

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



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 IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	7.017.646,70	9,38%	1.412	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	2.127.137,82	2,84%	223	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.474.439,30	8,65%	703	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	682.901,48	0,91%	1.226	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	1.104.725,68	1,48%	107	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	693.107,80	0,93%	712	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.442.878,62	9,95%	297	0,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.800.508,22	5,08%	722	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	612.127,56	0,82%	588	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	1.109.864,02	1,48%	72	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.281.526,31	3,05%	619	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	10.610.629,08	14,18%	8.162	0,10%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	D+5	Não há	2.097.359,83	2,80%	86	0,25%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	5.926.814,72	7,92%	757	0,14%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.012.282,79	2,69%	34	2,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	730.130,13	0,98%	95	0,18%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	2.013.578,94	2,69%	114	0,29%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	912.977,78	1,22%	313	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2030	1.305.662,00	1,74%	34	0,65%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	804.691,29	1,08%	518	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	1.308.164,77	1,75%	116	0,26%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.796.875,80	2,40%	5	2,89%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "

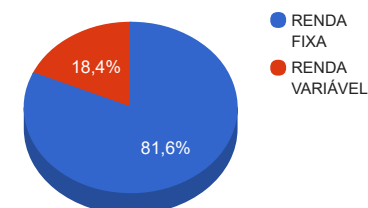
Carteira consolidada de investimentos - base (dezembro / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.316.667,12	1,76%	25	3,34%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	D+43	5 anos	1.180.984,16	1,58%	56	1,08%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FI AÇÕES	D+24	Não há	1.008.261,44	1,35%	58	0,28%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BRDESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.524.943,50	3,37%	850	0,28%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	D+4	Não há	2.782.926,95	3,72%	2.046	12,81%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	2.869.606,54	3,83%	501	5,30%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	Não se aplica	Não se aplica	290.512,39	0,39%		0,01%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
		TOTAL -	74.839.932,74				

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

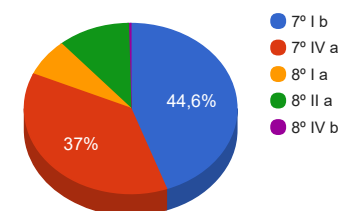
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	33.346.863,51	44,56%	30,00%	35,00%	85,00%	30.267.079,32
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	15,00%	20,00%	60,00%	44.903.959,64
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	27.722.291,33	37,04%	5,00%	5,00%	30,00%	-5.270.311,51
Artigo 7º, Inciso VI	0,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	11.225.989,91
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	3.741.996,64
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	3.741.996,64
Total Renda Fixa	100,00%	61.069.154,84	81,60%	55,00	75,00	200,00	-

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso I	0,00%	0,00	0,00%	1,00%	2,00%	5,00%	3.741.996,64
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	5.302.788,52	7,09%	0,00%	0,00%	0,00%	-5.302.788,52
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	8.177.476,99	10,93%	0,00%	0,00%	0,00%	-8.177.476,99
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	15,00%	11.225.989,91
Artigo 8º, Inciso IV	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	3.741.996,64
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	290.512,39	0,39%	0,00%	0,00%	0,00%	-290.512,39
Artigo 8º, Inciso V	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	4,00%	5,00%	3.741.996,64
Artigo 8º, Inciso VI	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	4,00%	5,00%	3.741.996,64
Total Renda Variável	30,00%	13.770.777,90	18,40%	12,00	25,00	35,00	-

Distribuição por Artigo / Resolução



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 " b "	33.346.863,51	44,56%	30,00%	85,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	27.722.291,33	37,04%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	0,00	0,00%	5,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa	61.069.154,84	81,60%	55,00	200,00

Artigos - Renda Variável	Base: dezembro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I	0,00	0,00%	1,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	5.302.788,52	7,09%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	8.177.476,99	10,93%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	290.512,39	0,39%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso V	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	0,00	0,00%	2,00%	5,00%
Total Renda Variável	13.770.777,90	18,40%	12,00	35,00

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	55.183.057,87	73,73%	0,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	9.953.246,46	13,30%	0,00%
ITAÚ UNIBANCO	4.902.497,07	6,55%	0,00%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	3.329.634,79	4,45%	0,00%
VINCI PARTNERS	1.180.984,16	1,58%	0,01%
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	290.512,39	0,39%	0,02%

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	1,24%	15,20%	1,44%	6,42%	15,20%	42,12%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,19%	14,80%	1,27%	6,17%	14,80%	41,50%	0,20%	0,843%	4,59%
IDKA IPCA 2 Anos	1,16%	13,61%	2,24%	6,80%	13,61%	30,90%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,87%	12,34%	1,85%	6,25%	12,34%	29,13%	0,20%	0,454%	2,69%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,86%	12,40%	1,91%	6,33%	12,40%	29,14%	0,20%	0,463%	2,75%
IPCA + 6,00% ao ano	0,91%	9,05%	2,58%	4,73%	9,05%	22,83%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,05%	13,94%	0,94%	7,74%	13,94%	37,69%	0,15%	1,107%	6,01%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,71%	2,67%	2,42%	1,35%	2,67%	9,70%	0,20%	0,111%	4,08%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,70%	8,95%	2,39%	4,28%	8,95%	23,16%	0,20%	0,111%	0,31%
IMA-B 5	0,88%	12,58%	1,48%	6,74%	12,58%	30,01%	-	-	-
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%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,05%	7,41%	1,61%	4,07%	7,41%	19,64%	0,20%	0,573%	5,61%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	0,82%	12,36%	-0,31%	6,73%	12,36%	39,48%	0,20%	1,392%	8,83%
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 IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,81%	12,55%	-0,39%	6,83%	12,55%	40,19%	0,20%	1,422%	9,24%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,60%	7,37%	-0,38%	3,96%	7,37%	24,37%	0,20%	1,374%	8,09%

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

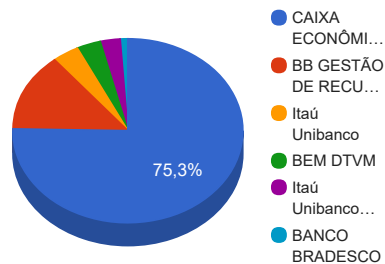
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,35%	4,26%	1,58%	1,65%	4,26%	13,21%	0,20%	0,131%	4,33%
IRF-M 1	0,57%	11,12%	1,82%	4,59%	11,12%	27,47%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,57%	10,93%	1,79%	4,51%	10,93%	27,11%	0,20%	0,031%	0,67%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,56%	10,86%	1,77%	4,48%	10,86%	26,92%	0,10%	0,040%	0,68%
Selic	0,54%	9,94%	1,76%	4,06%	9,94%	25,35%	-	-	-
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,53%	10,35%	1,75%	4,28%	10,35%	26,08%	0,20%	0,007%	0,14%
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%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,53%	9,96%	1,75%	4,06%	9,96%	25,21%	0,20%	0,008%	0,14%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,52%	9,88%	1,72%	3,97%	9,88%	25,33%	0,25%	0,012%	0,13%
IPCA	0,44%	2,95%	1,14%	1,74%	2,95%	9,42%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	0,80%	12,85%	0,97%	6,32%	12,85%	-	0,40%	0,468%	5,76%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,80%	11,22%	1,49%	5,54%	11,22%	-	0,002	0,423%	4,29%

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

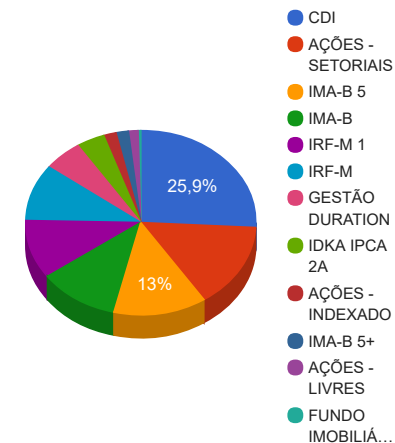
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
SMLL	7,03%	49,36%	2,89%	25,25%	49,36%	96,78%	-	-	-
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	7,88%	32,81%	0,93%	22,69%	32,81%	5,12%	1,72%	5,860%	15,16%
ICON	6,81%	33,14%	0,41%	24,09%	33,14%	50,76%	-	-	-
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	6,74%	32,74%	0,13%	24,07%	32,74%	45,94%	1,60%	6,358%	17,48%
IGCT	6,40%	31,16%	2,48%	20,67%	31,16%	78,02%	-	-	-
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA FI AÇÕES	6,44%	30,60%	2,43%	20,45%	30,60%	76,92%	0,90%	6,262%	18,43%
Ibovespa	6,16%	26,86%	2,84%	21,47%	26,86%	76,25%	-	-	-
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	6,23%	25,87%	2,65%	20,93%	25,87%	73,91%	0,50%	6,745%	18,90%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FI AÇÕES	5,71%	33,70%	1,18%	21,37%	33,70%	-	2,50%	5,983%	17,59%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	4,28%	23,75%	0,78%	16,78%	23,75%	66,74%	2,00%	5,602%	18,89%
IDIV	4,94%	25,30%	-1,77%	16,88%	25,30%	101,09%	-	-	-
BRADERCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	5,77%	30,88%	2,20%	17,68%	30,88%	73,36%	1,50%	6,182%	18,35%
IFIX	0,60%	19,41%	0,24%	7,34%	19,41%	58,02%	-	-	-
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-	0,30%	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	56.364.042,03	75,31%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	10.243.758,85	13,69%
Itaú Unibanco	2.805.137,24	3,75%
BEM DTVM	2.524.943,50	3,37%
Itaú Unibanco S.A.	2.097.359,83	2,80%
BANCO BRADESCO	804.691,29	1,08%



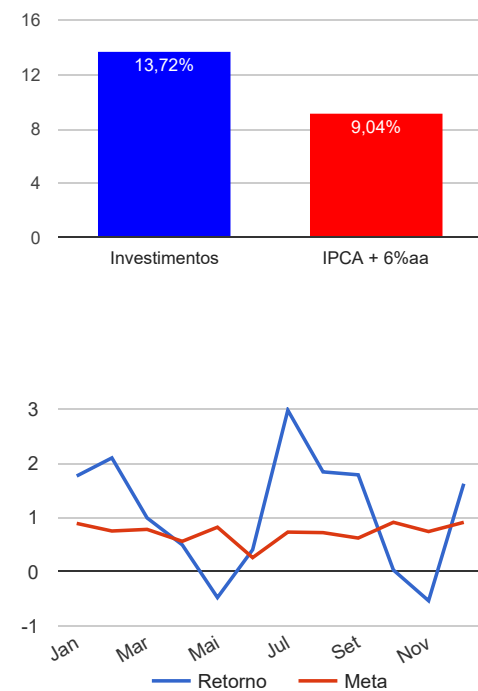
Sub-segmento	Valor	%
CDI	19.354.417,88	25,86%
AÇÕES - SETORIAIS	11.155.336,95	14,91%
IMA-B 5	9.706.302,80	12,97%
IMA-B	8.473.772,48	11,32%
IRF-M 1	7.700.548,18	10,29%
IRF-M	7.442.878,62	9,95%
GESTÃO DURATION	4.110.938,77	5,49%
IDKA IPCA 2A	2.974.634,11	3,97%
AÇÕES - INDEXADO	1.316.667,12	1,76%
IMA-B 5+	1.305.662,00	1,74%
AÇÕES - LIVRES	1.008.261,44	1,35%
FUNDO IMOBILIÁRIO	290.512,39	0,39%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	67.163.512,71	7.014.108,42	7.291.540,11	68.069.728,53	1.183.647,51	1,76%	0,89%	197,59%	1,95%
Fevereiro	68.069.728,53	5.152.660,24	5.326.071,97	69.322.645,25	1.426.328,45	2,10%	0,75%	279,96%	1,81%
Março	69.322.645,25	6.627.494,43	7.527.639,13	69.109.336,77	686.836,22	0,99%	0,78%	126,28%	1,87%
Abril	69.109.336,77	5.025.461,99	875.866,66	73.621.661,68	362.729,58	0,50%	0,56%	88,79%	1,56%
Maio	73.621.661,68	4.436.691,45	3.968.770,50	73.737.801,50	-351.781,13	-0,47%	0,82%	-57,79%	8,08%
Junho	73.737.801,50	7.441.430,30	7.323.294,51	74.155.478,64	299.541,35	0,41%	0,26%	158,65%	1,91%
Julho	74.155.478,64	2.253.102,45	3.660.464,18	74.952.921,74	2.204.804,83	2,97%	0,73%	408,45%	1,74%
Agosto	74.952.921,74	2.067.729,33	2.381.517,20	76.016.796,89	1.377.663,02	1,84%	0,72%	253,79%	1,93%
Setembro	76.016.796,89	13.683.124,39	14.506.068,82	76.549.966,12	1.356.113,66	1,78%	0,62%	285,77%	1,65%
Outubro	76.549.966,12	2.305.177,51	4.224.727,91	74.655.065,53	24.649,81	0,03%	0,91%	3,54%	1,93%
Novembro	74.655.065,53	12.358.636,75	13.413.856,17	73.201.721,87	-398.124,24	-0,53%	0,74%	-72,07%	2,31%
Dezembro	73.201.721,87	5.358.804,98	4.913.602,46	74.839.932,74	1.193.008,35	1,62%	0,91%	178,88%	1,45%
Acumulado no ano					9.365.417,41	13,72%	9,04%	151,67%	

Acumulado no Ano



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(%)
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.355.458,55	0,00	0,00	7.442.878,62	87.420,07	1,19%	0,84%	1,19%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.093.230,81	0,00	0,00	1.104.725,68	11.494,87	1,05%	0,57%	1,05%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	722.545,93	0,00	0,00	730.130,13	7.584,20	1,05%	1,11%	1,05%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.261.838,94	0,00	0,00	2.281.526,31	19.687,37	0,87%	0,45%	0,87%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.418.673,23	0,00	0,00	6.474.439,30	55.766,07	0,87%	0,67%	0,87%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	687.176,87	0,00	0,00	693.107,80	5.930,93	0,86%	0,46%	0,86%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	905.524,63	0,00	0,00	912.977,78	7.453,15	0,82%	1,39%	0,82%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	607.217,62	0,00	0,00	612.127,56	4.909,94	0,81%	1,42%	0,81%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.770.101,40	0,00	0,00	3.800.508,22	30.406,82	0,81%	1,42%	0,81%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	2.080.791,76	0,00	0,00	2.097.359,83	16.568,07	0,80%	0,47%	0,80%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1.997.690,85	0,00	0,00	2.013.578,94	15.888,09	0,80%	0,42%	0,80%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.296.498,00	0,00	0,00	1.305.662,00	9.164,00	0,71%	0,11%	0,71%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.299.098,63	0,00	0,00	1.308.164,77	9.066,14	0,70%	0,11%	0,70%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.103.250,54	0,00	0,00	1.109.864,02	6.613,48	0,60%	1,37%	0,60%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	679.106,95	0,00	0,00	682.901,48	3.794,53	0,56%	0,04%	0,56%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	2.001.636,53	0,00	0,00	2.012.282,79	10.646,26	0,53%	0,01%	0,53%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.225.037,26	2.565.182,97	899.467,43	5.926.814,72	36.061,92	0,53%	0,07%	0,58%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	800.442,81	0,00	0,00	804.691,29	4.248,48	0,53%	0,01%	0,53%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	10.964.759,63	671.317,54	1.080.773,43	10.610.629,08	55.325,34	0,48%	0,01%	0,52%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.528.235,01	1.822.304,47	1.368.178,63	7.017.646,70	35.285,85	0,42%	0,03%	0,57%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.119.699,48	0,00	0,00	2.127.137,82	7.438,34	0,35%	0,13%	0,35%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.561.357,06	0,00	1.562.482,97	0,00	1.125,91	0,07%	2,05%	0,75%
Total Renda Fixa					441.879,83	0,73%	0,42%	

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 VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	1.094.743,41	0,00	0,00	1.180.984,16	86.240,75	7,88%	5,86%	7,88%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	2.510.685,26	100.000,00	0,00	2.782.926,95	172.241,69	6,60%	6,36%	6,74%
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA FI AÇÕES	1.688.099,22	0,00	0,00	1.796.875,80	108.776,58	6,44%	6,26%	6,44%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	1.143.713,27	100.000,00	0,00	1.316.667,12	72.953,85	5,87%	6,74%	6,23%
BRDESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.387.133,54	0,00	0,00	2.524.943,50	137.809,96	5,77%	6,18%	5,77%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FI AÇÕES	953.839,35	0,00	0,00	1.008.261,44	54.422,09	5,71%	5,98%	5,71%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	2.654.168,32	100.000,00	0,00	2.869.606,54	115.438,22	4,19%	5,60%	4,28%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	289.967,01	0,00	2.700,00	290.512,39	3.245,38	1,12%	-	0,00%
Total Renda Variável					751.128,52	5,77%	6,12%	

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 (%)
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	10.466.822,43	3.058.683,06	3.083.476,72	10.610.629,08	168.600,31	1,49%	1,72%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.610.993,46	0,00	261.858,21	7.442.878,62	93.743,37	1,28%	1,27%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.740.161,00	0,00	358.328,01	6.474.439,30	92.606,31	1,42%	1,42%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.174.181,20	2.569.082,97	904.337,89	5.926.814,72	87.888,44	1,78%	1,83%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.669.912,63	8.294.853,21	4.020.428,02	7.017.646,70	73.308,88	1,05%	1,79%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.240.017,27	0,00	0,00	2.281.526,31	41.509,04	1,85%	1,85%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.094.115,40	0,00	0,00	2.127.137,82	33.022,42	1,58%	1,58%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.274.790,00	0,00	0,00	1.305.662,00	30.872,00	2,42%	2,42%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.277.577,80	0,00	0,00	1.308.164,77	30.586,97	2,39%	2,39%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	2.077.310,44	0,00	0,00	2.097.359,83	20.049,39	0,97%	0,97%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.087.206,75	0,00	0,00	1.104.725,68	17.518,93	1,61%	1,61%
BRASESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	790.866,94	0,00	0,00	804.691,29	13.824,35	1,75%	1,75%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,00	2.000.000,00	0,00	2.013.578,94	13.578,94	0,68%	1,49%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	680.089,35	0,00	0,00	693.107,80	13.018,45	1,91%	1,91%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,00	2.000.000,00	0,00	2.012.282,79	12.282,79	0,61%	1,75%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	671.040,52	0,00	0,00	682.901,48	11.860,96	1,77%	1,77%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	723.350,50	0,00	0,00	730.130,13	6.779,63	0,94%	0,94%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.114.062,75	0,00	0,00	1.109.864,02	-4.198,73	-0,38%	-0,38%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	308.406,78	0,00	303.542,48	0,00	-4.864,30	-1,58%	-1,70%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	678.146,88	0,00	671.335,04	0,00	-6.811,84	-1,00%	-0,45%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.626.320,97	0,00	1.000.000,00	612.127,56	-14.193,41	-0,38%	-0,38%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.833.137,48	0,00	3.000.000,00	3.800.508,22	-32.629,26	-0,12%	-0,39%

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 (%)
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	6.948.923,66	0,00	6.000.000,00	912.977,78	-35.945,88	0,19%	-0,31%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.599.961,51	0,00	1.562.482,97	0,00	-37.478,54	-2,34%	-1,68%
				Total Renda Fixa	624.929,22	1,02%	

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 (%)
BRDESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.470.499,09	0,00	0,00	2.524.943,50	54.444,41	2,20%	2,20%
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA FI AÇÕES	1.754.297,79	0,00	0,00	1.796.875,80	42.578,01	2,43%	2,43%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	578.690,36	700.000,00	0,00	1.316.667,12	37.976,76	2,72%	2,65%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	2.476.701,65	700.000,00	341.847,42	2.869.606,54	34.752,31	1,28%	0,78%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FI AÇÕES	996.514,07	0,00	0,00	1.008.261,44	11.747,37	1,18%	1,18%
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	1.170.062,71	0,00	0,00	1.180.984,16	10.921,45	0,93%	0,93%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	294.319,47	0,00	6.600,00	290.512,39	2.792,92	0,96%	0,00%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	3.121.485,26	700.000,00	1.037.949,78	2.782.926,95	-608,53	0,21%	0,13%
Total Renda Variável					194.604,70	1,31%	

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 (%)
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.209.066,68	0,00	5.979.716,92	6.474.439,30	1.245.089,54	12,30%	12,38%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.714.190,62	0,00	261.858,21	7.442.878,62	990.546,21	14,80%	14,80%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.233.612,72	1.578.138,37	4.842.189,58	3.800.508,22	830.946,71	11,95%	12,55%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.172.025,07	24.431.560,68	26.089.486,08	7.017.646,70	503.547,03	6,57%	10,93%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	1.830.361,33	7.192.530,55	8.590.647,92	912.977,78	480.733,82	11,43%	12,36%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	334.621,89	4.000.000,00	4.755.166,47	0,00	420.544,58	8,10%	12,44%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.764.244,34	2.979.095,65	1.210.254,68	5.926.814,72	393.729,41	9,97%	10,08%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	6.117.640,81	16.338.679,69	12.233.004,75	10.610.629,08	387.313,33	7,94%	9,88%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.747.493,50	0,00	1.776.750,95	2.281.526,31	310.783,76	12,18%	12,34%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.328.529,04	0,00	2.839.670,00	693.107,80	204.248,76	11,53%	12,40%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.040.134,38	0,00	115.242,21	2.127.137,82	202.245,65	10,20%	4,26%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	650.437,17	1.558.923,00	2.394.866,74	0,00	185.506,57	12,16%	12,17%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.028.524,14	0,00	58.833,36	1.104.725,68	135.034,90	13,50%	7,41%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.033.679,25	0,00	58.377,40	1.109.864,02	134.562,17	13,27%	7,37%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	1.500.000,00	1.000.000,00	612.127,56	112.127,56	8,01%	12,52%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.270.799,16	0,00	72.415,73	1.308.164,77	109.781,34	8,92%	8,95%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.271.675,00	0,00	74.279,70	1.305.662,00	108.266,70	8,81%	2,67%
BRASESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.196.871,89	0,00	500.000,00	804.691,29	107.819,40	10,30%	10,35%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	676.601,94	0,00	38.164,74	730.130,13	91.692,93	13,89%	13,94%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	604.114,53	0,00	671.335,04	0,00	67.220,51	11,13%	11,75%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	617.274,86	0,00	1.368,87	682.901,48	66.995,49	10,86%	10,86%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA II FIC RENDA FIXA	0,00	2.062.646,43	0,00	2.097.359,83	34.713,40	1,68%	12,85%

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 (%)
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,00	2.000.000,00	0,00	2.013.578,94	13.578,94	0,68%	11,22%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,00	2.000.000,00	0,00	2.012.282,79	12.282,79	0,61%	9,96%
Total Renda Fixa					7.149.311,50	11,78%	

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 (%)
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	1.223.407,85	1.982.847,87	1.037.949,78	2.782.926,95	614.621,01	30,82%	32,74%
BRANCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.589.505,58	800.000,00	401.413,00	2.524.943,50	536.850,92	30,35%	30,88%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	1.128.293,28	1.700.000,00	341.847,42	2.869.606,54	383.160,68	23,56%	23,75%
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA FI AÇÕES	400.934,63	1.100.000,00	0,00	1.796.875,80	295.941,17	28,09%	30,60%
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	661.235,54	300.000,00	0,00	1.180.984,16	219.748,62	30,54%	32,81%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	0,00	1.200.000,00	0,00	1.316.667,12	116.667,12	18,89%	25,87%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	318.237,51	0,00	68.580,07	290.512,39	40.854,95	13,46%	0,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FI AÇÕES	0,00	1.000.000,00	0,00	1.008.261,44	8.261,44	0,83%	33,70%
Total Renda Variável					2.216.105,91	28,02%	