Relatório Analítico dos Investimentos em dezembro, 4º Trimestre e ano de 2017

SIRU

Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

Carteira consolidada de investimentos - base (dezembro / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	32.369.994,42	6,28%	223	1,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	61.770.828,25	11,98%	677	1,31%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	28.390.141,86	5,50%	27	5,75%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	19.000.289,51	3,68%	13	14,61%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	58.066.912,77	11,26%	588	1,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	634.052,14	0,12%	193	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	27.076.287,67	5,25%	198	2,96%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	56.865.010,73	11,02%	703	0,85%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	6.095.734,64	1,18%	94	1,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	6.710.843,96	1,30%	1.412	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	59.884.388,06	11,61%	189	4,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	98.618.406,32	19,12%	102	6,78%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	11.949.369,80	2,32%	757	0,28%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	7.689.608,77	1,49%	40	2,64%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TRENDBANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	Não se aplica	Não se aplica	16.017,82	0,00%	1	0,83%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	90.050,78	0,02%	47	0,37%	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	7.370.150,38	1,43%	60	1,72%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	5.596.771,90	1,09%	3.209	2,08%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	6.016.098,55	1,17%	850	0,66%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	7.313.462,40	1,42%	2.201	6,96%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	4.376.522,72	0,85%	9.642	0,46%	Artigo 8º, Inciso III
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	Não se aplica	Não se aplica	3.477.429,39	0,67%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "

SIRU - TECNOLOGIA DE INFORMAÇÃO
Rua Quinze de Novembro 204 - 1º Andar Centro - Santos -SP - Telefone: (13) 3878-8410

Carteira consolidada de investimentos - base (dezembro / 2017)

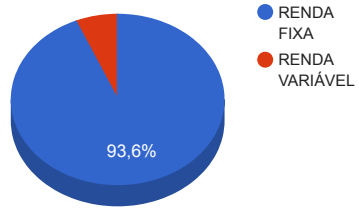
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	2.895.192,14	0,56%	33	1,09%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se aplica	Não se aplica	1.336.041,82	0,26%		3,21%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	S/Info	Não se aplica	2.197.890,59	0,43%		3,43%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
		TOTAL -	**515.807.497,39**				

SIRU - TECNOLOGIA DE INFORMAÇÃO
Rua Quinze de Novembro 204 - 1º Andar Centro - Santos -SP - Telefone: (13) 3878-8410

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

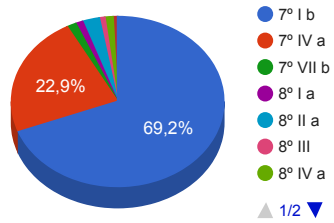
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira $	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	356.864.484,01	69,19%	10,00%	64,49%	100,00%	158.943.013,38
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	15,00%	80,00%	412.645.997,91
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	118.257.384,89	22,93%	5,00%	14,00%	30,00%	36.484.864,33
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	106.068,60	0,02%	0,00%	0,01%	5,00%	25.684.306,27
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	7.370.150,38	1,43%	0,00%	0,00%	5,00%	18.420.224,49
Total Renda Fixa	100,00%	482.598.087,88	93,56%	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 I, Alínea " a "	30,00%	5.596.771,90	1,09%	0,00%	0,00%	0,00%	-5.596.771,90
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	13.329.560,95	2,58%	0,00%	0,00%	0,00%	-13.329.560,95
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	4.376.522,72	0,85%	2,00%	4,00%	15,00%	72.994.601,89
Artigo 8º, Inciso IV	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	25.790.374,87
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	6.372.621,53	1,24%	0,00%	0,00%	0,00%	-6.372.621,53
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	3.533.932,41	0,69%	0,00%	0,00%	0,00%	-3.533.932,41
Artigo 8º, Inciso V	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	25.790.374,87
Artigo 8º, Inciso VI	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,05%	5,00%	25.790.374,87
Total Renda Variável	30,00%	33.209.409,51	6,44%	2,00	6,05	80,00	-

Distribuição por Artigo / Resolução



SIRU - TECNOLOGIA DE INFORMAÇÃO
Rua Quinze de Novembro 204 - 1º Andar Centro - Santos -SP - Telefone: (13) 3878-8410

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: dezembro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira ($)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	50,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	356.864.484,01	69,19%	10,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	80,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	80,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	118.257.384,89	22,93%	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 "	106.068,60	0,02%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	7.370.150,38	1,43%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	482.598.087,88	93,56%	15,00	380,00

Artigos - Renda Variável	Base: dezembro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira ($)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I	0,00	0,00%	0,00%	30,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	5.596.771,90	1,09%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	13.329.560,95	2,58%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso III	4.376.522,72	0,85%	2,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	6.372.621,53	1,24%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	3.533.932,41	0,69%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso V	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Total Renda Variável	33.209.409,51	6,44%	2,00	80,00

SIRU - TECNOLOGIA DE INFORMAÇÃO
Rua Quinze de Novembro 204 - 1º Andar Centro - Santos -SP - Telefone: (13) 3878-8410

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (dezembro / 2017)

Artigo 14º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR)

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	188.503.296,74	36,55%	0,05%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	145.887.047,98	28,28%	0,01%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	112.324.113,64	21,78%	0,01%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	28.390.141,86	5,50%	0,01%
WESTERN ASSET	23.376.812,23	4,53%	0,05%
GERAÇÃO FUTURO	7.313.462,40	1,42%	0,05%
PÁTRIA INVESTIMENTOS	3.477.429,39	0,67%	0,23%
Brasil Plural	2.895.192,14	0,56%	0,55%
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	2.197.890,59	0,43%	1,32%
AQ3 ASSET MANAGEMENT	1.336.041,82	0,26%	1,00%
VILA RICA CAPITAL	90.050,78	0,02%	0,08%
BRASIL PLURAL	16.017,82	0,00%	0,00%

SIRU - TECNOLOGIA DE INFORMAÇÃO
Rua Quinze de Novembro 204 - 1º Andar Centro - Santos -SP - Telefone: (13) 3878-8410

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M 1+	1,46%	16,67%	1,30%	7,07%	16,67%	51,25%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,38%	16,15%	1,09%	6,75%	16,15%	50,47%	0,20%	1,101%	5,97%
IRF-M	1,24%	15,20%	1,44%	6,42%	15,20%	42,12%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,22%	14,91%	1,37%	6,31%	14,91%	41,58%	0,20%	0,842%	4,57%
IDKA IPCA 2 Anos	1,16%	13,61%	2,24%	6,80%	13,61%	30,90%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,35%	10,19%	1,57%	4,46%	10,19%	24,79%	0,20%	0,130%	1,72%
IMA-B 5	0,88%	12,58%	1,48%	6,74%	12,58%	30,01%	-	-	-
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	1,17%	14,12%	1,13%	7,12%	14,12%	34,98%	0,40%	0,983%	5,00%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,87%	12,38%	1,42%	6,63%	12,38%	29,45%	0,20%	0,671%	3,50%
IMA-B	0,83%	12,79%	-0,32%	6,96%	12,79%	40,78%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,90%	13,60%	0,68%	7,17%	13,60%	37,37%	0,20%	1,029%	5,71%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	0,85%	12,96%	-0,39%	7,01%	12,96%	40,80%	0,20%	1,450%	9,38%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,81%	12,52%	-0,38%	6,80%	12,52%	40,11%	0,20%	1,420%	9,25%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,35%	4,26%	1,58%	1,65%	4,26%	13,21%	0,20%	0,131%	4,33%
CDI + 3,50% ao ano	0,81%	13,73%	2,61%	5,84%	13,73%	34,17%	-	-	-
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	38,62%	2,25%	28,17%	-5,76%	2,25%	-73,00%	0,39%	72,989%	50,92%
IMA-B 5+	0,79%	12,75%	-1,63%	6,87%	12,75%	47,75%	-	-	-

SIRU - TECNOLOGIA DE INFORMAÇÃO
Rua Quinze de Novembro 204 - 1º Andar Centro - Santos -SP - Telefone: (13) 3878-8410

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	0,77%	12,39%	-1,71%	6,66%	12,39%	46,61%	0,20%	2,062%	12,26%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,75%	12,44%	-1,70%	6,68%	12,44%	46,79%	0,20%	2,064%	11,96%
110% do CDI	0,59%	10,97%	1,94%	4,46%	10,97%	28,17%	-	-	-
TRENDBANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	-11,08%	-36,95%	-17,49%	-24,42%	-36,95%	-48,94%	0,00%	0,502%	-
IRF-M 1	0,57%	11,12%	1,82%	4,59%	11,12%	27,47%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,57%	10,93%	1,79%	4,51%	10,93%	27,11%	0,20%	0,031%	0,67%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,57%	11,05%	1,79%	4,51%	11,05%	27,27%	0,00%	0,031%	0,67%
CDI	0,54%	9,93%	1,76%	4,05%	9,93%	25,31%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,58%	10,08%	1,83%	4,14%	10,08%	25,36%	0,20%	0,068%	0,13%
IPCA	0,44%	2,95%	1,14%	1,74%	2,95%	9,42%	-	-	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1,02%	14,91%	1,62%	7,34%	14,91%	37,87%	0,20%	0,634%	4,22%

SIRU - TECNOLOGIA DE INFORMAÇÃO
Rua Quinze de Novembro 204 - 1º Andar Centro - Santos -SP - Telefone: (13) 3878-8410

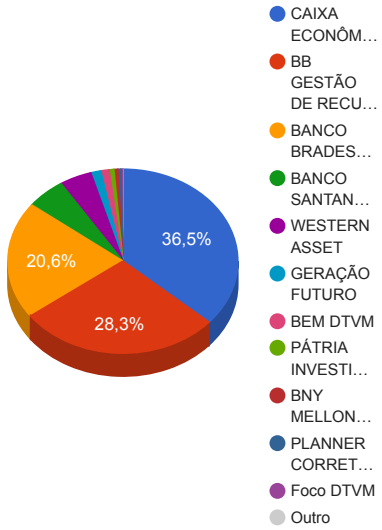
Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (dezembro / 2017)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
SMLL	7,03%	49,36%	2,89%	25,25%	49,36%	96,78%	-	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	7,19%	49,07%	3,11%	26,28%	49,07%	78,82%	1,50%	5,291%	18,53%
IDIV	4,94%	25,30%	-1,77%	16,88%	25,30%	101,09%	-	-	-
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	5,77%	30,88%	2,20%	17,68%	30,88%	73,36%	1,50%	6,182%	18,35%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	1,78%	-0,58%	-3,40%	1,69%	-0,58%	-2,21%	3,00%	7,371%	17,02%
S&P 500	0,98%	19,42%	6,12%	10,32%	19,42%	30,81%	-	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	1,71%	29,44%	7,96%	14,28%	29,44%	58,93%	1,00%	2,919%	6,33%
IFIX	0,60%	19,41%	0,24%	7,34%	19,41%	58,02%	-	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	0,00%	-15,86%	-5,40%	-15,86%	-15,86%	-	1,50%	0,000%	17,91%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	-	-100,00%	-	-	-100,00%	-	0,14%	-	-
IPCA	0,44%	2,95%	1,14%	1,74%	2,95%	9,42%	-	-	-
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	-	-	-	-	-	-	1,00%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTIESTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,50%	34,924%	20,84%

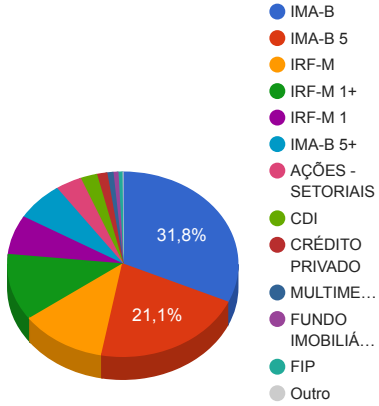
SIRU - TECNOLOGIA DE INFORMAÇÃO
Rua Quinze de Novembro 204 - 1º Andar Centro - Santos -SP - Telefone: (13) 3878-8410

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	188.503.296,74	36,55%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	145.887.047,98	28,28%
BANCO BRADESCO	106.308.015,09	20,61%
BANCO SANTANDER	28.390.141,86	5,50%
WESTERN ASSET	23.376.812,23	4,53%
GERAÇÃO FUTURO	7.313.462,40	1,42%
BEM DTVM	6.016.098,55	1,17%
PÁTRIA INVESTIMENTOS	3.477.429,39	0,67%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	2.895.192,14	0,56%
PLANNER CORRETORA	2.197.890,59	0,43%
Foco DTVM	1.336.041,82	0,26%
BRL Trust Investimentos	90.050,78	0,02%
GRADUAL INVESTIMENTOS	16.017,82	0,00%



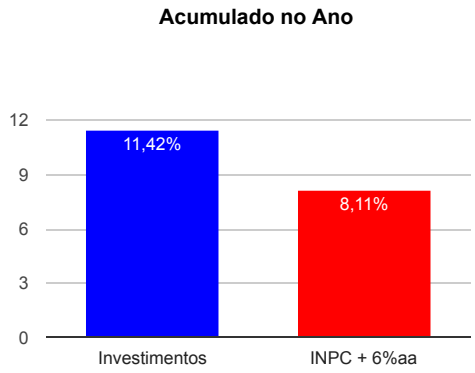
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	162.781.053,73	31,56%
IMA-B 5	108.235.294,66	20,98%
IRF-M	61.770.828,25	11,98%
IRF-M 1+	59.884.388,06	11,61%
IRF-M 1	35.100.985,82	6,81%
IMA-B 5+	34.765.896,44	6,74%
AÇÕES - SETORIAIS	18.926.332,85	3,67%
CDI	11.949.369,80	2,32%
CRÉDITO PRIVADO	7.370.150,38	1,43%
MULTIMERCADO	4.376.522,72	0,85%
FUNDO IMOBILIÁRIO	3.533.932,41	0,69%
FIP	2.895.192,14	0,56%
IDKA IPCA 2A	634.052,14	0,12%
FIDC - FECHADO	106.068,60	0,02%

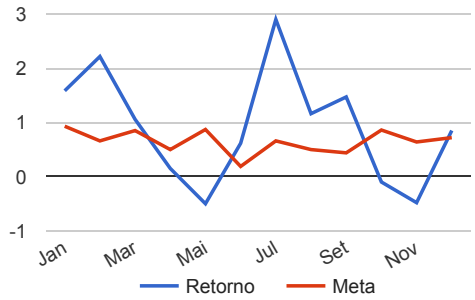


SIRU - TECNOLOGIA DE INFORMAÇÃO
Rua Quinze de Novembro 204 - 1º Andar Centro - Santos -SP - Telefone: (13) 3878-8410

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%
Maio	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%
Outubro	499.200.366,29	19.045.570,21	15.247.961,70	502.511.650,75	-486.324,05	-0,10%	0,86%	-11,26%	1,65%
Novembro	502.511.650,75	13.813.639,19	10.487.794,09	503.423.915,97	-2.413.579,88	-0,48%	0,64%	-74,55%	1,93%
Dezembro	503.423.915,97	33.614.274,79	25.580.924,45	515.807.497,39	4.350.231,08	0,85%	0,72%	117,36%	1,43%
Acumulado no ano					50.910.531,29	11,42%	8,11%	140,85%	





SIRU - TECNOLOGIA DE INFORMAÇÃO
Rua Quinze de Novembro 204 - 1º Andar Centro - Santos -SP - Telefone: (13) 3878-8410

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	64.960,25	0,00	2.871,18	90.050,78	27.961,71	43,04%	72,99%	38,62%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	59.066.517,60	0,00	0,00	59.884.388,06	817.870,46	1,38%	1,10%	1,38%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	61.024.584,51	0,00	0,00	61.770.828,25	746.243,74	1,22%	0,84%	1,22%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	18.780.731,52	0,00	0,00	19.000.289,51	219.557,99	1,17%	0,98%	1,17%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	7.295.557,22	0,00	0,00	7.370.150,38	74.593,16	1,02%	0,63%	1,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.041.357,22	0,00	0,00	6.095.734,64	54.377,42	0,90%	1,03%	0,90%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	56.375.217,28	0,00	0,00	56.865.010,73	489.793,45	0,87%	0,67%	0,87%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	97.791.605,05	0,00	0,00	98.618.406,32	826.801,27	0,85%	1,45%	0,85%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	57.601.152,18	0,00	0,00	58.066.912,77	465.760,59	0,81%	1,42%	0,81%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	34.384.502,13	0,00	7.500.000,00	27.076.287,67	191.785,54	0,56%	2,06%	0,75%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.714.323,13	7.357.611,30	6.200.556,06	11.949.369,80	77.991,43	0,43%	0,07%	0,58%
WESTERN ASSET ATIVO FI RENDA FIXA	4.360.652,05	0,00	4.377.497,21	0,00	16.845,16	0,39%	0,27%	0,74%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	13.117.121,38	15.170.045,74	0,00	28.390.141,86	102.974,74	0,36%	0,03%	0,57%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	631.833,14	0,00	0,00	634.052,14	2.219,00	0,35%	0,13%	0,35%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	32.256.800,58	0,00	0,00	32.369.994,42	113.193,84	0,35%	0,13%	0,35%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	15.153.806,67	0,00	7.500.000,00	7.689.608,77	35.802,10	0,24%	2,06%	0,77%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	6.709.120,54	0,00	6.710.843,96	1.723,42	0,03%	0,03%	0,57%
TRENDBANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	16.664,61	0,00	0,00	16.017,82	-646,79	-3,88%	0,50%	-3,84%
			Total Renda Fixa		4.264.848,23	0,89%	1,03%	

SIRU - TECNOLOGIA DE INFORMAÇÃO
Rua Quinze de Novembro 204 - 1º Andar Centro - Santos -SP - Telefone: (13) 3878-8410

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	5.221.420,93	0,00	0,00	5.596.771,90	375.350,97	7,19%	5,29%	7,19%
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	5.687.743,32	0,00	0,00	6.016.098,55	328.355,23	5,77%	6,18%	5,77%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	7.185.557,99	0,00	0,00	7.313.462,40	127.904,41	1,78%	7,37%	1,78%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	2.187.160,83	0,00	0,00	2.197.890,59	10.729,76	0,49%	-	0,00%
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	3.469.610,38	0,00	0,00	3.477.429,39	7.819,01	0,23%	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	0,00	4.377.497,21	0,00	4.376.522,72	-974,49	-0,02%	2,92%	1,71%
ÁQUILLA FII - AQLL11	1.338.715,86	0,00	0,00	1.336.041,82	-2.674,04	-0,20%	0,00%	0,00%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTIESTRATÉGIA FIP	3.656.320,14	0,00	0,00	2.895.192,14	-761.128,00	-20,82%	34,92%	-20,82%
			Total Renda Variável		85.382,85	0,26%	8,52%	

SIRU - TECNOLOGIA DE INFORMAÇÃO
Rua Quinze de Novembro 204 - 1º Andar Centro - Santos -SP - Telefone: (13) 3878-8410

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre / 2017

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	60.936.822,24	0,00	0,00	61.770.828,25	834.006,01	1,37%	1,37%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	57.872.172,02	180.852,05	2.000.000,00	56.865.010,73	811.986,66	1,43%	1,42%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	59.236.980,62	0,00	0,00	59.884.388,06	647.407,44	1,09%	1,09%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	31.867.471,43	0,00	0,00	32.369.994,42	502.522,99	1,58%	1,58%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.959.551,65	15.170.045,74	0,00	28.390.141,86	260.544,47	1,58%	1,79%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12.923.124,05	21.172.042,41	22.369.504,99	11.949.369,80	223.708,33	1,37%	1,83%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	18.787.468,15	0,00	0,00	19.000.289,51	212.821,36	1,13%	1,13%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	7.252.788,73	0,00	0,00	7.370.150,38	117.361,65	1,62%	1,62%
WESTERN ASSET ATIVO FI RENDA FIXA	4.325.338,64	0,00	4.377.497,21	0,00	52.158,57	1,21%	1,57%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.054.405,29	0,00	0,00	6.095.734,64	41.329,35	0,68%	0,68%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	70.260,50	0,00	8.194,82	90.050,78	27.985,10	43,10%	28,17%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	624.233,54	0,00	0,00	634.052,14	9.818,60	1,57%	1,57%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	6.709.120,54	0,00	6.710.843,96	1.723,42	0,03%	1,79%
TRENDBANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	17.957,37	0,00	0,00	16.017,82	-1.939,55	-10,80%	-17,49%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	58.285.798,14	0,00	0,00	58.066.912,77	-218.885,37	-0,38%	-0,38%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	15.536.008,62	0,00	7.500.000,00	7.689.608,77	-346.399,85	-2,23%	-1,71%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	99.004.841,29	0,00	0,00	98.618.406,32	-386.434,97	-0,39%	-0,39%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	27.972.954,40	7.250.737,74	7.500.000,00	27.076.287,67	-647.404,47	-1,84%	-1,70%
			Total Renda Fixa		2.142.309,74	0,44%	

SIRU - TECNOLOGIA DE INFORMAÇÃO
Rua Quinze de Novembro 204 - 1º Andar Centro - Santos -SP - Telefone: (13) 3878-8410

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre / 2017

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	Instituição (%)
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	3.458.476,25	0,00	3.561.483,22	0,00	103.006,97	2,98%	-3,96%
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	3.347.306,58	51.705,28	0,00	3.477.429,39	78.417,53	2,31%	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	0,00	5.561.483,22	0,00	5.596.771,90	35.288,68	0,63%	3,11%
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	0,00	6.000.000,00	0,00	6.016.098,55	16.098,55	0,27%	2,20%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	0,00	4.377.497,21	0,00	4.376.522,72	-974,49	-0,02%	7,96%
ÁQUILLA FII - AQLL11	1.344.064,09	0,00	0,00	1.336.041,82	-8.022,27	-0,60%	-5,40%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	2.206.998,84	0,00	0,00	2.197.890,59	-9.108,25	-0,41%	-
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	11.449.764,03	0,00	4.000.000,00	7.313.462,40	-136.301,63	-2,43%	-3,40%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTIESTRATÉGIA FIP	3.665.579,82	0,00	0,00	2.895.192,14	-770.387,68	-21,02%	-
			Total Renda Variável		-691.982,59	-2,38%	

SIRU - TECNOLOGIA DE INFORMAÇÃO
Rua Quinze de Novembro 204 - 1º Andar Centro - Santos -SP - Telefone: (13) 3878-8410

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no Ano de 2017

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	50.481.923,74	39.967.119,47	0,00	98.618.406,32	8.169.363,11	12,18%	12,96%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	40.384.116,11	14.000.000,00	0,00	61.770.828,25	7.386.712,14	14,63%	14,91%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	52.105.479,75	18.961.954,69	20.000.000,00	56.865.010,73	5.797.576,29	11,95%	12,38%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	37.188.757,46	15.174.751,13	0,00	58.066.912,77	5.703.404,18	11,80%	12,52%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	54.937.672,96	20.708,19	59.884.388,06	4.967.423,29	10,04%	16,15%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	31.046.008,31	0,00	1.753.713,21	32.369.994,42	3.077.699,32	10,20%	4,26%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	42.816.814,34	21.174.390,28	55.076.047,11	11.949.369,80	3.034.212,29	9,41%	10,08%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	24.050.538,82	21.965.674,20	21.794.854,84	27.076.287,67	2.854.929,49	11,94%	12,44%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	69.812.218,17	423.183,08	72.167.792,83	0,00	1.932.391,58	7,82%	10,35%
SANTANDER IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	19.867.576,30	0,00	21.737.150,71	0,00	1.869.574,41	9,59%	12,38%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	10.062.887,78	7.313.174,91	0,00	19.000.289,51	1.624.226,82	13,79%	14,12%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	0,00	14.042.590,96	7.500.000,00	7.689.608,77	1.147.017,81	8,52%	12,39%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.662.484,12	0,00	316.234,10	6.095.734,64	749.484,62	13,55%	13,60%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,00	6.777.585,18	0,00	7.370.150,38	592.565,20	8,74%	14,91%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	16.885.179,02	0,00	17.333.127,39	0,00	447.948,37	3,02%	12,40%
WESTERN ASSET ATIVO FI RENDA FIXA	0,00	4.000.000,00	4.377.497,21	0,00	377.497,21	9,44%	10,91%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	28.109.719,94	0,00	28.390.141,86	280.421,92	1,74%	11,05%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	608.919,08	0,00	34.987,29	634.052,14	60.120,35	10,16%	10,19%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	88.067,22	0,00	50.443,84	90.050,78	52.427,40	89,39%	2,25%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	6.709.120,54	0,00	6.710.843,96	1.723,42	0,03%	10,93%
TRENDBANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	23.502,81	0,00	0,00	16.017,82	-7.484,99	-31,85%	-36,95%
			Total Renda Fixa		50.119.234,23	12,16%	

SIRU - TECNOLOGIA DE INFORMAÇÃO
Rua Quinze de Novembro 204 - 1º Andar Centro - Santos -SP - Telefone: (13) 3878-8410

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no Ano de 2017

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	Instituição (%)
SANTANDER SELEÇÃO MAX FIC AÇÕES	1.784.258,49	0,00	2.206.242,14	0,00	421.983,65	23,65%	39,81%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	6.910.572,25	0,00	7.313.174,91	0,00	402.602,66	5,83%	8,66%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	3.215.466,39	0,00	3.561.483,22	0,00	346.016,83	10,76%	3,29%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	13.087.458,15	0,00	6.000.000,00	7.313.462,40	226.004,25	0,28%	-0,58%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	2.042.301,77	0,00	0,00	2.197.890,59	155.588,82	7,62%	-
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	3.360.165,48	68.277,74	0,00	3.477.429,39	48.986,17	1,42%	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	0,00	5.561.483,22	0,00	5.596.771,90	35.288,68	0,63%	49,07%
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	0,00	6.000.000,00	0,00	6.016.098,55	16.098,55	0,27%	30,88%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	0,00	4.377.497,21	0,00	4.376.522,72	-974,49	-0,02%	29,44%
ÁQUILLA FII - AQLL11	1.383.337,92	0,00	0,00	1.336.041,82	-47.296,10	-3,42%	-15,86%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTIESTRATÉGIA FIP	3.708.194,10	0,00	0,00	2.895.192,14	-813.001,96	-21,92%	-
			Total Renda Variável		791.297,06	2,05%	

SIRU - TECNOLOGIA DE INFORMAÇÃO
Rua Quinze de Novembro 204 - 1º Andar Centro - Santos -SP - Telefone: (13) 3878-8410