

Relatório Analítico dos Investimentos em setembro e 3º Trimestre de 2017

SIRU 

Carteira consolidada de investimentos - base (setembro / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	6.054.405,29	1,21%	94	1,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	31.867.471,43	6,38%	222	1,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	12.959.551,65	2,60%	26	5,95%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	60.936.822,24	12,21%	696	1,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	57.872.172,02	11,59%	711	0,92%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	27.972.954,40	5,60%	259	2,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	624.233,54	0,13%	193	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	59.236.980,62	11,87%	196	3,99%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	18.787.468,15	3,76%	11	16,65%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	58.285.798,14	11,68%	613	1,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	99.004.841,29	19,83%	103	5,83%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	15.536.008,62	3,11%	53	3,16%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	12.923.124,05	2,59%	763	0,30%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
WESTERN ASSET ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	4.325.338,64	0,87%	841	0,26%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	70.260,50	0,01%			Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	Não se aplica	Não se aplica	17.957,37	0,00%	1	0,83%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+30 a D+2880	Não há	7.252.788,73	1,45%	61	1,68%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	D+12	Não há	3.458.476,25	0,69%	297	8,10%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	11.449.764,03	2,29%	2.445	10,48%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	3.665.579,82	0,73%	33	1,09%	Artigo 8º, Inciso V
PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	Não se aplica	Não se aplica	3.347.306,58	0,67%			Artigo 8º, Inciso V
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se aplica	Não se aplica	1.344.064,09	0,27%		3,05%	Artigo 8º, Inciso VI

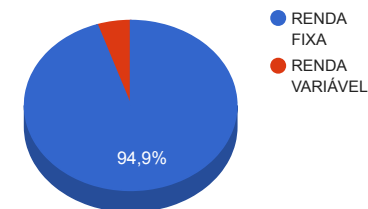
Carteira consolidada de investimentos - base (setembro / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	S/Info	Não se aplica	2.206.998,84	0,44%		3,41%	Artigo 8º, Inciso VI
		TOTAL -	499.200.366,29				

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

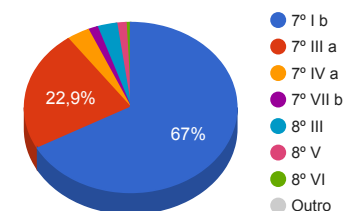
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	334.597.857,48	67,03%	10,00%	64,49%	100,00%	164.602.508,81
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	114.540.849,91	22,94%	0,00%	15,00%	80,00%	284.819.443,12
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	17.248.462,69	3,46%	5,00%	14,00%	30,00%	132.511.647,20
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	88.217,87	0,02%	0,00%	0,01%	5,00%	24.871.800,44
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	7.252.788,73	1,45%	0,00%	0,00%	5,00%	17.707.229,58
Total Renda Fixa	100,00%	473.728.176,68	94,90%	15,00	93,50	380,00	-

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	14.908.240,28	2,99%	2,00%	4,00%	15,00%	59.971.814,66
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	24.960.018,31
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	7.012.886,40	1,40%	0,00%	1,00%	5,00%	17.947.131,91
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	3.551.062,93	0,71%	0,00%	0,05%	5,00%	21.408.955,38
Total Renda Variável	30,00%	25.472.189,61	5,10%	2,00	6,05	80,00	-

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: setembro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	50,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	334.597.857,48	67,03%	10,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	114.540.849,91	22,94%	0,00%	80,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	80,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	17.248.462,69	3,46%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso V, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 7º, Inciso VI	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	88.217,87	0,02%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	7.252.788,73	1,45%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	473.728.176,68	94,90%	15,00	380,00

Artigos - Renda Variável	Base: setembro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I	0,00	0,00%	0,00%	30,00%
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	14.908.240,28	2,99%	2,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	7.012.886,40	1,40%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	3.551.062,93	0,71%	0,00%	5,00%
Total Renda Variável	25.472.189,61	5,10%	2,00	80,00

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5+	2,40%	14,62%	8,64%	5,79%	17,29%	57,99%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,37%	14,38%	8,52%	5,75%	16,99%	56,58%	0,20%	2,004%	12,71%
BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	2,36%	14,35%	8,51%	5,52%	16,94%	56,62%	0,20%	2,012%	13,02%
IMA-B	1,81%	13,16%	7,30%	5,86%	15,76%	48,59%	-	-	-
BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	1,83%	13,41%	7,43%	5,91%	16,15%	48,50%	0,20%	1,376%	9,96%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,78%	12,94%	7,21%	5,71%	15,46%	47,78%	0,20%	1,328%	9,80%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,28%	12,82%	6,44%	6,88%	15,13%	-	0,20%	0,963%	6,14%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,50%	2,65%	0,07%	2,15%	4,86%	17,80%	0,20%	0,279%	4,41%
IRF-M 1+	1,73%	15,17%	5,69%	7,83%	19,22%	51,80%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,68%	14,89%	5,59%	7,62%	18,92%	51,25%	0,20%	1,331%	6,40%
IRF-M	1,48%	13,57%	4,92%	7,23%	17,44%	43,51%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,45%	13,36%	4,87%	7,06%	17,16%	43,01%	0,20%	1,005%	4,84%
IMA-B 5	1,01%	10,94%	5,18%	6,58%	13,45%	34,82%	-	-	-
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	1,14%	12,84%	5,92%	7,18%	15,06%	40,09%	0,40%	0,817%	5,17%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,99%	10,80%	5,13%	6,49%	13,27%	34,14%	0,20%	0,646%	3,63%
CDI + 3,50% ao ano	0,91%	10,83%	3,15%	6,65%	15,40%	36,32%	-	-	-
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-3,15%	-20,22%	-26,47%	-15,82%	-77,54%	-77,59%	0,39%	-	-

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

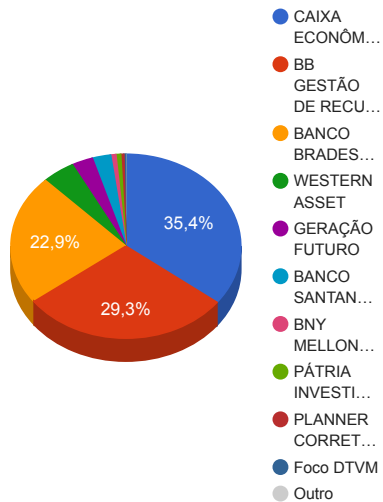
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDKA IPCA 2 Anos	0,91%	11,13%	4,46%	6,74%	13,66%	34,61%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,50%	8,48%	2,84%	4,98%	10,90%	28,86%	0,20%	0,276%	1,89%
IRF-M 1	0,74%	9,14%	2,72%	5,49%	12,65%	29,70%	-	-	-
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,71%	9,10%	2,67%	5,45%	12,59%	29,49%	0,00%	0,072%	0,68%
110% do CDI	0,70%	8,86%	2,48%	5,35%	12,75%	30,40%	-	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	9,96%	-23,59%	-8,40%	-17,54%	-29,99%	-45,03%	0,00%	41,670%	-
CDI	0,64%	8,03%	2,25%	4,85%	11,53%	27,29%	-	-	-
WESTERN ASSET ATIVO FI RENDA FIXA	0,76%	9,20%	2,78%	5,17%	12,49%	30,85%	0,40%	0,213%	1,39%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,65%	8,10%	2,27%	4,86%	11,65%	27,28%	0,20%	0,014%	0,11%
IPCA	0,16%	1,78%	0,59%	0,81%	2,54%	11,23%	-	-	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1,25%	13,08%	5,63%	7,24%	15,92%	42,90%	0,20%	0,703%	4,63%

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

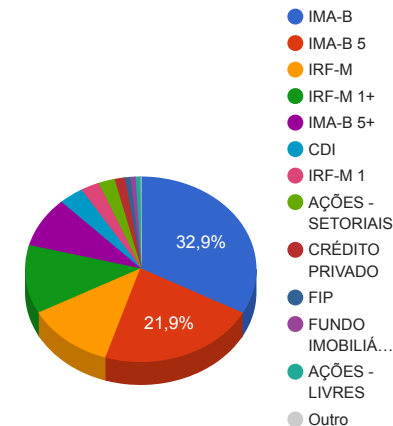
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	6,58%	19,16%	7,09%	9,30%	22,30%	58,65%	-	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	0,96%	-11,06%	-11,06%	-11,06%	-40,10%	-40,10%	1,50%	12,374%	36,91%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	-	-100,00%	-	-100,00%	-100,00%	-100,00%	0,14%	-	-
IDIV	6,12%	27,55%	18,99%	11,86%	42,02%	93,80%	-	-	-
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	2,04%	2,92%	5,27%	-1,50%	3,46%	0,40%	3,00%	5,583%	19,09%
Ibovespa	4,88%	23,36%	18,12%	14,33%	27,29%	64,88%	-	-	-
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	2,38%	7,56%	8,90%	3,33%	11,32%	19,79%	2,00%	5,213%	20,22%
IPCA	0,16%	1,78%	0,59%	0,81%	2,54%	11,23%	-	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,50%	0,001%	0,01%
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	-	-	-	-	-	-	1,00%	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	176.949.578,47	35,45%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	146.077.171,99	29,26%
BANCO BRADESCO	114.540.849,91	22,94%
WESTERN ASSET	23.112.806,79	4,63%
GERAÇÃO FUTURO	14.908.240,28	2,99%
BANCO SANTANDER	12.959.551,65	2,60%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	3.665.579,82	0,73%
PÁTRIA INVESTIMENTOS	3.347.306,58	0,67%
PLANNER CORRETORA	2.206.998,84	0,44%
Foco DTVM	1.344.064,09	0,27%
BRL Trust Investimentos	70.260,50	0,01%
GRADUAL INVESTIMENTOS	17.957,37	0,00%



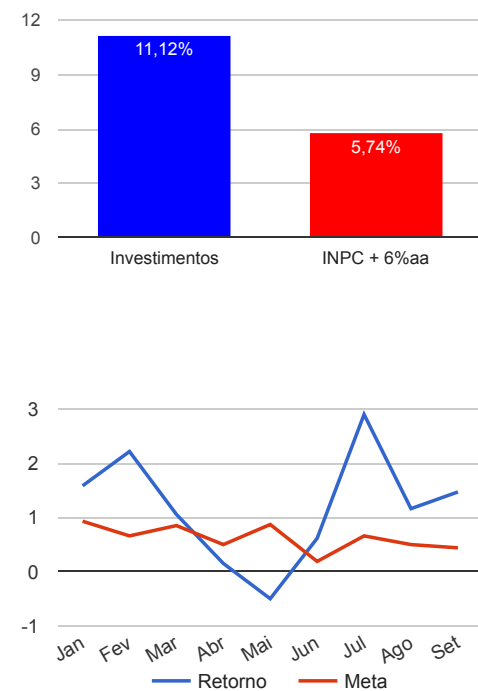
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	163.345.044,72	32,72%
IMA-B 5	108.527.111,60	21,74%
IRF-M	60.936.822,24	12,21%
IRF-M 1+	59.236.980,62	11,87%
IMA-B 5+	43.508.963,02	8,72%
CDI	17.248.462,69	3,46%
IRF-M 1	12.959.551,65	2,60%
AÇÕES - SETORIAIS	11.449.764,03	2,29%
CRÉDITO PRIVADO	7.252.788,73	1,45%
FIP	3.665.579,82	0,73%
FUNDO IMOBILIÁRIO	3.551.062,93	0,71%
AÇÕES - LIVRES	3.458.476,25	0,69%
IDKA IPCA 2A	624.233,54	0,13%
FIDC - FECHADO	88.217,87	0,02%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	436.576.227,58	31.006.264,66	29.059.550,65	445.460.368,97	6.937.427,38	1,58%	0,93%	169,72%	2,02%
Fevereiro	445.460.368,97	28.327.963,91	26.609.879,30	457.075.664,60	9.897.211,02	2,21%	0,66%	336,32%	1,71%
Março	457.075.664,60	55.817.962,90	54.252.429,76	463.486.562,84	4.845.365,10	1,06%	0,85%	123,57%	1,66%
Abril	463.486.562,84	6.900.951,17	5.127.055,12	465.972.314,50	711.855,61	0,15%	0,50%	30,76%	1,43%
Mai	465.972.314,50	6.859.029,84	5.356.198,78	465.154.827,18	-2.320.318,38	-0,50%	0,87%	-56,93%	8,41%
Junho	465.154.827,18	7.201.710,20	5.408.999,65	469.824.894,94	2.877.357,21	0,62%	0,19%	332,55%	1,76%
Julho	469.824.894,94	7.237.805,61	5.528.345,99	485.185.829,76	13.651.475,20	2,90%	0,66%	440,27%	1,62%
Agosto	485.185.829,76	27.803.630,23	31.236.597,47	487.385.926,39	5.633.063,87	1,16%	0,50%	230,78%	1,73%
Setembro	487.385.926,39	31.935.392,80	27.347.720,03	499.200.366,29	7.226.767,13	1,47%	0,44%	331,27%	1,25%
Acumulado no ano					49.460.204,14	11,12%	5,74%	193,66%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	16.330,68	0,00	0,00	17.957,37	1.626,69	9,96%	41,67%	9,96%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	15.177.764,05	0,00	0,00	15.536.008,62	358.244,57	2,36%	2,01%	2,36%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	27.152.243,88	176.600,00	0,00	27.972.954,40	644.110,52	2,36%	2,00%	2,37%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	57.266.025,36	0,00	0,00	58.285.798,14	1.019.772,78	1,78%	1,33%	1,78%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	58.258.506,76	0,00	0,00	59.236.980,62	978.473,86	1,68%	1,33%	1,68%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	83.552.762,53	13.819.118,60	0,00	99.004.841,29	1.632.960,16	1,68%	1,38%	1,83%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	60.063.532,15	0,00	0,00	60.936.822,24	873.290,09	1,45%	1,00%	1,45%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.977.927,37	0,00	0,00	6.054.405,29	76.477,92	1,28%	0,96%	1,28%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	7.162.917,76	0,00	0,00	7.252.788,73	89.870,97	1,25%	0,70%	1,25%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	18.576.005,85	0,00	0,00	18.787.468,15	211.462,30	1,14%	0,82%	1,14%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	52.303.822,53	5.000.000,00	0,00	57.872.172,02	568.349,49	0,99%	0,65%	0,99%
WESTERN ASSET ATIVO FI RENDA FIXA	4.292.824,03	0,00	0,00	4.325.338,64	32.514,61	0,76%	0,21%	0,76%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	18.477.100,64	0,00	5.668.315,99	12.923.124,05	114.339,40	0,62%	0,01%	0,65%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	12.874.956,73	0,00	12.939.674,20	0,00	64.717,47	0,50%	0,01%	0,67%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	31.709.122,89	0,00	0,00	31.867.471,43	158.348,54	0,50%	0,28%	0,50%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	621.133,87	0,00	0,00	624.233,54	3.099,67	0,50%	0,28%	0,50%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	72.542,02	0,00	2.579,13	70.260,50	297,61	0,41%	-	-
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	6.720.788,45	0,00	6.737.150,71	0,00	16.362,26	0,24%	0,65%	0,99%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	12.939.674,20	0,00	12.959.551,65	19.877,45	0,15%	0,07%	0,71%
				Total Renda Fixa	6.864.196,36	1,47%	1,09%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	3.378.139,17	0,00	0,00	3.458.476,25	80.337,08	2,38%	5,21%	2,38%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	2.164.347,00	0,00	0,00	2.206.998,84	42.651,84	1,97%	-	1,97%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	13.200.499,94	0,00	2.000.000,00	11.449.764,03	249.264,09	1,89%	5,58%	2,04%
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	3.349.177,28	0,00	0,00	3.347.306,58	-1.870,70	-0,06%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	3.670.074,02	0,00	0,00	3.665.579,82	-4.494,20	-0,12%	0,00%	-0,12%
ÁQUILLA FII - AQLL11	1.347.381,43	0,00	0,00	1.344.064,09	-3.317,34	-0,25%	12,37%	0,96%
Total Renda Variável					362.570,77	1,34%	4,95%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre / 2017

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	66.364.725,64	27.287.495,44	0,00	99.004.841,29	5.352.620,21	7,11%	7,43%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	54.367.368,37	0,00	0,00	58.285.798,14	3.918.429,77	7,21%	7,21%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	49.087.765,68	7.053.641,95	20.708,19	59.236.980,62	3.116.281,18	5,55%	5,59%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	58.107.046,98	0,00	0,00	60.936.822,24	2.829.775,26	4,87%	4,87%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	43.295.435,01	12.206.242,14	0,00	57.872.172,02	2.370.494,87	5,01%	5,13%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	25.614.526,84	176.600,00	0,00	27.972.954,40	2.181.827,56	8,50%	8,52%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	14.317.061,46	0,00	0,00	15.536.008,62	1.218.947,16	8,51%	8,51%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	31.844.186,45	0,00	880.124,46	31.867.471,43	903.409,44	2,85%	0,07%
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	20.934.651,75	0,00	21.737.150,71	0,00	802.498,96	4,01%	5,13%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	10.720.798,04	7.313.174,91	0,00	18.787.468,15	753.495,20	5,61%	5,92%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	29.212.314,10	0,00	16.813.316,88	12.923.124,05	524.126,83	2,17%	2,27%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	6.866.019,79	0,00	0,00	7.252.788,73	386.768,94	5,63%	5,63%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.840.768,05	0,00	158.884,30	6.054.405,29	372.521,54	6,41%	6,44%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	12.646.651,79	0,00	12.939.674,20	0,00	293.022,41	2,32%	2,49%
WESTERN ASSET ATIVO FI RENDA FIXA	4.208.460,35	0,00	0,00	4.325.338,64	116.878,29	2,78%	2,78%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	12.939.674,20	0,00	12.959.551,65	19.877,45	0,15%	2,67%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	624.213,34	0,00	17.585,96	624.233,54	17.606,16	2,83%	2,84%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	95.554,03	0,00	25.801,74	70.260,50	508,21	0,66%	-26,47%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	19.604,93	0,00	0,00	17.957,37	-1.647,56	-8,40%	-8,40%
Total Renda Fixa					25.177.441,88	5,72%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre / 2017

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	12.795.736,57	0,00	2.000.000,00	11.449.764,03	654.027,46	5,11%	5,27%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	3.175.928,14	0,00	0,00	3.458.476,25	282.548,11	8,90%	8,90%
SANTANDER SELEÇÃO MAX FIC AÇÕES	1.976.067,72	0,00	2.206.242,14	0,00	230.174,42	11,65%	22,46%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	7.209.610,53	0,00	7.313.174,91	0,00	103.564,38	1,44%	2,83%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	2.127.616,98	0,00	0,00	2.206.998,84	79.381,86	3,73%	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	1.337.435,28	0,00	0,00	1.344.064,09	6.628,81	0,50%	-11,06%
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	3.355.310,94	0,00	0,00	3.347.306,58	-8.004,36	-0,24%	-
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	3.680.036,18	0,00	0,00	3.665.579,82	-14.456,36	-0,39%	-
Total Renda Variável					1.333.864,32	4,10%	