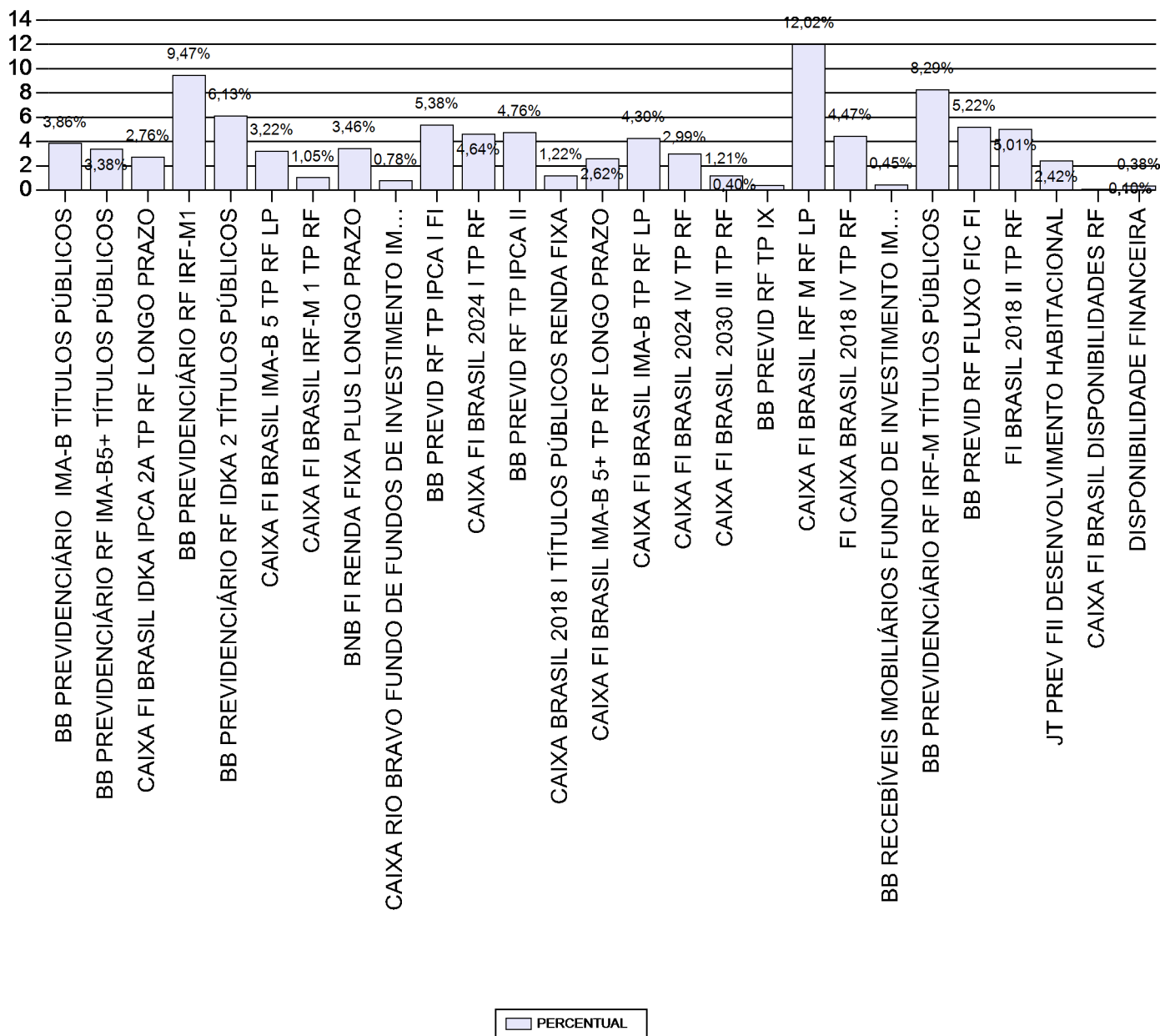


PORTFÓLIO DE INVESTIMENTO 11/2017

| APLICAÇÃO | SEGMENTO | % | QTD. COTAS/TÍTULOS | VALOR UNIT. | SALDO ATUAL |
|--|----------------|-------|----------------------|-----------------|---------------|
| BB PREVIDENCIÁRIO IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS | RENTA FIXA | 2,43 | 1.288.397,904162000 | 4,420746810 | 5.225.949,42 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS | RENTA FIXA | 2,21 | 13.673.072,459696000 | 2,252775610 | 4.747.674,10 |
| CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LONGO PRAZO | RENTA FIXA | 2,76 | 4.063.082,309162000 | 1,810058000 | 5.916.842,51 |
| BB PREVIDENCIÁRIO IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS | RENTA FIXA | 1,43 | 222.290,616316000 | 4,420746810 | 3.066.425,45 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M1 | RENTA FIXA | 8,98 | 16.965.618,732560000 | 2,303818910 | 19.287.905,54 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS | RENTA FIXA | 5,04 | 5.374.355,981438000 | 2,186985280 | 10.820.883,58 |
| CAIXA FI BRASIL IMA-B 5 TP RF LP | RENTA FIXA | 3,22 | 5.722.534,966580000 | 2,400410000 | 6.921.515,96 |
| CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF | RENTA FIXA | 0,58 | 695.915,188079000 | 2,203125000 | 1.240.471,13 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M1 | RENTA FIXA | 0,48 | -603.593,827947000 | 2,303818910 | 1.040.738,17 |
| BNB FI RENDA FIXA PLUS LONGO PRAZO | RENTA FIXA | 3,46 | 247.181,492664000 | 4,590518000 | 7.432.850,58 |
| CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FII | RENTA VARIÁVEL | 0,78 | 1.500,000000000 | 1.120,521807770 | 1.680.782,71 |
| BB PREVID RF TP IPCA I FI | RENTA FIXA | 5,38 | 6.558.182,965338000 | 1,763585340 | 11.560.734,63 |
| CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF | RENTA FIXA | 4,64 | 6.688.211,384898000 | 1,423411000 | 9.963.877,00 |
| BB PREVID RF TP IPCA II | RENTA FIXA | 4,76 | 8.385.763,349151000 | 1,666040910 | 10.225.639,85 |
| CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA | RENTA FIXA | 1,22 | 1.826.244,159923000 | 1,309860000 | 2.619.720,00 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS | RENTA FIXA | 1,17 | 881.693,999361000 | 2,252775610 | 2.521.219,90 |
| CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF | RENTA FIXA | 0,46 | 442.936,932611000 | 2,203125000 | 985.345,45 |
| CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF | RENTA FIXA | 0,02 | 15.451,465793000 | 2,203125000 | 34.301,74 |
| CAIXA FI BRASIL IMA-B 5+ TP RF LONGO PRAZO | RENTA FIXA | 2,62 | 1.174.959,134016000 | 1,777896000 | 5.626.803,89 |
| CAIXA FI BRASIL IMA-B TP RF LP | RENTA FIXA | 4,26 | 3.377.356,547122000 | 2,497751000 | 9.154.318,01 |
| CAIXA FI BRASIL 2024 IV TP RF | RENTA FIXA | 2,99 | 4.668.022,278609000 | 1,283835000 | 6.419.175,00 |
| CAIXA FI BRASIL 2030 III TP RF | RENTA FIXA | 1,21 | 1.863.203,681425000 | 1,297427000 | 2.594.854,00 |
| BB PREVID RF TP IX | RENTA FIXA | 0,40 | 623.634,148721000 | 1,377776530 | 859.034,77 |
| CAIXA FI BRASIL IRF M RF LP | RENTA FIXA | 11,91 | 12.424.012,316627000 | 1,768691000 | 25.577.783,73 |
| FI CAIXA BRASIL 2018 IV TP RF | RENTA FIXA | 4,47 | 7.530.993,561011000 | 1,200170000 | 9.601.360,00 |
| CAIXA FI BRASIL IMA-B TP RF LP | RENTA FIXA | 0,03 | 29.749,668204000 | 2,497751000 | 74.307,27 |
| BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FII | RENTA FIXA | 0,45 | 10.000,000000000 | 96,655669000 | 966.556,69 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS | RENTA FIXA | 1,09 | 1.071.592,236093000 | 2,186985280 | 2.343.556,45 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS | RENTA FIXA | 6,97 | 3.241.713,186916000 | 4,619871590 | 14.975.352,80 |
| CAIXA FI BRASIL IRF M RF LP | RENTA FIXA | 0,11 | 135.562,064040000 | 1,768691000 | 239.767,40 |
| BB PREVID RF FLUXO FIC FI | RENTA FIXA | 1,41 | 1.608.172,803041000 | 1,876415470 | 3.024.369,39 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS | RENTA FIXA | 1,32 | 611.345,510776000 | 4,619871590 | 2.824.337,75 |

| APLICAÇÃO | SEGMENTO | % | QTD. COTAS/TÍTULOS | VALOR UNIT. | SALDO ATUAL |
|--|-----------------|---------------|---------------------------|--------------------|-----------------------|
| FI BRASIL 2018 II TP RF | RENDA FIXA | 5,01 | 0,000000000 | 1,207986000 | 10.756.786,07 |
| BB PREVID RF FLUXO FIC FI | RENDA FIXA | 3,81 | 3.255.923,378445000 | 1,876415470 | 8.188.972,73 |
| JT PREV FII DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL | RENDA FIXA | 2,42 | 48.676,866159000 | 106,743198420 | 5.195.714,28 |
| CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF | RENDA FIXA | 0,10 | 130.317,864817000 | 1,657151000 | 216.483,57 |
| CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF | RENDA FIXA | 0,00 | 9.282,991246000 | 1,657151000 | 5.484,34 |
| TOTAL INVESTIMENTOS | | 99,62 | | | 213.937.895,86 |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA | | 0,38 | | | 816.577,25 |
| TOTAL GERAL | | 100,00 | | | 214.754.473,11 |

Composição da Carteira



Política Anual de Investimento - P.A.I. - 2017

| TIPO | SEGMENTO | RESOLUÇÃO | P.A.I | ALOCÇÃO |
|--|----------------|-----------|----------|----------------|
| FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, "b" | RENDA FIXA | 100,00 % | 100,00 % | 81,80 % |
| FI de Renda Fixa - Art 7º, IV, "a" | RENDA FIXA | 30,00 % | 30,00 % | 14,17 % |
| FI Imobiliário - Cotas Negociadas em Bolsa - Art. 8º, VI | RENDA VARIÁVEL | 5,00 % | 5,00 % | 0,78 % |
| FI em Direitos Creditórios - Fechado - Art. 7º, VII, "a" | RENDA FIXA | 5,00 % | 5,00 % | 0,45 % |
| FI Renda Fixa/ Referenciados RF - Art 7º, III, "a" | RENDA FIXA | 80,00 % | 80,00 % | 2,42 % |
| TOTAL | | | | 99,62 % |

META ATUARIAL

| | PATRIMÔNIO INICIAL | APLICAÇÕES | RESGATES / AMORTIZAÇÃO | RENTABILIDADE CARTEIRA | PATRIMÔNIO FINAL | RENTABILIDADE CARTEIRA | RENTABILIDADE ACUMULADA | META ATUARIAL | DIFERENÇA |
|-----------|--------------------|---------------|------------------------|------------------------|------------------|------------------------|-------------------------|---------------|-----------|
| Janeiro | 178.506.308,67 | 3.093.145,06 | 3.599.079,93 | 2.849.025,77 | 180.849.399,57 | 1,60% | 1,60% | 0,49% | 1,11% |
| Fevereiro | 180.849.399,57 | 4.464.526,90 | 3.261.227,55 | 3.967.808,32 | 186.020.507,24 | 2,18% | 3,78% | 1,31% | 2,47% |
| Março | 186.020.507,24 | 4.735.798,59 | 1.583.952,17 | 2.335.703,54 | 191.508.057,20 | 1,23% | 5,01% | 2,04% | 2,97% |
| Abril | 191.508.057,20 | 2.703.650,11 | 1.724.087,82 | 677.993,08 | 193.165.612,57 | 0,35% | 5,37% | 2,67% | 2,70% |
| Mai | 193.165.612,57 | 4.435.136,38 | 1.883.043,78 | 4.752,82 | 195.722.457,99 | 0,00% | 5,37% | 3,47% | 1,90% |
| Junho | 195.722.457,99 | 3.529.569,14 | 2.572.274,91 | 1.236.493,69 | 197.916.245,91 | 0,63% | 6,00% | 3,72% | 2,28% |
| Julho | 197.916.245,91 | 15.486.151,66 | 14.312.616,13 | 4.961.237,69 | 204.051.019,13 | 2,49% | 8,49% | 4,45% | 4,04% |
| Agosto | 204.051.019,13 | 5.014.776,81 | 3.293.988,88 | 2.153.541,60 | 207.925.348,66 | 1,05% | 9,54% | 5,13% | 4,41% |
| Setembro | 207.925.348,66 | 2.611.598,81 | 1.844.539,53 | 2.361.751,45 | 211.054.159,39 | 1,13% | 10,67% | 5,77% | 4,90% |
| Outubro | 211.054.159,39 | 3.821.574,59 | 1.912.678,58 | 528.279,68 | 213.491.335,08 | 0,25% | 10,92% | 6,68% | 4,24% |
| Novembro | 213.491.335,08 | 4.658.919,90 | 1.890.552,40 | -134.144,81 | 216.125.557,77 | -0,06% | 10,85% | 7,45% | 3,40% |

Rentabilidade da Carteira

