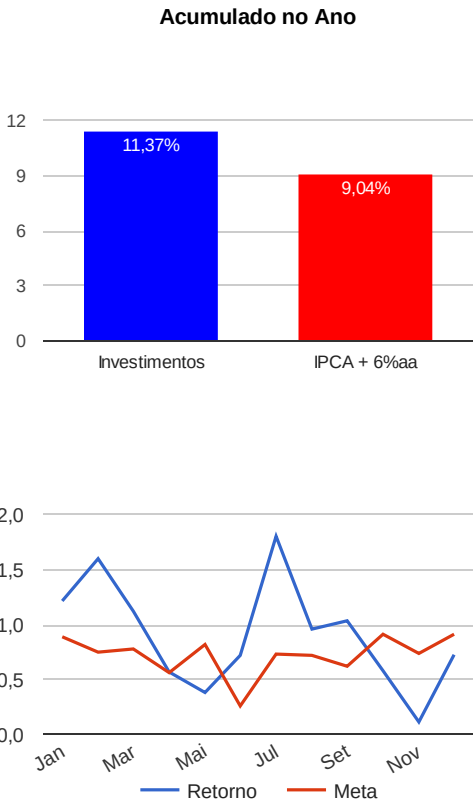


Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	156.156.395,32	2.002.646,52	68.000,00	160.009.594,81	1.918.552,97	1,21%	0,89%	136,06%	1,47%
Fevereiro	160.009.594,81	4.383.262,92	2.947.856,49	164.020.417,88	2.575.416,64	1,60%	0,75%	213,14%	2,19%
Março	164.020.417,88	17.358.152,66	15.974.153,94	167.257.707,70	1.853.291,10	1,12%	0,78%	142,81%	1,08%
Abril	167.257.707,70	1.424.968,72	116.350,00	169.529.170,25	962.843,83	0,57%	0,56%	102,43%	0,80%
Mai	169.529.170,25	1.465.610,52	115.000,00	171.538.198,86	658.418,09	0,39%	0,82%	46,90%	3,96%
Junho	171.538.198,86	1.446.126,43	117.603,30	174.113.749,79	1.247.027,80	0,72%	0,26%	282,19%	0,96%
Julho	174.113.749,79	1.499.887,56	125.183,92	178.653.288,69	3.164.835,26	1,80%	0,73%	247,75%	1,11%
Agosto	178.653.288,69	4.344.457,37	3.017.146,31	181.704.909,29	1.724.309,54	0,96%	0,72%	132,28%	1,63%
Setembro	181.704.909,29	1.467.983,90	137.950,00	184.931.196,83	1.896.253,64	1,04%	0,62%	165,96%	0,78%
Outubro	184.931.196,83	4.522.391,14	3.220.000,00	187.314.862,55	1.081.274,58	0,58%	0,91%	63,89%	1,00%
Novembro	187.314.862,55	1.714.564,47	148.750,00	189.099.386,55	218.709,53	0,12%	0,74%	15,65%	0,89%
Dezembro	189.099.386,55	1.691.831,46	263.000,00	191.910.687,86	1.382.469,85	0,73%	0,91%	80,13%	0,65%
Acumulado no ano					18.683.402,83	11,37%	9,04%	125,68%	



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(%)
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.035.770,64	0,00	0,00	1.048.436,64	12.666,00	1,22%	0,84%	1,22%
CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.349.745,69	0,00	0,00	1.363.920,14	14.174,45	1,05%	0,57%	1,05%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.328.459,09	0,00	0,00	4.373.892,75	45.433,66	1,05%	1,11%	1,05%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	6.103.140,88	0,00	0,00	6.165.542,22	62.401,34	1,02%	0,63%	1,02%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.637.641,83	0,00	0,00	5.688.371,46	50.729,63	0,90%	0,80%	0,90%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.035.839,82	0,00	0,00	2.053.527,40	17.687,58	0,87%	0,67%	0,87%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2.793.983,65	0,00	0,00	2.818.248,70	24.265,05	0,87%	0,67%	0,87%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	3.799.540,13	0,00	0,00	3.829.758,74	30.218,61	0,80%	0,42%	0,80%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.236.890,00	0,00	0,00	7.292.720,00	55.830,00	0,77%	1,79%	0,77%
BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	13.831.546,83	0,00	0,00	13.937.607,57	106.060,74	0,77%	0,21%	0,77%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.388.945,90	0,00	0,00	2.406.813,83	17.867,93	0,75%	0,45%	0,75%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.555.173,37	0,00	0,00	10.630.237,95	75.064,58	0,71%	0,11%	0,71%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.619.720,00	0,00	0,00	2.638.124,00	18.404,00	0,70%	0,11%	0,70%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.052.468,85	0,00	0,00	3.073.702,91	21.234,06	0,70%	0,33%	0,70%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.023.968,75	0,00	0,00	8.072.068,75	48.100,00	0,60%	1,37%	0,60%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.117.055,00	0,00	0,00	7.159.660,00	42.605,00	0,60%	1,37%	0,60%
BANESTES FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	547.335,36	0,00	0,00	550.596,15	3.260,79	0,60%	2,16%	0,60%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	243.945,13	0,00	0,00	245.367,09	1.421,96	0,58%	0,07%	0,58%
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	17.640.926,23	0,00	263.000,00	17.475.506,87	97.580,64	0,55%	0,02%	0,56%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.842.653,26	845.915,73	0,00	8.736.103,11	47.534,12	0,55%	0,03%	0,57%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	4.705.611,54	0,00	0,00	4.730.639,63	25.028,09	0,53%	0,01%	0,53%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.356.625,19	845.915,73	0,00	5.229.806,95	27.266,03	0,52%	0,04%	0,56%

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 FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.333.257,53	0,00	0,00	4.355.946,58	22.689,05	0,52%	0,02%	0,52%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.415.026,02	0,00	0,00	4.430.531,57	15.505,55	0,35%	0,13%	0,35%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	21.120.043,58	0,00	0,00	21.194.156,91	74.113,33	0,35%	0,13%	0,35%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	33.402.898,46	0,00	0,00	33.520.020,92	117.122,46	0,35%	0,13%	0,35%
Total Renda Fixa					1.074.264,65	0,59%	0,38%	

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(%)
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	394.070,15	0,00	0,00	415.169,34	21.099,19	5,35%	6,19%	5,35%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	2.111.722,76	0,00	0,00	2.222.235,32	110.512,56	5,23%	5,09%	5,23%
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	1.946.722,71	0,00	0,00	2.027.844,42	81.121,71	4,17%	3,96%	4,17%
BB PIPE FIC AÇÕES	1.491.158,20	0,00	0,00	1.549.129,94	57.971,74	3,89%	5,19%	3,89%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	2.637.500,00	0,00	0,00	2.675.000,00	37.500,00	1,42%	8,88%	1,42%
Total Renda Variável					308.205,20	3,59%	6,04%	

