



Instituto de Previdência dos Servidores Municipais de Goiânia  
Setembro 2017

### Dados do Ente Federativo

Ente Federativo	<b>Prefeitura Municipal de Goiânia</b>
CNPJ	01.612.092/0001-23
Endereço	Avenida do Cerrado, nº 999
E-mail	gabinete.goiania@gmail.com
Telefone	(62) 3524-1000
Prefeito	Iris Rezende Machado
Início da Gestão	01/02/2017
E-mail	gabinete.goiania@gmail.com

### Dados da Unidade Gestora do RPPS do Município de Goiânia

Unidade Gestora	<b>Instituto de Previdência dos Servidores Municipais de Goiânia</b>
Nome Fantasia	<b>IPSM</b>
CNPJ	08.948.407/0001-57
Endereço	Av. B, Quadra C1, Lote 16/18, nº 155
CEP	74110-030
Telefone	(62) 3524-5831
E-mail	ipsm@goiania.go.gov.br

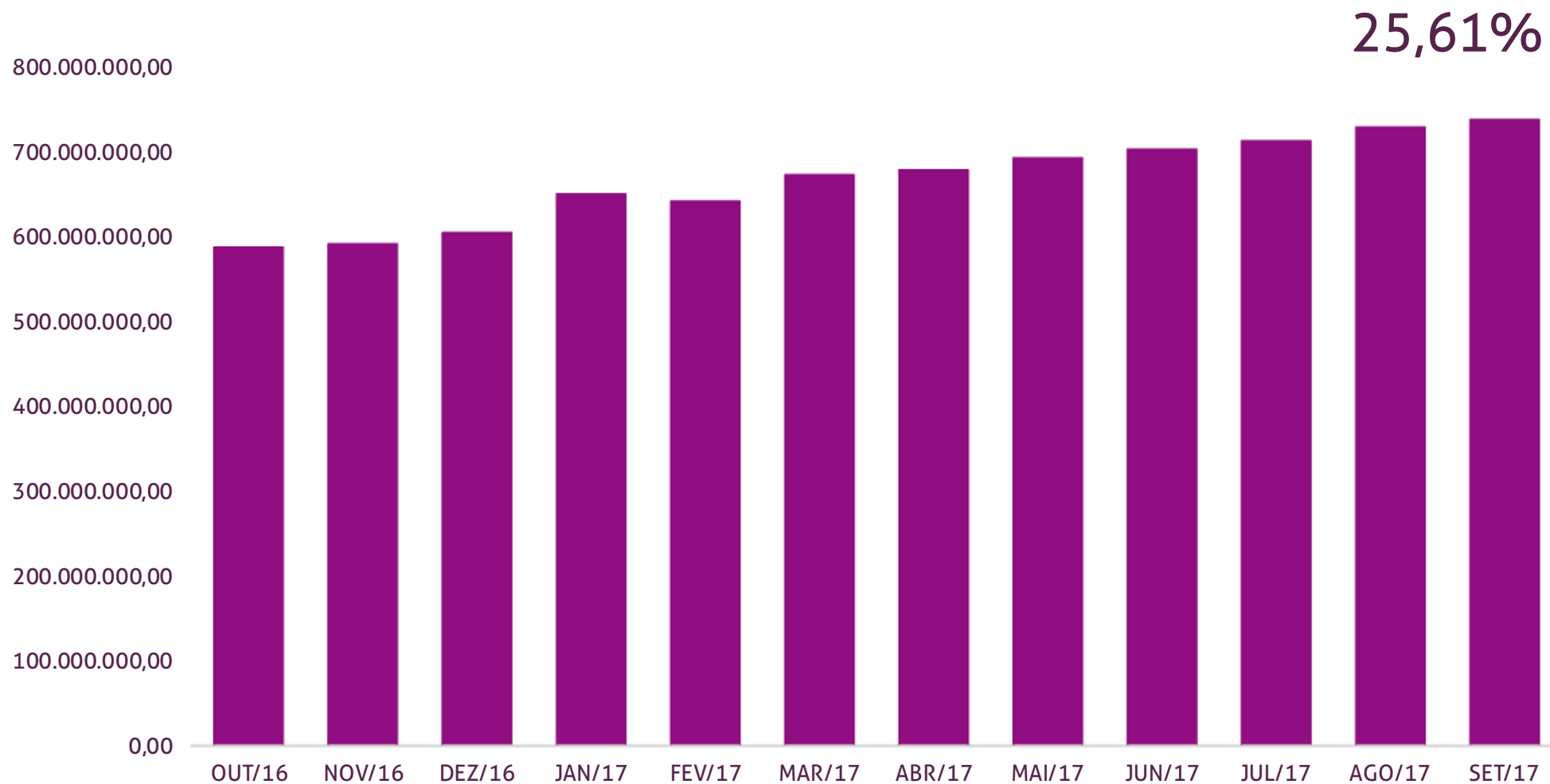
Representante Lega	<b>Silvio Antonio Fernandes Filho</b>	Gestor de Recursos	<b>Oberlin da Cunha Nogueira</b>
Cargo	Presidente	Cargo	Gerente de Investimentos
Início da Gestão	16/01/17	Início da Gestão	28/03/2017
E-mail	silvio.go@hotmail.com	E-mail	ipsm@goiania.go.gov.br
Telefone	(62) 3524-5831	Telefone	(62) 3524-5831
Certificação		Certificação	ANBIMA CPA 20
Validade		Validade	15/06/2019

### Membros da Unidade Gestora do RPPS do Município de Goiânia

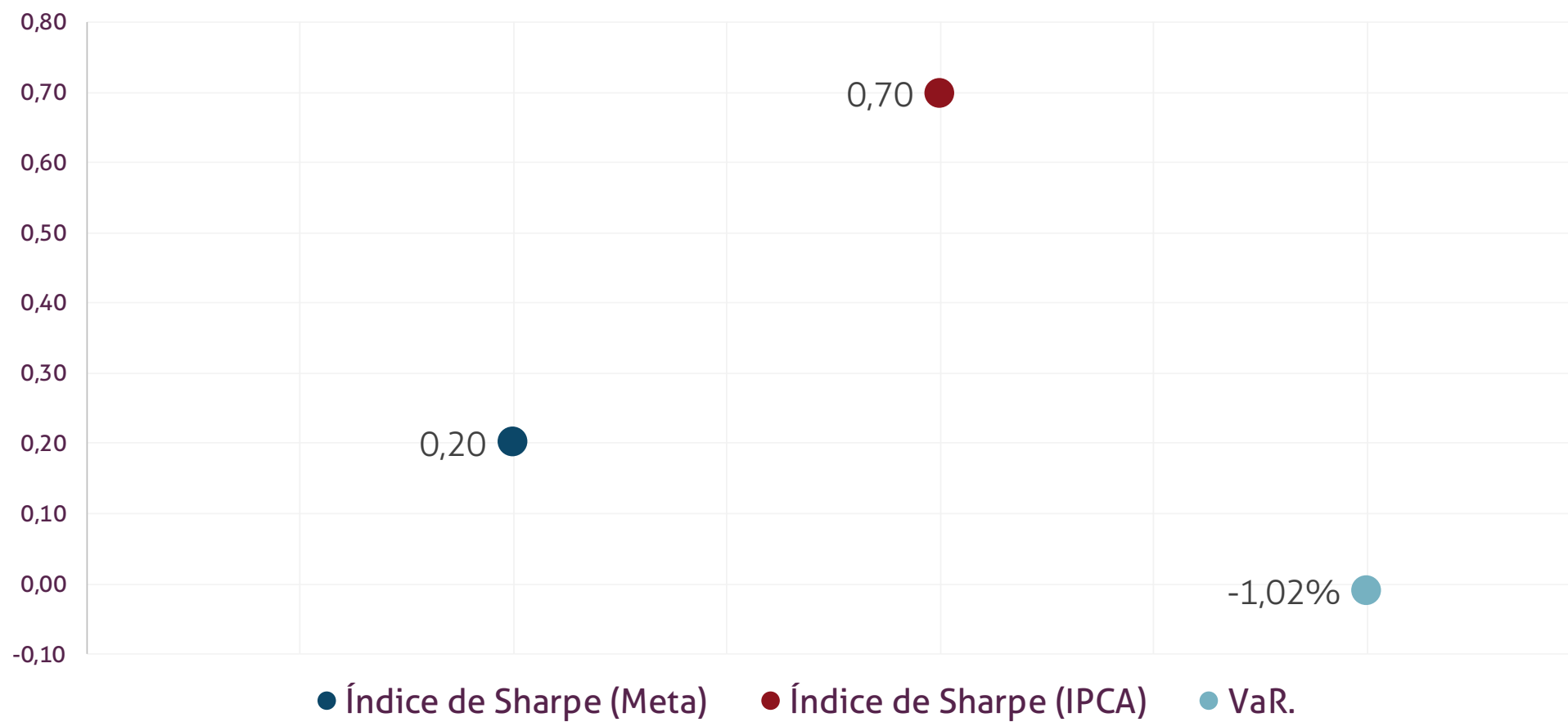
Comitê de Investimentos	Cargo	Conselho	Cargo
Silvio Antonio Fernandes Filho	Autorizador da Operação	Anderson Cleiton Ferreira de Paula	Membro Conselho Efeti
Fábio Alves Caixeta	Responsável pela Liquidação	Alba Valéria Lemes Lauria	Membro Conselho Efeti
Oberlin da Cunha Nogueira	Preponente da Operação	Fernando Evangelista da Silva	Membro Conselho Efeti
Napoleão Batista Ferreira da Costa	Membro Comitê Efetivo	Julimária dos Santos Sousa	Membro Conselho Efeti
Anderson Cleiton Ferreira de Paula	Membro Comitê Efetivo	José Humberto Mariano	Membro Conselho Efeti
		Meibb de Souza Santos Freitas	Membro Conselho Efeti
		Karla Alves Rodrigues	Membro Conselho Efeti
		Oberlin da Cunha Nogueira	Membro Conselho Efeti
		Sheila da Silva Araújo	Membro Conselho Efeti
		Ricardo Sousa Manzi	Membro Conselho Efeti
		Silvio Antonio Fernandes Filho	Membro Conselho Efeti
		Denise Rodrigues de Oliveira	Membro Conselho Efeti
		Luis Fernando Xavier de Souza	Membro Conselho Efeti
		José Donizetti Mendes	Membro Conselho Efeti
		Napoleão Batista Ferreira da Costa	Membro Conselho Efeti
		Edmo Rafael Machado	Membro Conselho Efeti

## Evolução Patrimônio Líquido

Jan	R\$ 649.580.719,52	Fev	R\$ 640.982.473,98	Mar	R\$ 671.971.606,33	Abr	R\$ 677.887.073,42
Mai	R\$ 692.005.531,26	Jun	R\$ 701.984.982,41	Jul	R\$ 712.035.275,15	Ago	R\$ 728.144.040,79
Set	R\$ 737.016.303,03	Out		Nov		Dez	



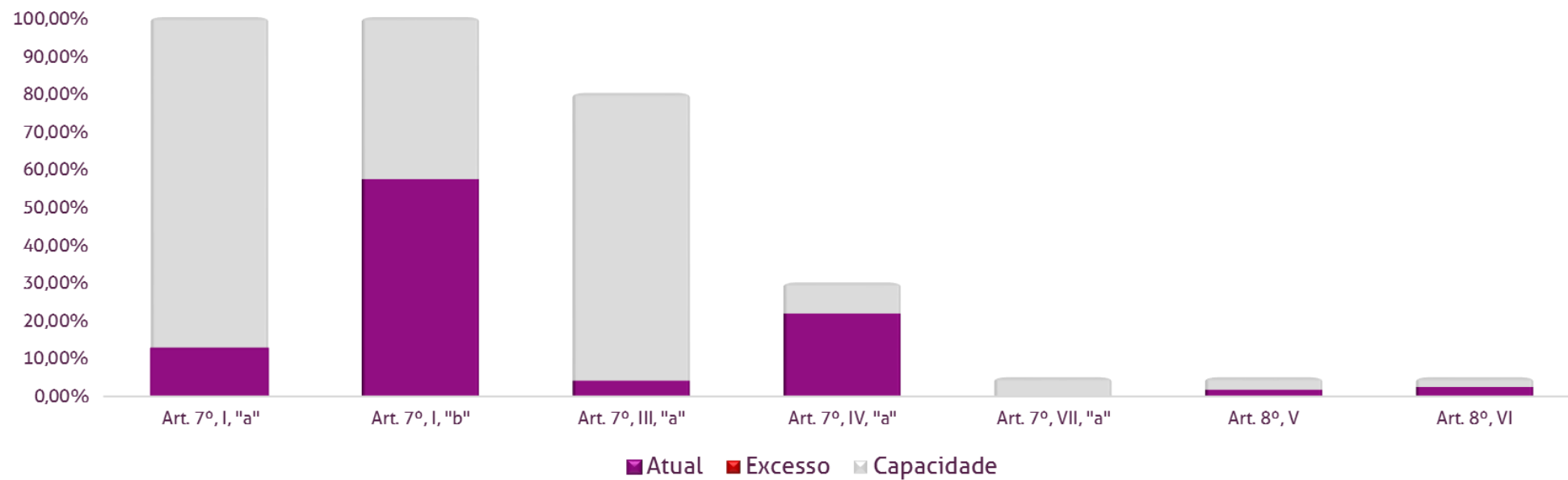
## Índice de Sharpe e Var da Carteira



Fundos	Saldo no Mês	% do RPPS	Lt. do RPPS	Lt. por fundo	Status
<b>Renda Fixa</b>	<b>705.255.827,51</b>	<b>95,85%</b>	<b>100%</b>		
<b>Art. 7º, I, "a" - Títulos Públicos Federais - SELIC</b>	<b>92.790.865,78</b>	<b>12,61%</b>	<b>100%</b>		<b>OK</b>
NTN-B IPSM	12.907.102,10	1,75%			
NTN-F IPSM	79.883.763,68	10,86%			
<b>Art. 7º, I, "b" - FI (100% TPF) - IMA ou IDKA</b>	<b>421.266.022,22</b>	<b>57,25%</b>	<b>100%</b>		<b>OK</b>
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.808.043,76	1,33%			
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.099.587,42	1,51%			
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.223.419,35	0,71%			
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	220.648.977,64	29,99%			
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.026.575,99	0,28%			
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	180.225,88	0,02%			
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	922.329,55	0,13%			
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.458.526,80	0,61%			
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	102.934.675,91	13,99%			
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	21.475.027,89	2,92%			
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	554.949,43	0,08%			
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	41.609.038,48	5,65%			
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	324.644,12	0,04%			
<b>Art. 7º, II - Compromissadas</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>15%</b>		<b>OK</b>
<b>Art. 7º, III, "a" - FI Referenciado RF ou RF - IMA</b>	<b>30.153.134,06</b>	<b>4,10%</b>	<b>80%</b>	<b>20% por fundo</b>	<b>OK</b>
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	262.074,91	0,04%			
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	16.913.416,51	2,30%			
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	778.918,94	0,11%			
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.322.588,75	1,00%			
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	318.255,70	0,04%			
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	3.540.684,92	0,48%			
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	1.017.194,33	0,14%			
<b>Art. 7º, III, "b" - FI de Índices RF - IMA ou IDKA</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>80%</b>	<b>20% por fundo</b>	<b>OK</b>
<b>Art. 7º, IV, "a" - FI Referenciado RF ou RF</b>	<b>160.744.250,55</b>	<b>21,85%</b>	<b>30%</b>	<b>20% por fundo</b>	<b>OK</b>
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	1.130.418,41	0,15%			
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	116.296.489,39	15,81%			
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.232.686,14	0,30%			
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	582.419,85	0,08%			
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	36.953.703,13	5,02%			
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	942.560,69	0,13%			
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	304.532,08	0,04%			
BB SUPREMO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	95.224,25	0,01%			
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	86.965,33	0,01%			
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	1.153.601,80	0,16%			
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	965.649,48	0,13%			
<b>Art. 7º, IV, "b" - FI de Índices RF</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>30%</b>	<b>20% por fundo</b>	<b>OK</b>

Art. 7º, V, "a" - Poupança	0,00	0,00%	20%	OK
Art. 7º, V, "b" - LIG - Letras Imobiliárias Garantidas	0,00	0,00%	20%	OK
Art. 7º, VI - FIDC Aberto	0,00	0,00%	15%	OK
Art. 7º, VII, "a" - FIDC Fechado	301.554,90	0,04%	5%	OK
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	301.554,90	0,04%		
Art. 7º, VII, "b" - FI Crédito Privado	0,00	0,00%	5%	OK
<b>Renda Variável</b>	<b>30.554.098,56</b>	<b>4,15%</b>	<b>30%</b>	
Art. 8º, I - FIA Referenciado - IBOV ou IBrX ou IE	0,00	0,00%	30%	20% por fundo OK
Art. 8º, II - ETF Referenciado - IBOV ou IBrX ou I	0,00	0,00%	20%	OK
Art. 8º, III - FIA - Fundo de Ações	0,00	0,00%	15%	OK
Art. 8º, IV - FI Multimercado - FIM	0,00	0,00%	5%	OK
Art. 8º, V - FI em Participações - FIP	12.608.997,79	1,71%	5%	OK
CONQUEST FIP - FCCQ11	12.608.997,79	1,71%		
Art. 8º, VI - FI Imobiliário - FII	17.945.100,77	2,44%	5%	OK
ÁQUILLA FII - AQLL11	6.353.609,43	0,86%		
FIRENZE FII	11.591.491,34	1,58%		
Não Enquadra	0,00	0,00%		OK
<b>Aplicações</b>	<b>735.809.926,07</b>	<b>99,84%</b>		
<b>Imóveis</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>		
Art. 3º - Integralização em Imóveis	0,00	0,00%		OK
<b>Conta Corrente</b>	<b>1.206.376,96</b>	<b>0,16%</b>		
<b>CARTEIRA</b>	<b>737.016.303,03</b>	<b>100,00%</b>		

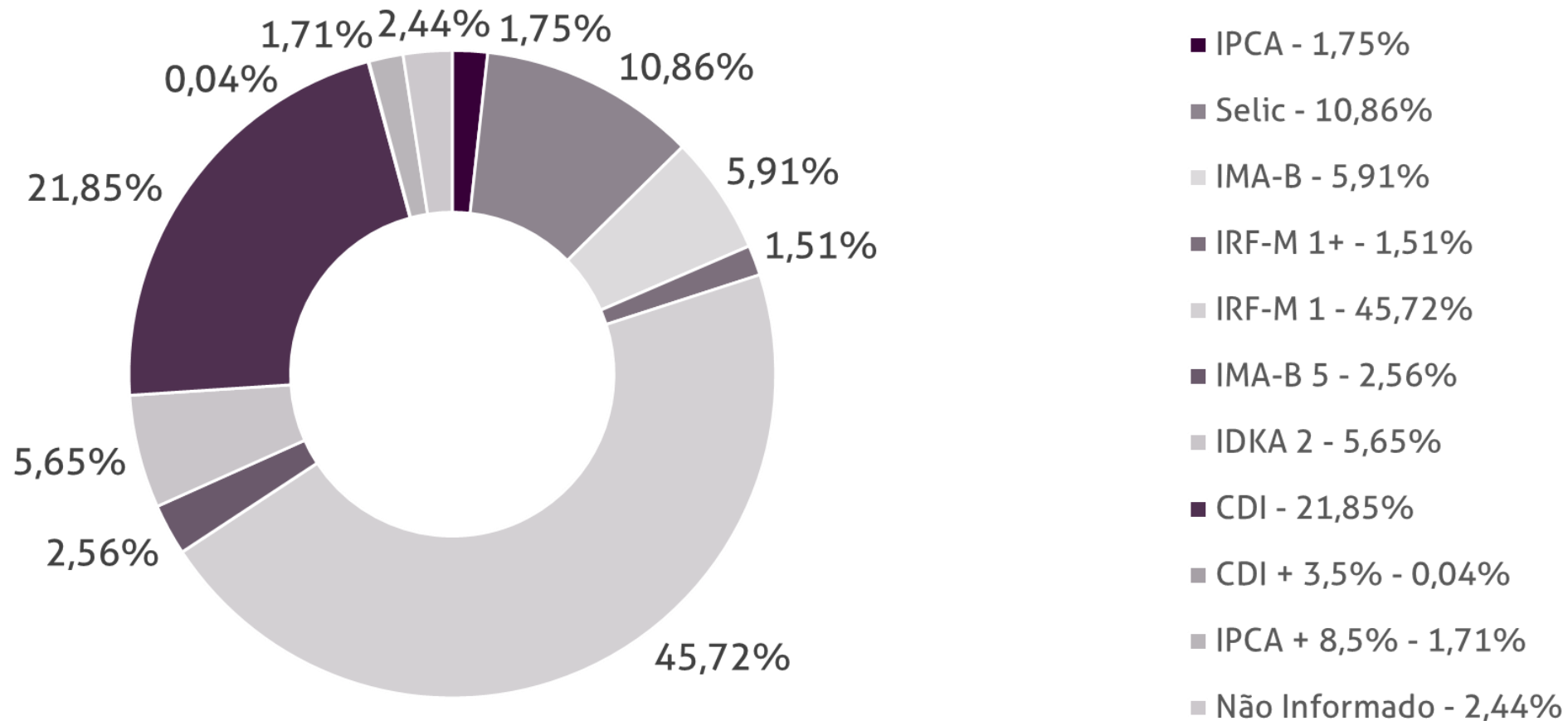
## Disponibilidade 3.922



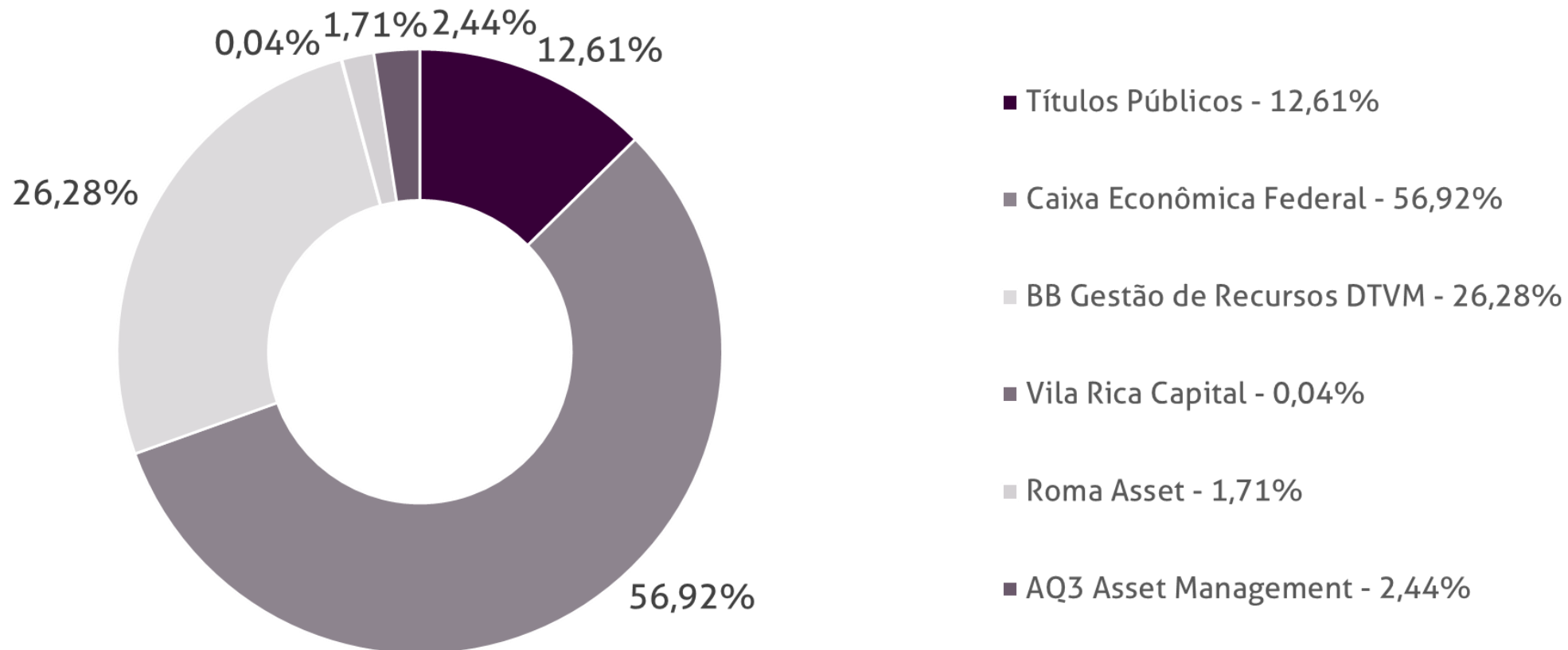
Fundos	CNPJ	Gestão	Taxa de Administração	Benchmark	Resgate
NTN-B IPSM		Títulos Públicos	0,00%	IPCA	-
NTN-F IPSM		Títulos Públicos	0,00%	Selic	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.740.658/0001-93	Caixa Econômica Federal	0,20%	IMA-B	D+0
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.577.519/0001-90	Caixa Econômica Federal	0,20%	IRF-M 1+	D+0
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.740.670/0001-06	Caixa Econômica Federal	0,20%	IRF-M 1	D+0
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.328.882/0001-35	BB Gestão de Recursos DTVM	0,10%	IRF-M 1	D+0
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	07.442.078/0001-05	BB Gestão de Recursos DTVM	0,20%	IMA-B	D+1
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.060.913/0001-10	Caixa Econômica Federal	0,20%	IMA-B 5	D+0
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	14.386.926/0001-71	Caixa Econômica Federal	0,20%	IDKA 2	D+0
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	03.543.447/0001-03	BB Gestão de Recursos DTVM	0,20%	IMA-B 5	D+1
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	07.861.554/0001-22	BB Gestão de Recursos DTVM	0,30%	IMA-B	D+1
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	10.646.895/0001-90	Caixa Econômica Federal	0,20%	IMA-B	D+0
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	14.508.643/0001-55	Caixa Econômica Federal	0,80%	CDI	D+0
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	03.737.206/0001-97	Caixa Econômica Federal	0,20%	CDI	D+0
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.077.418/0001-49	BB Gestão de Recursos DTVM	0,20%	CDI	D+0
BB SUPREMO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	04.288.966/0001-27	BB Gestão de Recursos DTVM	4,00%	CDI	D+0
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	13.990.000/0001-28	Vila Rica Capital	0,39%	CDI + 3,5%	Não se aplica
CONQUEST FIP - FCCQ11	10.625.626/0001-47	Roma Asset	0,15%	IPCA + 8,5%	Não se aplica
ÁQUILLA FII - AQLL11	13.555.918/0001-49	AQ3 Asset Management	1,50%	Não Informado	Não se aplica
FIRENZE FII	14.074.721/0001-50	AQ3 Asset Management	1,50%	Não Informado	Não se aplica



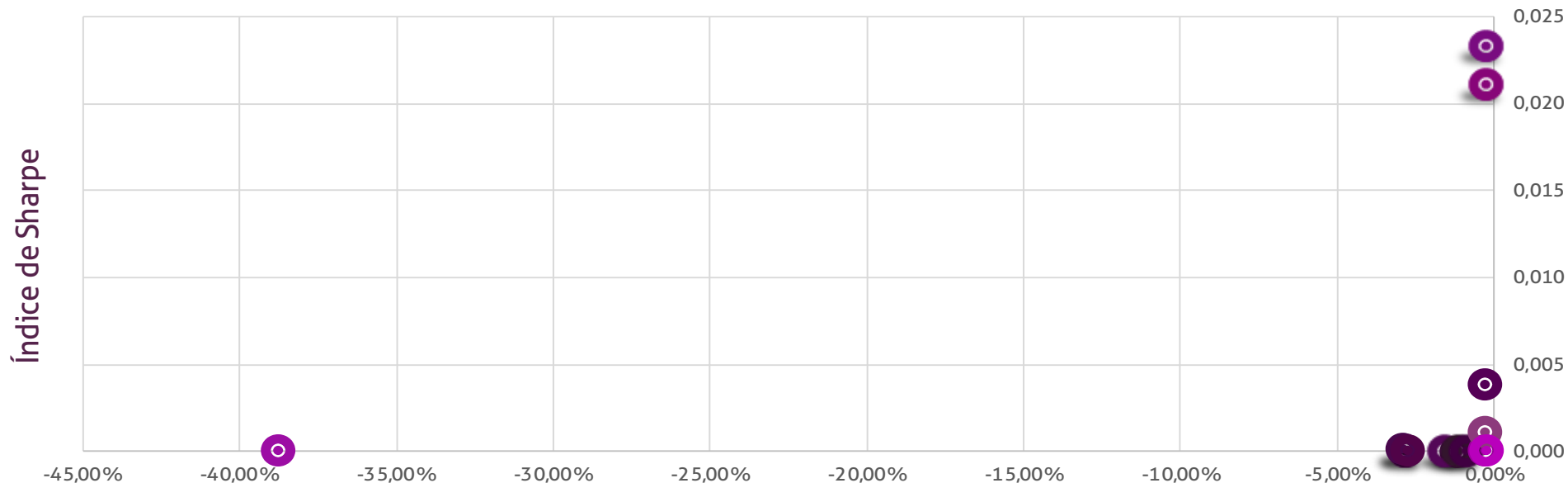
## Distribuição por Indicador - Setembro - 2017



## Distribuição por Instituição - Setembro - 2017



## Índice de Sharpe e Var



- CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP
- CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA
- BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO
- CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP
- BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO
- CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA
- BB SUPREMO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO
- CONQUEST FIP - FCCQ11
- FIRENZE FII

### VaR

- CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP
- BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO
- CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP
- BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP
- CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP
- CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP
- ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR
- ÁQUILLA FII - AQLL11
- BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO

Fundos	2016	12 meses	jul/17	ago/17	set/17	2017
<b>Renda Fixa</b>						
<b>Art. 7º, I, "a" - Títulos Públicos Federais - SELIC</b>						
NTN-B IPSM	30,28%	30,28%	30,28%	30,28%	30,28%	0,12%
NTN-F IPSM	33,38%	33,38%	33,38%	33,38%	33,38%	2,39%
<b>Art. 7º, I, "b" - FI (100% TPF) - IMA ou IDKA</b>						
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	24,56%	15,63%	3,97%	1,33%	1,80%	12,99%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	29,55%	18,92%	2,77%	1,05%	1,68%	14,89%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	14,58%	12,45%	1,04%	0,89%	0,71%	8,98%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	14,58%	12,45%	1,04%	0,89%	0,71%	8,98%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	14,58%	12,45%	1,04%	0,89%	0,71%	8,98%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	14,58%	12,45%	1,04%	0,89%	0,71%	8,98%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14,48%	12,38%	1,06%	0,88%	0,71%	8,94%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14,48%	12,38%	1,06%	0,88%	0,71%	8,94%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14,48%	12,38%	1,06%	0,88%	0,71%	8,94%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	24,52%	15,46%	3,96%	1,32%	1,78%	12,94%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	15,19%	13,27%	2,82%	1,24%	0,99%	10,80%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	14,94%	12,77%	2,41%	0,96%	0,89%	10,30%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	15,19%	13,27%	2,82%	1,24%	0,99%	10,80%
<b>Art. 7º, II - Compromissadas</b>						
<b>Art. 7º, III, "a" - FI Referenciado RF ou RF - IMA ou IDKA</b>						
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	15,28%	13,28%	2,85%	1,24%	0,99%	10,84%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	15,28%	13,28%	2,85%	1,24%	0,99%	10,84%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	15,28%	13,28%	2,85%	1,24%	0,99%	10,84%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	24,46%	15,81%	4,01%	1,33%	1,84%	13,20%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	24,14%	15,50%	3,77%	1,36%	1,79%	12,71%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	24,14%	15,50%	3,77%	1,36%	1,79%	12,71%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	24,14%	15,50%	3,77%	1,36%	1,79%	12,71%
<b>Art. 7º, III, "b" - FI de Índices RF - IMA ou IDKA</b>						

#### Art. 7º, IV, "a" - FI Referenciado RF ou RF

CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	13,05%	10,63%	0,73%	0,72%	0,57%	7,37%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	14,00%	11,56%	0,79%	0,79%	0,63%	8,06%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	14,00%	11,56%	0,79%	0,79%	0,63%	8,06%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	14,00%	11,56%	0,79%	0,79%	0,63%	8,06%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13,88%	11,65%	0,81%	0,79%	0,65%	8,10%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13,88%	11,65%	0,81%	0,79%	0,65%	8,10%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13,88%	11,65%	0,81%	0,79%	0,65%	8,10%
BB SUPREMO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	9,50%	7,19%	0,46%	0,43%	0,32%	4,86%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	13,05%	10,63%	0,73%	0,72%	0,57%	7,37%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	13,05%	10,63%	0,73%	0,72%	0,57%	7,37%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	13,05%	10,63%	0,73%	0,72%	0,57%	7,37%

#### Art. 7º, IV, "b" - FI de Índices RF

#### Art. 7º, V, "a" - Poupança

#### Art. 7º, V, "b" - LIG - Letras Imobiliárias Garantidas

#### Art. 7º, VI - FIDC Aberto

#### Art. 7º, VII, "a" - FIDC Fechado

ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-65,83%		0,12%	0,12%		
-----------------------------------	---------	--	-------	-------	--	--

#### Art. 7º, VII, "b" - FI Crédito Privado

#### Renda Variável

#### Art. 8º, I - FIA Referenciado - IBOV ou IBrX ou IBrX-50

#### Art. 8º, II - ETF Referenciado - IBOV ou IBrX ou IBrX-50

#### Art. 8º, III - FIA - Fundo de Ações

#### Art. 8º, IV - FI Multimercado - FIM

#### Art. 8º, V - FI em Participações - FIP

CONQUEST FIP - FCCQ11	-1,12%	-19,88%	-0,21%	-0,12%	-0,09%	-19,69%
-----------------------	--------	---------	--------	--------	--------	---------

#### Art. 8º, VI - FI Imobiliário - FII

ÁQUILLA FII - AQLL11	1,45%	-2,99%	0,95%	-0,21%	-0,25%	-2,84%
FIRENZE FII	-4,34%	2,88%	4,66%	-0,01%	-0,03%	0,59%

#### Imóveis

#### Art. 3º - Integralização em Imóveis

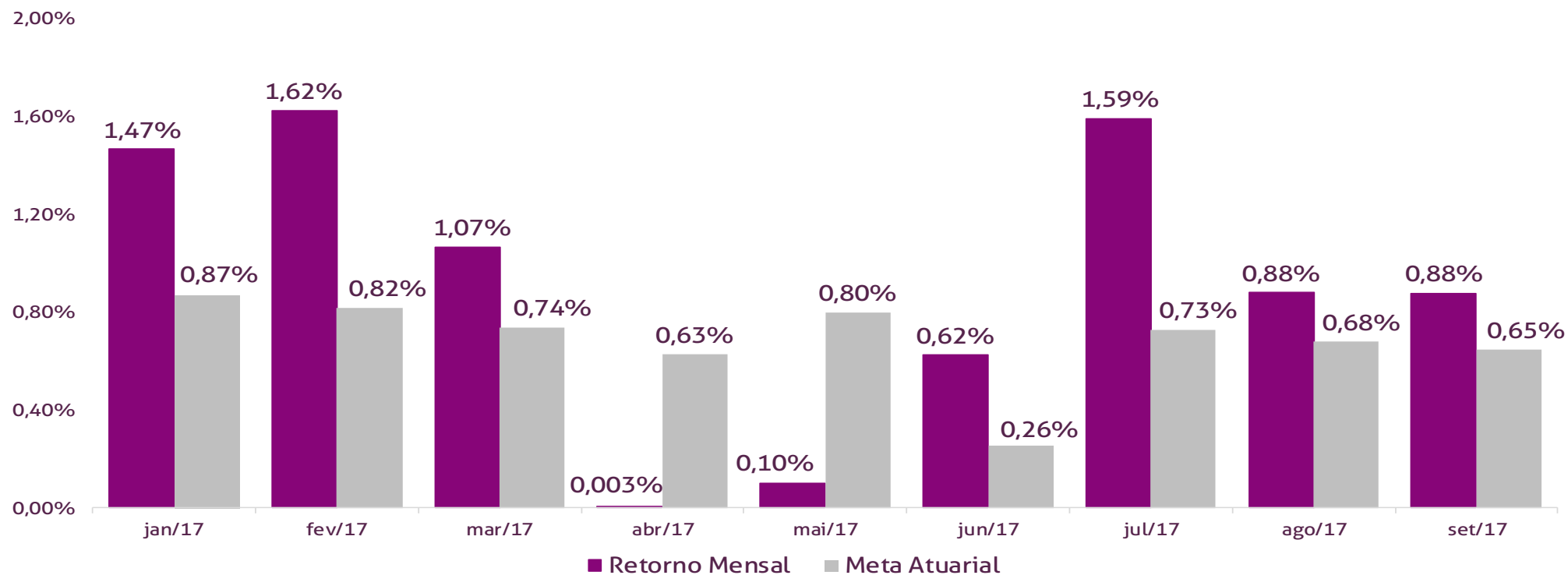
#### Não Enquadra

Performance Absoluta

	jan-17	fev-17	mar-17	abr-17	mai-17	jun-17
Carteira	1,47%	1,62%	1,07%	0,003%	0,10%	0,62%
Retorno Financeiro	8.847.175,93	10.777.512,71	7.109.609,66	21.209,28	683.141,92	4.333.547,78
Meta Atuarial	0,87%	0,82%	0,74%	0,63%	0,80%	0,26%

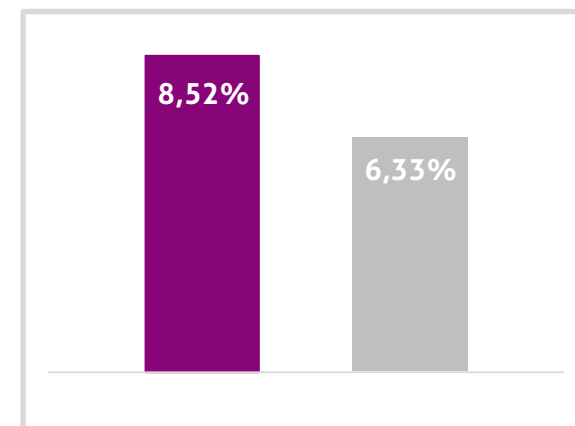
	jul-17	ago-17	set-17	out-17	nov-17	dez-17
Carteira	1,59%	0,88%	0,88%			
Retorno Financeiro	11.205.264,84	6.340.479,05	6.443.144,14			
Meta Atuarial	0,73%	0,68%	0,65%			

### Retorno Mensal X Meta Atuarial Mensal



Estatística		
Meses positivos:	9	
Meses negativos:	0	
Meses acima da Meta Atuarial:	7	
Meses abaixo da Meta Atuarial:	2	
Retorno Mensal Máximo	1,62%	fev-17
Retorno Mensal Médio	0,91%	
Retorno Mensal Mínimo	0,003%	abr-17
Sharpe	0,20	
Volatilidade	12,38%	
VaR	-1,02%	
Meta Atuarial	IPCA + 6%	

Consolidado - 2017	
Carteira	8,52%
Retorno	R\$ 55.761.085,31
Meta	6,33%



jan/17

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
NTN-B IPSM		11.477.445,00				325.536,69	2,84%	11.802.981,69
NTN-F IPSM		76.108.499,33			3.672.865,96	2.136.438,55	2,81%	74.572.071,92
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	8.108.475,23				149.404,80	1,84%	8.257.880,03
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	1.090.240,93				29.380,30	2,69%	1.119.621,23
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 278-7	362.671,07				4.565,02	1,26%	367.236,09
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 267-1	119.956.819,09				1.509.919,77	1,26%	121.466.738,86
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁR	Ag. 86-8 cc 18272-9	563.567,80				7.100,96	1,26%	570.668,76
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁR	Ag. 86-8 cc 17879-9	2.960.377,80				37.300,81	1,26%	2.997.678,61
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	42.783.020,59				789.045,54	1,84%	43.572.066,13
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 278-7	928.991,84				10.567,94	1,14%	939.559,78
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 267-1	50.779.453,94				540.215,59	1,06%	51.319.669,53
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 281-7	530.852,48				6.038,82	1,14%	536.891,30
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 18272-9	521.839,95				5.937,99	1,14%	527.777,94
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 15852-6	43.799.217,81				498.388,72	1,14%	44.297.606,53
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 17879-9	1.844.334,30				20.986,57	1,14%	1.865.320,87
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	49.321.539,24				932.629,03	1,89%	50.254.168,27
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 281-7	616.159,82				11.634,12	1,89%	627.793,94
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	7.055.348,18				133.216,65	1,89%	7.188.564,83
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 278-7	2.142.293,95				40.450,06	1,89%	2.182.744,01
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 269-8	464.404,74		-195.345,46		4.361,09	1,62%	273.420,37
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 267-1	108.345.364,65				1.164.015,91	1,07%	109.509.380,56
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 278-7	2.066.203,71				22.198,40	1,07%	2.088.402,11
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 281-7	538.991,14				5.790,69	1,07%	544.781,83
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	33.985.777,11				373.114,60	1,10%	34.358.891,71
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 17879-9	871.935,28				9.572,58	1,10%	881.507,86
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 18272-9	281.713,70				3.092,81	1,10%	284.806,51
BB SUPREMO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	Ag. 86-8 cc 18961-8	90.814,03				661,84	0,73%	91.475,87
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR		377.980,53			3.516,63	907,23	0,24%	375.371,13
CONQUEST FIP - FCCQ11		15.700.656,17				-17.720,42	-0,11%	15.682.935,75
ÁQUILLA FII - AQLL11		6.539.263,25				-821,59	-0,01%	6.538.441,66
FIRENZE FII		11.523.739,89				93.244,86	0,81%	11.616.984,75
<b>Aplicações</b>		<b>601.737.992,55</b>						<b>606.713.440,43</b>
<b>Imóveis</b>		<b>0,00</b>						<b>0,00</b>
<b>Conta Corrente</b>		<b>2.328.124,50</b>						<b>42.867.279,09</b>
Caixa 267-1		221.776,52						6.340.246,58
Caixa 278-7		0,00						97.996,42
Caixa 281-7		0,00						0,00
Banco do Brasil 17160-3		0,00						37.314,95
Banco do Brasil 15853-4		0,00						0,00
Banco do Brasil 15854-2		158,73						3.645,23
Banco do Brasil 15852-6		0,00						23.407,33
Banco do Brasil 17879-9		0,00						0,00
Banco do Brasil 18272-9		0,00						0,00
Banco do Brasil 18961-8		0,00						0,00
Caixa 271-0		704.793,81						690.373,66
Caixa 269-8		0,00						0,00
Caixa 266-3		1.401.344,30						35.674.243,78
Caixa 538-7		51,14						51,14
<b>Final</b>		<b>604.066.117,05</b>	<b>0,00</b>	<b>-195.345,46</b>	<b>3.676.382,59</b>	<b>8.847.175,93</b>	<b>1,47%</b>	<b>649.580.719,52</b>



fev/17

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
NTN-B IPSM		11.802.981,69				774.353,51	6,56%	12.577.335,20
NTN-F IPSM		74.572.071,92				1.759.079,14	2,36%	76.331.151,06
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	8.257.880,03	6.466.426,57			310.181,38	2,11%	15.034.487,98
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	1.119.621,23				26.851,33	2,40%	1.146.472,56
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 278-7	367.236,09	413.886,69			3.816,45	0,49%	784.939,23
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 267-1	121.466.738,86				1.207.815,69	0,99%	122.674.554,55
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 281-7	0,00	330.941,08			131,78	0,04%	331.072,86
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁR	Ag. 86-8 cc 18272-9	570.668,76				5.632,18	0,99%	576.300,94
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁR	Ag. 86-8 cc 17879-9	2.997.678,61				29.585,40	0,99%	3.027.264,01
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	43.572.066,13				1.675.991,80	3,85%	45.248.057,93
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 278-7	939.559,78				13.883,33	1,48%	953.443,11
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 267-1	51.319.669,53	6.466.426,57			670.937,12	1,16%	58.457.033,22
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 281-7	536.891,30				7.933,33	1,48%	544.824,63
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 18272-9	527.777,94				7.800,50	1,48%	535.578,44
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 15852-6	44.297.606,53				654.713,79	1,48%	44.952.320,32
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 17879-9	1.865.320,87				27.569,24	1,48%	1.892.890,11
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	50.254.168,27				1.953.888,10	3,89%	52.208.056,37
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 281-7	627.793,94				23.707,33	3,78%	651.501,27
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	7.188.564,83				271.461,18	3,78%	7.460.026,01
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 278-7	2.182.744,01				82.426,78	3,78%	2.265.170,79
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 269-8	273.420,37	947.851,78	-637.902,47		1.101,12	0,19%	584.470,80
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 267-1	109.509.380,56				964.127,01	0,88%	110.473.507,57
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 278-7	2088402,11				18.386,43	0,88%	2.106.788,54
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 281-7	544.781,83				4.796,29	0,88%	549.578,12
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	34.358.891,71				306.344,13	0,89%	34.665.235,84
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 17879-9	881.507,86				7.859,53	0,89%	889.367,39
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 18272-9	284.806,51				2.539,34	0,89%	287.345,85
BB SUPREMO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	Ag. 86-8 cc 18961-8	91.475,87				526,38	0,58%	92.002,25
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR		375.371,13			10.585,47	3.925,97	1,05%	368.711,63
CONQUEST FIP - FCCQ11		15.682.935,75				-26.383,09	-0,17%	15.656.552,66
ÁQUILLA FII - AQLL11		6.538.441,66				-10.838,17	-0,17%	6.527.603,49
FIRENZE FII		11.616.984,75				-2.631,59	-0,02%	11.614.353,16
<b>Aplicações</b>		<b>606.713.440,43</b>						<b>631.467.997,89</b>
<b>Imóveis</b>		<b>0,00</b>						<b>0,00</b>
<b>Conta Corrente</b>		<b>42.867.279,09</b>						<b>9.514.476,09</b>
Caixa 267-1		6.340.246,58						3.077.657,66
Caixa 278-7		97.996,42						0,00
Caixa 281-7		0,00						0,00
Banco do Brasil 17160-3		37.314,95						37.314,95
Banco do Brasil 15854-2		3.645,23						10.420,74
Banco do Brasil 15852-6		23.407,33						54.819,59
Banco do Brasil 17879-9		0,00						0,00
Banco do Brasil 18272-9		0,00						0,00
Banco do Brasil 18961-8		0,00						0,00
Caixa 271-0		690.373,66						2.208.389,82
Caixa 269-8		0,00						0,00
Caixa 266-3		35.674.243,78						3.956.833,65
Caixa 538-7		51,14						169.039,68
<b>FINAL</b>		<b>649.580.719,52</b>	<b>14.625.532,69</b>	<b>-637.902,47</b>	<b>10.585,47</b>	<b>10.777.512,71</b>	<b>1,62%</b>	<b>640.982.473,98</b>

mar/17

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
NTN-B IPISM		12.577.335,20				49.367,18	0,39%	12.626.702,38
NTN-F IPISM		76.331.151,06				1.229.854,47	1,61%	77.561.005,53
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	15.034.487,98	5.150.000,00			166.454,21	0,82%	20.350.942,19
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	1.146.472,56				17.428,62	1,52%	1.163.901,18
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 278-7	784.939,23	355.193,38			10.023,37	0,88%	1.150.155,98
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 267-1	122.674.554,55	2.145.000,00			1.367.859,31	1,10%	126.187.413,86
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 281-7	331.072,86	329.637,02			4.877,11	0,74%	665.586,99
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁR	Ag. 86-8 cc 18272-9	576.300,94				6.344,80	1,10%	582.645,74
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁR	Ag. 86-8 cc 17879-9	3.027.264,01				33.328,75	1,10%	3.060.592,76
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	45.248.057,93	68.147,27			461.447,87	1,02%	45.777.653,07
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 278-7	953.443,11				13.131,77	1,38%	966.574,88
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 267-1	58.457.033,22	5.150.000,00			844.834,30	1,33%	64.451.867,52
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 281-7	544.824,63				7.503,87	1,38%	552.328,50
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 18272-9	535.578,44				7.395,75	1,38%	542.974,19
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 15852-6	44.952.320,32				620.741,93	1,38%	45.573.062,25
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 17879-9	1.892.890,11				26.138,72	1,38%	1.919.028,83
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	52.208.056,37				545.861,91	1,05%	52.753.918,28
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 281-7	651.501,27				6.184,52	0,95%	657.685,79
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	7.460.026,01				70.815,96	0,95%	7.530.841,97
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 278-7	2.265.170,79				21.502,64	0,95%	2.286.673,43
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 269-8	584.470,80	590.000,00	-654.383,76		4.094,38	0,79%	524.181,42
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 267-1	110.473.507,57				1.180.209,27	1,07%	111.653.716,84
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 278-7	2106788,54				22.507,20	1,07%	2.129.295,74
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 281-7	549.578,12				5.871,25	1,07%	555.449,37
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	34.665.235,84				369.734,77	1,07%	35.034.970,61
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 17879-9	889.367,39				9.485,88	1,07%	898.853,27
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 18272-9	287.345,85				3.064,79	1,07%	290.410,64
BB SUPREMO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	Ag. 86-8 cc 18961-8	92.002,25				629,95	0,68%	92.632,20
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 271-0	0,00	2.471.327,72	-1.642.678,04		5.914,07	0,71%	834.563,75
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 538-7	0,00	325.159,52			960,56	0,30%	326.120,08
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 266-3	0,00	10.900.000,00			32.199,90	0,30%	10.932.199,90
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR		368.711,63			13.327,68	2.857,79	0,78%	358.241,74
CONQUEST FIP - FCCQ11		15.656.552,66				-20.465,38	-0,13%	15.636.087,28
ÁQUILLA FII - AQLL11		6.527.603,49				-14.495,52	-0,22%	6.513.107,97
FIRENZE FII		11.614.353,16				-4.056,31	-0,03%	11.610.296,85
<b>Aplicações</b>		<b>631.467.997,89</b>						<b>663.751.682,98</b>
<b>Imóveis</b>		<b>0,00</b>						<b>0,00</b>
<b>Conta Corrente</b>		<b>9.514.476,09</b>						<b>8.219.923,35</b>
Caixa 267-1		3.077.657,66						2.529.034,63
Caixa 278-7		0,00						0,00
Caixa 281-7		0,00						0,00
Banco do Brasil 17160-3		37.314,95						0,00
Banco do Brasil 15854-2		10.420,74						7.076,25
Banco do Brasil 15852-6		54.819,59						19.549,24
Banco do Brasil 17879-9		0,00						0,00
Banco do Brasil 18272-9		0,00						0,00
Banco do Brasil 18961-8		0,00						0,00
Caixa 271-0		2.208.389,82						53.156,66
Caixa 269-8		0,00						0,00
Caixa 266-3		3.956.833,65						5.460.095,91
Caixa 538-7		169.039,68						151.010,66
<b>FINAL</b>		<b>640.982.473,98</b>	<b>27.484.464,91</b>	<b>-2.297.061,80</b>	<b>13.327,68</b>	<b>7.109.609,66</b>	<b>1,07%</b>	<b>671.971.606,33</b>

abr/17

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
NTN-B IPISM		12.626.702,38				-189.558,32	-1,50%	12.437.144,06
NTN-F IPISM		77.561.005,53				333.196,46	0,43%	77.894.201,99
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	20.350.942,19				-69.414,04	-0,34%	20.281.528,15
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	1.163.901,18				3.890,93	0,33%	1.167.792,11
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 278-7	1.150.155,98	336.218,94			11.295,52	0,76%	1.497.670,44
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 267-1	126.187.413,86	6.237.563,30			1.110.372,78	0,84%	133.535.349,94
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 281-7	665.586,99	155.803,95			6.069,97	0,74%	827.460,91
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁR	Ag. 86-8 cc 18272-9	582.645,74				4.988,31	0,86%	587.634,05
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁR	Ag. 86-8 cc 17879-9	3.060.592,76				26.203,20	0,86%	3.086.795,96
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	45.777.653,07				-157.660,59	-0,34%	45.619.992,48
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 278-7	966.574,88				6.731,25	0,70%	973.306,13
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 267-1	64.451.867,52	4.775.163,29			525.454,02	0,76%	69.752.484,83
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 281-7	552.328,50				3.846,43	0,70%	556.174,93
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 18272-9	542.974,19				3.793,07	0,70%	546.767,26
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 15852-6	45.573.062,25				318.361,31	0,70%	45.891.423,56
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 17879-9	1.919.028,83				13.405,83	0,70%	1.932.434,66
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	52.753.918,28				-183.285,06	-0,35%	52.570.633,22
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 281-7	657.685,79				-3.466,82	-0,53%	654.218,97
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	7.530.841,97				-39.696,90	-0,53%	7.491.145,07
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 278-7	2.286.673,43				-12.053,61	-0,53%	2.274.619,82
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 269-8	524.181,42	412.567,15	-578.241,17		2.793,70	0,78%	361.301,10
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 267-1	111.653.716,84		-250.000,00		885.395,08	0,79%	112.289.111,92
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 278-7	2129295,74				16.884,97	0,79%	2.146.180,71
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 281-7	555.449,37				4.404,62	0,79%	559.853,99
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	35.034.970,61				274.234,73	0,78%	35.309.205,34
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 17879-9	898.853,27				7.035,73	0,78%	905.889,00
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 18272-9	290.410,64				2.273,18	0,78%	292.683,82
BB SUPREMO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	Ag. 86-8 cc 18961-8	92.632,20				462,13	0,50%	93.094,33
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 271-0	834.563,75	144.035,85			6.583,05	0,67%	985.182,65
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 538-7	326.120,08	149.855,40			2.897,89	0,61%	478.873,37
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 266-3	10.932.199,90	2.965.437,93	-2.618.682,56		68.665,45	0,61%	11.347.620,72
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR		358.241,74			15.611,83	2.994,55	0,84%	345.624,46
CONQUEST FIP - FCCQ11		15.636.087,28				-2.947.684,92	-18,85%	12.688.402,36
ÁQUILLA FII - AQLL11		6.513.107,97				-11.261,91	-0,17%	6.501.846,06
FIRENZE FII		11.610.296,85				-6.942,71	-0,06%	11.603.354,14
<b>Aplicações</b>		<b>663.751.682,98</b>						<b>675.487.002,51</b>
<b>Imóveis</b>		<b>0,00</b>						<b>0,00</b>
<b>Conta Corrente</b>		<b>8.219.923,35</b>						<b>2.400.070,91</b>
Caixa 267-1		2.529.034,63						553.006,14
Caixa 278-7		0,00						0,00
Caixa 281-7		0,00						0,00
Banco do Brasil 17160-3		0,00						0,00
Banco do Brasil 15854-2		7.076,25						4.701,25
Banco do Brasil 15852-6		19.549,24						56.319,76
Banco do Brasil 17879-9		0,00						0,00
Banco do Brasil 18272-9		0,00						0,00
Banco do Brasil 18961-8		0,00						0,00
Caixa 271-0		53.156,66						322.070,67
Caixa 269-8		0,00						0,00
Caixa 266-3		5.460.095,91						1.314.355,39
Caixa 538-7		151.010,66						149.617,70
<b>FINAL</b>		<b>671.971.606,33</b>	<b>15.176.645,81</b>	<b>-3.446.923,73</b>	<b>15.611,83</b>	<b>21.209,28</b>	<b>0,003%</b>	<b>677.887.073,42</b>

mai/17

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
NTN-B IPISM		12.437.144,06			329.756,97	-287.090,85	-2,31%	11.820.296,24
NTN-F IPISM		77.894.201,99				27.567,84	0,04%	77.921.769,83
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	20.281.528,15				-241.918,73	-1,19%	20.039.609,42
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	1.167.792,11				1.097,96	0,09%	1.168.890,07
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 278-7	1.497.670,44	387.859,02			14.396,07	0,76%	1.899.925,53
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 267-1	133.535.349,94	13.000.000,00			1.238.600,41	0,85%	147.773.950,35
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 281-7	827.460,91	524.755,76			9.145,37	0,68%	1.361.362,04
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁR	Ag. 86-8 cc 18272-9	587.634,05				5.211,94	0,89%	592.845,99
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁR	Ag. 86-8 cc 17879-9	3.086.795,96				27.377,94	0,89%	3.114.173,90
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	45.619.992,48				-546.160,64	-1,20%	45.073.831,84
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 278-7	973.306,13				824,43	0,08%	974.130,56
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 267-1	69.752.484,83				288.338,83	0,41%	70.040.823,66
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 281-7	556.174,93				471,10	0,08%	556.646,03
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 18272-9	546.767,26				502,09	0,09%	547.269,35
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 15852-6	45.891.423,56				42.141,63	0,09%	45.933.565,19
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 17879-9	1.932.434,66				1.774,53	0,09%	1.934.209,19
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	52.570.633,22				-650.598,87	-1,24%	51.920.034,35
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 281-7	654.218,97				-6.312,30	-0,96%	647.906,67
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	7.491.145,07				-72.279,10	-0,96%	7.418.865,97
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 278-7	2.274.619,82				-21.946,91	-0,96%	2.252.672,91
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 269-8	361.301,10	400.000,00	-465.096,83		1.785,72	0,60%	297.989,99
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 267-1	112.289.111,92		-500.000,00		1.043.287,43	0,93%	112.832.399,35
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 278-7	214.618,71				20.001,05	0,93%	2.166.181,76
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 281-7	559.853,99				5.217,48	0,93%	565.071,47
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	35.309.205,34	71.000,00			325.873,58	0,92%	35.706.078,92
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 17879-9	905.889,00				8.355,14	0,92%	914.244,14
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 18272-9	292.683,82				2.699,46	0,92%	295.383,28
BB SUPREMO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	Ag. 86-8 cc 18961-8	93.094,33				532,32	0,57%	93.626,65
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 271-0	985.182,65	130.728,48			8.903,00	0,80%	1.124.814,13
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 538-7	478.873,37	148.462,44			4.655,89	0,74%	631.991,70
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 266-3	11.347.620,72	9.400.000,00	-7.772.724,14		77.610,83	0,60%	13.052.507,41
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR		345.624,46			14.764,46	4.749,09	1,37%	335.609,09
CONQUEST FIP - FCCQ11		12.688.402,36				-13.089,44	-0,10%	12.675.312,92
ÁQUILLA FII - AQLL11		6.501.846,06				-120.167,54	-1,85%	6.381.678,52
FIRENZE FII		11.603.354,14				-518.414,83	-4,47%	11.084.939,31
<b>Aplicações</b>		<b>675.487.002,51</b>						<b>691.150.607,73</b>
<b>Imóveis</b>		<b>0,00</b>						<b>0,00</b>
<b>Conta Corrente</b>		<b>2.400.070,91</b>						<b>854.923,53</b>
Caixa 267-1		553.006,14						218.988,45
Caixa 278-7		0,00						14.058,19
Caixa 281-7		0,00						0,00
Banco do Brasil 17160-3		0,00						0,00
Banco do Brasil 15854-2		4.701,25						6.908,89
Banco do Brasil 15852-6		56.319,76						19.465,96
Banco do Brasil 17879-9		0,00						0,00
Banco do Brasil 18272-9		0,00						0,00
Banco do Brasil 18961-8		0,00						0,00
Caixa 271-0		322.070,67						302.127,10
Caixa 269-8		0,00						0,00
Caixa 266-3		1.314.355,39						137.562,13
Caixa 538-7		149.617,70						155.812,81
<b>FINAL</b>		<b>677.887.073,42</b>	<b>24.062.805,70</b>	<b>-8.737.820,97</b>	<b>344.521,43</b>	<b>683.141,92</b>	<b>0,099%</b>	<b>692.005.531,26</b>

jun/17

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
NTN-B IPSM		11.820.296,24				-63.839,03	-0,54%	11.756.457,21
NTN-F IPSM		77.921.769,83				1.130.911,63	1,45%	79.052.681,46
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	20.039.609,42		-10.000.000,00		-13.555,50	-0,14%	10.026.053,92
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	1.168.890,07				17.402,22	1,49%	1.186.292,29
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 278-7	1.899.925,53	2.099.953,54			20.256,00	0,51%	4.020.135,07
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 267-1	147.773.950,35	50.500.000,00			1.364.499,99	0,69%	199.638.450,34
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 281-7	1.361.362,04	600.000,00			12.507,27	0,64%	1.973.869,31
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁR	Ag. 86-8 cc 18272-9	592.845,99	300.000,00			5.520,60	0,62%	898.366,59
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁR	Ag. 86-8 cc 17879-9	3.114.173,90	2.400.000,00	-1.200.000,00		28.516,31	0,66%	4.342.690,21
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁR	Ag. 86-8 cc 15852-6	0,00	100.000.000,00			128.487,77	0,13%	100.128.487,77
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	45.073.831,84		-25.000.000,00		-42.524,22	-0,21%	20.031.307,62
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 278-7	974.130,56		-450.000,00		3.737,53	0,71%	527.868,09
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 267-1	70.040.823,66		-30.500.000,00		344.496,53	0,87%	39.885.320,19
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 281-7	556.646,03		-250.000,00		2.155,57	0,70%	308.801,60
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 18272-9	547.269,35		-300.000,00		1.947,99	0,79%	249.217,34
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 15852-6	45.933.565,19		-30.000.000,00		150.067,75	0,94%	16.083.632,94
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 17879-9	1.934.209,19		-1.200.000,00		6.495,47	0,88%	740.704,66
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	51.920.034,35		-45.000.000,00		-97.935,18	-1,42%	6.822.099,17
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 281-7	647.906,67		-350.000,00		-654,57	-0,22%	297.252,10
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	7.418.865,97		-4.100.000,00		-11.852,01	-0,36%	3.307.013,96
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 278-7	2.252.672,91		-1.300.000,00		-2.609,31	-0,27%	950.063,60
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 269-8	297.989,99	200.000,00	-279.930,64		1.231,72	0,56%	219.291,07
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 267-1	112.832.399,35				930.201,30	0,82%	113.762.600,65
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 278-7	2166181,76				17.858,21	0,82%	2.184.039,97
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 281-7	565.071,47				4.658,51	0,82%	569.729,98
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	35.706.078,92				290.584,92	0,81%	35.996.663,84
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 17879-9	914.244,14				7.440,35	0,81%	921.684,49
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 18272-9	295.383,28				2.403,90	0,81%	297.787,18
BB SUPREMO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	Ag. 86-8 cc 18961-8	93.626,65				445,00	0,48%	94.071,65
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 271-0	1.124.814,13	243.723,34			9.277,63	0,68%	1.377.815,10
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 538-7	631.991,70	154.657,55			5.281,13	0,67%	791.930,38
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 266-3	13.052.507,41	5.400.000,00	-8.128.948,12		69.290,45	0,67%	10.392.849,74
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR		335.609,09			12.784,84	87.289,30	26,01%	410.113,55
CONQUEST FIP - FCCQ11		12.675.312,92				-12.460,29	-0,10%	12.662.852,63
ÁQUILLA FII - AQLL11		6.381.678,52				-59.404,53	-0,93%	6.322.273,99
FIRENZE FII		11.084.939,31				-4.582,63	-0,04%	11.080.356,68
<b>Aplicações</b>		<b>691.150.607,73</b>						<b>699.310.826,34</b>
<b>Imóveis</b>		<b>0,00</b>						<b>0,00</b>
<b>Conta Corrente</b>		<b>854.923,53</b>						<b>2.674.156,07</b>
Caixa 267-1		218.988,45						348.955,33
Caixa 278-7		14.058,19						5.864,35
Caixa 281-7		0,00						0,00
Banco do Brasil 17160-3		0,00						0,00
Banco do Brasil 15854-2		6.908,89						5.165,39
Banco do Brasil 15852-6		19.465,96						51.076,57
Banco do Brasil 17879-9		0,00						0,00
Banco do Brasil 18272-9		0,00						0,00
Banco do Brasil 18961-8		0,00						0,00
Caixa 271-0		302.127,10						421.413,39
Caixa 269-8		0,00						493.172,46
Caixa 266-3		137.562,13						1.187.994,57
Caixa 538-7		155.812,81						160.514,01
<b>FINAL</b>		<b>692.005.531,26</b>	<b>161.898.334,43</b>	<b>-158.058.878,76</b>	<b>12.784,84</b>	<b>4.333.547,78</b>	<b>0,62%</b>	<b>701.984.982,41</b>

jul/17

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
NTN-B IPSM		11.756.457,21				622.283,32	5,29%	12.378.740,53
NTN-F IPSM		79.052.681,46			3.672.865,96	2.334.056,79	2,95%	77.713.872,29
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	10.026.053,92		-900.000,00		382.413,35	4,19%	9.508.467,27
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	1.186.292,29				32.864,40	2,77%	1.219.156,69
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 278-7	4.020.135,07	349.361,62			44.374,68	1,02%	4.413.871,37
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 267-1	199.638.450,34	8.600.000,00			2.136.855,33	1,03%	210.375.305,67
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 281-7	1.973.869,31				20.582,69	1,04%	1.994.452,00
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁR	Ag. 86-8 cc 18272-9	898.366,59				9.482,96	1,06%	907.849,55
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁR	Ag. 86-8 cc 17879-9	4.342.690,21				45.840,49	1,06%	4.388.530,70
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁR	Ag. 86-8 cc 15852-6	100.128.487,77				1.056.934,35	1,06%	101.185.422,12
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	20.031.307,62				792.576,24	3,96%	20.823.883,86
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 278-7	527.868,09				14.902,79	2,82%	542.770,88
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 267-1	39.885.320,19				962.214,60	2,41%	40.847.534,79
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 281-7	308.801,60				8.718,10	2,82%	317.519,70
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 18272-9	249.217,34				7.102,16	2,85%	256.319,50
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 15852-6	16.083.632,94				458.348,81	2,85%	16.541.981,75
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 17879-9	740.704,66				21.108,48	2,85%	761.813,14
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	6.822.099,17				273.424,13	4,01%	7.095.523,30
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 281-7	297.252,10				11.217,78	3,77%	308.469,88
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	3.307.013,96				124.800,95	3,77%	3.431.814,91
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 278-7	950.063,60				35.853,75	3,77%	985.917,35
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 269-8	219.291,07		-76.001,03		1.406,93	0,98%	144.696,97
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 267-1	113.762.600,65				893.553,72	0,79%	114.656.154,37
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 278-7	2.184.039,97				17.154,64	0,79%	2.201.194,61
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 281-7	569.729,98				4.474,97	0,79%	574.204,95
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	35.996.663,84	139.000,00			290.694,74	0,80%	36.426.358,58
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 17879-9	921.684,49				7.425,47	0,81%	929.109,96
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 18272-9	297.787,18				2.399,10	0,81%	300.186,28
BB SUPREMO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	Ag. 86-8 cc 18961-8	94.071,65				437,15	0,46%	94.508,80
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 271-0	1.377.815,10	37.271,89	-765.460,55		5.690,89	0,88%	655.317,33
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 538-7	791.930,38	159.358,75			6.385,87	0,67%	957.675,00
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 266-3	10.392.849,74	3.000.000,00	-8.712.248,18		30.047,17	0,64%	4.710.648,73
ITÁLIA FIDC MULTISSECTORIAL SÊNIOR		410.113,55			88.878,58	508,49	0,12%	321.743,46
CONQUEST FIP - FCCQ11		12.662.852,63				-26.879,80	-0,21%	12.635.972,83
ÁQUILLA FII - AQLL11		6.322.273,99				60.207,81	0,95%	6.382.481,80
FIRENZE FII		11.080.356,68				515.801,54	4,66%	11.596.158,22
<b>Aplicações</b>		<b>699.310.826,34</b>						<b>708.585.629,14</b>
<b>Imóveis</b>		<b>0,00</b>						<b>0,00</b>
<b>Conta Corrente</b>		<b>2.674.156,07</b>						<b>3.449.646,01</b>
Caixa 267-1		348.955,33						969.788,12
Caixa 278-7		5.864,35						4.280,84
Caixa 281-7		0,00						0,00
Banco do Brasil 17160-3		0,00						0,00
Banco do Brasil 15854-2		5.165,39						3.421,89
Banco do Brasil 15852-6		51.076,57						23.060,85
Banco do Brasil 17879-9		0,00						0,00
Banco do Brasil 18272-9		0,00						0,00
Banco do Brasil 18961-8		0,00						0,00
Caixa 271-0		421.413,39						332.115,58
Caixa 269-8		493.172,46						599.334,58
Caixa 266-3		1.187.994,57						1.334.677,46
Caixa 538-7		160.514,01						182.966,69
<b>FINAL</b>		<b>701.984.982,41</b>	<b>12.284.992,26</b>	<b>-10.453.709,76</b>	<b>3.761.744,54</b>	<b>11.205.264,84</b>	<b>1,59%</b>	<b>712.035.275,15</b>

ago/17

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
NTN-B IPSM		12.378.740,53				170.080,58	1,37%	12.548.821,11
NTN-F IPSM		77.713.872,29				828.883,57	1,07%	78.542.755,86
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	9.508.467,27				126.166,67	1,33%	9.634.633,94
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	1.219.156,69	800.000,00			20.465,10	1,01%	2.039.621,79
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 278-7	4.413.871,37	358.417,45			41.185,68	0,86%	4.813.474,50
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 267-1	210.375.305,67	6.800.000,00			1.908.004,84	0,88%	219.083.310,51
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 281-7	1.994.452,00				17.743,94	0,89%	2.012.195,94
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁR	Ag. 86-8 cc 18272-9	907.849,55				7.966,14	0,88%	915.815,69
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁR	Ag. 86-8 cc 17879-9	4.388.530,70				38.508,20	0,88%	4.427.038,90
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁR	Ag. 86-8 cc 15852-6	101.185.422,12				887.875,52	0,88%	102.073.297,64
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	20.823.883,86				275.415,30	1,32%	21.099.299,16
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 278-7	542.770,88				6.728,43	1,24%	549.499,31
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 267-1	40.847.534,79				393.761,96	0,96%	41.241.296,75
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 281-7	317.519,70				3.936,11	1,24%	321.455,81
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 18272-9	256.319,50				3.189,00	1,24%	259.508,50
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 15852-6	16.541.981,75				205.807,33	1,24%	16.747.789,08
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 17879-9	761.813,14				9.478,11	1,24%	771.291,25
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	7.095.523,30				94.426,74	1,33%	7.189.950,04
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 281-7	308.469,88				4.186,80	1,36%	312.656,68
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	3.431.814,91				46.579,43	1,36%	3.478.394,34
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 278-7	985.917,35				13.381,67	1,36%	999.299,02
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 269-8	144.696,97				1.047,34	0,72%	145.744,31
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 267-1	114.656.154,37				907.674,12	0,79%	115.563.828,49
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 278-7	2.201.194,61				17.425,74	0,79%	2.218.620,35
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 281-7	574.204,95				4.545,69	0,79%	578.750,64
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	36.426.358,58				288.828,21	0,79%	36.715.186,79
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 17879-9	929.109,96				7.367,00	0,79%	936.476,96
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 18272-9	300.186,28				2.380,20	0,79%	302.566,48
BB SUPREMO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	Ag. 86-8 cc 18961-8	94.508,80				409,69	0,43%	94.918,49
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 271-0	655.317,33	350.000,00			6.173,30	0,61%	1.011.490,63
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 538-7	957.675,00	181.670,03			7.674,06	0,67%	1.147.019,09
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 266-3	4.710.648,73	3.500.000,00	-3.135.021,78		22.374,69	0,44%	5.098.001,64
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR		321.743,46			10.791,77	395,38	0,12%	311.347,07
CONQUEST FIP - FCCQ11		12.635.972,83				-15.102,98	-0,12%	12.620.869,85
ÁQUILLA FII - AQLL11		6.382.481,80				-13.190,75	-0,21%	6.369.291,05
FIRENZE FII		11.596.158,22				-1.293,76	-0,01%	11.594.864,46
<b>Aplicações</b>		<b>708.585.629,14</b>						<b>723.770.382,12</b>
<b>Imóveis</b>		<b>0,00</b>						<b>0,00</b>
<b>Conta Corrente</b>		<b>3.449.646,01</b>						<b>4.373.658,67</b>
Caixa 267-1		969.788,12						1.362.916,78
Caixa 278-7		4.280,84						16.522,07
Caixa 281-7		0,00						0,00
Banco do Brasil 17160-3		0,00						0,00
Banco do Brasil 15854-2		3.421,89						3.410,64
Banco do Brasil 15852-6		23.060,85						124.176,80
Banco do Brasil 17879-9		0,00						0,00
Banco do Brasil 18272-9		0,00						0,00
Banco do Brasil 18961-8		0,00						0,00
Caixa 271-0		332.115,58						408.592,85
Caixa 269-8		599.334,58						815.210,82
Caixa 266-3		1.334.677,46						1.459.224,55
Caixa 538-7		182.966,69						183.604,16
<b>FINAL</b>		<b>712.035.275,15</b>	<b>11.990.087,48</b>	<b>-3.135.021,78</b>	<b>10.791,77</b>	<b>6.340.479,05</b>	<b>0,88%</b>	<b>728.144.040,79</b>

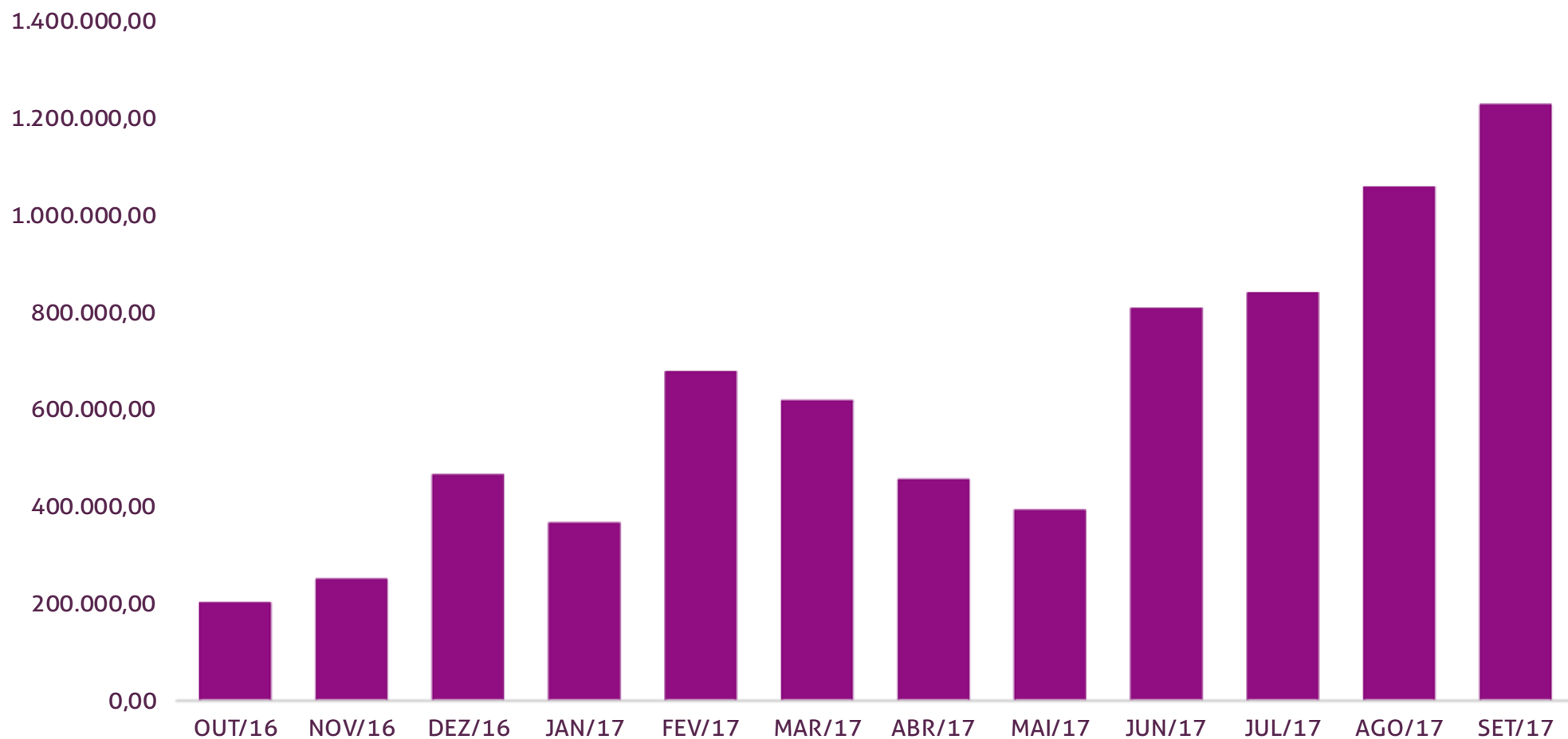
set/17

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
NTN-B IPSM		12.548.821,11				358.280,99	2,86%	12.907.102,10
NTN-F IPSM		78.542.755,86				1.341.007,82	1,71%	79.883.763,68
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	9.634.633,94				173.409,82	1,80%	9.808.043,76
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	2.039.621,79	9.000.000,00			59.965,63	0,54%	11.099.587,42
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 278-7	4.813.474,50	375.074,95			34.869,90	0,67%	5.223.419,35
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 267-1	219.083.310,51				1.565.667,13	0,71%	220.648.977,64
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 281-7	2.012.195,94				14.380,05	0,71%	2.026.575,99
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 538-7	0,00	180.000,00			225,88	0,13%	180.225,88
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁR	Ag. 86-8 cc 18272-9	915.815,69				6.513,86	0,71%	922.329,55
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁR	Ag. 86-8 cc 17879-9	4.427.038,90				31.487,90	0,71%	4.458.526,80
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁR	Ag. 86-8 cc 15852-6	102.073.297,64	135.246,29			726.131,98	0,71%	102.934.675,91
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	21.099.299,16				375.728,73	1,78%	21.475.027,89
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 278-7	549.499,31				5.450,12	0,99%	554.949,43
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 267-1	41.241.296,75				367.741,73	0,89%	41.609.038,48
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 281-7	321.455,81				3.188,31	0,99%	324.644,12
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 18272-9	259.508,50				2.566,41	0,99%	262.074,91
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 15852-6	16.747.789,08				165.627,43	0,99%	16.913.416,51
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 17879-9	771.291,25				7.627,69	0,99%	778.918,94
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	7.189.950,04				132.638,71	1,84%	7.322.588,75
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 281-7	312.656,68				5.599,02	1,79%	318.255,70
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	3.478.394,34				62.290,58	1,79%	3.540.684,92
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 278-7	999.299,02				17.895,31	1,79%	1.017.194,33
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 269-8	145.744,31	1.000.000,00	-17.252,12		1.926,22	0,17%	1.130.418,41
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 267-1	115.563.828,49				732.660,90	0,63%	116.296.489,39
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 278-7	2.218.620,35				14.065,79	0,63%	2.232.686,14
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 281-7	578.750,64				3.669,21	0,63%	582.419,85
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	36.715.186,79				238.516,34	0,65%	36.953.703,13
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 17879-9	936.476,96				6.083,73	0,65%	942.560,69
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 18272-9	302.566,48				1.965,60	0,65%	304.532,08
BB SUPREMO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	Ag. 86-8 cc 18961-8	94.918,49				305,76	0,32%	95.224,25
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 271-0	1.011.490,63		-926.638,64		2.113,34	0,21%	86.965,33
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 538-7	1.147.019,09				6.582,71	0,57%	1.153.601,80
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 266-3	5.098.001,64	763.095,65	-4.902.056,83		6.609,02	0,13%	965.649,48
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR		311.347,07			11.069,49	1.277,32	0,41%	301.554,90
CONQUEST FIP - FCCQ11		12.620.869,85				-11.872,06	-0,09%	12.608.997,79
ÁQUILLA FII - AQLL11		6.369.291,05				-15.681,62	-0,25%	6.353.609,43
FIRENZE FII		11.594.864,46				-3.373,12	-0,03%	11.591.491,34
<b>Aplicações</b>		<b>723.770.382,12</b>						<b>735.809.926,07</b>
<b>Imóveis</b>		<b>0,00</b>						<b>0,00</b>
<b>Conta Corrente</b>		<b>4.373.658,67</b>						<b>1.206.376,96</b>
Caixa 267-1		1.362.916,78						526.000,99
Caixa 278-7		16.522,07						7.605,44
Caixa 281-7		0,00						0,00
Banco do Brasil 17160-3		0,00						0,00
Banco do Brasil 15854-2		3.410,64						3.410,64
Banco do Brasil 15852-6		124.176,80						19.927,76
Banco do Brasil 17879-9		0,00						0,00
Banco do Brasil 18272-9		0,00						0,00
Banco do Brasil 18961-8		0,00						0,00
Caixa 271-0		408.592,85						362.262,79
Caixa 269-8		815.210,82						0,00
Caixa 266-3		1.459.224,55						78.552,82
Caixa 538-7		183.604,16						208.616,52
<b>FINAL</b>		<b>728.144.040,79</b>	<b>11.453.416,89</b>	<b>-5.845.947,59</b>	<b>11.069,49</b>	<b>6.443.144,14</b>	<b>0,88%</b>	<b>737.016.303,03</b>

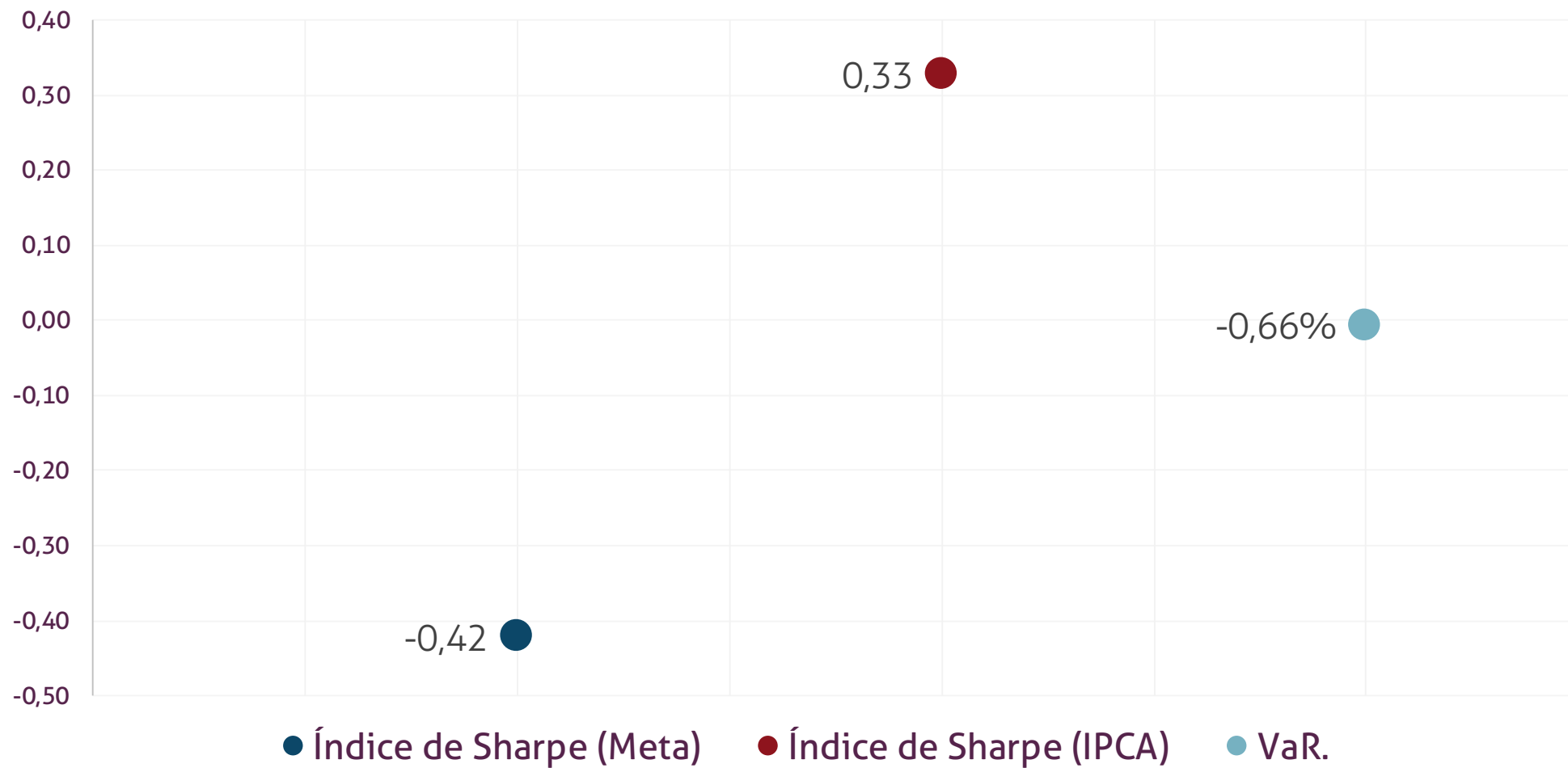


## Evolução Patrimônio Líquido - Fundo Administrativo

Jan	R\$	364.896,24	Fev	R\$	676.473,05	Mar	R\$	616.813,62	Abr	R\$	454.395,43
Mai	R\$	391.616,64	Jun	R\$	806.535,18	Jul	R\$	838.540,35	Ago	R\$	1.055.873,62
Set	R\$	1.225.642,66	Out			Nov			Dez		

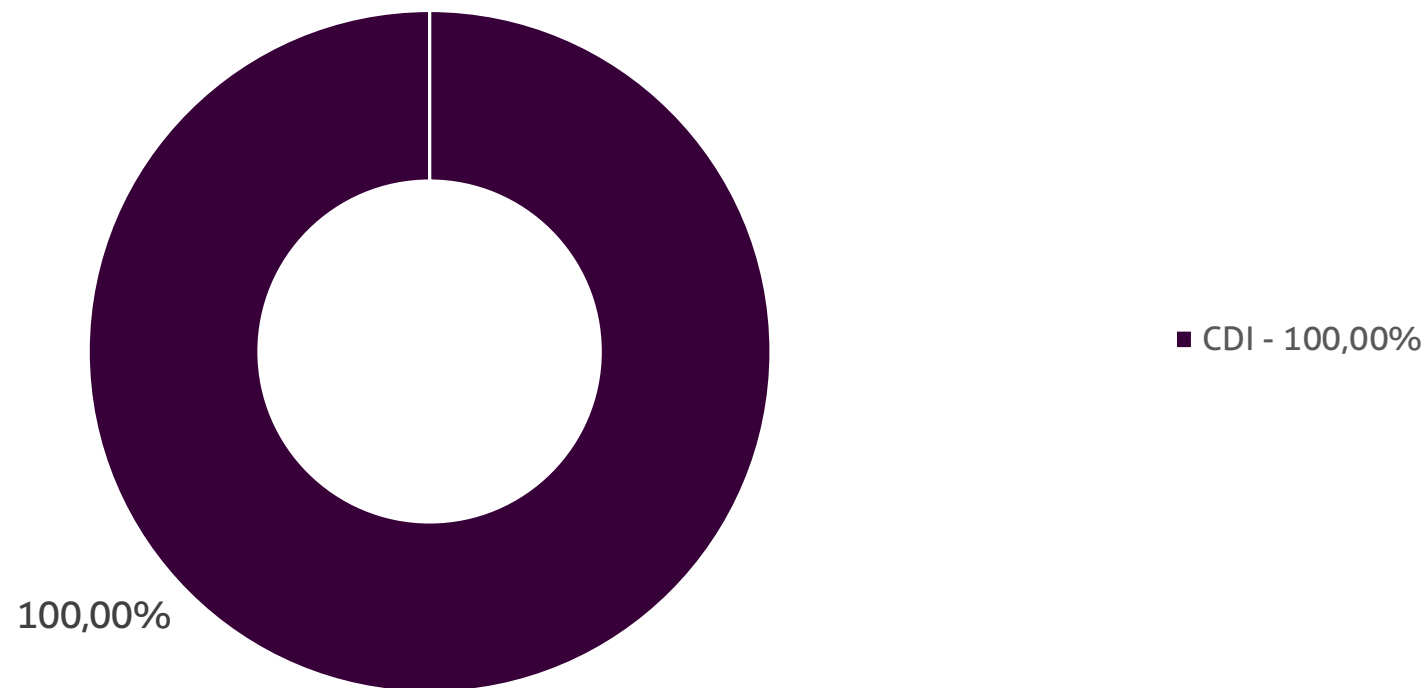


## Índice de Sharpe e Var da Carteira

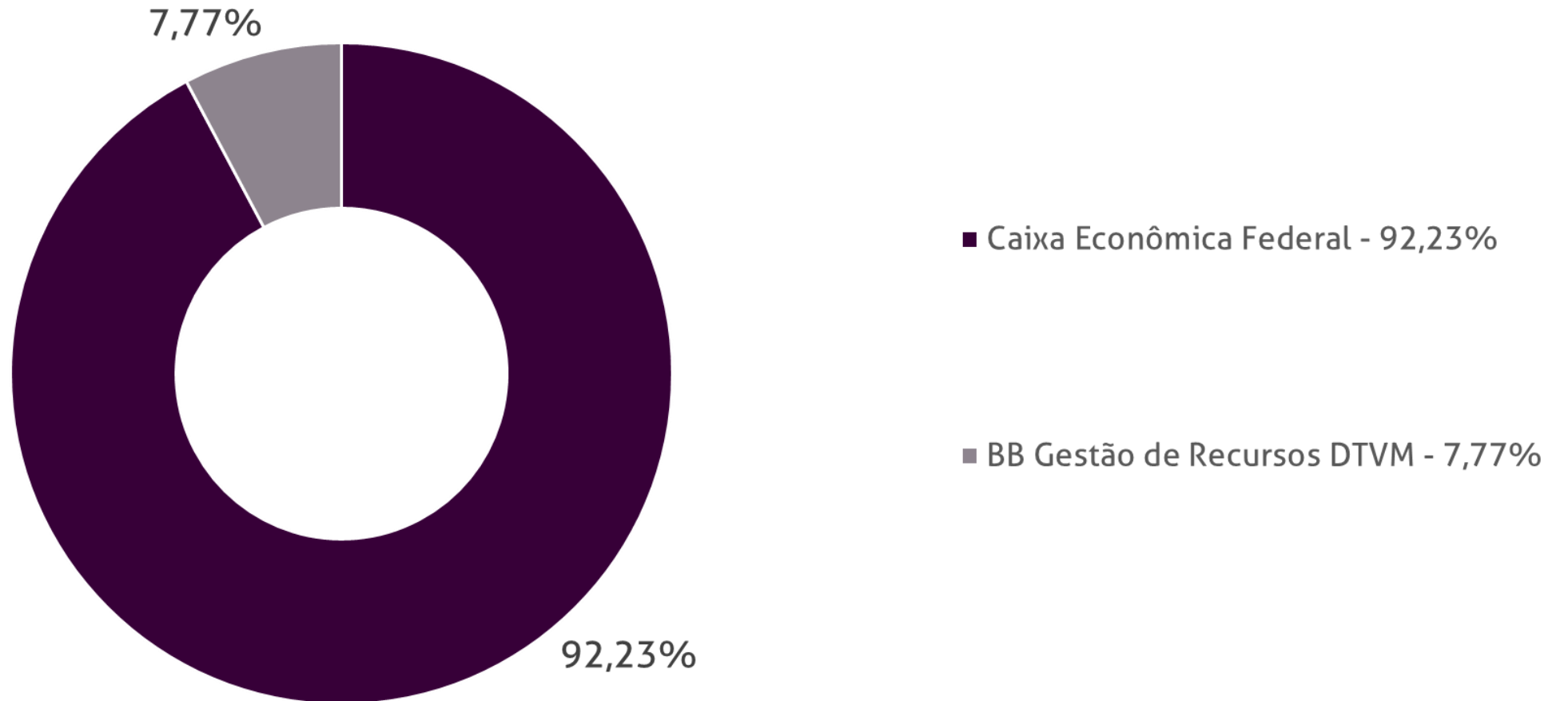


Fundos	CNPJ	Gestão	Taxa de Administração	Benchmark	Resgate
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	14.508.643/0001-55	Caixa Econômica Federal	0,80%	CDI	D+0
BB SUPREMO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	04.288.966/0001-27	BB Gestão de Recursos DTVM	4,00%	CDI	D+0

### Distribuição por Indicador - Setembro - 2017



## Distribuição por Instituição - Setembro - 2017

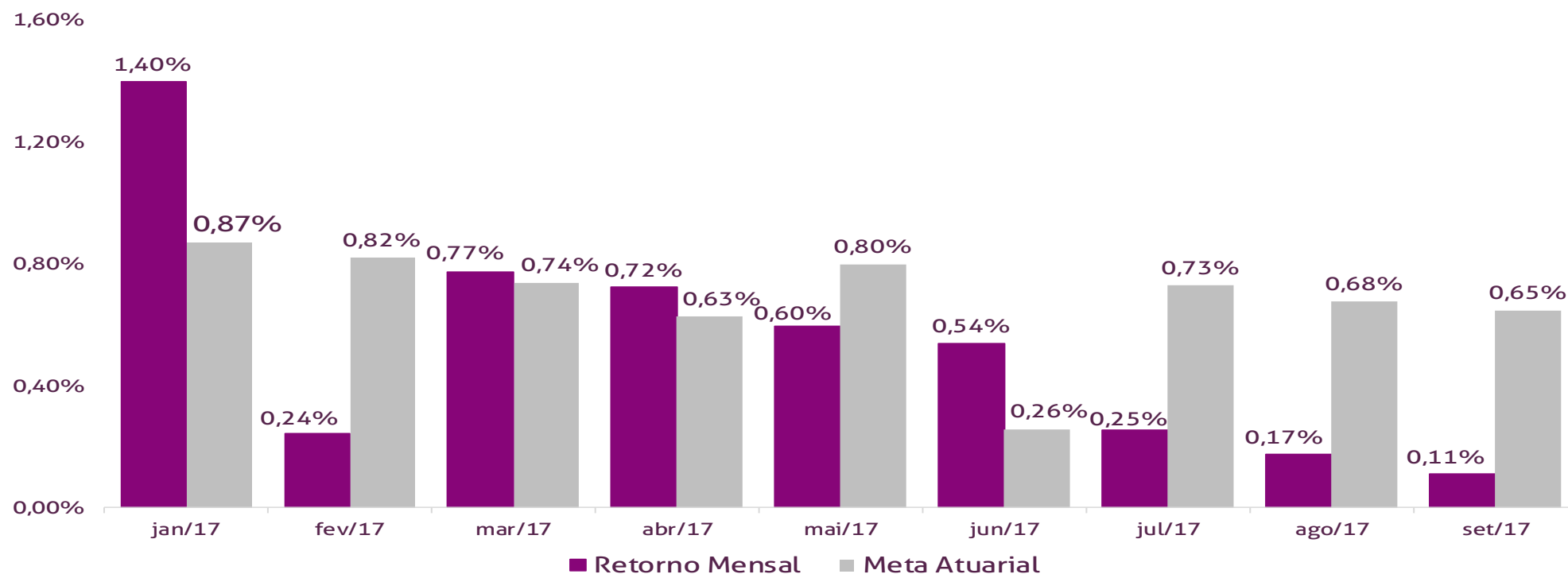


Performance Absoluta

	jan-17	fev-17	mar-17	abr-17	mai-17	jun-17
Carteira	1,40%	0,24%	0,77%	0,72%	0,60%	0,54%
Retorno Financeiro	5.022,93	1.627,50	4.724,33	3.255,83	2.318,04	1.676,72
Meta Atuarial	0,87%	0,82%	0,74%	0,63%	0,80%	0,26%

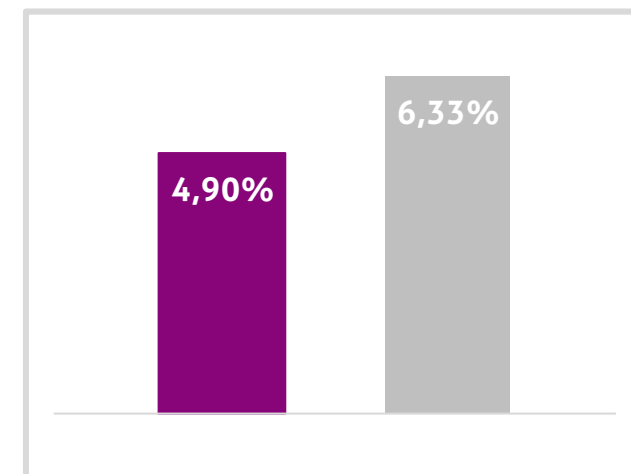
	jul-17	ago-17	set-17	out-17	nov-17	dez-17
Carteira	0,25%	0,17%	0,11%			
Retorno Financeiro	1.844,08	1.457,03	2.231,98			
Meta Atuarial	0,73%	0,68%	0,65%			

### Retorno Mensal X Meta Atuarial Mensal



Estatística		
Meses positivos:	9	
Meses negativos:	0	
Meses acima da Meta Atuarial:	4	
Meses abaixo da Meta Atuarial:	5	
Retorno Mensal Máximo	1,40%	jan-17
Retorno Mensal Médio	0,53%	
Retorno Mensal Mínimo	0,11%	set-17
Sharpe	-0,42	
Volatilidade	8,21%	
VaR	-0,66%	
Meta Atuarial	IPCA + 6%	

Consolidado - 2017	
Carteira	4,90%
Retorno	R\$ 24.158,44
Meta	6,33%



### jan/17

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 269-8	464.404,74		-195.345,46		4.361,09	1,62%	273.420,37
BB SUPREMO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRA	Ag. 86-8 cc 18961-8	90.814,03				661,84	0,73%	91.475,87
<b>Aplicações</b>		<b>555.218,77</b>						<b>364.896,24</b>
<b>Imóveis</b>		<b>0,00</b>						<b>0,00</b>
<b>Conta Corrente</b>		<b>0,00</b>						<b>0,00</b>
Banco do Brasil 15853-4		0,00						0,00
Banco do Brasil 18961-8		0,00						0,00
Caixa 269-8		0,00						0,00
<b>Final</b>		<b>555.218,77</b>	<b>0,00</b>	<b>-195.345,46</b>	<b>0,00</b>	<b>5.022,93</b>	<b>1,40%</b>	<b>364.896,24</b>

### fev/17

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 269-8	273.420,37	947.851,78	-637.902,47		1.101,12	0,19%	584.470,80
BB SUPREMO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRA	Ag. 86-8 cc 18961-8	91.475,87				526,38	0,58%	92.002,25
<b>Aplicações</b>		<b>364.896,24</b>						<b>676.473,05</b>
<b>Imóveis</b>		<b>0,00</b>						<b>0,00</b>
<b>Conta Corrente</b>		<b>0,00</b>						<b>0,00</b>
Banco do Brasil 18961-8		0,00						0,00
Caixa 269-8		0,00						0,00
<b>FINAL</b>		<b>364.896,24</b>	<b>947.851,78</b>	<b>-637.902,47</b>	<b>0,00</b>	<b>1.627,50</b>	<b>0,24%</b>	<b>676.473,05</b>

### mar/17

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 269-8	584.470,80	590.000,00	-654.383,76		4.094,38	0,79%	524.181,42
BB SUPREMO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRA	Ag. 86-8 cc 18961-8	92.002,25				629,95	0,68%	92.632,20
<b>Aplicações</b>		<b>676.473,05</b>						<b>616.813,62</b>
<b>Imóveis</b>		<b>0,00</b>						<b>0,00</b>
<b>Conta Corrente</b>		<b>0,00</b>						<b>0,00</b>
Banco do Brasil 18961-8		0,00						0,00
Caixa 269-8		0,00						0,00
<b>FINAL</b>		<b>676.473,05</b>	<b>590.000,00</b>	<b>-654.383,76</b>	<b>0,00</b>	<b>4.724,33</b>	<b>0,77%</b>	<b>616.813,62</b>

**abr/17**

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 269-8	524.181,42	412.567,15	-578.241,17		2.793,70	0,78%	361.301,10
BB SUPREMO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRA	Ag. 86-8 cc 18961-8	92.632,20				462,13	0,50%	93.094,33
<b>Aplicações</b>		<b>616.813,62</b>						<b>454.395,43</b>
<b>Imóveis</b>		<b>0,00</b>						<b>0,00</b>
<b>Conta Corrente</b>		<b>0,00</b>						<b>0,00</b>
Banco do Brasil 18961-8		0,00						0,00
Caixa 269-8		0,00						0,00
<b>FINAL</b>		<b>616.813,62</b>	<b>412.567,15</b>	<b>-578.241,17</b>	<b>0,00</b>	<b>3.255,83</b>	<b>0,72%</b>	<b>454.395,43</b>

**mai/17**

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 269-8	361.301,10	400.000,00	-465.096,83		1.785,72	0,60%	297.989,99
BB SUPREMO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRA	Ag. 86-8 cc 18961-8	93.094,33				532,32	0,57%	93.626,65
<b>Aplicações</b>		<b>454.395,43</b>						<b>391.616,64</b>
<b>Imóveis</b>		<b>0,00</b>						<b>0,00</b>
<b>Conta Corrente</b>		<b>0,00</b>						<b>0,00</b>
Banco do Brasil 18961-8		0,00						0,00
Caixa 269-8		0,00						0,00
<b>FINAL</b>		<b>454.395,43</b>	<b>400.000,00</b>	<b>-465.096,83</b>	<b>0,00</b>	<b>2.318,04</b>	<b>0,60%</b>	<b>391.616,64</b>

**jun/17**

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 269-8	297.989,99	200.000,00	-279.930,64		1.231,72	0,56%	219.291,07
BB SUPREMO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRA	Ag. 86-8 cc 18961-8	93.626,65				445,00	0,48%	94.071,65
<b>Aplicações</b>		<b>391.616,64</b>						<b>313.362,72</b>
<b>Imóveis</b>		<b>0,00</b>						<b>0,00</b>
<b>Conta Corrente</b>		<b>0,00</b>						<b>493.172,46</b>
Banco do Brasil 18961-8		0,00						0,00
Caixa 269-8		0,00						493.172,46
<b>FINAL</b>		<b>391.616,64</b>	<b>200.000,00</b>	<b>-279.930,64</b>	<b>0,00</b>	<b>1.676,72</b>	<b>0,54%</b>	<b>806.535,18</b>



### jul/17

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 269-8	219.291,07		-76.001,03		1.406,93	0,98%	144.696,97
BB SUPREMO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRA	Ag. 86-8 cc 18961-8	94.071,65				437,15	0,46%	94.508,80
<b>Aplicações</b>		<b>313.362,72</b>						<b>239.205,77</b>
<b>Imóveis</b>		<b>0,00</b>						<b>0,00</b>
<b>Conta Corrente</b>		<b>493.172,46</b>						<b>599.334,58</b>
Banco do Brasil 18961-8		0,00						0,00
Caixa 269-8		493.172,46						599.334,58
<b>FINAL</b>		<b>806.535,18</b>	<b>0,00</b>	<b>-76.001,03</b>	<b>0,00</b>	<b>1.844,08</b>	<b>0,25%</b>	<b>838.540,35</b>

### ago/17

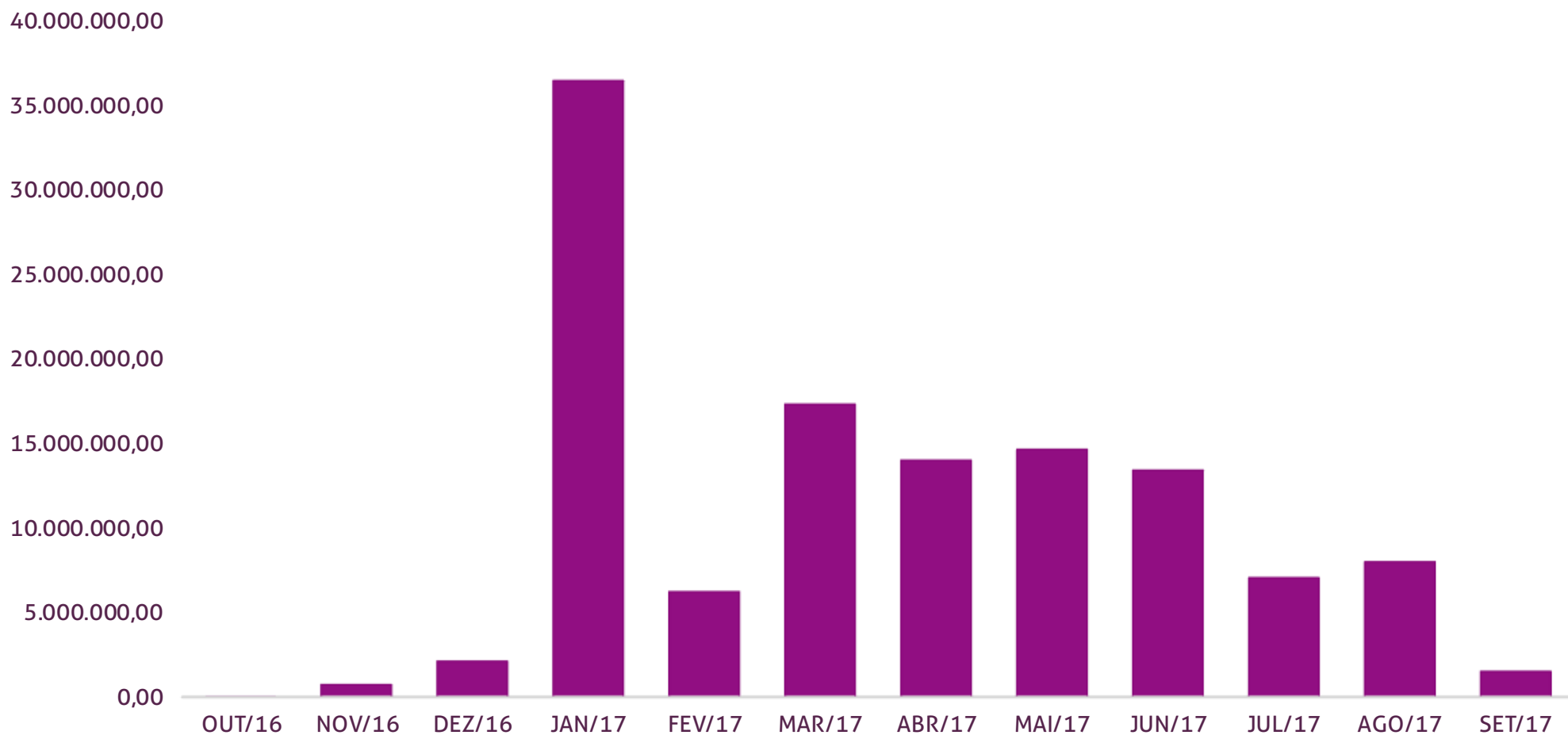
Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 269-8	144.696,97				1.047,34	0,72%	145.744,31
BB SUPREMO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRA	Ag. 86-8 cc 18961-8	94.508,80				409,69	0,43%	94.918,49
<b>Aplicações</b>		<b>239.205,77</b>						<b>240.662,80</b>
<b>Imóveis</b>		<b>0,00</b>						<b>0,00</b>
<b>Conta Corrente</b>		<b>599.334,58</b>						<b>815.210,82</b>
Banco do Brasil 18961-8		0,00						0,00
Caixa 269-8		599.334,58						815.210,82
<b>FINAL</b>		<b>838.540,35</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>1.457,03</b>	<b>0,17%</b>	<b>1.055.873,62</b>

### set/17

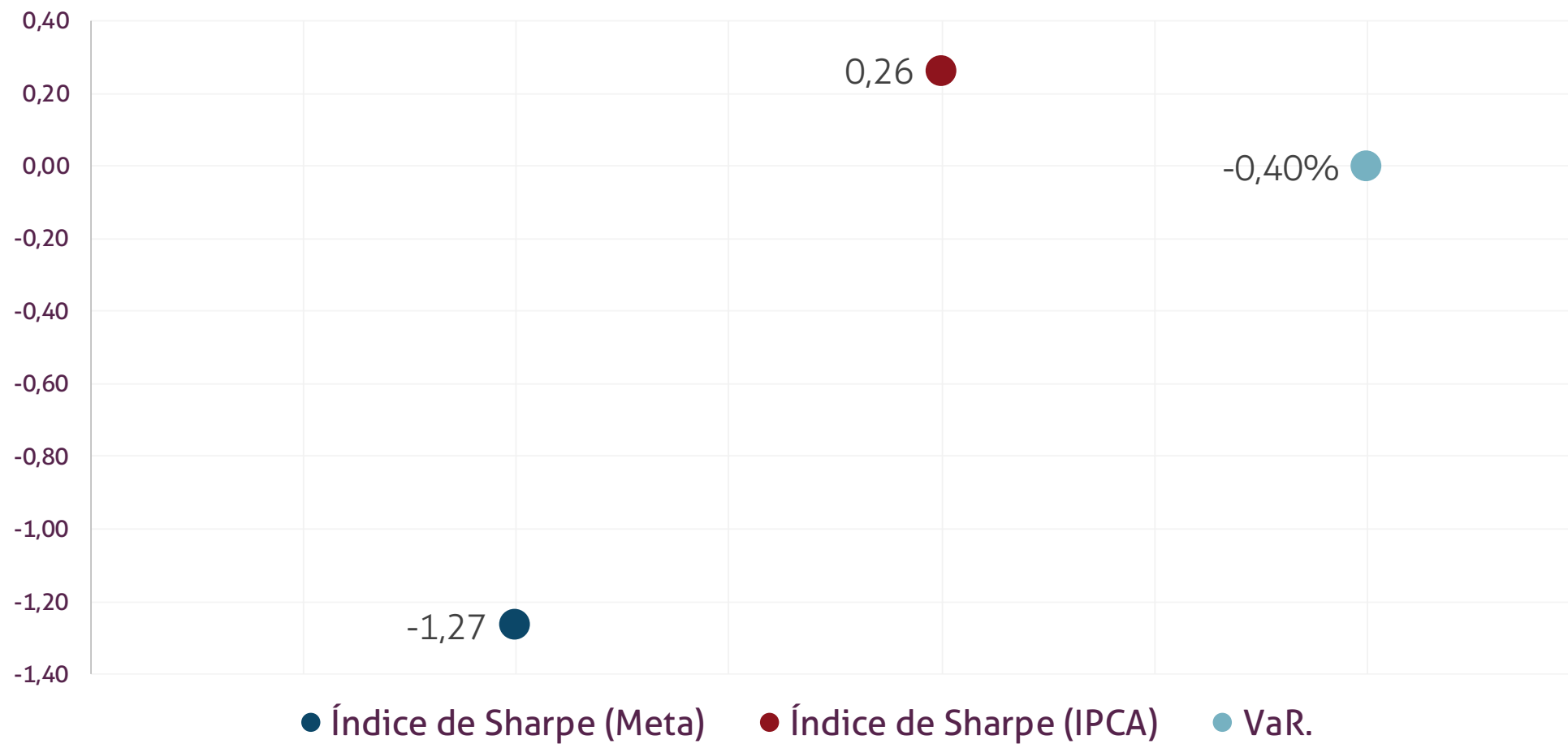
Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 269-8	145.744,31	1.000.000,00	-17.252,12		1.926,22	0,17%	1.130.418,41
BB SUPREMO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRA	Ag. 86-8 cc 18961-8	94.918,49				305,76	0,32%	95.224,25
<b>Aplicações</b>		<b>240.662,80</b>						<b>1.225.642,66</b>
<b>Imóveis</b>		<b>0,00</b>						<b>0,00</b>
<b>Conta Corrente</b>		<b>815.210,82</b>						<b>0,00</b>
Banco do Brasil 18961-8		0,00						0,00
Caixa 269-8		815.210,82						0,00
<b>FINAL</b>		<b>1.055.873,62</b>	<b>1.000.000,00</b>	<b>-17.252,12</b>	<b>0,00</b>	<b>2.231,98</b>	<b>0,11%</b>	<b>1.225.642,66</b>

## Evolução Patrimônio Líquido - Fundo I

Jan	R\$ 36.405.577,62	Fev	R\$ 6.212.959,16	Mar	R\$ 17.287.092,47	Abr	R\$ 13.973.930,68
Mai	R\$ 14.623.919,66	Jun	R\$ 13.385.238,19	Jul	R\$ 7.036.180,99	Ago	R\$ 7.980.720,31
Set	R\$ 1.496.841,06	Out		Nov		Dez	

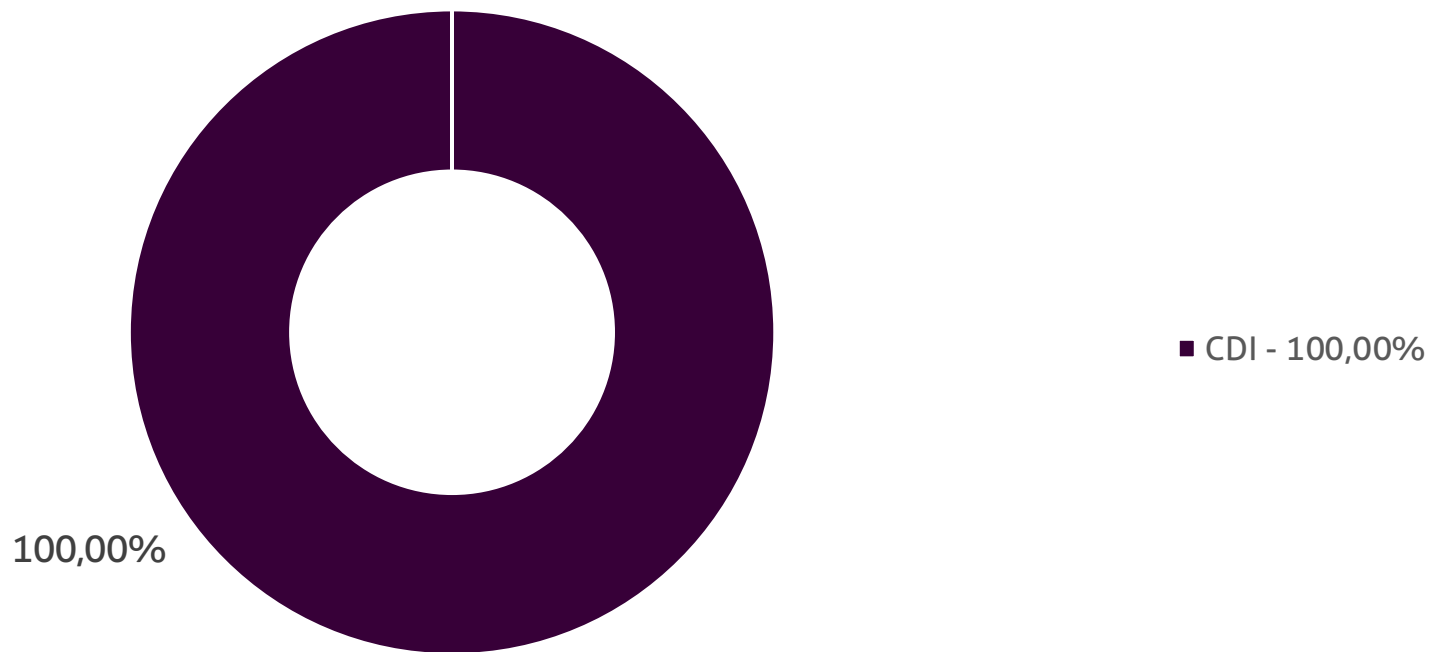


## Índice de Sharpe e Var da Carteira



Fundos	CNPJ	Gestão	Taxa de Administração	Benchmark	Resgate
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	14.508.643/0001-55	Caixa Econômica Federal	0,80%	CDI	D+0

### Distribuição por Indicador - Setembro - 2017



## Distribuição por Instituição - Setembro - 2017

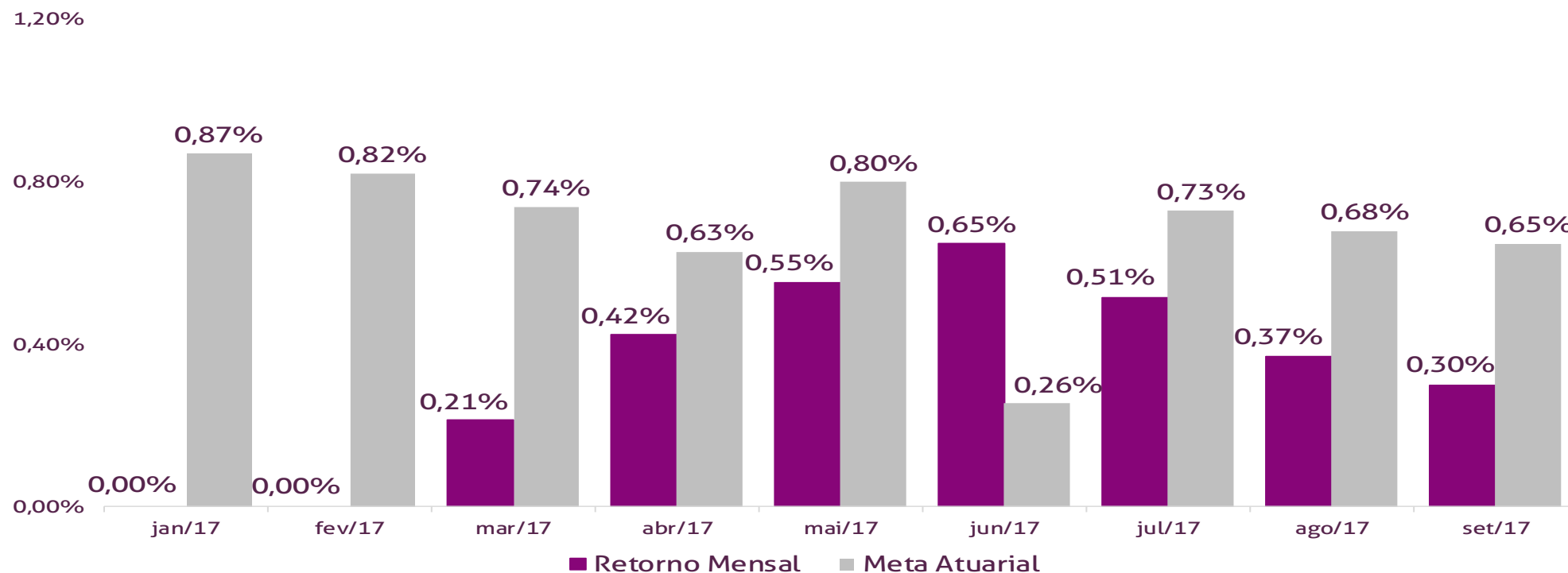


Performance Absoluta

	jan-17	fev-17	mar-17	abr-17	mai-17	jun-17
Carteira	0,00%	0,00%	0,21%	0,42%	0,55%	0,65%
Retorno Financeiro	0,00	0,00	38.113,97	75.248,50	86.513,83	78.568,08
Meta Atuarial	0,87%	0,82%	0,74%	0,63%	0,80%	0,26%

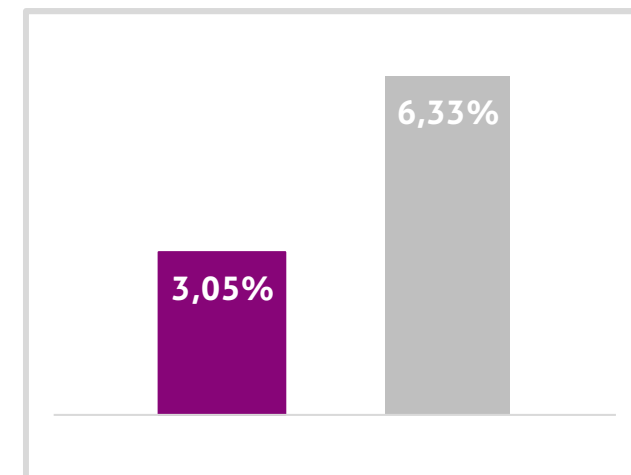
	jul-17	ago-17	set-17	out-17	nov-17	dez-17
Carteira	0,51%	0,37%	0,30%			
Retorno Financeiro	35.738,06	28.547,99	8.722,36			
Meta Atuarial	0,73%	0,68%	0,65%			

## Retorno Mensal X Meta Atuarial Mensal



Estatística		
Meses positivos:	7	
Meses negativos:	0	
Meses acima da Meta Atuarial:	1	
Meses abaixo da Meta Atuarial:	6	
Retorno Mensal Máximo	0,65%	jun-17
Retorno Mensal Médio	0,34%	
Retorno Mensal Mínimo	0,00%	jan-17
Sharpe	-1,27	
Volatilidade	4,03%	
VaR	-0,40%	
Meta Atuarial	IPCA + 6%	

Consolidado - 2017	
Carteira	3,05%
Retorno	R\$ 351.452,79
Meta	6,33%



### jan/17

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
								0,00
Aplicações		0,00						0,00
Imóveis		0,00						0,00
Conta Corrente		2.106.296,84						36.405.577,62
Banco do Brasil 17160-3		0,00						37.314,95
Banco do Brasil 15854-2		158,73						3.645,23
Caixa 271-0		704.793,81						690.373,66
Caixa 266-3		1.401.344,30						35.674.243,78
<b>Final</b>		<b>2.106.296,84</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>36.405.577,62</b>

### fev/17

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
								0,00
Aplicações		0,00						0,00
Imóveis		0,00						0,00
Conta Corrente		36.405.577,62						6.212.959,16
Banco do Brasil 17160-3		37.314,95						37.314,95
Banco do Brasil 15854-2		3.645,23						10.420,74
Caixa 271-0		690.373,66						2.208.389,82
Caixa 266-3		35.674.243,78						3.956.833,65
<b>FINAL</b>		<b>36.405.577,62</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>6.212.959,16</b>

### mar/17

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 271-0	0,00	2.471.327,72	-1.642.678,04		5.914,07	0,71%	834.563,75
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 266-3	0,00	10.900.000,00			32.199,90	0,30%	10.932.199,90
Aplicações		0,00						11.766.763,65
Imóveis		0,00						0,00
Conta Corrente		6.212.959,16						5.520.328,82
Banco do Brasil 17160-3		37.314,95						0,00
Banco do Brasil 15854-2		10.420,74						7.076,25
Caixa 271-0		2.208.389,82						53.156,66
Caixa 266-3		3.956.833,65						5.460.095,91
<b>FINAL</b>		<b>6.212.959,16</b>	<b>13.371.327,72</b>	<b>-1.642.678,04</b>	<b>0,00</b>	<b>38.113,97</b>	<b>0,21%</b>	<b>17.287.092,47</b>



**abr/17**

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 271-0	834.563,75	144.035,85			6.583,05	0,67%	985.182,65
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 266-3	10.932.199,90	2.965.437,93	-2.618.682,56		68.665,45	0,61%	11.347.620,72
<b>Aplicações</b>		<b>11.766.763,65</b>						<b>12.332.803,37</b>
<b>Imóveis</b>		<b>0,00</b>						<b>0,00</b>
<b>Conta Corrente</b>		<b>5.520.328,82</b>						<b>1.641.127,31</b>
Banco do Brasil 17160-3		0,00						0,00
Banco do Brasil 15854-2		7.076,25						4.701,25
Caixa 271-0		53.156,66						322.070,67
Caixa 266-3		5.460.095,91						1.314.355,39
<b>FINAL</b>		<b>17.287.092,47</b>	<b>3.109.473,78</b>	<b>-2.618.682,56</b>	<b>0,00</b>	<b>75.248,50</b>	<b>0,42%</b>	<b>13.973.930,68</b>

**mai/17**

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 271-0	985.182,65	130.728,48			8.903,00	0,80%	1.124.814,13
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 266-3	11.347.620,72	9.400.000,00	-7.772.724,14		77.610,83	0,60%	13.052.507,41
<b>Aplicações</b>		<b>12.332.803,37</b>						<b>14.177.321,54</b>
<b>Imóveis</b>		<b>0,00</b>						<b>0,00</b>
<b>Conta Corrente</b>		<b>1.641.127,31</b>						<b>446.598,12</b>
Banco do Brasil 17160-3		0,00						0,00
Banco do Brasil 15854-2		4.701,25						6.908,89
Caixa 271-0		322.070,67						302.127,10
Caixa 266-3		1.314.355,39						137.562,13
<b>FINAL</b>		<b>13.973.930,68</b>	<b>9.530.728,48</b>	<b>-7.772.724,14</b>	<b>0,00</b>	<b>86.513,83</b>	<b>0,55%</b>	<b>14.623.919,66</b>

**jun/17**

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 271-0	1.124.814,13	243.723,34			9.277,63	0,68%	1.377.815,10
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 266-3	13.052.507,41	5.400.000,00	-8.128.948,12		69.290,45	0,67%	10.392.849,74
<b>Aplicações</b>		<b>14.177.321,54</b>						<b>11.770.664,84</b>
<b>Imóveis</b>		<b>0,00</b>						<b>0,00</b>
<b>Conta Corrente</b>		<b>446.598,12</b>						<b>1.614.573,35</b>
Banco do Brasil 17160-3		0,00						0,00
Banco do Brasil 15854-2		6.908,89						5.165,39
Caixa 271-0		302.127,10						421.413,39
Caixa 266-3		137.562,13						1.187.994,57
<b>FINAL</b>		<b>14.623.919,66</b>	<b>5.643.723,34</b>	<b>-8.128.948,12</b>	<b>0,00</b>	<b>78.568,08</b>	<b>0,65%</b>	<b>13.385.238,19</b>

jul/17

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 271-0	1.377.815,10	37.271,89	-765.460,55		5.690,89	0,88%	655.317,33
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 266-3	10.392.849,74	3.000.000,00	-8.712.248,18		30.047,17	0,64%	4.710.648,73
<b>Aplicações</b>		11.770.664,84						5.365.966,06
<b>Imóveis</b>		0,00						0,00
<b>Conta Corrente</b>		1.614.573,35						1.670.214,93
Banco do Brasil 17160-3		0,00						0,00
Banco do Brasil 15854-2		5.165,39						3.421,89
Caixa 271-0		421.413,39						332.115,58
Caixa 266-3		1.187.994,57						1.334.677,46
<b>FINAL</b>		<b>13.385.238,19</b>	<b>3.037.271,89</b>	<b>-9.477.708,73</b>	<b>0,00</b>	<b>35.738,06</b>	<b>0,51%</b>	<b>7.036.180,99</b>

ago/17

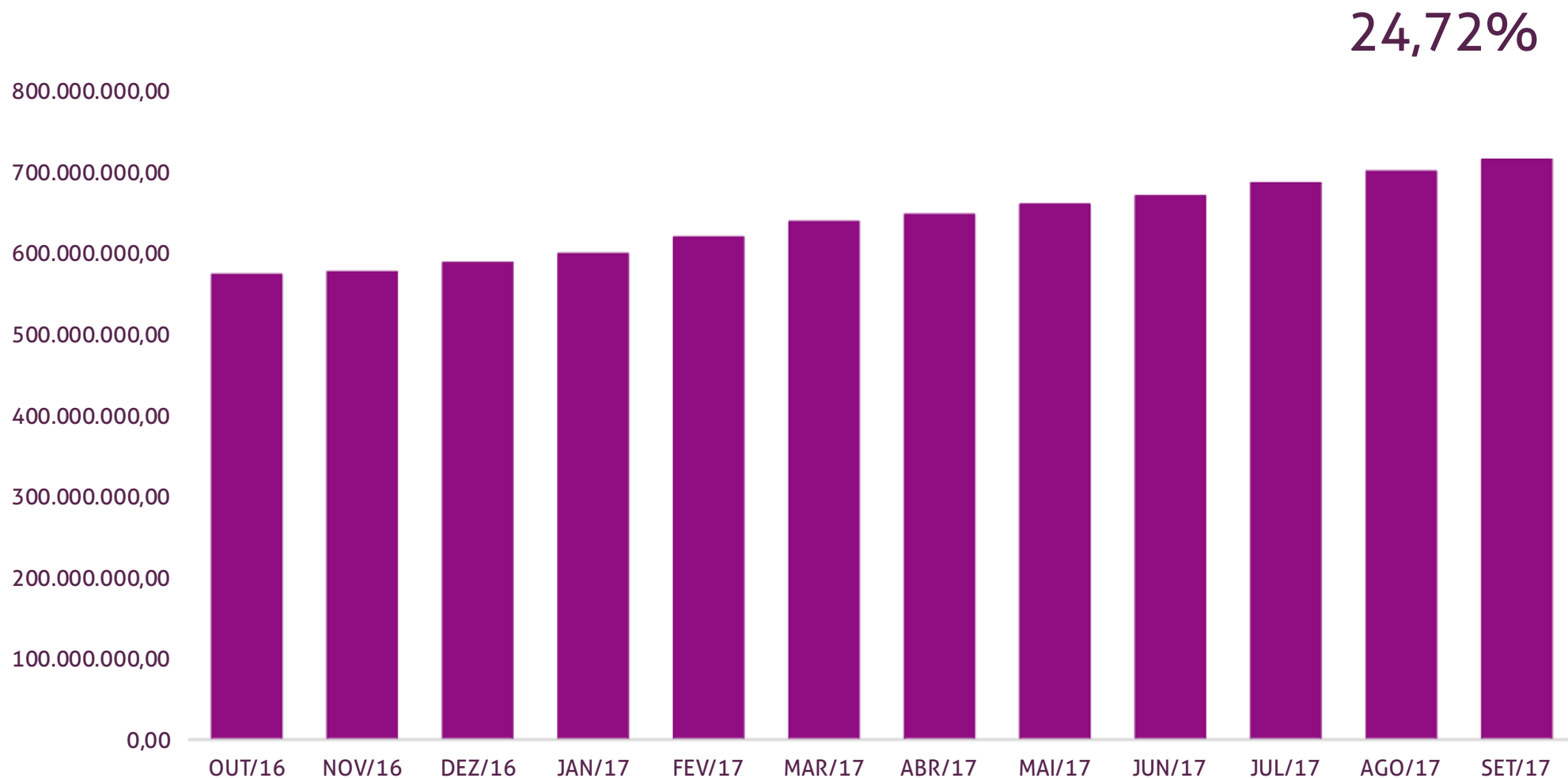
Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 271-0	655.317,33	350.000,00			6.173,30	0,61%	1.011.490,63
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 266-3	4.710.648,73	3.500.000,00	-3.135.021,78		22.374,69	0,44%	5.098.001,64
<b>Aplicações</b>		5.365.966,06						6.109.492,27
<b>Imóveis</b>		0,00						0,00
<b>Conta Corrente</b>		1.670.214,93						1.871.228,04
Banco do Brasil 17160-3		0,00						0,00
Banco do Brasil 15854-2		3.421,89						3.410,64
Caixa 271-0		332.115,58						408.592,85
Caixa 266-3		1.334.677,46						1.459.224,55
<b>FINAL</b>		<b>7.036.180,99</b>	<b>3.850.000,00</b>	<b>-3.135.021,78</b>	<b>0,00</b>	<b>28.547,99</b>	<b>0,37%</b>	<b>7.980.720,31</b>

set/17

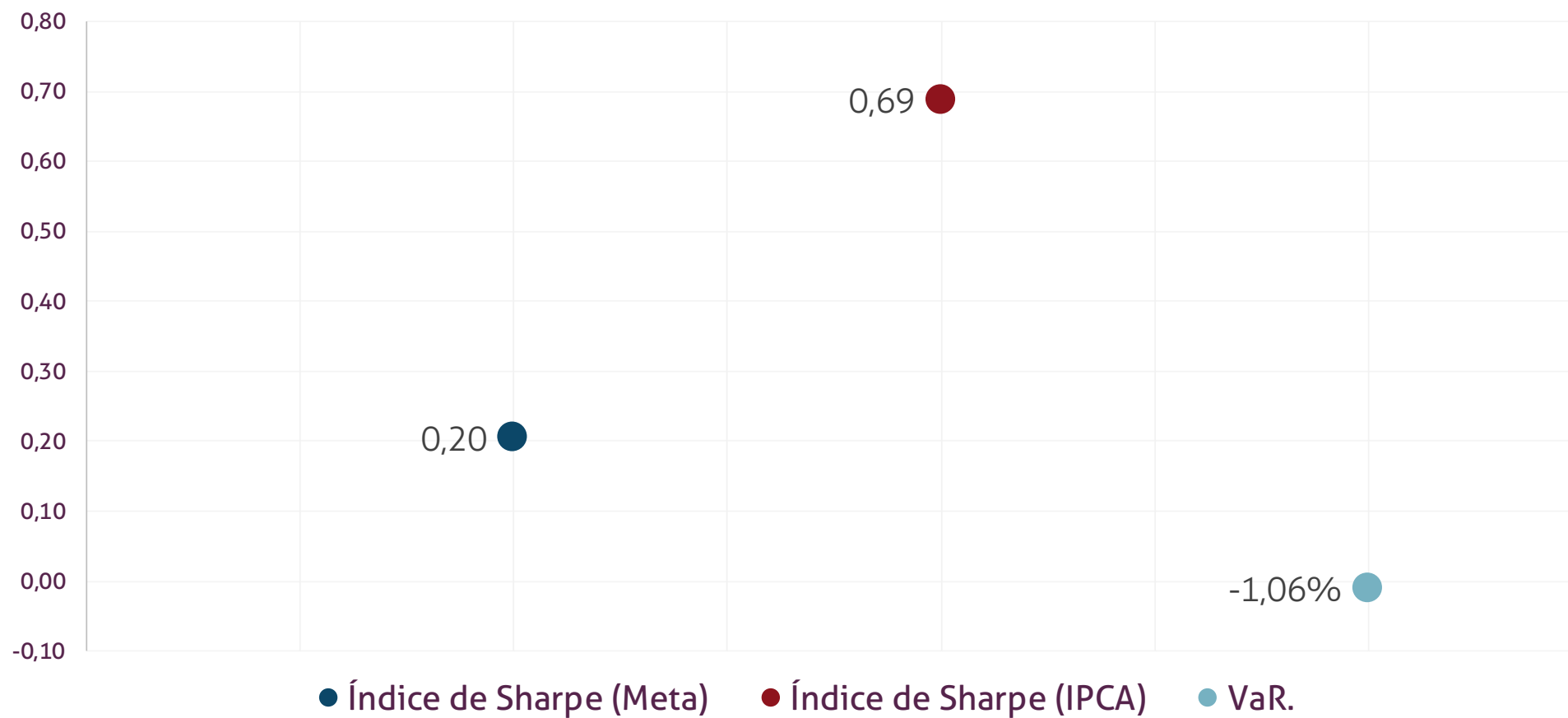
Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 271-0	1.011.490,63		-926.638,64		2.113,34	0,21%	86.965,33
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 266-3	5.098.001,64	763.095,65	-4.902.056,83		6.609,02	0,13%	965.649,48
<b>Aplicações</b>		6.109.492,27						1.052.614,81
<b>Imóveis</b>		0,00						0,00
<b>Conta Corrente</b>		1.871.228,04						444.226,25
Banco do Brasil 17160-3		0,00						0,00
Banco do Brasil 15854-2		3.410,64						3.410,64
Caixa 271-0		408.592,85						362.262,79
Caixa 266-3		1.459.224,55						78.552,82
<b>FINAL</b>		<b>7.980.720,31</b>	<b>763.095,65</b>	<b>-5.828.695,47</b>	<b>0,00</b>	<b>8.722,36</b>	<b>0,30%</b>	<b>1.496.841,06</b>

## Evolução Patrimônio Líquido - Fundo II

Jan	R\$ 598.297.079,63	Fev	R\$ 618.696.976,48	Mar	R\$ 637.809.444,13	Abr	R\$ 646.617.056,66
Mai	R\$ 659.153.913,95	Jun	R\$ 669.505.134,50	Jul	R\$ 685.274.063,10	Ago	R\$ 699.672.274,76
Set	R\$ 714.337.125,99	Out		Nov		Dez	

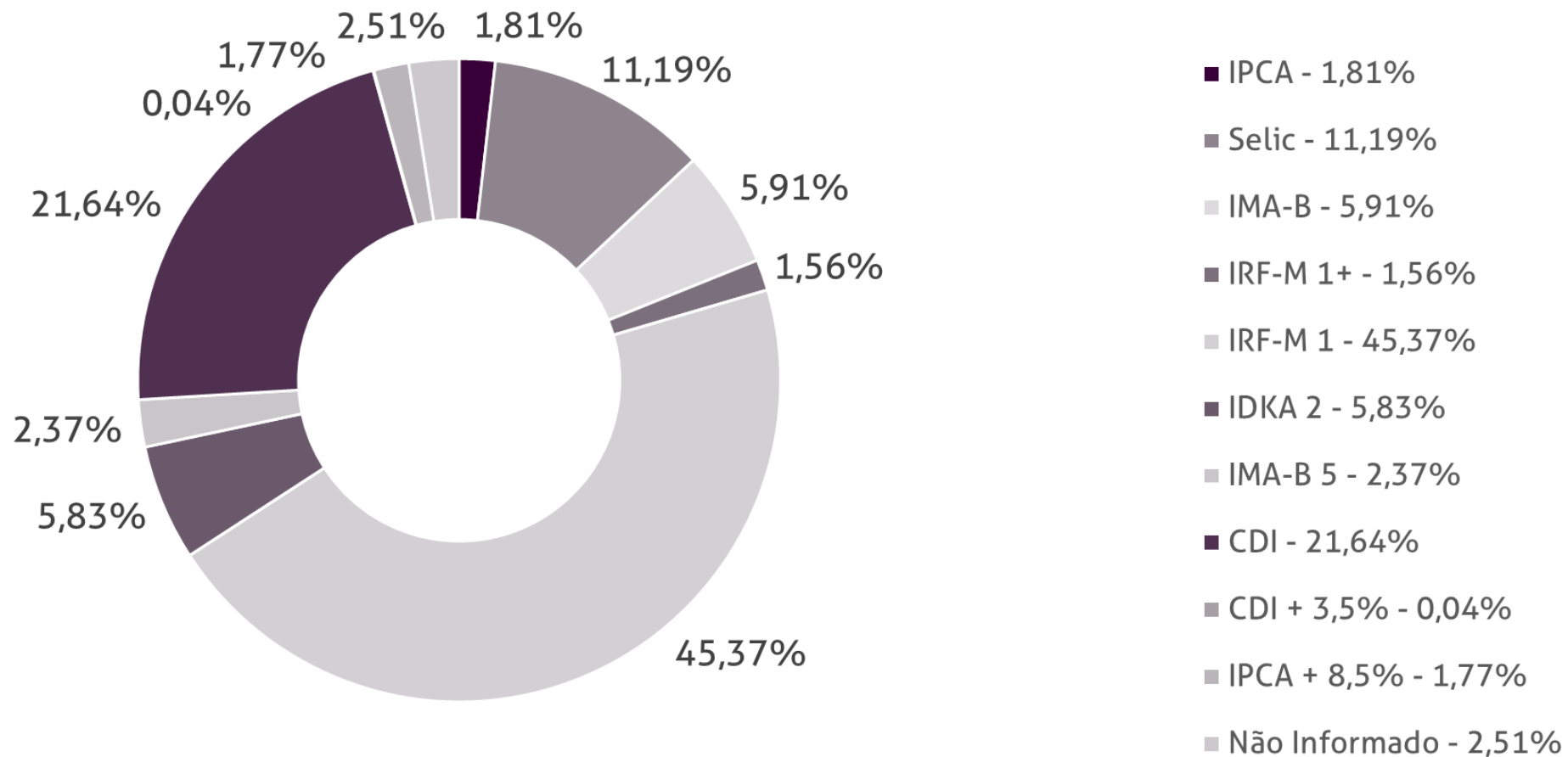


## Índice de Sharpe e Var da Carteira

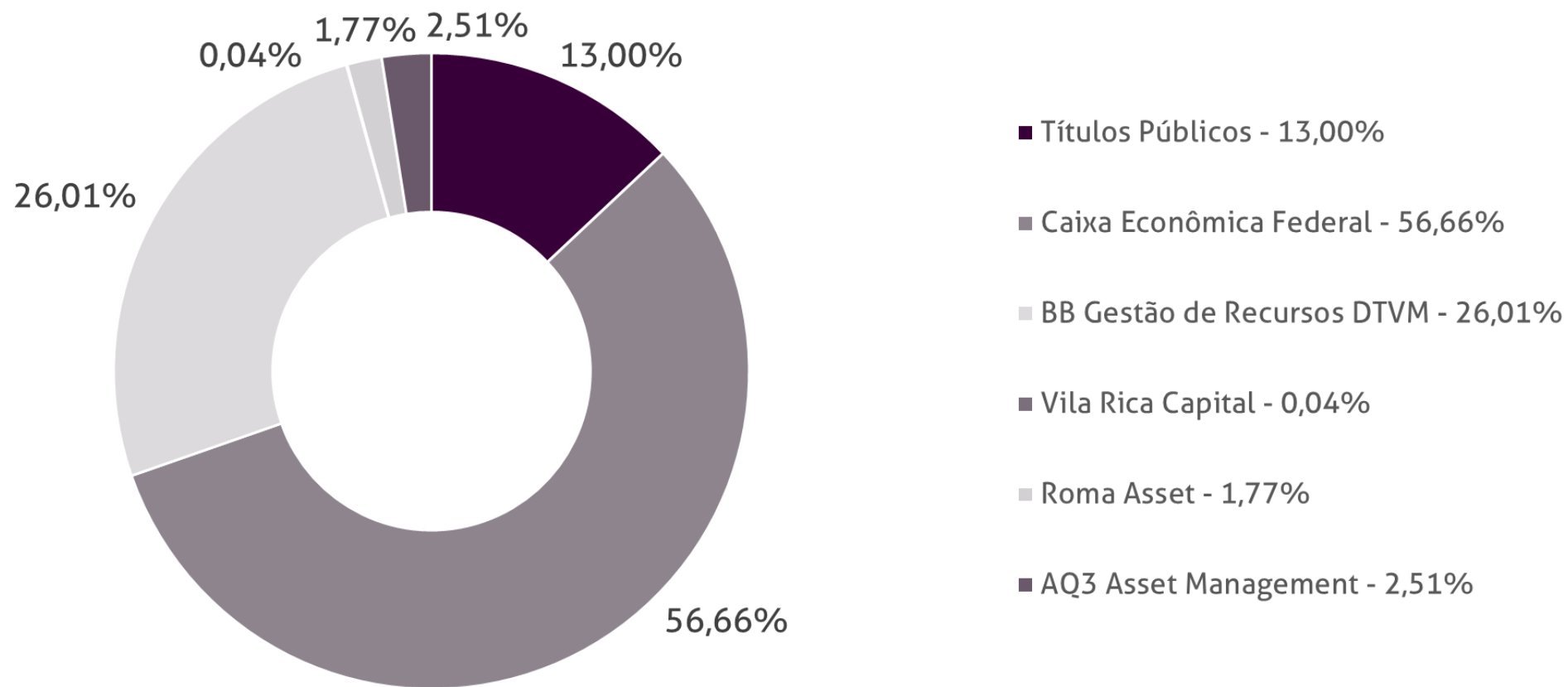


Fundos	CNPJ	Gestão	Taxa de Administração	Benchmark	Resgate
NTN-B IPSM		Títulos Públicos	0,00%	IPCA	-
NTN-F IPSM		Títulos Públicos	0,00%	Selic	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.740.658/0001-93	Caixa Econômica Federal	0,20%	IMA-B	D+0
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.577.519/0001-90	Caixa Econômica Federal	0,20%	IRF-M 1+	D+0
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.740.670/0001-06	Caixa Econômica Federal	0,20%	IRF-M 1	D+0
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	14.386.926/0001-71	Caixa Econômica Federal	0,20%	IDKA 2	D+0
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	07.442.078/0001-05	BB Gestão de Recursos DTVM	0,20%	IMA-B	D+1
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	03.543.447/0001-03	BB Gestão de Recursos DTVM	0,20%	IMA-B 5	D+1
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	07.861.554/0001-22	BB Gestão de Recursos DTVM	0,30%	IMA-B	D+1
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	10.646.895/0001-90	Caixa Econômica Federal	0,20%	IMA-B	D+0
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	03.737.206/0001-97	Caixa Econômica Federal	0,20%	CDI	D+0
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.077.418/0001-49	BB Gestão de Recursos DTVM	0,20%	CDI	D+0
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	13.990.000/0001-28	Vila Rica Capital	0,39%	CDI + 3,5%	Não se aplica
CONQUEST FIP - FCCQ11	10.625.626/0001-47	Roma Asset	0,15%	IPCA + 8,5%	Não se aplica
ÁQUILLA FII - AQLL11	13.555.918/0001-49	AQ3 Asset Management	1,50%	Não Informado	Não se aplica
FIRENZE FII	14.074.721/0001-50	AQ3 Asset Management	1,50%	Não Informado	Não se aplica
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	14.508.643/0001-55	Caixa Econômica Federal	0,80%	CDI	D+0
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.328.882/0001-35	BB Gestão de Recursos DTVM	0,10%	IRF-M 1	D+0

## Distribuição por Indicador - Setembro - 2017



### Distribuição por Instituição - Setembro - 2017

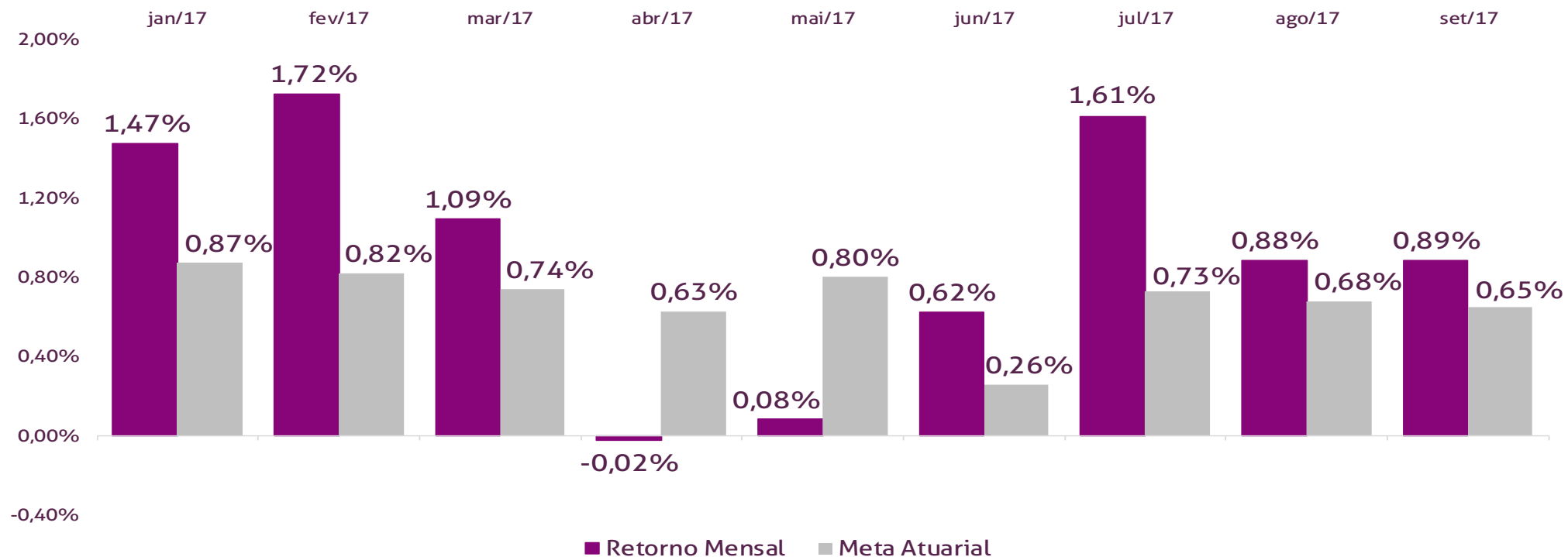


Performance Absoluta

	jan-17	fev-17	mar-17	abr-17	mai-17	jun-17
Carteira	1,47%	1,72%	1,09%	-0,02%	0,08%	0,62%
Retorno Financeiro	8.656.916,23	10.539.817,30	6.889.410,94	-148.706,70	526.592,66	4.143.069,15
Meta Atuarial	0,87%	0,82%	0,74%	0,63%	0,80%	0,26%

	jul-17	ago-17	set-17	out-17	nov-17	dez-17
Carteira	1,61%	0,88%	0,89%			
Retorno Financeiro	10.917.044,64	6.132.451,32	6.276.826,90			
Meta Atuarial	0,73%	0,68%	0,65%			

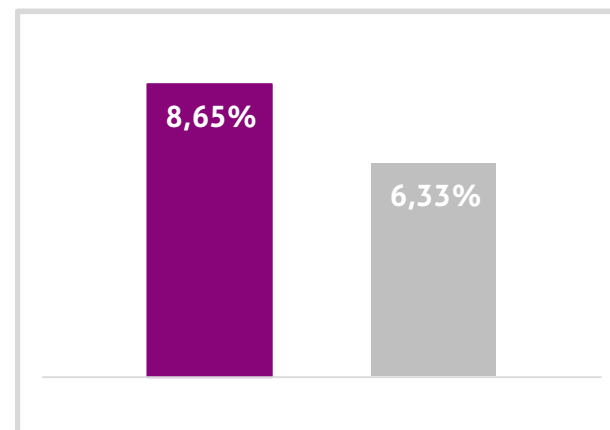
### Retorno Mensal X Meta Atuarial Mensal





Estatística		
Meses positivos:	8	
Meses negativos:	1	
Meses acima da Meta Atuarial:	7	
Meses abaixo da Meta Atuarial:	2	
Retorno Mensal Máximo	1,72%	fev-17
Retorno Mensal Médio	0,93%	
Retorno Mensal Mínimo	-0,02%	abr-17
Sharpe	0,20	
Volatilidade	12,75%	
VaR	-1,06%	
Meta Atuarial	IPCA + 6%	

Consolidado - 2017	
Carteira	8,65%
Retorno	R\$ 53.933.422,44
Meta	6,33%



jan/17

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
NTN-B IPSM		11.477.445,00				325.536,69	2,84%	11.802.981,69
NTN-F IPSM		76.108.499,33			3.672.865,96	2.136.438,55	2,81%	74.572.071,92
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	8.108.475,23				149.404,80	1,84%	8.257.880,03
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	1.090.240,93				29.380,30	2,69%	1.119.621,23
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 267-1	119.956.819,09				1.509.919,77	1,26%	121.466.738,86
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 267-1	50.779.453,94				540.215,59	1,06%	51.319.669,53
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	42.783.020,59				789.045,54	1,84%	43.572.066,13
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 15852-6	43.799.217,81				498.388,72	1,14%	44.297.606,53
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	49.321.539,24				932.629,03	1,89%	50.254.168,27
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	7.055.348,18				133.216,65	1,89%	7.188.564,83
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 267-1	108.345.364,65				1.164.015,91	1,07%	109.509.380,56
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	33.985.777,11				373.114,60	1,10%	34.358.891,71
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR		377.980,53			3.516,63	907,23	0,24%	375.371,13
CONQUEST FIP - FCCQ11		15.700.656,17				-17.720,42	-0,11%	15.682.935,75
ÁQUILLA FII - AQLL11		6.539.263,25				-821,59	-0,01%	6.538.441,66
FIRENZE FII		11.523.739,89				93.244,86	0,81%	11.616.984,75
<b>Aplicações</b>		<b>586.952.840,94</b>						<b>591.933.374,58</b>
<b>Imóveis</b>		<b>0,00</b>						<b>0,00</b>
<b>Conta Corrente</b>		<b>221.827,66</b>						<b>6.363.705,05</b>
Caixa 267-1		221.776,52						6.340.246,58
Banco do Brasil 15852-6		0,00						23.407,33
Caixa 538-7		51,14						51,14
<b>Final</b>		<b>587.174.668,60</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>3.676.382,59</b>	<b>8.656.916,23</b>	<b>1,47%</b>	<b>598.297.079,63</b>

fev/17

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
NTN-B IPSM		11.802.981,69				774.353,51	6,56%	12.577.335,20
NTN-F IPSM		74.572.071,92				1.759.079,14	2,36%	76.331.151,06
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	8.257.880,03	6.466.426,57			310.181,38	2,11%	15.034.487,98
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	1.119.621,23				26.851,33	2,40%	1.146.472,56
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 267-1	121.466.738,86				1.207.815,69	0,99%	122.674.554,55
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 267-1	51.319.669,53	6.466.426,57			670.937,12	1,16%	58.457.033,22
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	43.572.066,13				1.675.991,80	3,85%	45.248.057,93
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 15852-6	44.297.606,53				654.713,79	1,48%	44.952.320,32
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	50.254.168,27				1.953.888,10	3,89%	52.208.056,37
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	7.188.564,83				271.461,18	3,78%	7.460.026,01
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 267-1	109.509.380,56				964.127,01	0,88%	110.473.507,57
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	34.358.891,71				306.344,13	0,89%	34.665.235,84
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR		375.371,13			10.585,47	3.925,97	1,05%	368.711,63
CONQUEST FIP - FCCQ11		15.682.935,75				-26.383,09	-0,17%	15.656.552,66
ÁQUILLA FII - AQLL11		6.538.441,66				-10.838,17	-0,17%	6.527.603,49
FIRENZE FII		11.616.984,75				-2.631,59	-0,02%	11.614.353,16
<b>Aplicações</b>		<b>591.933.374,58</b>						<b>615.395.459,55</b>
<b>Imóveis</b>		<b>0,00</b>						<b>0,00</b>
<b>Conta Corrente</b>		<b>6.363.705,05</b>						<b>3.301.516,93</b>
Caixa 267-1		6.340.246,58						3.077.657,66
Banco do Brasil 15852-6		23.407,33						54.819,59
Caixa 538-7		51,14						169.039,68
<b>FINAL</b>		<b>598.297.079,63</b>	<b>12.932.853,14</b>	<b>0,00</b>	<b>10.585,47</b>	<b>10.539.817,30</b>	<b>1,72%</b>	<b>618.696.976,48</b>

mar/17

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
NTN-B IPSM		12.577.335,20				49.367,18	0,39%	12.626.702,38
NTN-F IPSM		76.331.151,06				1.229.854,47	1,61%	77.561.005,53
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	15.034.487,98	5.150.000,00			166.454,21	0,82%	20.350.942,19
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	1.146.472,56				17.428,62	1,52%	1.163.901,18
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 267-1	122.674.554,55	2.145.000,00			1.367.859,31	1,10%	126.187.413,86
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 267-1	58.457.033,22	5.150.000,00			844.834,30	1,33%	64.451.867,52
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	45.248.057,93	68.147,27			461.447,87	1,02%	45.777.653,07
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 15852-6	44.952.320,32				620.741,93	1,38%	45.573.062,25
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	52.208.056,37				545.861,91	1,05%	52.753.918,28
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	7.460.026,01				70.815,96	0,95%	7.530.841,97
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 267-1	110.473.507,57				1.180.209,27	1,07%	111.653.716,84
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	34.665.235,84				369.734,77	1,07%	35.034.970,61
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 538-7	0,00	325.159,52			960,56	0,30%	326.120,08
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR		368.711,63			13.327,68	2.857,79	0,78%	358.241,74
CONQUEST FIP - FCCQ11		15.656.552,66				-20.465,38	-0,13%	15.636.087,28
ÁQUILLA FII - AQLL11		6.527.603,49				-14.495,52	-0,22%	6.513.107,97
FIRENZE FII		11.614.353,16				-4.056,31	-0,03%	11.610.296,85
<b>Aplicações</b>		<b>615.395.459,55</b>						<b>635.109.849,60</b>
<b>Imóveis</b>		<b>0,00</b>						<b>0,00</b>
<b>Conta Corrente</b>		<b>3.301.516,93</b>						<b>2.699.594,53</b>
Caixa 267-1		3.077.657,66						2.529.034,63
Banco do Brasil 15852-6		54.819,59						19.549,24
Caixa 538-7		169.039,68						151.010,66
<b>FINAL</b>		<b>618.696.976,48</b>	<b>12.838.306,79</b>	<b>0,00</b>	<b>13.327,68</b>	<b>6.889.410,94</b>	<b>1,09%</b>	<b>637.809.444,13</b>

abr/17

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
NTN-B IPSM		12.626.702,38				-189.558,32	-1,50%	12.437.144,06
NTN-F IPSM		77.561.005,53				333.196,46	0,43%	77.894.201,99
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	20.350.942,19				-69.414,04	-0,34%	20.281.528,15
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	1.163.901,18				3.890,93	0,33%	1.167.792,11
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 267-1	126.187.413,86	6.237.563,30			1.110.372,78	0,84%	133.535.349,94
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 267-1	64.451.867,52	4.775.163,29			525.454,02	0,76%	69.752.484,83
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	45.777.653,07				-157.660,59	-0,34%	45.619.992,48
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 15852-6	45.573.062,25				318.361,31	0,70%	45.891.423,56
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	52.753.918,28				-183.285,06	-0,35%	52.570.633,22
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	7.530.841,97				-39.696,90	-0,53%	7.491.145,07
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 267-1	111.653.716,84		-250.000,00		885.395,08	0,79%	112.289.111,92
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	35.034.970,61				274.234,73	0,78%	35.309.205,34
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 538-7	326.120,08	149.855,40			2.897,89	0,61%	478.873,37
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR		358.241,74			15.611,83	2.994,55	0,84%	345.624,46
CONQUEST FIP - FCCQ11		15.636.087,28				-2.947.684,92	-18,85%	12.688.402,36
ÁQUILLA FII - AQLL11		6.513.107,97				-11.261,91	-0,17%	6.501.846,06
FIRENZE FII		11.610.296,85				-6.942,71	-0,06%	11.603.354,14
<b>Aplicações</b>		<b>635.109.849,60</b>						<b>645.858.113,06</b>
<b>Imóveis</b>		<b>0,00</b>						<b>0,00</b>
<b>Conta Corrente</b>		<b>2.699.594,53</b>						<b>758.943,60</b>
Caixa 267-1		2.529.034,63						553.006,14
Banco do Brasil 15852-6		19.549,24						56.319,76
Caixa 538-7		151.010,66						149.617,70
<b>FINAL</b>		<b>637.809.444,13</b>	<b>11.162.581,99</b>	<b>-250.000,00</b>	<b>15.611,83</b>	<b>-148.706,70</b>	<b>-0,02%</b>	<b>646.617.056,66</b>

**mai/17**

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
NTN-B IPSM		12.437.144,06			329.756,97	-287.090,85	-2,31%	11.820.296,24
NTN-F IPSM		77.894.201,99				27.567,84	0,04%	77.921.769,83
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	20.281.528,15				-241.918,73	-1,19%	20.039.609,42
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	1.167.792,11				1.097,96	0,09%	1.168.890,07
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 267-1	133.535.349,94	13.000.000,00			1.238.600,41	0,85%	147.773.950,35
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 267-1	69.752.484,83				288.338,83	0,41%	70.040.823,66
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	45.619.992,48				-546.160,64	-1,20%	45.073.831,84
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 15852-6	45.891.423,56				42.141,63	0,09%	45.933.565,19
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	52.570.633,22				-650.598,87	-1,24%	51.920.034,35
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	7.491.145,07				-72.279,10	-0,96%	7.418.865,97
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 267-1	112.289.111,92		-500.000,00		1.043.287,43	0,93%	112.832.399,35
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	35.309.205,34	71.000,00			325.873,58	0,92%	35.706.078,92
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 538-7	478.873,37	148.462,44			4.655,89	0,74%	631.991,70
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR		345.624,46			14.764,46	4.749,09	1,37%	335.609,09
CONQUEST FIP - FCCQ11		12.688.402,36				-13.089,44	-0,10%	12.675.312,92
ÁQUILLA FII - AQLL11		6.501.846,06				-120.167,54	-1,85%	6.381.678,52
FIRENZE FII		11.603.354,14				-518.414,83	-4,47%	11.084.939,31
<b>Aplicações</b>		<b>645.858.113,06</b>						<b>658.759.646,73</b>
<b>Imóveis</b>		<b>0,00</b>						<b>0,00</b>
<b>Conta Corrente</b>		<b>758.943,60</b>						<b>394.267,22</b>
Caixa 267-1		553.006,14						218.988,45
Banco do Brasil 15852-6		56.319,76						19.465,96
Caixa 538-7		149.617,70						155.812,81
<b>FINAL</b>		<b>646.617.056,66</b>	<b>13.219.462,44</b>	<b>-500.000,00</b>	<b>344.521,43</b>	<b>526.592,66</b>	<b>0,08%</b>	<b>659.153.913,95</b>

**jun/17**

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
NTN-B IPSM		11.820.296,24				-63.839,03	-0,54%	11.756.457,21
NTN-F IPSM		77.921.769,83				1.130.911,63	1,45%	79.052.681,46
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	20.039.609,42		-10.000.000,00		-13.555,50	-0,14%	10.026.053,92
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	1.168.890,07				17.402,22	1,49%	1.186.292,29
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 267-1	147.773.950,35	50.500.000,00			1.364.499,99	0,69%	199.638.450,34
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	0,00	100.000.000,00			128.487,77	0,13%	100.128.487,77
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 267-1	70.040.823,66		-30.500.000,00		344.496,53	0,87%	39.885.320,19
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	45.073.831,84		-25.000.000,00		-42.524,22	-0,21%	20.031.307,62
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 15852-6	45.933.565,19		-30.000.000,00		150.067,75	0,94%	16.083.632,94
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	51.920.034,35		-45.000.000,00		-97.935,18	-1,42%	6.822.099,17
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	7.418.865,97		-4.100.000,00		-11.852,01	-0,36%	3.307.013,96
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 267-1	112.832.399,35				930.201,30	0,82%	113.762.600,65
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	35.706.078,92				290.584,92	0,81%	35.996.663,84
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 538-7	631.991,70	154.657,55			5.281,13	0,67%	791.930,38
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR		335.609,09			12.784,84	87.289,30	26,01%	410.113,55
CONQUEST FIP - FCCQ11		12.675.312,92				-12.460,29	-0,10%	12.662.852,63
ÁQUILLA FII - AQLL11		6.381.678,52				-59.404,53	-0,93%	6.322.273,99
FIRENZE FII		11.084.939,31				-4.582,63	-0,04%	11.080.356,68
<b>Aplicações</b>		<b>658.759.646,73</b>						<b>668.944.588,59</b>
<b>Imóveis</b>		<b>0,00</b>						<b>0,00</b>
<b>Conta Corrente</b>		<b>394.267,22</b>						<b>560.545,91</b>
Caixa 267-1		218.988,45						348.955,33
Banco do Brasil 15852-6		19.465,96						51.076,57
Caixa 538-7		155.812,81						160.514,01
<b>FINAL</b>		<b>659.153.913,95</b>	<b>150.654.657,55</b>	<b>-144.600.000,00</b>	<b>12.784,84</b>	<b>4.143.069,15</b>	<b>0,62%</b>	<b>669.505.134,50</b>

jul/17

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
NTN-B IPISM		11.756.457,21				622.283,32	5,29%	12.378.740,53
NTN-F IPISM		79.052.681,46			3.672.865,96	2.334.056,79	2,95%	77.713.872,29
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	10.026.053,92		-900.000,00		382.413,35	3,81%	9.508.467,27
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	1.186.292,29				32.864,40	2,77%	1.219.156,69
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 267-1	199.638.450,34	8.600.000,00			2.136.855,33	1,03%	210.375.305,67
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRI	Ag. 86-8 cc 15852-6	100.128.487,77				1.056.934,35	1,06%	101.185.422,12
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 267-1	39.885.320,19				962.214,60	2,41%	40.847.534,79
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	20.031.307,62				792.553,24	3,96%	20.823.883,86
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 15852-6	16.083.632,94				458.348,81	2,85%	16.541.981,75
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	6.822.099,17				273.424,13	4,01%	7.095.523,30
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	3.307.013,96				124.800,95	3,77%	3.431.814,91
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 267-1	113.762.600,65				893.553,72	0,79%	114.656.154,37
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	35.996.663,84	139.000,00			290.694,74	0,80%	36.426.358,58
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 538-7	791.930,38	159.358,75			6.385,87	0,67%	957.675,00
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR		410.113,55			88.878,58	508,49	0,12%	321.743,46
CONQUEST FIP - FCCQ11		12.662.852,63				-26.879,80	-0,21%	12.635.972,83
ÁQUILLA FII - AQLL11		6.322.273,99				60.207,81	0,95%	6.382.481,80
FIRENZE FII		11.080.356,68				515.801,54	4,66%	11.596.158,22
<b>Aplicações</b>		<b>668.944.588,59</b>						<b>684.098.247,44</b>
<b>Imóveis</b>		<b>0,00</b>						<b>0,00</b>
<b>Conta Corrente</b>		<b>560.545,91</b>						<b>1.175.815,66</b>
Caixa 267-1		348.955,33						969.788,12
Banco do Brasil 15852-6		51.076,57						23.060,85
Caixa 538-7		160.514,01						182.966,69
<b>FINAL</b>		<b>669.505.134,50</b>	<b>8.898.358,75</b>	<b>-900.000,00</b>	<b>3.761.744,54</b>	<b>10.917.044,64</b>	<b>1,61%</b>	<b>685.274.063,10</b>

ago/17

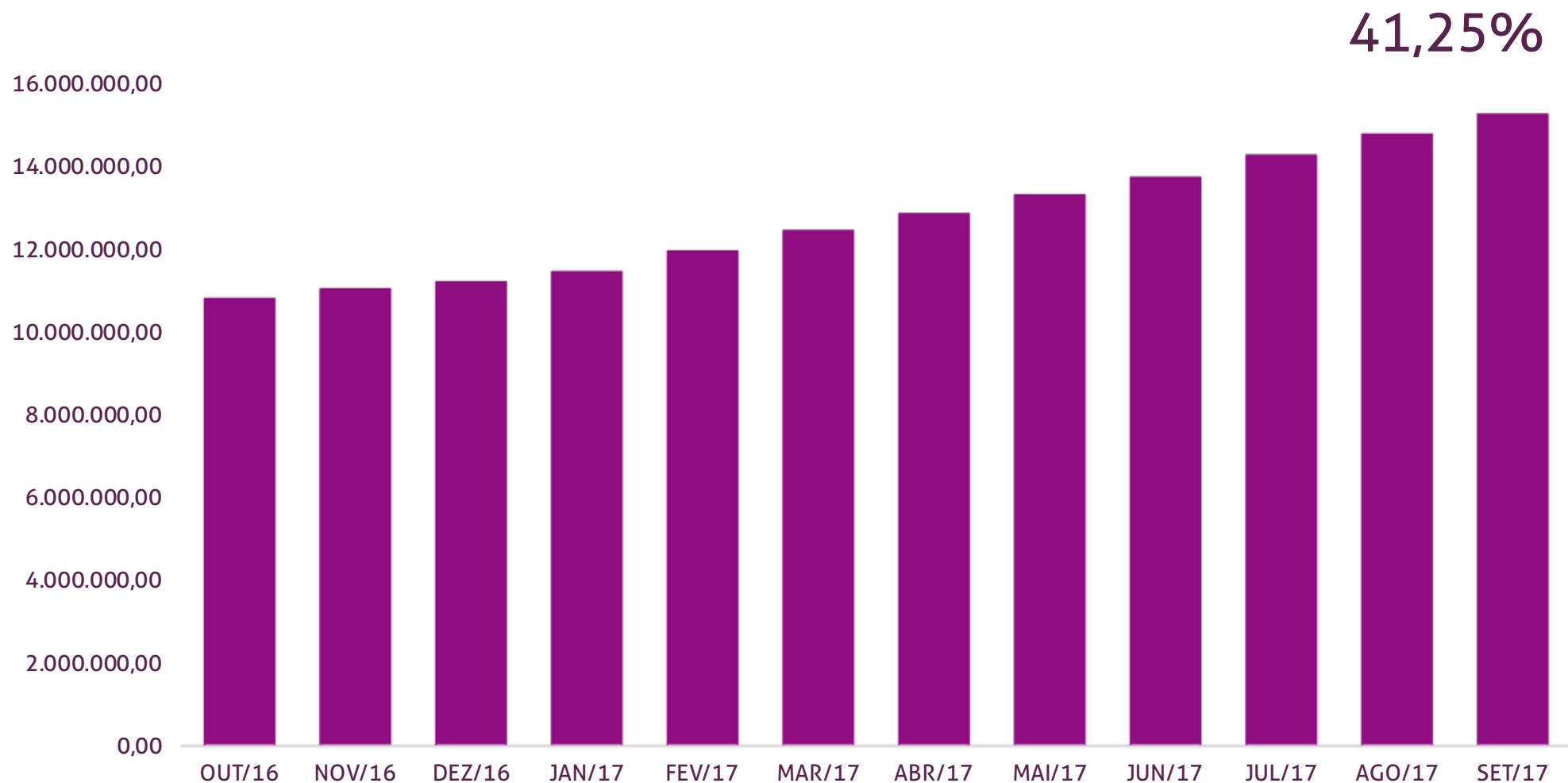
Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
NTN-B IPISM		12.378.740,53				170.080,58	1,37%	12.548.821,11
NTN-F IPISM		77.713.872,29				828.883,57	1,07%	78.542.755,86
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	9.508.467,27				126.166,67	1,33%	9.634.633,94
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	1.219.156,69	800.000,00			20.465,10	1,01%	2.039.621,79
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 267-1	210.375.305,67	6.800.000,00			1.908.004,84	0,88%	219.083.310,51
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRI	Ag. 86-8 cc 15852-6	101.185.422,12				887.875,52	0,88%	102.073.297,64
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 267-1	40.847.534,79				393.761,96	0,96%	41.241.296,75
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	20.823.883,86				275.415,30	1,32%	21.099.299,16
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 15852-6	16.541.981,75				205.807,33	1,24%	16.747.789,08
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	7.095.523,30				94.426,74	1,33%	7.189.950,04
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	3.431.814,91				46.579,43	1,36%	3.478.394,34
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 267-1	114.656.154,37				907.674,12	0,79%	115.563.828,49
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	36.426.358,58				288.828,21	0,79%	36.715.186,79
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 538-7	957.675,00	181.670,03			7.674,06	0,67%	1.147.019,09
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR		321.743,46			10.791,77	395,38	0,12%	311.347,07
CONQUEST FIP - FCCQ11		12.635.972,83				-15.102,98	-0,12%	12.620.869,85
ÁQUILLA FII - AQLL11		6.382.481,80				-13.190,75	-0,21%	6.369.291,05
FIRENZE FII		11.596.158,22				-1.293,76	-0,01%	11.594.864,46
<b>Aplicações</b>		<b>684.098.247,44</b>						<b>698.001.577,02</b>
<b>Imóveis</b>		<b>0,00</b>						<b>0,00</b>
<b>Conta Corrente</b>		<b>1.175.815,66</b>						<b>1.670.697,74</b>
Caixa 267-1		969.788,12						1.362.916,78
Banco do Brasil 15852-6		23.060,85						124.176,80
Caixa 538-7		182.966,69						183.604,16
<b>FINAL</b>		<b>685.274.063,10</b>	<b>7.781.670,03</b>	<b>0,00</b>	<b>10.791,77</b>	<b>6.132.451,32</b>	<b>0,88%</b>	<b>699.672.274,76</b>

**set/17**

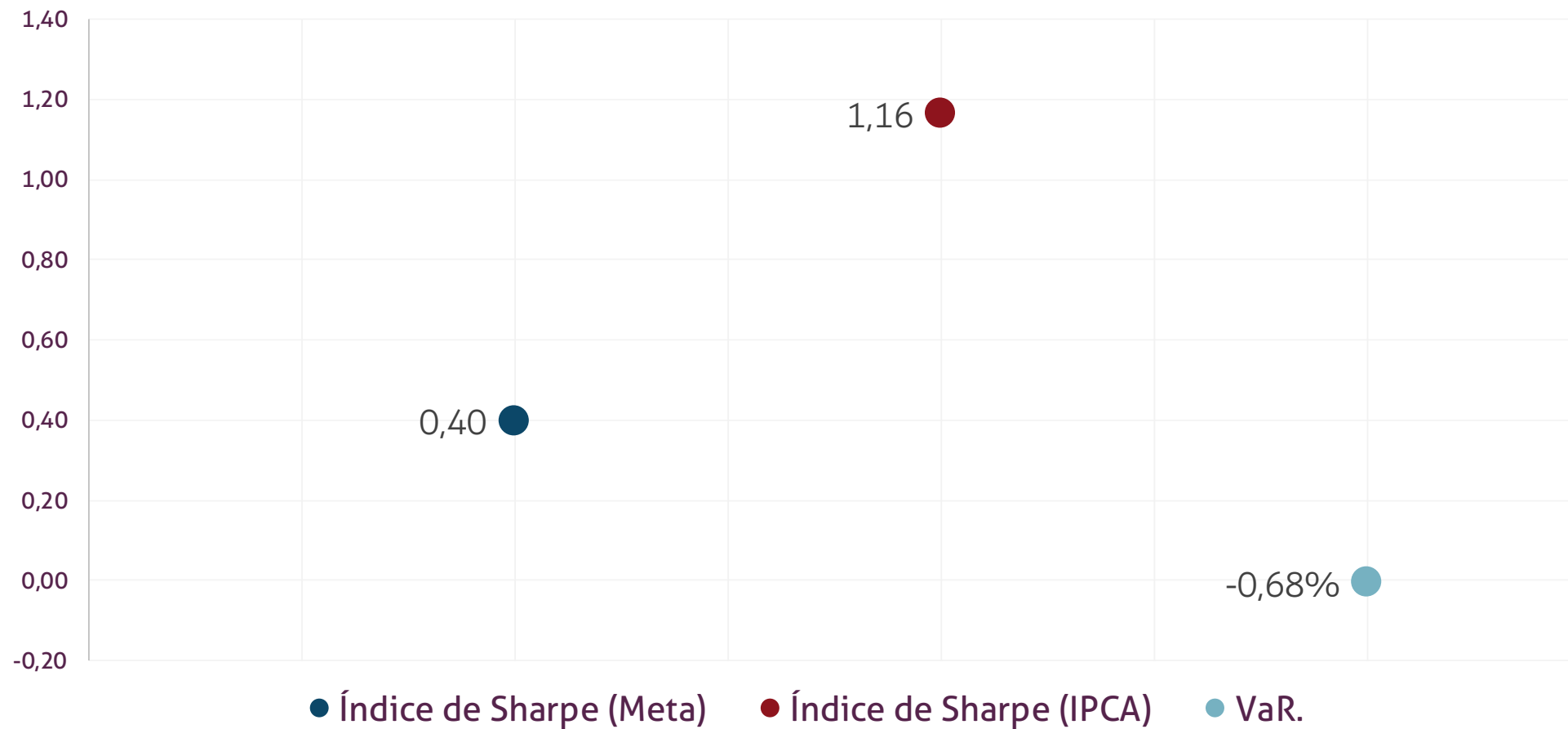
Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
NTN-B IPSM		12.548.821,11				358.280,99	2,86%	12.907.102,10
NTN-F IPSM		78.542.755,86				1.341.007,82	1,71%	79.883.763,68
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 538-7	0,00	180.000,00			225,88	0,13%	180.225,88
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	9.634.633,94				173.409,82	1,80%	9.808.043,76
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	2.039.621,79	9.000.000,00			59.965,63	0,54%	11.099.587,42
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 267-1	219.083.310,51				1.565.667,13	0,71%	220.648.977,64
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	102.073.297,64	135.246,29			726.131,98	0,71%	102.934.675,91
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 267-1	41.241.296,75				367.741,73	0,89%	41.609.038,48
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	21.099.299,16				375.728,73	1,78%	21.475.027,89
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 15852-6	16.747.789,08				165.627,43	0,99%	16.913.416,51
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	7.189.950,04				132.638,71	1,84%	7.322.588,75
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	3.478.394,34				62.290,58	1,79%	3.540.684,92
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 267-1	115.563.828,49				732.660,90	0,63%	116.296.489,39
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	36.715.186,79				238.516,34	0,65%	36.953.703,13
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 538-7	1.147.019,09				6.582,71	0,57%	1.153.601,80
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR		311.347,07			11.069,49	1.277,32	0,41%	301.554,90
CONQUEST FIP - FCCQ11		12.620.869,85				-11.872,06	-0,09%	12.608.997,79
ÁQUILLA FII - AQLL11		6.369.291,05				-15.681,62	-0,25%	6.353.609,43
FIRENZE FII		11.594.864,46				-3.373,12	-0,03%	11.591.491,34
<b>Aplicações</b>		<b>698.001.577,02</b>						<b>713.582.580,72</b>
<b>Imóveis</b>		<b>0,00</b>						<b>0,00</b>
<b>Conta Corrente</b>		<b>1.670.697,74</b>						<b>754.545,27</b>
Caixa 267-1		1.362.916,78						526.000,99
Banco do Brasil 15852-6		124.176,80						19.927,76
Caixa 538-7		183.604,16						208.616,52
<b>FINAL</b>		<b>699.672.274,76</b>	<b>9.315.246,29</b>	<b>0,00</b>	<b>11.069,49</b>	<b>6.276.826,90</b>	<b>0,89%</b>	<b>714.337.125,99</b>

## Evolução Patrimônio Líquido - Fundo III

Jan	R\$ 11.420.445,75	Fev	R\$ 11.919.863,18	Mar	R\$ 12.411.174,89	Abr	R\$ 12.816.896,72
Mai	R\$ 13.269.596,18	Jun	R\$ 13.693.050,44	Jul	R\$ 14.227.488,85	Ago	R\$ 14.732.222,36
Set	R\$ 15.215.861,12	Out		Nov		Dez	



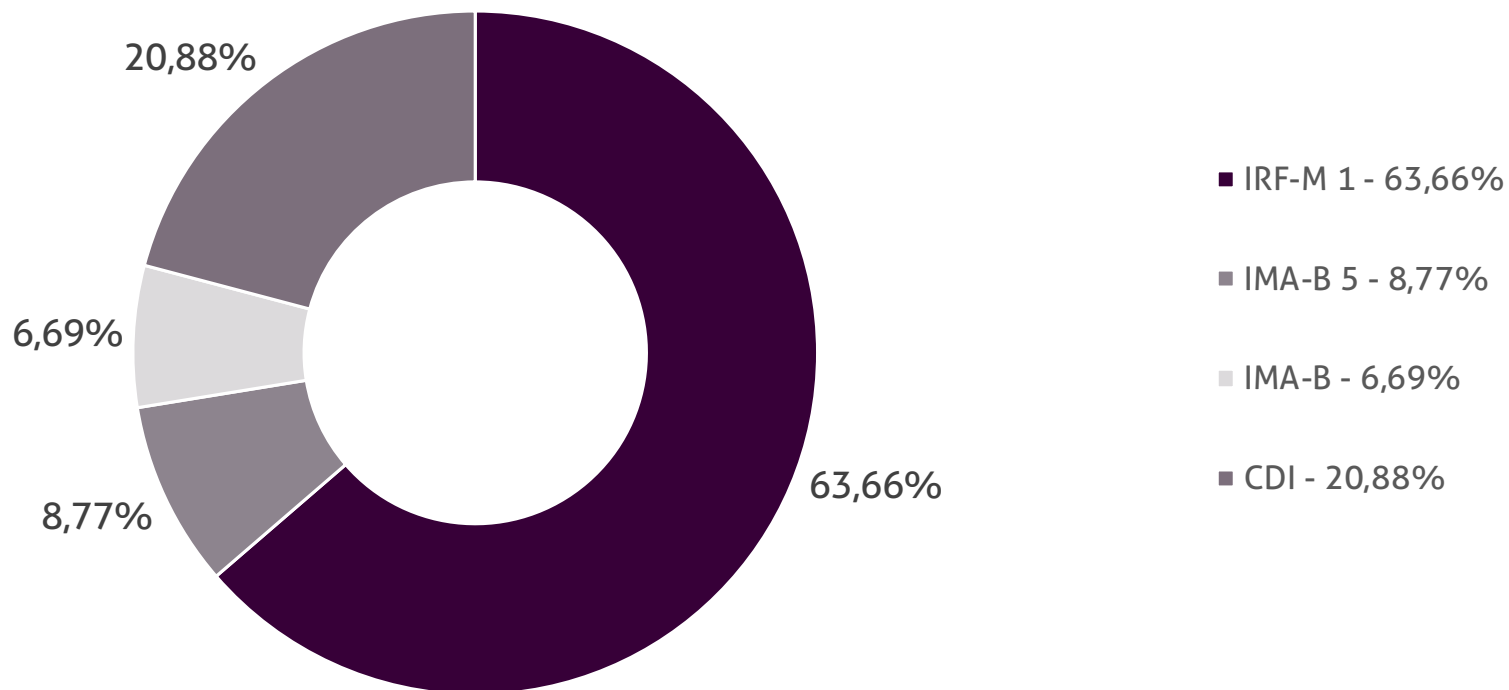
## Índice de Sharpe e Var da Carteira



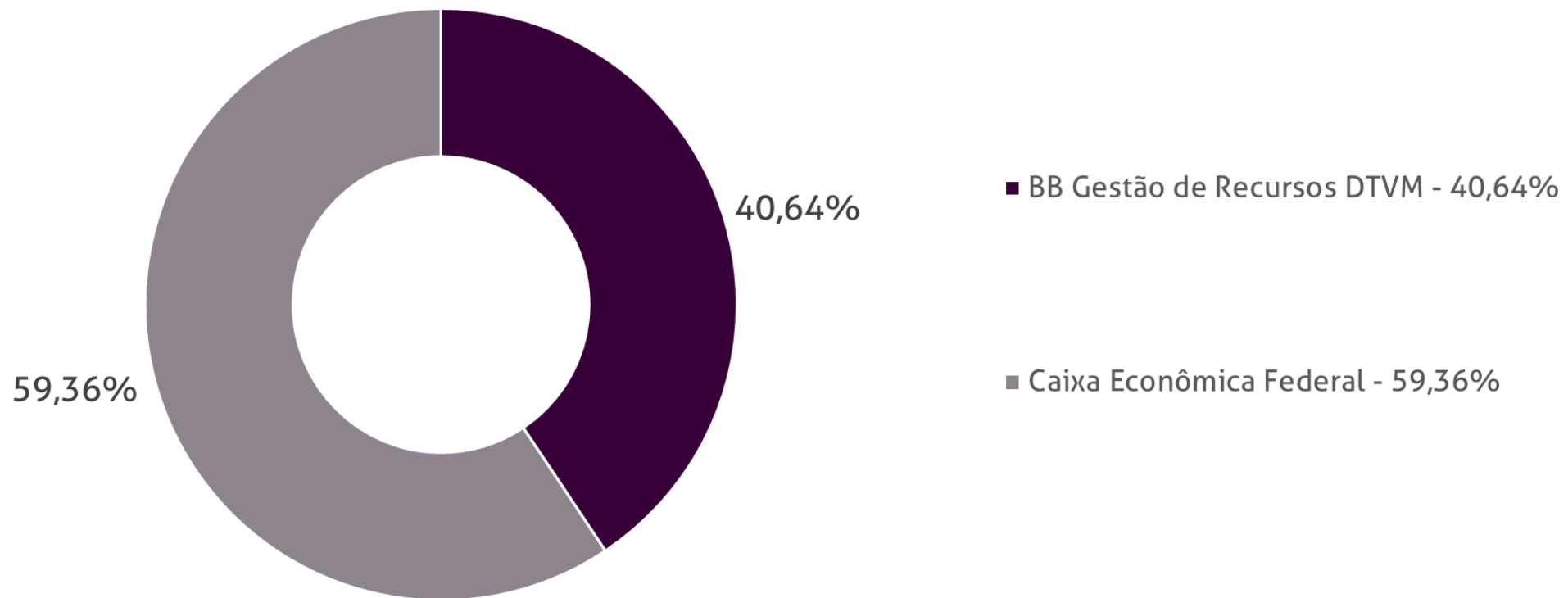


Fundos	CNPJ	Gestão	Taxa de Administração	Benchmark	Resgate
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.328.882/0001-35	BB Gestão de Recursos DTVM	0,10%	IRF-M 1	D+0
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.740.670/0001-06	Caixa Econômica Federal	0,20%	IRF-M 1	D+0
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.060.913/0001-10	Caixa Econômica Federal	0,20%	IMA-B 5	D+0
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	03.543.447/0001-03	BB Gestão de Recursos DTVM	0,20%	IMA-B 5	D+1
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	10.646.895/0001-90	Caixa Econômica Federal	0,20%	IMA-B	D+0
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	03.737.206/0001-97	Caixa Econômica Federal	0,20%	CDI	D+0
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.077.418/0001-49	BB Gestão de Recursos DTVM	0,20%	CDI	D+0

Distribuição por Indicador - Setembro - 2017



## Distribuição por Instituição - Setembro - 2017

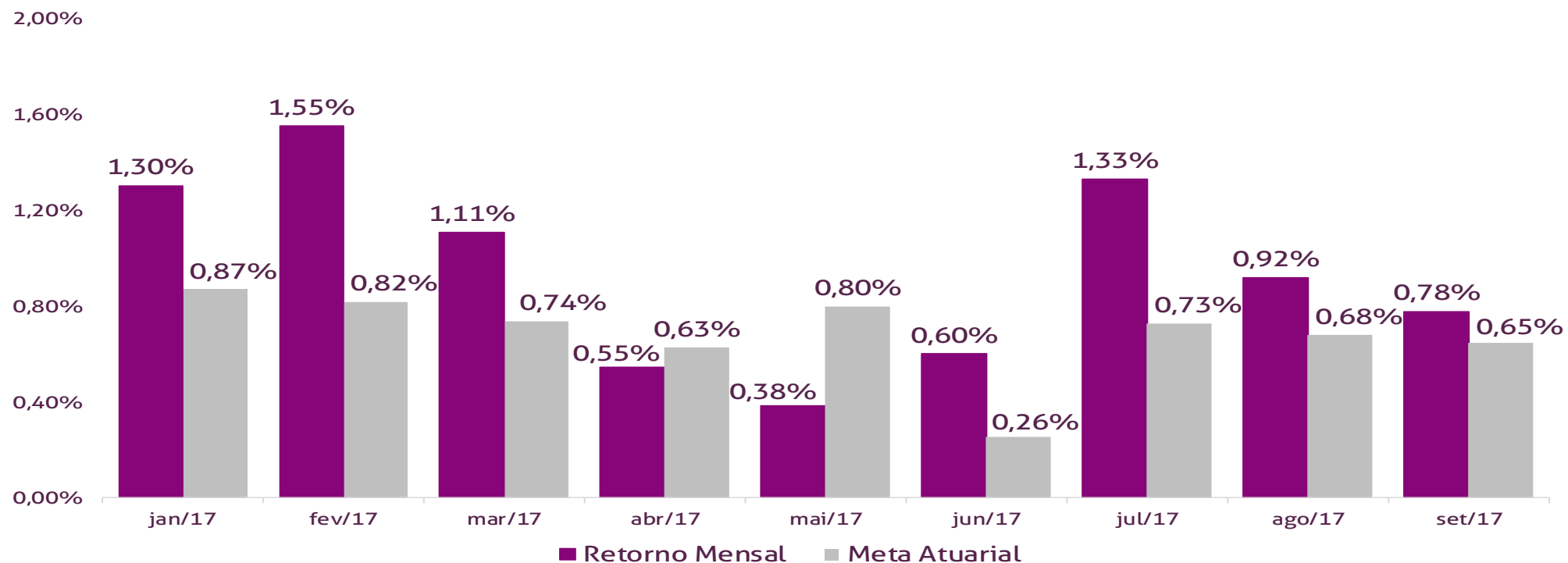


Performance Absoluta

	jan-17	fev-17	mar-17	abr-17	mai-17	jun-17
Carteira	1,30%	1,55%	1,11%	0,55%	0,38%	0,60%
Retorno Financeiro	145.641,38	183.527,16	136.118,33	69.502,89	50.782,25	81.694,56
Meta Atuarial	0,87%	0,82%	0,74%	0,63%	0,80%	0,26%

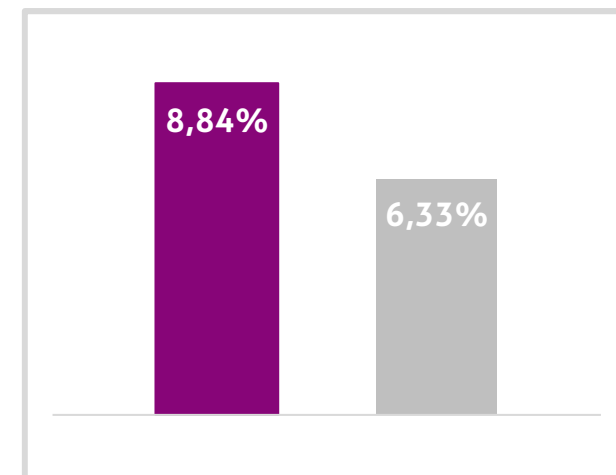
	jul-17	ago-17	set-17	out-17	nov-17	dez-17
Carteira	1,33%	0,92%	0,78%			
Retorno Financeiro	186.660,30	134.074,83	117.480,44			
Meta Atuarial	0,73%	0,68%	0,65%			

## Retorno Mensal X Meta Atuarial Mensal



Estatística		
Meses positivos:	9	
Meses negativos:	0	
Meses acima da Meta Atuarial:	7	
Meses abaixo da Meta Atuarial:	2	
Retorno Mensal Máximo	1,55%	fev-17
Retorno Mensal Médio	0,95%	
Retorno Mensal Mínimo	0,38%	mai-17
Sharpe	0,40	
Volatilidade	8,03%	
VaR	-0,68%	
Meta Atuarial	IPCA + 6%	

Consolidado - 2017	
Carteira	8,84%
Retorno	R\$ 1.105.482,14
Meta	6,33%



jan/17

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 17879-9	2.960.377,80				37.300,81	1,26%	2.997.678,61
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 278-7	362.671,07				4.565,02	1,26%	367.236,09
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 278-7	928.991,84				10.567,94	1,14%	939.559,78
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 17879-9	1.844.334,30				20.986,57	1,14%	1.865.320,87
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 278-7	2.142.293,95				40.450,06	1,89%	2.182.744,01
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 278-7	2.066.203,71				22.198,40	1,07%	2.088.402,11
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 17879-9	871.935,28				9.572,58	1,10%	881.507,86
<b>Aplicações</b>		<b>11.176.807,95</b>						<b>11.322.449,33</b>
<b>Imóveis</b>		<b>0,00</b>						<b>0,00</b>
<b>Conta Corrente</b>		<b>0,00</b>						<b>97.996,42</b>
Caixa 278-7		0,00						97.996,42
Banco do Brasil 17879-9		0,00						0,00
<b>Final</b>		<b>11.176.807,95</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>145.641,38</b>	<b>1,30%</b>	<b>11.420.445,75</b>

fev/17

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 17879-9	2.997.678,61				29.585,40	0,99%	3.027.264,01
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 278-7	367.236,09	413.886,69			3.816,45	0,49%	784.939,23
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 278-7	939.559,78				13.883,33	1,48%	953.443,11
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 17879-9	1.865.320,87				27.569,24	1,48%	1.892.890,11
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 278-7	2.182.744,01				82.426,78	3,78%	2.265.170,79
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 278-7	2.088.402,11				18.386,43	0,88%	2.106.788,54
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 17879-9	881.507,86				7.859,53	0,89%	889.367,39
<b>Aplicações</b>		<b>11.322.449,33</b>						<b>11.919.863,18</b>
<b>Imóveis</b>		<b>0,00</b>						<b>0,00</b>
<b>Conta Corrente</b>		<b>97.996,42</b>						<b>0,00</b>
Caixa 278-7		97.996,42						0,00
Banco do Brasil 17879-9		0,00						0,00
<b>FINAL</b>		<b>11.420.445,75</b>	<b>413.886,69</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>183.527,16</b>	<b>1,55%</b>	<b>11.919.863,18</b>

mar/17

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 17879-9	3.027.264,01				33.328,75	1,10%	3.060.592,76
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 278-7	784.939,23	355.193,38			10.023,37	0,88%	1.150.155,98
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 278-7	953.443,11				13.131,77	1,38%	966.574,88
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 17879-9	1.892.890,11				26.138,72	1,38%	1.919.028,83
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 278-7	2.265.170,79				21.502,64	0,95%	2.286.673,43
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 278-7	2.106.788,54				22.507,20	1,07%	2.129.295,74
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 17879-9	889.367,39				9.485,88	1,07%	898.853,27
<b>Aplicações</b>		<b>11.919.863,18</b>						<b>12.411.174,89</b>
<b>Imóveis</b>		<b>0,00</b>						<b>0,00</b>
<b>Conta Corrente</b>		<b>0,00</b>						<b>0,00</b>
Caixa 278-7		0,00						0,00
Banco do Brasil 17879-9		0,00						0,00
<b>FINAL</b>		<b>11.919.863,18</b>	<b>355.193,38</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>136.118,33</b>	<b>1,11%</b>	<b>12.411.174,89</b>

**abr/17**

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 17879-9	3.060.592,76				26.203,20	0,86%	3.086.795,96
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 278-7	1.150.155,98	336.218,94			11.295,52	0,76%	1.497.670,44
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 278-7	966.574,88				6.731,25	0,70%	973.306,13
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 17879-9	1.919.028,83				13.405,83	0,70%	1.932.434,66
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 278-7	2.286.673,43				-12.053,61	-0,53%	2.274.619,82
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 278-7	2.129.295,74				16.884,97	0,79%	2.146.180,71
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 17879-9	898.853,27				7.035,73	0,78%	905.889,00
<b>Aplicações</b>		<b>12.411.174,89</b>						<b>12.816.896,72</b>
<b>Imóveis</b>		<b>0,00</b>						<b>0,00</b>
<b>Conta Corrente</b>		<b>0,00</b>						<b>0,00</b>
Caixa 278-7		0,00						0,00
Banco do Brasil 17879-9		0,00						0,00
<b>FINAL</b>		<b>12.411.174,89</b>	<b>336.218,94</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>69.502,89</b>	<b>0,55%</b>	<b>12.816.896,72</b>

**mai/17**

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 17879-9	3.086.795,96				27.377,94	0,89%	3.114.173,90
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 278-7	1.497.670,44	387.859,02			14.396,07	0,76%	1.899.925,53
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 278-7	973.306,13				824,43	0,08%	974.130,56
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 17879-9	1.932.434,66				1.774,53	0,09%	1.934.209,19
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 278-7	2.274.619,82				-21.946,91	-0,96%	2.252.672,91
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 278-7	2.146.180,71				20.001,05	0,93%	2.166.181,76
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 17879-9	905.889,00				8.355,14	0,92%	914.244,14
<b>Aplicações</b>		<b>12.816.896,72</b>						<b>13.255.537,99</b>
<b>Imóveis</b>		<b>0,00</b>						<b>0,00</b>
<b>Conta Corrente</b>		<b>0,00</b>						<b>14.058,19</b>
Caixa 278-7		0,00						14.058,19
Banco do Brasil 17879-9		0,00						0,00
<b>FINAL</b>		<b>12.816.896,72</b>	<b>387.859,02</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>50.782,25</b>	<b>0,38%</b>	<b>13.269.596,18</b>

**jun/17**

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 17879-9	3.114.173,90	2.400.000,00	-1.200.000,00		28.516,31	0,66%	4.342.690,21
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 278-7	1.899.925,53	2.099.953,54			20.256,00	0,51%	4.020.135,07
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 278-7	974.130,56		-450.000,00		3.737,53	0,71%	527.868,09
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 17879-9	1.934.209,19		-1.200.000,00		6.495,47	0,88%	740.704,66
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 278-7	2.252.672,91		-1.300.000,00		-2.609,31	-0,27%	950.063,60
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 278-7	2.166.181,76				17.858,21	0,82%	2.184.039,97
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 17879-9	914.244,14				7.440,35	0,81%	921.684,49
<b>Aplicações</b>		<b>13.255.537,99</b>						<b>13.687.186,09</b>
<b>Imóveis</b>		<b>0,00</b>						<b>0,00</b>
<b>Conta Corrente</b>		<b>14.058,19</b>						<b>5.864,35</b>
Caixa 278-7		14.058,19						5.864,35
Banco do Brasil 17879-9		0,00						0,00
<b>FINAL</b>		<b>13.269.596,18</b>	<b>4.499.953,54</b>	<b>-4.150.000,00</b>	<b>0,00</b>	<b>81.694,56</b>	<b>0,60%</b>	<b>13.693.050,44</b>

jul/17

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 17879-9	4.342.690,21				45.840,49	1,06%	4.388.530,70
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 278-7	4.020.135,07	349.361,62			44.374,68	1,02%	4.413.871,37
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 278-7	527.868,09				14.902,79	2,82%	542.770,88
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 17879-9	740.704,66				21.108,48	2,85%	761.813,14
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 278-7	950.063,60				35.853,75	3,77%	985.917,35
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 278-7	2.184.039,97				17.154,64	0,79%	2.201.194,61
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 17879-9	921.684,49				7.425,47	0,81%	929.109,96
<b>Aplicações</b>		<b>13.687.186,09</b>						<b>14.223.208,01</b>
<b>Imóveis</b>		<b>0,00</b>						<b>0,00</b>
<b>Conta Corrente</b>		<b>5.864,35</b>						<b>4.280,84</b>
Caixa 278-7		5.864,35						4.280,84
Banco do Brasil 17879-9		0,00						0,00
<b>FINAL</b>		<b>13.693.050,44</b>	<b>349.361,62</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>186.660,30</b>	<b>1,33%</b>	<b>14.227.488,85</b>

ago/17

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 17879-9	4.388.530,70				38.508,20	0,88%	4.427.038,90
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 278-7	4.413.871,37	358.417,45			41.185,68	0,86%	4.813.474,50
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 278-7	542.770,88				6.728,43	1,24%	549.499,31
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 17879-9	761.813,14				9.478,11	1,24%	771.291,25
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 278-7	985.917,35				13.381,67	1,36%	999.299,02
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 278-7	2.201.194,61				17.425,74	0,79%	2.218.620,35
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 17879-9	929.109,96				7.367,00	0,79%	936.476,96
<b>Aplicações</b>		<b>14.223.208,01</b>						<b>14.715.700,29</b>
<b>Imóveis</b>		<b>0,00</b>						<b>0,00</b>
<b>Conta Corrente</b>		<b>4.280,84</b>						<b>16.522,07</b>
Caixa 278-7		4.280,84						16.522,07
Banco do Brasil 17879-9		0,00						0,00
<b>FINAL</b>		<b>14.227.488,85</b>	<b>358.417,45</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>134.074,83</b>	<b>0,92%</b>	<b>14.732.222,36</b>

set/17

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 17879-9	4.427.038,90				31.487,90	0,71%	4.458.526,80
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 278-7	4.813.474,50	375.074,95			34.869,90	0,67%	5.223.419,35
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 278-7	549.499,31				5.450,12	0,99%	554.949,43
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 17879-9	771.291,25				7.627,69	0,99%	778.918,94
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 278-7	999.299,02				17.895,31	1,79%	1.017.194,33
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 278-7	2.218.620,35				14.065,79	0,63%	2.232.686,14
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 17879-9	936.476,96				6.083,73	0,65%	942.560,69
<b>Aplicações</b>		<b>14.715.700,29</b>						<b>15.208.255,68</b>
<b>Imóveis</b>		<b>0,00</b>						<b>0,00</b>
<b>Conta Corrente</b>		<b>16.522,07</b>						<b>7.605,44</b>
Caixa 278-7		16.522,07						7.605,44
Banco do Brasil 17879-9		0,00						0,00
<b>FINAL</b>		<b>14.732.222,36</b>	<b>375.074,95</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>117.480,44</b>	<b>0,78%</b>	<b>15.215.861,12</b>

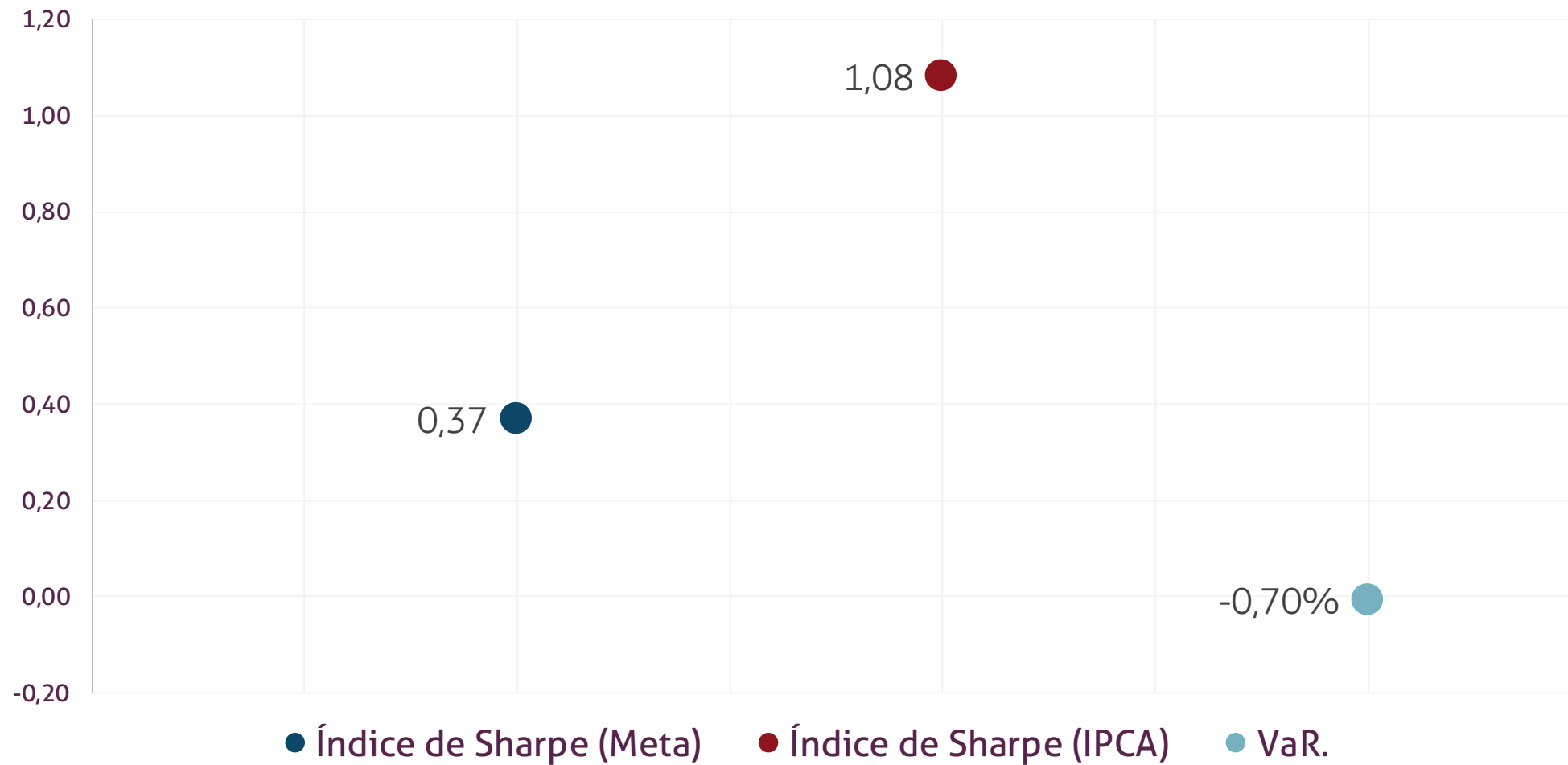
## Evolução Patrimônio Líquido - Fundo IV

Jan	R\$	3.092.720,28	Fev	R\$	3.476.202,11	Mar	R\$	3.847.081,22	Abr	R\$	4.024.793,93
Mai	R\$	4.566.484,83	Jun	R\$	4.595.024,10	Jul	R\$	4.659.001,86	Ago	R\$	4.702.949,74
Set	R\$	4.740.832,20	Out			Nov			Dez		



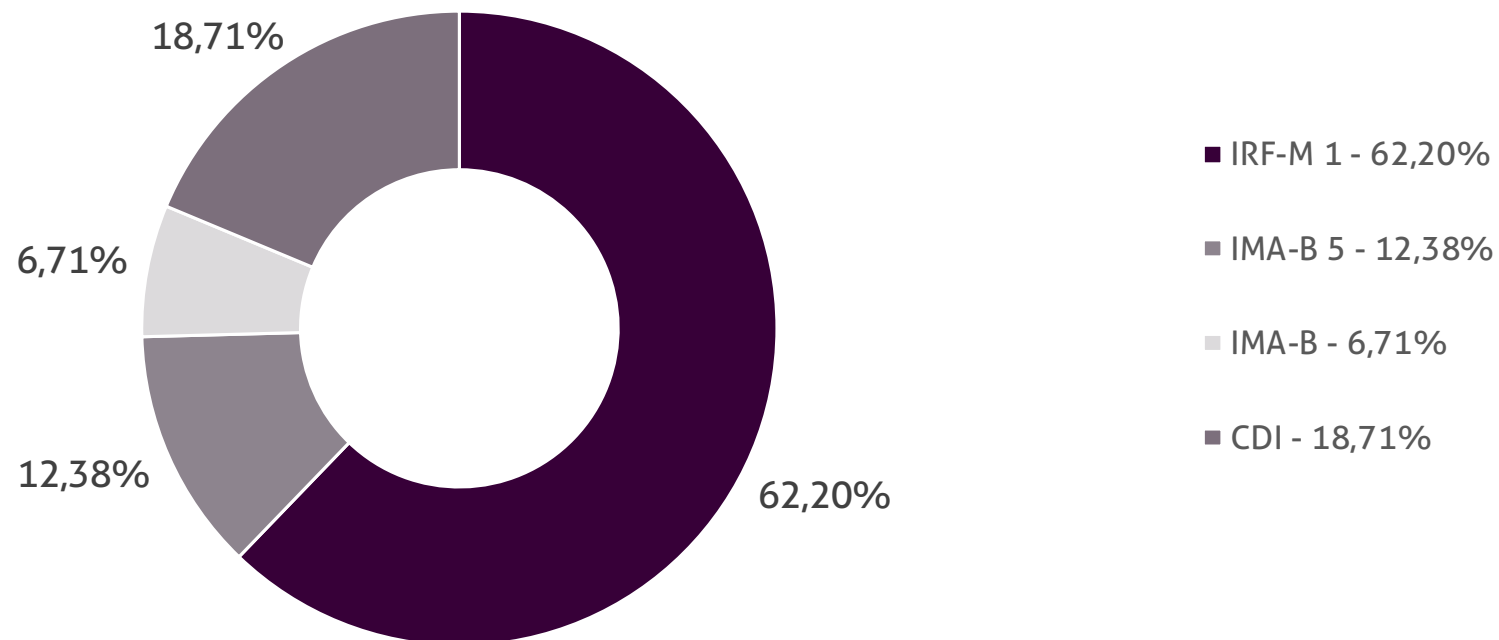


## Índice de Sharpe e Var da Carteira

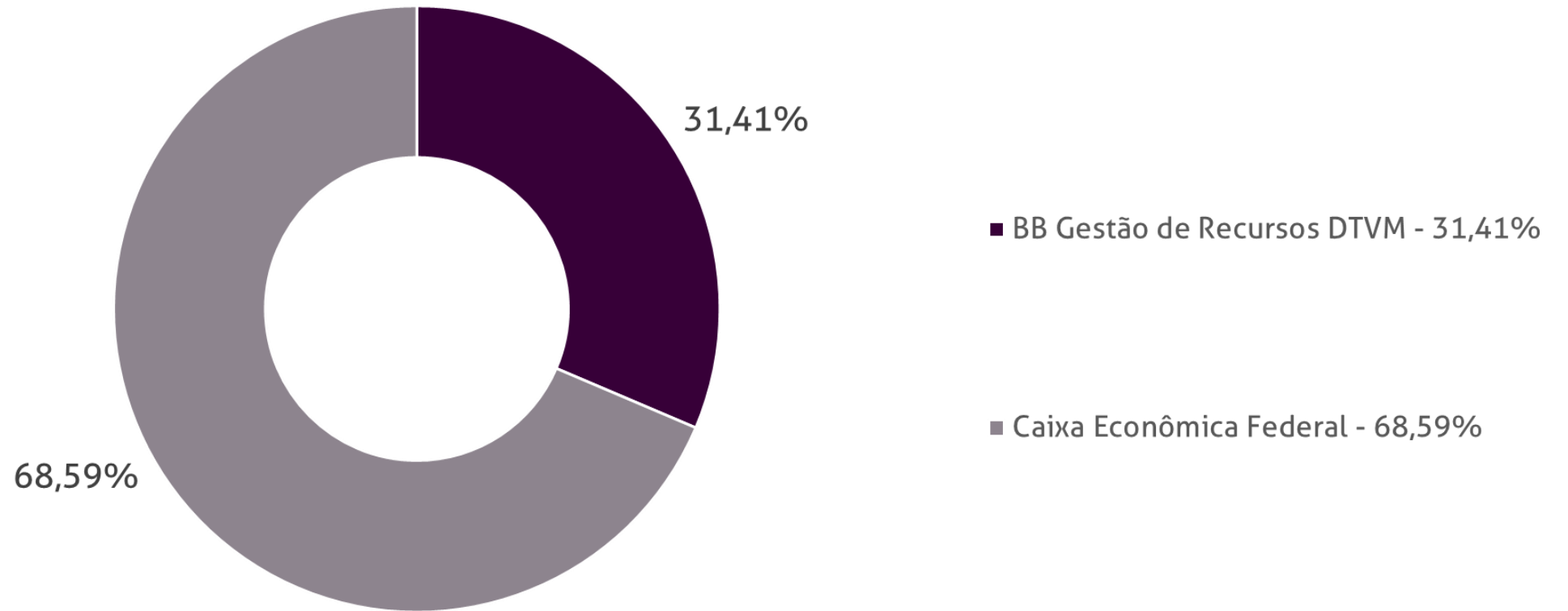


Fundos	CNPJ	Gestão	Taxa de Administração	Benchmark	Resgate
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.328.882/0001-35	BB Gestão de Recursos DTVM	0,10%	IRF-M 1	D+0
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.060.913/0001-10	Caixa Econômica Federal	0,20%	IMA-B 5	D+0
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	03.543.447/0001-03	BB Gestão de Recursos DTVM	0,20%	IMA-B 5	D+1
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	10.646.895/0001-90	Caixa Econômica Federal	0,20%	IMA-B	D+0
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	03.737.206/0001-97	Caixa Econômica Federal	0,20%	CDI	D+0
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.077.418/0001-49	BB Gestão de Recursos DTVM	0,20%	CDI	D+0
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.740.670/0001-06	Caixa Econômica Federal	0,20%	IRF-M 1	D+0

### Distribuição por Indicador - Setembro - 2017



## Distribuição por Instituição - Setembro - 2017

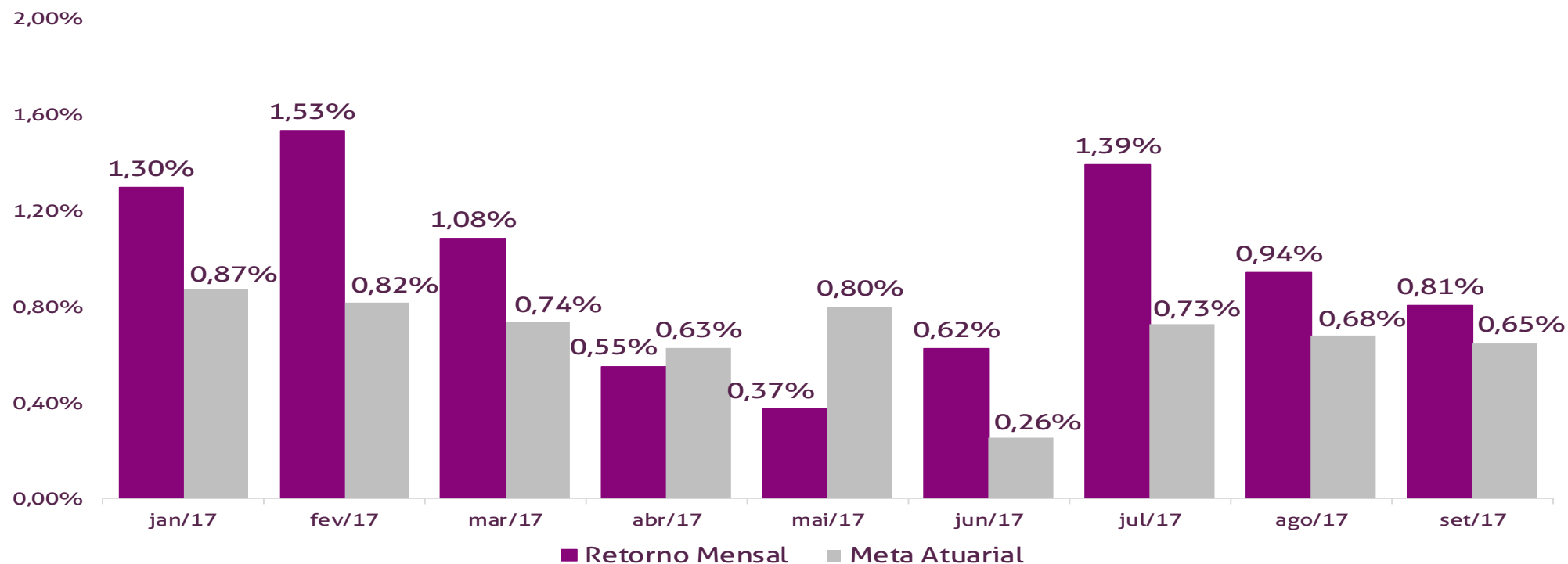


Performance Absoluta

	jan-17	fev-17	mar-17	abr-17	mai-17	jun-17
Carteira	1,30%	1,53%	1,08%	0,55%	0,37%	0,62%
Retorno Financeiro	39.595,39	52.540,75	41.242,09	21.908,76	16.935,14	28.539,27
Meta Atuarial	0,87%	0,82%	0,74%	0,63%	0,80%	0,26%

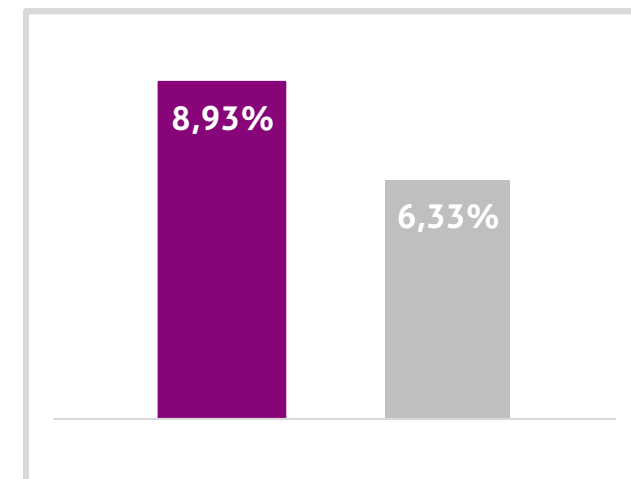
	jul-17	ago-17	set-17	out-17	nov-17	dez-17
Carteira	1,39%	0,94%	0,81%			
Retorno Financeiro	63.977,76	43.947,88	37.882,46			
Meta Atuarial	0,73%	0,68%	0,65%			

### Retorno Mensal X Meta Atuarial Mensal



Estatística		
Meses positivos:	9	
Meses negativos:	0	
Meses acima da Meta Atuarial:	7	
Meses abaixo da Meta Atuarial:	2	
Retorno Mensal Máximo	1,53%	fev-17
Retorno Mensal Médio	0,96%	
Retorno Mensal Mínimo	0,37%	mai-17
Sharpe	0,37	
Volatilidade	8,65%	
VaR	-0,70%	
Meta Atuarial	IPCA + 6%	

Consolidado - 2017	
Carteira	8,93%
Retorno	R\$ 346.569,50
Meta	6,33%



jan/17

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 18272-9	563.567,80				7.100,96	1,26%	570.668,76
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 281-7	530.852,48				6.038,82	1,14%	536.891,30
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 18272-9	521.839,95				5.937,99	1,14%	527.777,94
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 281-7	616.159,82				11.634,12	1,89%	627.793,94
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 281-7	538.991,14				5.790,69	1,07%	544.781,83
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 18272-9	281.713,70				3.092,81	1,10%	284.806,51
<b>Aplicações</b>		<b>3.053.124,89</b>						<b>3.092.720,28</b>
<b>Imóveis</b>		<b>0,00</b>						<b>0,00</b>
<b>Conta Corrente</b>		<b>0,00</b>						<b>0,00</b>
Caixa 281-7		0,00						0,00
Banco do Brasil 18272-9		0,00						0,00
<b>Final</b>		<b>3.053.124,89</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>39.595,39</b>	<b>1,30%</b>	<b>3.092.720,28</b>

fev/17

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 18272-9	570.668,76				5.632,18	0,99%	576.300,94
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 281-7	536.891,30				7.933,33	1,48%	544.824,63
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 281-7	0,00	330.941,08			131,78	0,04%	331.072,86
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 18272-9	527.777,94				7.800,50	1,48%	535.578,44
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 281-7	627.793,94				23.707,33	3,78%	651.501,27
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 281-7	544.781,83				4.796,29	0,88%	549.578,12
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 18272-9	284.806,51				2.539,34	0,89%	287.345,85
<b>Aplicações</b>		<b>3.092.720,28</b>						<b>3.476.202,11</b>
<b>Imóveis</b>		<b>0,00</b>						<b>0,00</b>
<b>Conta Corrente</b>		<b>0,00</b>						<b>0,00</b>
Caixa 281-7		0,00						0,00
Banco do Brasil 18272-9		0,00						0,00
<b>FINAL</b>		<b>3.092.720,28</b>	<b>330.941,08</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>52.540,75</b>	<b>1,53%</b>	<b>3.476.202,11</b>

mar/17

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 18272-9	576.300,94				6.344,80	1,10%	582.645,74
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 281-7	544.824,63				7.503,87	1,38%	552.328,50
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 281-7	331.072,86	329.637,02			4.877,11	0,74%	665.586,99
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 18272-9	535.578,44				7.395,75	1,38%	542.974,19
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 281-7	651.501,27				6.184,52	0,95%	657.685,79
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 281-7	549.578,12				5.871,25	1,07%	555.449,37
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 18272-9	287.345,85				3.064,79	1,07%	290.410,64
<b>Aplicações</b>		<b>3.476.202,11</b>						<b>3.847.081,22</b>
<b>Imóveis</b>		<b>0,00</b>						<b>0,00</b>
<b>Conta Corrente</b>		<b>0,00</b>						<b>0,00</b>
Caixa 281-7		0,00						0,00
Banco do Brasil 18272-9		0,00						0,00
<b>FINAL</b>		<b>3.476.202,11</b>	<b>329.637,02</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>41.242,09</b>	<b>1,08%</b>	<b>3.847.081,22</b>

**abr/17**

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 18272-9	582.645,74				4.988,31	0,86%	587.634,05
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 281-7	552.328,50				3.846,43	0,70%	556.174,93
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 281-7	665.586,99	155.803,95			6.069,97	0,74%	827.460,91
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 18272-9	542.974,19				3.793,07	0,70%	546.767,26
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 281-7	657.685,79				-3.466,82	-0,53%	654.218,97
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 281-7	555.449,37				4.404,62	0,79%	559.853,99
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 18272-9	290.410,64				2.273,18	0,78%	292.683,82
<b>Aplicações</b>		<b>3.847.081,22</b>						<b>4.024.793,93</b>
<b>Imóveis</b>		<b>0,00</b>						<b>0,00</b>
<b>Conta Corrente</b>		<b>0,00</b>						<b>0,00</b>
Caixa 281-7		0,00						0,00
Banco do Brasil 18272-9		0,00						0,00
<b>FINAL</b>		<b>3.847.081,22</b>	<b>155.803,95</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>21.908,76</b>	<b>0,55%</b>	<b>4.024.793,93</b>

**mai/17**

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 18272-9	587.634,05				5.211,94	0,89%	592.845,99
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 281-7	556.174,93				471,10	0,08%	556.646,03
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 281-7	827.460,91	524.755,76			9.145,37	0,68%	1.361.362,04
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 18272-9	546.767,26				502,09	0,09%	547.269,35
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 281-7	654.218,97				-6.312,30	-0,96%	647.906,67
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 281-7	559.853,99				5.217,48	0,93%	565.071,47
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 18272-9	292.683,82				2.699,46	0,92%	295.383,28
<b>Aplicações</b>		<b>4.024.793,93</b>						<b>4.566.484,83</b>
<b>Imóveis</b>		<b>0,00</b>						<b>0,00</b>
<b>Conta Corrente</b>		<b>0,00</b>						<b>0,00</b>
Caixa 281-7		0,00						0,00
Banco do Brasil 18272-9		0,00						0,00
<b>FINAL</b>		<b>4.024.793,93</b>	<b>524.755,76</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>16.935,14</b>	<b>0,37%</b>	<b>4.566.484,83</b>

**jun/17**

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 18272-9	592.845,99	300.000,00			5.520,60	0,62%	898.366,59
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 281-7	556.646,03		-250.000,00		2.155,57	0,70%	308.801,60
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 281-7	1.361.362,04	600.000,00			12.507,27	0,64%	1.973.869,31
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 18272-9	547.269,35		-300.000,00		1.947,99	0,79%	249.217,34
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 281-7	647.906,67		-350.000,00		-654,57	-0,22%	297.252,10
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 281-7	565.071,47				4.658,51	0,82%	569.729,98
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 18272-9	295.383,28				2.403,90	0,81%	297.787,18
<b>Aplicações</b>		<b>4.566.484,83</b>						<b>4.595.024,10</b>
<b>Imóveis</b>		<b>0,00</b>						<b>0,00</b>
<b>Conta Corrente</b>		<b>0,00</b>						<b>0,00</b>
Caixa 281-7		0,00						0,00
Banco do Brasil 18272-9		0,00						0,00
<b>FINAL</b>		<b>4.566.484,83</b>	<b>900.000,00</b>	<b>-900.000,00</b>	<b>0,00</b>	<b>28.539,27</b>	<b>0,62%</b>	<b>4.595.024,10</b>

jul/17

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 18272-9	898.366,59				9.482,96	1,06%	907.849,55
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 281-7	308.801,60				8.718,10	2,82%	317.519,70
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 281-7	1.973.869,31				20.582,69	1,04%	1.994.452,00
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 18272-9	249.217,34				7.102,16	2,85%	256.319,50
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 281-7	297.252,10				11.217,78	3,77%	308.469,88
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 281-7	569.729,98				4.474,97	0,79%	574.204,95
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 18272-9	297.787,18				2.399,10	0,81%	300.186,28
<b>Aplicações</b>		4.595.024,10						4.659.001,86
<b>Imóveis</b>		0,00						0,00
<b>Conta Corrente</b>		0,00						0,00
Caixa 281-7		0,00						0,00
Banco do Brasil 18272-9		0,00						0,00
<b>FINAL</b>		<b>4.595.024,10</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>63.977,76</b>	<b>1,39%</b>	<b>4.659.001,86</b>

ago/17

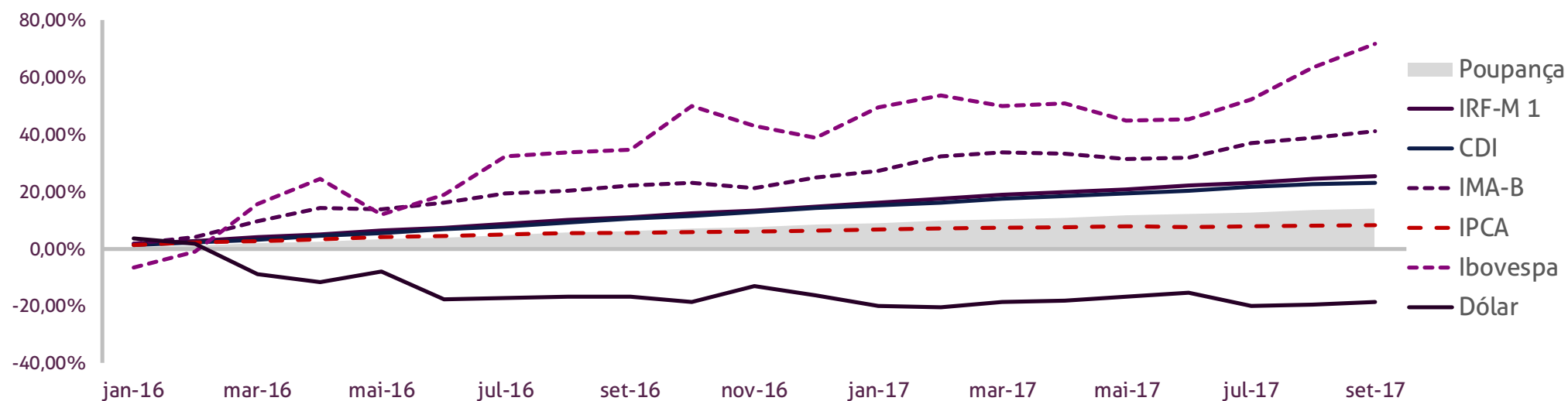
Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 18272-9	907.849,55				7.966,14	0,88%	915.815,69
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 281-7	317.519,70				3.936,11	1,24%	321.455,81
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 281-7	1.994.452,00				17.743,94	0,89%	2.012.195,94
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 18272-9	256.319,50				3.189,00	1,24%	259.508,50
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 281-7	308.469,88				4.186,80	1,36%	312.656,68
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 281-7	574.204,95				4.545,69	0,79%	578.750,64
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 18272-9	300.186,28				2.380,20	0,79%	302.566,48
<b>Aplicações</b>		4.659.001,86						4.702.949,74
<b>Imóveis</b>		0,00						0,00
<b>Conta Corrente</b>		0,00						0,00
Caixa 281-7		0,00						0,00
Banco do Brasil 18272-9		0,00						0,00
<b>FINAL</b>		<b>4.659.001,86</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>43.947,88</b>	<b>0,94%</b>	<b>4.702.949,74</b>

set/17

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 18272-9	915.815,69				6.513,86	0,71%	922.329,55
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 281-7	321.455,81				3.188,31	0,99%	324.644,12
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 281-7	2.012.195,94				14.380,05	0,71%	2.026.575,99
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 18272-9	259.508,50				2.566,41	0,99%	262.074,91
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 281-7	312.656,68				5.599,02	1,79%	318.255,70
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 281-7	578.750,64				3.669,21	0,63%	582.419,85
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 18272-9	302.566,48				1.965,60	0,65%	304.532,08
<b>Aplicações</b>		4.702.949,74						4.740.832,20
<b>Imóveis</b>		0,00						0,00
<b>Conta Corrente</b>		0,00						0,00
Caixa 281-7		0,00						0,00
Banco do Brasil 18272-9		0,00						0,00
<b>FINAL</b>		<b>4.702.949,74</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>37.882,46</b>	<b>0,81%</b>	<b>4.740.832,20</b>



	IRF-M 1	CDI	IMA-B	IDKA 2	Poupança	IPCA	Ibovespa	Dólar	IPCA + 6%
2016	14,72%	13,99%	24,82%	13,75%	8,31%	6,29%	38,92%	-16,54%	12,67%
out-16	0,94%	1,05%	0,64%	0,41%	0,66%	0,26%	11,23%	-2,01%	0,75%
nov-16	1,05%	1,04%	-1,22%	0,57%	0,64%	0,18%	-4,65%	6,78%	0,67%
dez-16	1,20%	1,12%	2,91%	1,28%	0,69%	0,30%	-2,71%	-4,05%	0,79%
jan-17	1,29%	1,08%	1,87%	1,09%	0,67%	0,38%	7,38%	-4,05%	0,87%
fev-17	1,01%	0,86%	3,85%	1,35%	0,53%	0,33%	3,08%	-0,89%	0,82%
mar-17	1,12%	1,05%	1,04%	1,62%	0,65%	0,25%	-2,52%	2,23%	0,74%
abr-17	0,87%	0,79%	-0,32%	0,92%	0,50%	0,14%	0,64%	0,95%	0,63%
mai-17	0,91%	0,93%	-1,19%	0,45%	0,58%	0,31%	-4,12%	1,42%	0,80%
jun-17	0,89%	0,81%	0,16%	0,79%	0,55%	-0,23%	0,30%	1,99%	0,26%
jul-17	1,05%	0,80%	4,00%	2,53%	0,56%	0,24%	4,80%	-5,37%	0,73%
ago-17	0,90%	0,80%	1,34%	0,97%	0,55%	0,19%	7,46%	0,52%	0,68%
set-17	0,74%	0,64%	1,81%	0,91%	0,50%	0,16%	4,88%	0,66%	0,65%
2017	9,13%	8,02%	13,16%	11,13%	5,21%	1,78%	23,35%	-2,80%	6,33%



## Cenário Econômico Setembro 2017

### EUA

O aumento da tensão entre o Presidente Trump e o líder norte-coreano Kim Jong-un aumentou a busca por proteção dos investidores internacionais. Trump respondeu com ameaças severas aos testes nucleares de Kim, próximos a zona costeira do Japão. Em resposta, o governo Chinês impôs sanções à Coreia do Norte reduzindo a exportação de combustível e a importação de têxteis.

Além da tensão geopolítica, os furacões abalaram a economia do país. Com a passagem do furacão, as indústrias petrolíferas ficaram paralisadas, gerando estoque do petróleo, contribuindo para a inconstância do preço do barril.

Do lado econômico, as notícias corporativas e empresas de tecnologia sustentaram o otimismo em Wall Street, que fechou em recordes, e acabou por desvalorizar o dólar.

Trump propôs uma revisão da carga tributária, defendendo a maior redução tributária do país em três décadas. Apesar do benefício que isso traria para a população, o plano enfrenta grande resistência no Congresso, pois críticos dizem que essa medida pode ampliar a dívida do país em trilhões de dólares, por consequência da eventual diminuição da arrecadação fiscal.

### Europa

Eleições para o parlamento Alemão definiu a agenda política em setembro. Os alemães elegeram Ângela Merkel pela quarta vez como primeira-ministra. Apesar do resultado, considerado positivo por líderes mundiais, o partido de extrema direita "Alternativa para a Alemanha" – AfD ganhou espaço e irá ocupar assentos no Parlamento.

O fato, inédito desde a Segunda Guerra Mundial, trouxe preocupação por trazer maior polarização de opiniões,

com discursos de ódio (contra islâmicos) e separatistas (contra a Europa).

O Banco Central Europeu (BCE) sinalizou que o programa de estímulos monetários poderá sofrer alterações até o final deste ano. Diante de melhores resultados econômicos, o BCE pretende reduzir a sua injeção de dinheiro na economia, em vista da retomada do crescimento do PIB.

### Brasil

O cenário político foi conturbado, com denúncias, declarações, delações e a espera do mercado por decisões importantes no Congresso.

A segunda denúncia contra o Presidente da República, enviada pelo ex-Procurador Geral da República, chegou à Câmara dos deputados para a aprovação ou não da investigação sobre o Presidente. Temer é acusado de dois crimes: obstrução de Justiça e organização criminosa. Além dele, outras pessoas com foro privilegiado estão envolvidas na acusação. O pedido de abertura de inquérito enviado pelo Ministério Público Federal (MPF) inclui os ministros da Casa Civil, Eliseu Padilha, e da Secretaria Geral da Presidência, Moreira Franco. O caso trouxe maior insegurança para o mercado, diante da incerteza quanto a viabilidade do governo providenciar a Reforma da Previdência.

Acusados de crime pelo uso de informações privilegiadas, os irmãos Batistas (Grupo JBS) foram presos em ação preventiva. Eles são acusados de terem obtido lucro com operações financeiras, através da prática ilegal. Os irmãos são investigados em outros 13 processos e inquéritos pela Comissão de Valores Mobiliários (CVM).

Em uma operação da Polícia Federal que investiga pagamento de propinas na liberação de FGTS pela Caixa, foi decretada a prisão do ex-ministro do governo Temer, Geddel Vieira Lima. Geddel surpreendeu o país por ter um apartamento exclusivo em uma área nobre de Salvador (BA), para guardar malas e caixas de dinheiro contendo R\$ 51 milhões.

Temer anunciou a liberação antecipada de R\$ 15,5 bi do PIS/Pasep, visando estimular o aumento de consumo e movimentar a economia brasileira.

### Mercado

Pela oitava vez seguida, o Banco Central (BC) reduziu os juros da economia. Por unanimidade, o Comitê de Política Monetária (Copom) reduziu a taxa Selic em 1 ponto percentual, de 9,25% ao ano para 8,25% ao ano. Em ata, o Banco Central comunicou que deve reduzir o ciclo de corte da Selic, agora que ela está próxima do nível esperado para o final do ano (7,0%).

Com a taxa básica de juros Selic em queda, produtos alternativos à renda fixa se destacam entre as aplicações financeiras. Em setembro, os fundos de investimentos imobiliários lideraram o ranking de investimentos: o IFIX, índice que mede a variação desses ativos, fechou o mês com rentabilidade de 6,57%.

As opções de renda variável se seguiram aos fundos imobiliários como as opções de maior retorno.

O Ibovespa também foi destaque com recordes no mês, ao superar o nível de 74 mil pontos pela primeira vez. O índice encerra o terceiro trimestre em alta de 12,7% e acumula alta em 2017 de 23,3%. Apesar dos bons resultados, a bolsa perdeu força próximo ao encerramento do mês, diante da piora do cenário político. Ainda assim, fechou o mês com ganho de 4,8%.





62 3924.6211  
[www.setecapital.com](http://www.setecapital.com)

Av. Olinda, 960,  
Ed. Lozandes Corporate Design,  
Sl. 806, Park Lozandes, Goiânia - GO - 74884-120