 2,35% | 8,77% | 10,90% |
| MÉRITO DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - MFII11 | 6.720.544,04 | 0,00 | 0,00 | 6.861.406,72 | 140.862,68 | 2,10% | 16,55% | 2,10% |
| SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO | 5.326.211,05 | 0,00 | 0,00 | 5.392.863,34 | 66.652,29 | 1,25% | 0,49% | 1,25% |
| WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO | 7.119.000,39 | 0,00 | 0,00 | 7.198.391,72 | 79.391,33 | 1,12% | 0,64% | 1,12% |
| SULAMÉRICA HIGH YIELD FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO | 4.242.782,87 | 0,00 | 0,00 | 4.288.341,94 | 45.559,07 | 1,07% | 0,22% | 1,07% |
| VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11 | 7.594.428,10 | 0,00 | 0,00 | 7.653.305,58 | 58.877,48 | 0,78% | - | -56,41% |
| INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO | 4.990.438,95 | 0,00 | 0,00 | 5.022.649,02 | 32.210,07 | 0,65% | 0,22% | 0,65% |
| SUL AMÉRICA CRÉDITO ATIVO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP | 4.166.716,54 | 0,00 | 0,00 | 4.191.544,51 | 24.827,97 | 0,60% | 0,03% | 0,60% |
| LSH FIP | 4.633.799,38 | 0,00 | 0,00 | 4.632.784,58 | -1.014,80 | -0,02% | - | - |
| BRASIL ENERGIA RENOVÁVEL MULTISTRATÉGIA FIP | 472.927,50 | 0,00 | 0,00 | 472.607,55 | -319,95 | -0,07% | - | - |
| CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO | 1.254.319,84 | 0,00 | 0,00 | 1.251.987,86 | -2.331,98 | -0,19% | 1,32% | -0,19% |
| BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP | 906.512,98 | 0,00 | 0,00 | 901.355,93 | -5.157,05 | -0,57% | - | - |
| REAG RENDA IMOBILIÁRIA FII - DOMC11 | 1.238.000,00 | 0,00 | 0,00 | 1.120.000,00 | -118.000,00 | -9,53% | 32,32% | -9,53% |
| Total Renda Variável | | | | | 10.058.520,66 | 6,38% | 6,49% | |