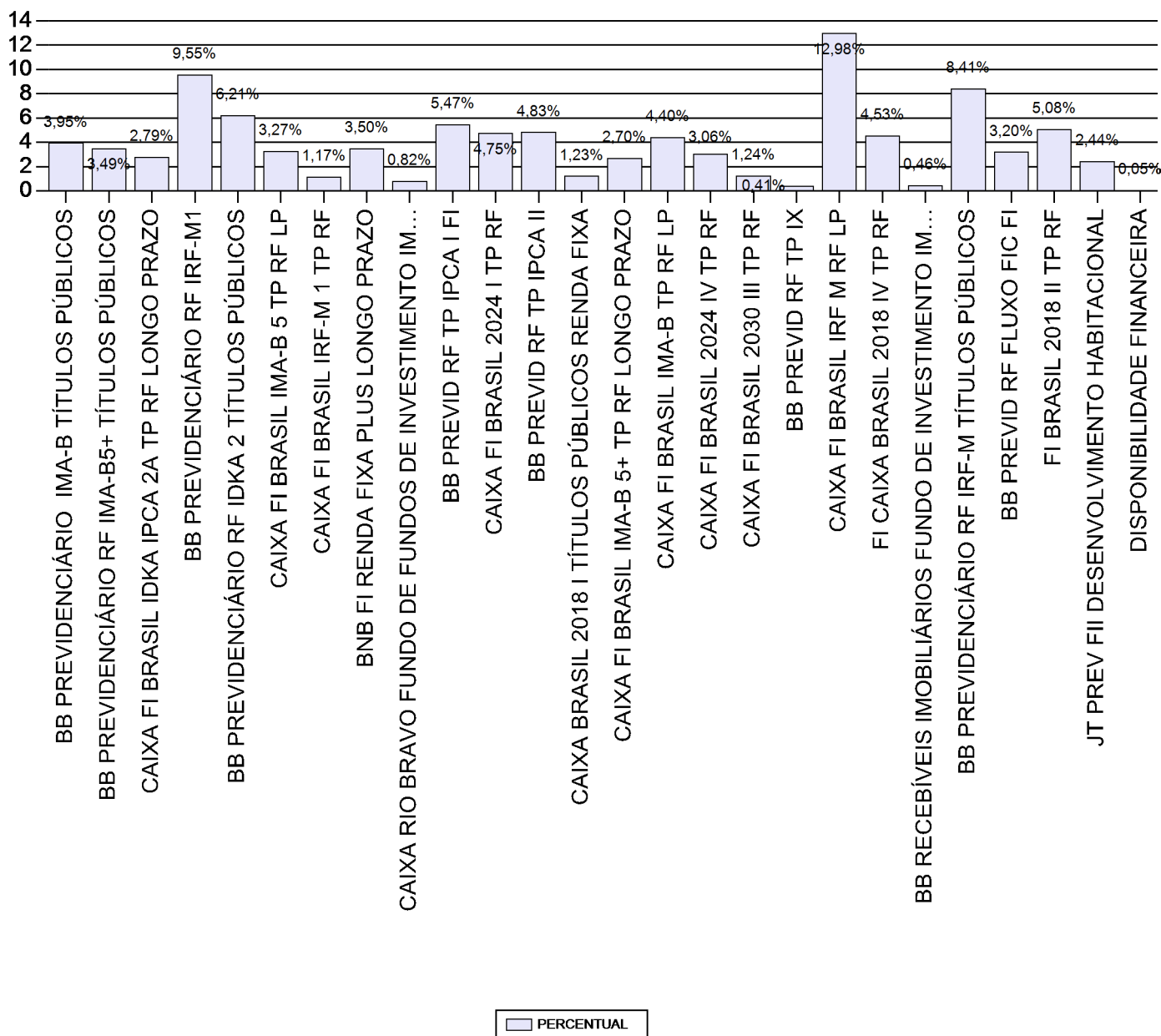


PORTFÓLIO DE INVESTIMENTO 10/2017

APLICAÇÃO	SEGMENTO	%	QTD. COTAS/TÍTULOS	VALOR UNIT.	SALDO ATUAL
BB PREVIDENCIÁRIO IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS	RENTA FIXA	2,49	1.288.397,904162000	4,455276850	5.266.768,82
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS	RENTA FIXA	2,28	13.673.072,459696000	2,285560200	4.816.766,91
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LONGO PRAZO	RENTA FIXA	2,79	4.063.082,309162000	1,805936000	5.903.368,22
BB PREVIDENCIÁRIO IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS	RENTA FIXA	1,46	222.290,616316000	4,455276850	3.090.377,01
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M1	RENTA FIXA	9,06	16.953.971,215540000	2,290320850	19.148.115,18
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS	RENTA FIXA	5,10	5.374.355,981438000	2,180775860	10.790.160,28
CAIXA FI BRASIL IMA-B 5 TP RF LP	RENTA FIXA	3,27	5.722.534,966580000	2,398268000	6.915.339,57
CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	RENTA FIXA	0,59	699.027,888806000	2,190150000	1.239.984,41
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M1	RENTA FIXA	0,49	-603.593,827947000	2,290320850	1.034.640,49
BNB FI RENDA FIXA PLUS LONGO PRAZO	RENTA FIXA	3,50	247.181,492664000	4,566709000	7.394.299,65
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FII	RENTA VARIÁVEL	0,82	1.500,000000000	1.149,111149480	1.723.666,72
BB PREVID RF TP IPCA I FI	RENTA FIXA	5,47	6.558.182,965338000	1,765514020	11.573.377,56
CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF	RENTA FIXA	4,75	6.688.211,384898000	1,435826000	10.050.782,00
BB PREVID RF TP IPCA II	RENTA FIXA	4,83	8.385.763,349151000	1,664635830	10.217.015,95
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	RENTA FIXA	1,23	1.826.244,159923000	1,299196000	2.598.392,00
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS	RENTA FIXA	1,21	881.693,999361000	2,285560200	2.557.911,16
CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	RENTA FIXA	0,57	544.096,594455000	2,190150000	1.201.520,20
CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	RENTA FIXA	0,02	15.451,465793000	2,190150000	34.099,72
CAIXA FI BRASIL IMA-B 5+ TP RF LONGO PRAZO	RENTA FIXA	2,70	1.174.959,134016000	1,803472000	5.707.748,52
CAIXA FI BRASIL IMA-B TP RF LP	RENTA FIXA	4,36	3.377.356,547122000	2,517404000	9.226.346,74
CAIXA FI BRASIL 2024 IV TP RF	RENTA FIXA	3,06	4.668.022,278609000	1,295024000	6.475.120,00
CAIXA FI BRASIL 2030 III TP RF	RENTA FIXA	1,24	1.863.203,681425000	1,310572000	2.621.144,00
BB PREVID RF TP IX	RENTA FIXA	0,41	623.634,148721000	1,374838570	857.202,97
CAIXA FI BRASIL IRF M RF LP	RENTA FIXA	12,87	13.360.498,791850000	1,767166000	27.210.637,40
FI CAIXA BRASIL 2018 IV TP RF	RENTA FIXA	4,53	7.530.993,561011000	1,197650000	9.581.200,00
CAIXA FI BRASIL IMA-B TP RF LP	RENTA FIXA	0,04	29.749,668204000	2,517404000	74.891,93
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FII	RENTA FIXA	0,46	10.000,000000000	97,565020600	975.650,21
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS	RENTA FIXA	1,11	1.071.592,236093000	2,180775860	2.336.902,48
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS	RENTA FIXA	7,08	3.241.713,186916000	4,616782120	14.965.338,28
CAIXA FI BRASIL IRF M RF LP	RENTA FIXA	0,11	135.562,064040000	1,767166000	239.560,67
BB PREVID RF FLUXO FIC FI	RENTA FIXA	0,09	98.236,751688000	1,867445790	183.451,81
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS	RENTA FIXA	1,34	611.345,510776000	4,616782120	2.822.449,02

APLICAÇÃO	SEGMENTO	%	QTD. COTAS/TÍTULOS	VALOR UNIT.	SALDO ATUAL
FI BRASIL 2018 II TP RF	RENDA FIXA	5,08	0,000000000	1,205437000	10.734.087,92
BB PREVID RF FLUXO FIC FI	RENDA FIXA	3,11	2.417.694,045639000	1,867445790	6.583.311,03
JT PREV FII DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL	RENDA FIXA	2,44	48.676,866159000	105,846022540	5.152.044,34
TOTAL INVESTIMENTOS		99,95			211.303.673,17
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA		0,05			114.968,17
TOTAL GERAL		100,00			211.418.641,34

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 %	84,06 %
FI de Renda Fixa - Art 7º, IV, "a"	RENDA FIXA	30,00 %	30,00 %	12,17 %
FI Imobiliário - Cotas Negociadas em Bolsa - Art. 8º, VI	RENDA VARIÁVEL	5,00 %	5,00 %	0,82 %
FI em Direitos Creditórios - Fechado - Art. 7º, VII, "a"	RENDA FIXA	5,00 %	5,00 %	0,46 %
FI Renda Fixa/ Referenciados RF - Art 7º, III, "a"	RENDA FIXA	80,00 %	80,00 %	2,44 %
TOTAL				99,95 %

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%

Rentabilidade da Carteira

