

# Relatório Analítico dos Investimentos em novembro de 2017

Carteira consolidada de investimentos - base (novembro / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BRDESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	D+1	16/05/2019	11.787.733,30	3,18%	11	15,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BGT PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA	D+0 ou D+1	Não há	12.493.231,00	3,37%	12	8,43%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	12.191.780,66	3,29%	602	0,24%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	31.189.916,88	8,42%	1.401	0,19%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	36.714.525,46	9,91%	713	0,56%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	24.278.127,73	6,55%	177	3,11%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	19.178.787,64	5,18%	12	16,95%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	2.403.900,53	0,65%	62	0,16%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	52.936.840,76	14,29%	763	1,19%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	18.660.281,36	5,04%	545	0,17%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	14.450.918,30	3,90%	95	3,67%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	18.328.550,27	4,95%	1.230	0,16%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	57.326.066,81	15,48%	104	3,95%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.605.842,94	0,43%	352	0,14%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+30 a D+2880	Não há	7.449.022,14	2,01%	60	1,75%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FI AÇÕES	D+24	Não há	7.423.976,12	2,00%	53	2,27%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	1.966.761,85	0,53%	3.253	0,53%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	23/08/2017	2.231.097,37	0,60%	114	0,61%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	8.046.554,84	2,17%	2.278	7,83%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	9.232.418,60	2,49%	7.578	1,27%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	D+5	Não há	9.168.682,82	2,48%	33	4,23%	Artigo 8º, Inciso III
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	Não se aplica	Não se aplica	4.136.442,41	1,12%			Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "

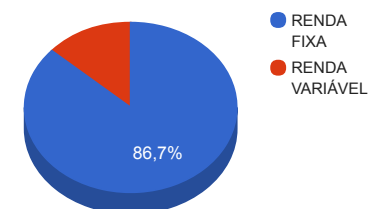
Carteira consolidada de investimentos - base (novembro / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	958.520,59	0,26%	19	1,02%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	Não se aplica	Não se aplica	1.435.079,04	0,39%		0,73%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	Não se aplica	Não se aplica	4.832.783,45	1,30%		0,20%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
		<b>TOTAL -</b>	<b>370.427.842,87</b>				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	0,00	0,00%	30,00%	35,00%	70,00%	259.299.490,01
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	10,00%	20,00%	60,00%	222.256.705,72
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	313.546.503,64	84,64%	5,00%	5,00%	30,00%	-202.418.150,78
Artigo 7º, Inciso VI	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	15,00%	55.564.176,43
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	18.521.392,14
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	7.449.022,14	2,01%	0,00%	2,50%	5,00%	11.072.370,00
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>320.995.525,78</b>	<b>86,66%</b>	<b>45,00</b>	<b>75,00</b>	<b>185,00</b>	<b>-</b>

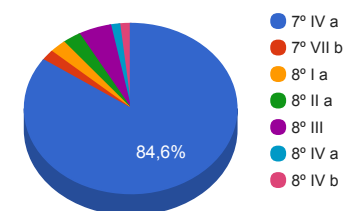
Distribuição por Segmento



 O Somatório dos incisos "a" e "b" do Artigo 7º IV não podem ultrapassar 40% (quarenta por cento).

Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	9.390.737,97	2,54%	0,00%	0,00%	0,00%	-9.390.737,97
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	10.277.652,21	2,77%	0,00%	0,00%	0,00%	-10.277.652,21
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	18.401.101,42	4,97%	2,00%	10,00%	12,00%	26.050.239,72
Artigo 8º, Inciso IV	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	18.521.392,14
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	5.094.963,00	1,38%	0,00%	0,00%	0,00%	-5.094.963,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	6.267.862,49	1,69%	0,00%	0,00%	0,00%	-6.267.862,49
Artigo 8º, Inciso V	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	18.521.392,14
Artigo 8º, Inciso VI	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	18.521.392,14
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>49.432.317,09</b>	<b>13,34%</b>	<b>4,00</b>	<b>25,00</b>	<b>32,00</b>	<b>-</b>

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: novembro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	0,00	0,00%	30,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	10,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	313.546.503,64	84,64%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	0,00	0,00%	0,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	7.449.022,14	2,01%	0,00%	5,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>320.995.525,78</b>	<b>86,66%</b>	<b>45,00</b>	<b>185,00</b>

Artigos - Renda Variável	Base: novembro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	9.390.737,97	2,54%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	10.277.652,21	2,77%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso III	18.401.101,42	4,97%	2,00%	12,00%
Artigo 8º, Inciso IV	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5.094.963,00	1,38%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	6.267.862,49	1,69%	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%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>49.432.317,09</b>	<b>13,34%</b>	<b>4,00</b>	<b>32,00</b>

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (novembro / 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
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	105.357.112,13	28,44%	0,01%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	87.774.081,47	23,70%	0,01%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	68.862.962,93	18,59%	0,02%
WESTERN ASSET	37.579.889,06	10,14%	0,07%
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEMENT	25.883.970,67	6,99%	0,01%
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSOS	12.493.231,00	3,37%	0,04%
ITAÚ UNIBANCO	9.827.876,65	2,65%	0,00%
GERAÇÃO FUTURO	8.046.554,84	2,17%	0,05%
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	4.832.783,45	1,30%	0,35%
PÁTRIA INVESTIMENTOS	4.136.442,41	1,12%	0,27%
VINCI PARTNERS	2.231.097,37	0,60%	0,01%
AZ QUEST INVESTIMENTOS	1.966.761,85	0,53%	0,01%
BRASIL PLURAL	1.435.079,04	0,39%	0,01%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA + 6,00% ao ano	0,74%	8,07%	2,30%	4,05%	8,95%	23,52%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,11%	12,76%	1,13%	6,98%	14,77%	40,15%	0,15%	1,621%	6,16%
BTG PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA	-2,00%	2,40%	-0,67%	1,15%	3,12%	11,20%	0,15%	4,704%	3,86%
IRF-M 1	0,62%	10,49%	2,00%	4,92%	11,82%	28,26%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,59%	10,31%	1,94%	4,82%	11,61%	27,86%	0,20%	0,042%	0,67%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,59%	10,25%	1,92%	4,80%	11,53%	27,67%	0,10%	0,041%	0,67%
Selic	0,57%	9,35%	1,86%	4,34%	10,58%	26,13%	-	-	-
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,56%	9,77%	1,89%	4,59%	11,00%	26,88%	0,20%	0,001%	0,13%
CDI	0,57%	9,34%	1,86%	4,33%	10,56%	26,09%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,56%	9,44%	1,90%	4,38%	10,68%	26,10%	0,20%	0,040%	0,12%
IPCA	0,28%	2,50%	0,86%	1,06%	2,80%	9,99%	-	-	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,15%	13,75%	1,85%	7,26%	15,62%	40,08%	0,20%	0,793%	4,37%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,13%	11,98%	1,68%	6,50%	14,36%	37,36%	0,40%	0,742%	5,92%
IMA-B 5	0,10%	11,59%	1,60%	6,36%	13,15%	31,60%	-	-	-
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	0,11%	11,41%	1,58%	6,27%	12,95%	31,11%	0,10%	0,897%	3,56%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,09%	11,41%	1,55%	6,25%	12,95%	30,96%	0,20%	0,890%	3,55%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	-0,24%	12,80%	1,10%	6,56%	14,76%	36,03%	0,40%	1,368%	5,04%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	-0,76%	11,87%	0,65%	6,25%	15,12%	41,75%	-	-	-
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP	-0,77%	11,69%	0,60%	6,14%	14,92%	41,35%	0,20%	2,218%	9,45%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,78%	11,62%	0,59%	6,10%	14,84%	41,03%	0,20%	2,214%	9,44%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	-0,81%	12,02%	0,58%	6,27%	15,38%	41,62%	0,20%	2,257%	9,58%
BRDESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	-2,04%	6,11%	-0,44%	3,43%	7,43%	16,70%	0,20%	4,345%	4,66%



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

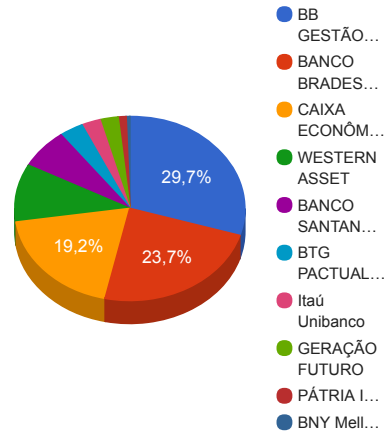
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
S&P 500	2,33%	18,35%	11,02%	10,38%	15,62%	7,80%	-	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	3,31%	27,27%	8,33%	13,62%	31,29%	56,74%	1,00%	2,765%	6,40%
CDI	0,57%	9,34%	1,86%	4,33%	10,56%	26,09%	-	-	-
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	-0,06%	8,04%	1,88%	4,42%	9,54%	28,84%	2,00%	0,774%	1,65%
IPCA	0,28%	2,50%	0,86%	1,06%	2,80%	9,99%	-	-	-
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	-	-	-	-	-	-	1,00%	-	-
IDIV	-6,67%	19,39%	-0,67%	10,02%	18,34%	84,42%	-	-	-
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	-3,11%	13,76%	0,49%	8,74%	13,16%	27,98%	1,72%	9,152%	17,17%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	-5,22%	-2,32%	-3,15%	0,16%	-0,15%	-6,90%	3,00%	8,300%	17,42%
Ibovespa	-3,15%	19,50%	1,60%	14,77%	16,26%	59,51%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FI AÇÕES	-3,79%	26,48%	0,59%	15,18%	23,29%	-	2,50%	9,184%	18,22%
SMLL	-2,43%	39,54%	-0,34%	17,47%	38,80%	74,16%	-	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	-4,02%	34,15%	1,76%	21,30%	37,18%	54,45%	2,00%	10,258%	20,13%
IFIX	-0,59%	18,73%	6,19%	7,64%	20,47%	52,42%	-	-	-
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	0,51%	22,21%	4,79%	8,41%	15,22%	42,75%	0,40%	7,605%	16,68%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-	0,30%	-	-
Não Possui	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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

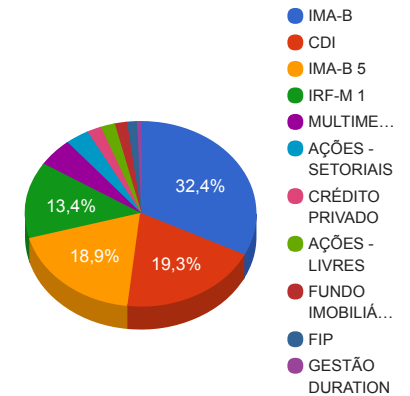
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,50%	0,467%	17,55%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	110.189.895,58	29,75%
BANCO BRADESCO	87.774.081,47	23,70%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	71.094.060,30	19,19%
WESTERN ASSET	37.579.889,06	10,14%
BANCO SANTANDER	25.883.970,67	6,99%
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS	12.493.231,00	3,37%
Itaú Unibanco	9.827.876,65	2,65%
GERAÇÃO FUTURO	9.481.633,88	2,56%
PÁTRIA INVESTIMENTOS	4.136.442,41	1,12%
BNY Mellon Serviços Financeiros	1.966.761,85	0,53%



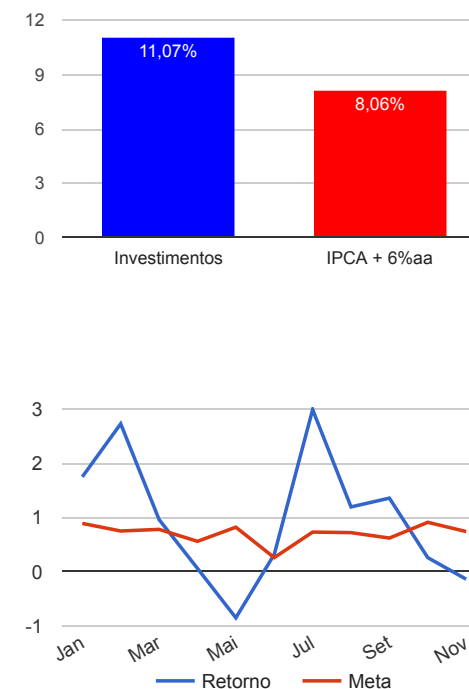
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	120.034.626,80	32,40%
CDI	71.597.122,12	19,33%
IMA-B 5	69.992.387,04	18,90%
IRF-M 1	49.518.467,15	13,37%
MULTIMERCADO	18.401.101,42	4,97%
AÇÕES - SETORIAIS	12.244.414,06	3,31%
CRÉDITO PRIVADO	7.449.022,14	2,01%
AÇÕES - LIVRES	7.423.976,12	2,00%
FUNDO IMOBILIÁRIO	6.267.862,49	1,69%
FIP	5.094.963,00	1,38%
GESTÃO DURATION	2.403.900,53	0,65%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	316.694.151,95	16.186.674,39	5.832.522,08	332.762.274,86	5.713.970,60	1,75%	0,89%	195,88%	2,61%
Fevereiro	332.762.274,86	10.110.678,08	7.183.643,36	344.830.683,60	9.141.374,02	2,72%	0,75%	363,84%	1,69%
Março	344.830.683,60	17.998.289,25	18.041.475,61	348.100.630,40	3.313.133,16	0,96%	0,78%	122,46%	1,92%
Abril	348.100.630,40	6.828.114,55	7.288.033,54	347.855.613,79	214.902,38	0,06%	0,56%	11,07%	1,73%
Mai	347.855.613,79	7.601.852,25	8.042.063,54	344.465.169,66	-2.950.232,84	-0,85%	0,82%	-103,23%	9,66%
Junho	344.465.169,66	6.810.000,00	11.269.541,81	341.105.801,22	1.100.173,37	0,32%	0,26%	124,94%	2,00%
Julho	341.105.801,22	64.007.589,09	64.874.606,18	350.419.080,68	10.180.296,55	2,98%	0,73%	410,00%	1,68%
Agosto	350.419.080,68	23.202.295,66	26.463.678,61	351.339.670,37	4.181.972,64	1,19%	0,72%	164,78%	1,48%
Setembro	351.339.670,37	64.509.000,00	65.626.050,52	354.982.812,02	4.760.192,17	1,35%	0,62%	217,03%	0,99%
Outubro	354.982.812,02	6.970.550,40	8.268.041,54	354.604.718,92	919.398,04	0,26%	0,91%	28,50%	1,27%
Novembro	354.604.718,92	15.308.585,57	14.514.743,26	354.912.059,83	-486.501,40	-0,14%	0,74%	-18,50%	1,76%
Acumulado no ano					36.088.678,69	11,07%	8,06%	137,26%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BTG PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA	12.748.646,00	0,00	358.399,67	12.493.231,00	102.984,67	0,81%	4,70%	-2,00%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	31.006.228,18	0,00	0,00	31.189.916,88	183.688,70	0,59%	0,04%	0,59%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	18.221.163,39	0,00	0,00	18.328.550,27	107.386,88	0,59%	0,04%	0,59%
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	18.556.890,40	0,00	0,00	18.660.281,36	103.390,96	0,56%	0,00%	0,56%
BRADERCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	12.033.069,93	0,00	308.708,38	11.787.733,30	63.371,75	0,53%	4,34%	-2,04%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	51.382.266,68	9.744.000,00	8.474.700,00	52.936.840,76	285.274,08	0,47%	0,04%	0,56%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	7.437.689,23	0,00	0,00	7.449.022,14	11.332,91	0,15%	0,79%	0,15%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.400.774,98	0,00	0,00	2.403.900,53	3.125,55	0,13%	0,74%	0,13%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	1.604.023,81	0,00	0,00	1.605.842,94	1.819,13	0,11%	0,90%	0,11%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	36.681.763,32	0,00	0,00	36.714.525,46	32.762,14	0,09%	0,89%	0,09%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.466.721,96	0,00	0,00	14.450.918,30	-15.803,66	-0,11%	1,62%	-0,11%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	19.224.953,39	0,00	0,00	19.178.787,64	-46.165,75	-0,24%	1,37%	-0,24%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIX...	24.467.104,05	0,00	0,00	24.278.127,73	-188.976,32	-0,77%	2,22%	-0,77%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12.287.009,51	0,00	0,00	12.191.780,66	-95.228,85	-0,78%	2,21%	-0,78%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	57.794.644,76	0,00	0,00	57.326.066,81	-468.577,95	-0,81%	2,26%	-0,81%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>80.384,24</b>	<b>0,03%</b>	<b>1,30%</b>	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	8.936.401,11	0,00	0,00	9.232.418,60	296.017,49	3,31%	2,77%	3,31%
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	4.048.342,96	0,00	0,00	4.136.442,41	88.099,45	2,18%	-	-
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPF11	1.442.352,18	0,00	10.041,36	1.435.079,04	2.768,22	0,19%	7,60%	0,51%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	4.878.251,04	0,00	45.000,00	4.832.783,45	-467,59	-0,01%	-	0,00%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	9.173.946,50	0,00	0,00	9.168.682,82	-5.263,68	-0,06%	0,77%	-0,06%
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTISTRATÉGIA FIP	946.099,36	13.691,72	0,00	958.520,59	-1.270,49	-0,13%	0,47%	0,17%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FI AÇÕES	1.937.983,03	5.560.893,85	0,00	7.423.976,12	-74.900,76	-1,00%	9,18%	-3,79%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	2.302.693,23	0,00	0,00	2.231.097,37	-71.595,86	-3,11%	9,15%	-3,11%
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	5.755.148,87	0,00	5.560.893,85	0,00	-194.255,02	-3,38%	10,19%	-6,53%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	2.049.143,20	0,00	0,00	1.966.761,85	-82.381,35	-4,02%	10,26%	-4,02%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	8.489.889,12	0,00	0,00	8.046.554,84	-443.334,28	-5,22%	8,30%	-5,22%
Total Renda Variável					-486.583,87	-0,97%	5,43%	