

Relatório Analítico dos Investimentos em janeiro de 2018

SIRU 

Carteira consolidada de investimentos - base (janeiro / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	60.876.306,91	11,65%	203	4,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	32.708.374,31	6,26%	223	1,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	62.565.841,18	11,97%	685	1,32%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	18.528.342,65	3,54%	25	3,87%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	19.303.653,30	3,69%	15	12,48%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	60.032.128,09	11,48%	590	1,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	640.629,92	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	28.861.300,85	5,52%	197	3,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	57.608.378,90	11,02%	707	0,85%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	6.217.446,32	1,19%	94	1,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.404.532,37	0,27%	1.418	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	8.064.669,88	1,54%	36	3,45%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	101.956.827,05	19,50%	101	7,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	11.374.406,08	2,18%	756	0,28%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	Não se aplica	Não se aplica	15.411,92	0,00%	1	0,83%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	121.571,33	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	7.470.247,01	1,43%	60	1,72%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	5.852.579,68	1,12%	3.983	1,80%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	9.912.744,04	1,90%	361	6,95%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BRADERCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	6.697.120,90	1,28%	923	0,58%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	8.014.991,50	1,53%	2.137	8,75%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	4.612.118,75	0,88%	13.704	0,34%	Artigo 8º, Inciso III

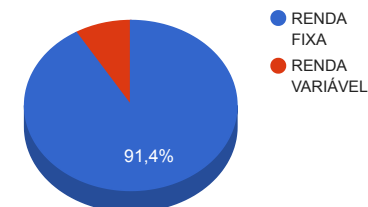
Carteira consolidada de investimentos - base (janeiro / 2018)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	Não se aplica	Não se aplica	3.474.239,84	0,66%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	2.891.171,92	0,55%	33	1,09%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se aplica	Não se aplica	1.343.561,27	0,26%		3,23%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	S/Info	Não se aplica	2.214.930,22	0,42%		3,41%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
		TOTAL -	522.763.526,19				

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

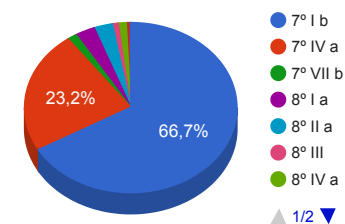
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	348.746.934,80	66,71%	0,00%	69,49%	100,00%	174.016.591,39
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	23,00%	60,00%	313.658.115,71
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	121.395.903,01	23,22%	0,00%	1,00%	40,00%	87.709.507,47
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	136.983,25	0,03%	0,00%	0,01%	5,00%	26.001.193,06
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	7.470.247,01	1,43%	0,00%	1,00%	5,00%	18.667.929,30
Desenquadrado - RF	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	26.138.176,31
Em Enquadramento - RF	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	26.138.176,31
Total Renda Fixa	100,00%	477.750.068,07	91,39%	4,00	104,50	530,00	-

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%	15.765.323,72	3,02%	0,00%	0,00%	30,00%	141.063.734,14
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	14.712.112,40	2,81%	0,00%	3,00%	20,00%	89.840.592,84
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	4.612.118,75	0,88%	0,00%	1,00%	10,00%	47.664.233,87
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	6.365.411,76	1,22%	0,00%	1,00%	5,00%	19.772.764,55
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	3.558.491,49	0,68%	0,00%	0,05%	5,00%	22.579.684,82
Desenquadrado - RV	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	26.138.176,31
Em Enquadramento - RV	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	26.138.176,31
Total Renda Variável	30,00%	45.013.458,12	8,61%	4,00	15,05	130,00	-

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: janeiro / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	50,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	348.746.934,80	66,71%	0,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	100,00%
Artigo 7º, Inciso II	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	121.395.903,01	23,22%	0,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	40,00%
Artigo 7º, Inciso V, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	136.983,25	0,03%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	7.470.247,01	1,43%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Desenquadrado - RF	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Em Enquadramento - RF	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Total Renda Fixa	477.750.068,07	91,39%	4,00	530,00

Artigos - Renda Variável	Base: janeiro / 2018		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	15.765.323,72	3,02%	0,00%	30,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	30,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	14.712.112,40	2,81%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	20,00%
Artigo 8º, Inciso III	4.612.118,75	0,88%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	6.365.411,76	1,22%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	3.558.491,49	0,68%	0,00%	5,00%
Desenquadrado - RV	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Em Enquadramento - RV	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Total Renda Variável	45.013.458,12	8,61%	4,00	130,00

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

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

Gestão	Valor	% s/ Carteira	% s/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	187.311.473,02	35,83%	0,05%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	148.300.698,60	28,37%	0,01%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	116.718.617,83	22,33%	0,01%
WESTERN ASSET	33.828.516,09	6,47%	0,07%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	18.528.342,65	3,54%	0,00%
GERAÇÃO FUTURO	8.014.991,50	1,53%	0,05%
PÁTRIA INVESTIMENTOS	3.474.239,84	0,66%	0,20%
BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUTURADOS LTDA	2.906.583,84	0,56%	0,02%
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	2.214.930,22	0,42%	1,33%
AQ3 ASSET MANAGEMENT	1.343.561,27	0,26%	1,00%
VILA RICA CAPITAL	121.571,33	0,02%	0,13%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5+	4,95%	4,95%	4,29%	7,16%	15,74%	53,21%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4,91%	4,91%	4,20%	6,98%	15,45%	52,37%	0,20%	2,748%	11,80%
BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	4,88%	4,88%	4,18%	6,92%	15,24%	52,07%	0,20%	2,759%	12,08%
IMA-B	3,40%	3,40%	3,46%	6,35%	14,49%	42,84%	-	-	-
BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	3,39%	3,39%	3,41%	6,32%	14,58%	43,05%	0,20%	1,833%	9,23%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,38%	3,38%	3,41%	6,22%	14,22%	42,25%	0,20%	1,803%	9,10%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,00%	2,00%	2,56%	5,56%	14,27%	36,80%	0,20%	1,025%	5,53%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,05%	1,05%	1,61%	1,04%	4,30%	10,82%	0,20%	0,350%	4,31%
IRF-M 1+	1,55%	1,55%	2,94%	5,81%	15,40%	47,98%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,66%	1,66%	2,98%	5,59%	14,97%	47,80%	0,20%	1,178%	5,89%
IMA-B 5	1,33%	1,33%	2,33%	5,17%	12,77%	27,94%	-	-	-
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	1,60%	1,60%	2,54%	5,19%	14,21%	31,76%	0,40%	0,954%	4,89%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,31%	1,31%	2,28%	5,06%	12,57%	27,44%	0,20%	0,609%	3,43%
IRF-M	1,30%	1,30%	2,65%	5,38%	14,09%	40,05%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,29%	1,29%	2,59%	5,25%	13,78%	39,58%	0,20%	0,887%	4,50%
CDI + 3,50% ao ano	0,89%	0,89%	2,56%	5,63%	13,16%	33,58%	-	-	-
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	35,00%	35,00%	79,01%	62,17%	39,00%	-62,96%	0,39%	172,306%	117,90%

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

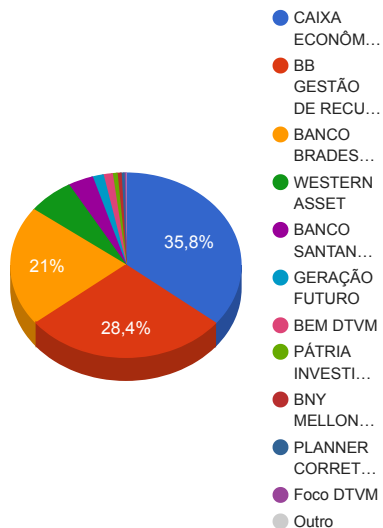
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDKA IPCA 2 Anos	0,77%	0,77%	2,20%	4,96%	13,25%	27,12%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,04%	1,04%	1,61%	3,84%	10,22%	23,85%	0,20%	0,345%	1,66%
110% do CDI	0,64%	0,64%	1,87%	4,22%	10,37%	27,52%	-	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	-3,74%	-3,74%	-17,59%	-24,38%	-38,34%	-48,97%	0,00%	0,430%	-
IRF-M 1	0,59%	0,59%	1,79%	4,11%	10,35%	26,16%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,57%	0,57%	1,74%	4,02%	10,18%	25,79%	0,20%	0,097%	0,65%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,57%	0,57%	1,73%	4,01%	10,29%	25,95%	0,00%	0,098%	0,65%
CDI	0,58%	0,58%	1,70%	3,83%	9,38%	24,73%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,57%	0,57%	1,73%	3,90%	9,51%	24,76%	0,20%	0,021%	0,13%
IPCA	0,29%	0,29%	1,01%	1,79%	2,86%	8,36%	-	-	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1,36%	1,36%	2,55%	5,72%	14,87%	36,01%	0,20%	0,635%	4,08%

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

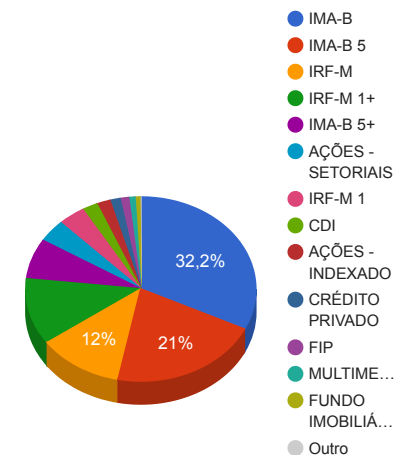
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDIV	9,88%	9,88%	7,63%	22,52%	26,79%	144,24%	-	-	-
BRASESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	11,32%	11,32%	14,19%	24,94%	31,94%	101,44%	1,50%	8,106%	18,32%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	9,59%	9,59%	5,72%	9,39%	3,93%	13,79%	3,00%	7,159%	16,95%
S&P 500	5,62%	5,62%	9,65%	14,31%	23,91%	45,54%	-	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	5,38%	5,38%	10,74%	17,37%	33,69%	78,17%	1,00%	4,064%	6,53%
SMLL	4,34%	4,34%	8,96%	20,84%	39,86%	124,46%	-	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	4,57%	4,57%	9,21%	22,44%	40,68%	97,70%	1,50%	6,814%	18,12%
IFIX	2,64%	2,64%	2,65%	10,60%	18,12%	72,74%	-	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	-0,00%	-0,00%	-0,00%	-22,73%	-15,86%	-43,33%	1,50%	0,004%	17,91%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	-	-	-	-	-	0,00%	0,14%	-	-
Global BDRX	1,64%	1,64%	8,25%	18,20%	29,64%	19,87%	-	-	-
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1,36%	1,36%	7,32%	16,80%	27,18%	15,69%	1,50%	6,232%	-
IPCA	0,29%	0,29%	1,01%	1,79%	2,86%	8,36%	-	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTIESTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	0,30%	0,006%	20,84%
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	-	-	-	-	-	-	1,00%	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	187.311.473,02	35,83%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	148.300.698,60	28,37%
BANCO BRADESCO	110.021.496,93	21,05%
WESTERN ASSET	33.828.516,09	6,47%
BANCO SANTANDER	18.528.342,65	3,54%
GERAÇÃO FUTURO	8.014.991,50	1,53%
BEM DTVM	6.697.120,90	1,28%
PÁTRIA INVESTIMENTOS	3.474.239,84	0,66%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	2.891.171,92	0,55%
PLANNER CORRETORA	2.214.930,22	0,42%
Foco DTVM	1.343.561,27	0,26%
BRL Trust Investimentos	121.571,33	0,02%
Brasil Plural	15.411,92	0,00%



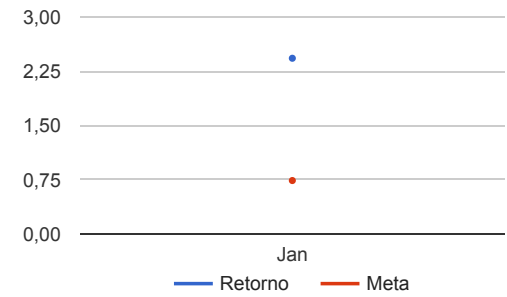
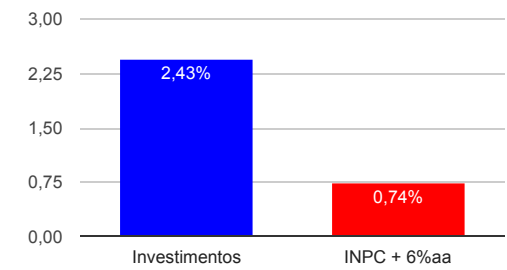
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	168.206.401,46	32,18%
IMA-B 5	109.620.406,51	20,97%
IRF-M	62.565.841,18	11,97%
IRF-M 1+	60.876.306,91	11,65%
IMA-B 5+	36.925.970,73	7,06%
AÇÕES - SETORIAIS	20.564.692,08	3,93%
IRF-M 1	19.932.875,02	3,81%
CDI	11.374.406,08	2,18%
AÇÕES - INDEXADO	9.912.744,04	1,90%
CRÉDITO PRIVADO	7.470.247,01	1,43%
FIP	6.365.411,76	1,22%
MULTIMERCADO	4.612.118,75	0,88%
FUNDO IMOBILIÁRIO	3.558.491,49	0,68%
IDKA IPCA 2A	640.629,92	0,12%
FIDC - FECHADO	136.983,25	0,03%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2018

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	515.807.497,39	10.444.075,18	16.011.182,45	522.763.526,19	12.523.136,07	2,43%	0,74%	327,57%	1,65%
Acumulado no ano					12.523.136,07	2,43%	0,74%	327,57%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	90.050,78	0,00	29.728,67	121.571,33	61.249,22	68,02%	172,31%	35,00%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	7.689.608,77	0,00	0,00	8.064.669,88	375.061,11	4,88%	2,76%	4,88%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	27.076.287,67	444.075,18	0,00	28.861.300,85	1.340.938,00	4,87%	2,75%	4,91%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	98.618.406,32	0,00	0,00	101.956.827,05	3.338.420,73	3,39%	1,83%	3,39%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	58.066.912,77	0,00	0,00	60.032.128,09	1.965.215,32	3,38%	1,80%	3,38%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.095.734,64	0,00	0,00	6.217.446,32	121.711,68	2,00%	1,03%	2,00%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	59.884.388,06	0,00	0,00	60.876.306,91	991.918,85	1,66%	1,18%	1,66%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	19.000.289,51	0,00	0,00	19.303.653,30	303.363,79	1,60%	0,95%	1,60%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	7.370.150,38	0,00	0,00	7.470.247,01	100.096,63	1,36%	0,63%	1,36%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	56.865.010,73	0,00	0,00	57.608.378,90	743.368,17	1,31%	0,61%	1,31%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	61.770.828,25	0,00	0,00	62.565.841,18	795.012,93	1,29%	0,89%	1,29%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	32.369.994,42	0,00	0,00	32.708.374,31	338.379,89	1,05%	0,35%	1,05%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	634.052,14	0,00	0,00	640.629,92	6.577,78	1,04%	0,34%	1,04%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	11.949.369,80	0,00	640.213,83	11.374.406,08	65.250,11	0,55%	0,02%	0,57%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.710.843,96	0,00	5.341.239,95	1.404.532,37	34.928,36	0,52%	0,10%	0,57%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	28.390.141,86	0,00	10.000.000,00	18.528.342,65	138.200,79	0,49%	0,10%	0,57%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	16.017,82	0,00	0,00	15.411,92	-605,90	-3,78%	0,43%	-3,73%
Total Renda Fixa					10.719.087,46	2,22%	1,30%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BRDESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	6.016.098,55	0,00	0,00	6.697.120,90	681.022,35	11,32%	8,11%	11,32%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	7.313.462,40	0,00	0,00	8.014.991,50	701.529,10	9,59%	7,16%	9,59%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	4.376.522,72	0,00	0,00	4.612.118,75	235.596,03	5,38%	4,06%	5,38%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	5.596.771,90	0,00	0,00	5.852.579,68	255.807,78	4,57%	6,81%	4,57%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	2.197.890,59	0,00	0,00	2.214.930,22	17.039,63	0,78%	-	0,78%
ÁQUILLA FII - AQLL11	1.336.041,82	0,00	0,00	1.343.561,27	7.519,45	0,56%	0,00%	-0,00%
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	3.477.429,39	0,00	0,00	3.474.239,84	-3.189,55	-0,09%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	2.895.192,14	0,00	0,00	2.891.171,92	-4.020,22	-0,14%	0,01%	-0,14%
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,00	10.000.000,00	0,00	9.912.744,04	-87.255,96	-0,87%	6,23%	1,36%
Total Renda Variável					1.804.048,61	4,18%	5,90%	