

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



Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

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 Artigo 20
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			26.349,51	0,09%			
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2030	510.490,40	1,71%	18	0,95%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	797.578,48	2,68%	143	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	257.709,52	0,87%	193	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	D+1	Não há	4.049.052,56	13,60%	250	1,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	2.868.629,56	9,64%	147	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BANRISUL PREVIDÊNCIA IPCA 2024 FI RENDA FIXA LP	D+0	15/08/2024	650.675,00	2,19%	96	0,57%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	369.124,14	1,24%	107	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	909.168,75	3,05%	223	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2018	1.319.062,00	4,43%	163	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	853.776,21	2,87%	94	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL III FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	106.155,45	0,36%	125	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.923.752,90	9,82%	235	0,27%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.957.082,41	13,29%	96	2,12%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
AUSTRO IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	418.352,58	1,41%	26	0,32%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	D+0	Não há	1.914.643,75	6,43%	313	0,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	5.135.502,12	17,25%	748	0,09%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BANRISUL ÍNDICE FIAÇÕES	D+4	Não há	67.278,56	0,23%	334	0,69%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	140.208,59	0,47%	29	0,25%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB CONSUMO FIC AÇÕES	D+4	Não há	67.954,65	0,23%	2.896	0,05%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	23/08/2017	520.279,23	1,75%	116	0,14%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB PETROBRAS FIAÇÕES	D+4	Não há	34.232,59	0,11%	54.708	0,01%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "

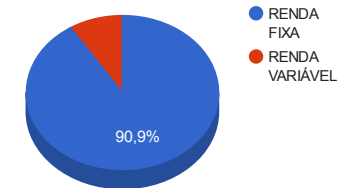
Carteira consolidada de investimentos - base (dezembro / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB PIPE FIC AÇÕES	D+4	03/06/2018	896.029,61	3,01%	43	0,76%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BANRISUL INFRA-ESTRUTURA FIAÇÕES	D+4	Não há	29.793,32	0,10%	553	0,32%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
GERAÇÃO FIAÇÕES	D+4	Não há	135.343,19	0,45%	104	0,12%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BRS PARTICIPAÇÕES FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+1	4 anos	141.939,06	0,48%	33	0,13%	Artigo 8º, Inciso III
AGÊNCIAS CAIXA FII - AGCX11	Não se aplica	Não se aplica	125.212,00	0,42%		0,02%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
BANRISUL NOVAS FRONTEIRAS FII - BNFS11	Não se aplica	Não se aplica	439.800,00	1,48%		0,52%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se aplica	Não se aplica	107.000,00	0,36%		0,06%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
<b>TOTAL -</b>			<b>29.772.176,14</b>				

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 20	100,00%	26.349,51	0,09%	0,00%	0,00%	0,00%	-26.349,51
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	12.585.266,62	42,27%	25,00%	40,00%	70,00%	8.255.256,68
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	15,00%	35,00%	60,00%	17.863.305,68
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	14.455.489,21	48,55%	5,00%	5,00%	30,00%	-5.523.836,37
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	1.488.608,81
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>27.067.105,34</b>	<b>90,91%</b>	<b>45,00</b>	<b>85,00</b>	<b>165,00</b>	<b>-</b>

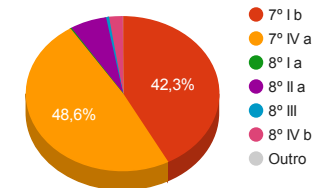
Distribuição por Segmento



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%	67.278,56	0,23%	0,00%	0,00%	0,00%	-67.278,56
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	1.823.841,18	6,13%	0,00%	0,00%	0,00%	-1.823.841,18
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	141.939,06	0,48%	5,00%	7,00%	15,00%	4.323.887,36
Artigo 8º, Inciso IV	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	3,00%	5,00%	1.488.608,81
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	672.012,00	2,26%	0,00%	0,00%	0,00%	-672.012,00
Artigo 8º, Inciso VI	0,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	1.488.608,81
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>2.705.070,80</b>	<b>9,09%</b>	<b>9,00</b>	<b>15,00</b>	<b>25,00</b>	<b>-</b>

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 20	26.349,51	0,09%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	12.585.266,62	42,27%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	14.455.489,21	48,55%	0,00%	0,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>27.067.105,34</b>	<b>90,91%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>

Artigos - Renda Variável	Base: dezembro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	67.278,56	0,23%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	1.823.841,18	6,13%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso III	141.939,06	0,48%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	672.012,00	2,26%	0,00%	0,00%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>2.705.070,80</b>	<b>9,09%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>

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	10.264.991,16	34,48%	0,00%
BANRISUL CORRETORA	8.860.037,30	29,76%	0,09%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	8.839.872,11	29,69%	0,00%
AUSTRO CAPITAL	560.291,64	1,88%	0,11%
VINCI PARTNERS	520.279,23	1,75%	0,00%
OLIVEIRA TRUST	439.800,00	1,48%	0,01%
GERAÇÃO FUTURO	135.343,19	0,45%	0,00%
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	125.212,00	0,42%	0,01%

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
IDKA IPCA 2 Anos	1,16%	13,61%	2,24%	6,80%	13,61%	30,90%	-	-	-
BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	0,91%	12,44%	1,83%	6,24%	12,44%	29,65%	0,20%	0,458%	2,75%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,35%	10,19%	1,57%	4,46%	10,19%	24,79%	0,20%	0,130%	1,72%
IPCA + 6,00% ao ano	0,91%	9,05%	2,58%	4,73%	9,05%	22,83%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,71%	9,30%	2,44%	4,44%	9,30%	23,99%	0,20%	0,109%	0,31%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,70%	2,99%	2,41%	1,41%	2,99%	10,08%	0,20%	0,111%	3,96%
IMA Geral ex-C	0,89%	12,89%	1,03%	5,83%	12,89%	36,69%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,90%	12,26%	0,78%	5,71%	12,26%	-	0,30%	0,804%	4,92%
IMA Geral	0,88%	12,82%	1,02%	5,88%	12,82%	36,50%	-	-	-
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA LP	0,91%	13,27%	1,06%	5,74%	13,27%	36,22%	0,20%	0,688%	4,37%
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%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,90%	13,60%	0,68%	7,17%	13,60%	37,37%	0,20%	1,029%	5,71%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,85%	12,80%	-0,36%	6,95%	12,80%	40,39%	0,30%	1,415%	9,26%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	0,82%	12,36%	-0,31%	6,73%	12,36%	39,48%	0,20%	1,392%	8,83%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL III FI RENDA FIXA LP	0,80%	12,30%	-0,35%	6,54%	12,30%	38,57%	0,35%	1,369%	8,94%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,77%	6,48%	-0,87%	3,89%	6,48%	30,89%	0,20%	1,786%	11,44%

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%
AUSTRO IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	-0,21%	7,15%	0,86%	3,82%	7,15%	24,85%	0,30%	1,539%	3,03%
CDI	0,54%	9,93%	1,76%	4,05%	9,93%	25,31%	-	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,52%	9,94%	1,74%	4,01%	9,94%	25,33%	0,20%	0,021%	0,13%
IPCA	0,44%	2,95%	1,14%	1,74%	2,95%	9,42%	-	-	-
BANRISUL PREVIDÊNCIA IPCA 2024 FI RENDA FIXA LP	0,72%	3,20%	2,45%	1,48%	3,20%	10,32%	0,15%	0,111%	3,99%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-



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

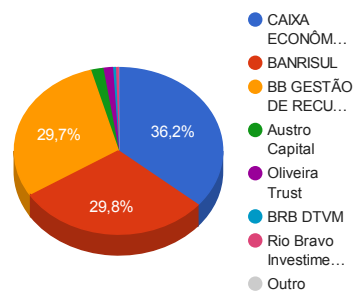
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
ICON	6,81%	33,14%	0,41%	24,09%	33,14%	50,76%	-	-	-
BB CONSUMO FIC AÇÕES	6,69%	30,90%	-0,12%	22,92%	30,90%	46,40%	1,00%	6,017%	17,28%
IBX	6,35%	27,55%	2,62%	21,00%	27,55%	74,36%	-	-	-
BANRISUL INFRA-ESTRUTURA FIAÇÕES	4,30%	25,27%	3,35%	19,24%	25,27%	52,10%	2,50%	5,657%	17,88%
Ibovespa	6,16%	26,86%	2,84%	21,47%	26,86%	76,25%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	5,35%	20,80%	1,77%	21,07%	20,80%	51,67%	1,00%	6,189%	18,81%
BANRISUL ÍNDICE FIAÇÕES	5,24%	22,37%	2,27%	20,07%	22,37%	70,76%	0,85%	6,562%	18,11%
BB PIPE FIC AÇÕES	3,89%	30,82%	-0,12%	18,81%	30,82%	61,31%	1,20%	5,186%	15,92%
GERAÇÃO FIAÇÕES	3,85%	1,63%	-3,33%	4,72%	1,63%	7,60%	3,00%	7,446%	19,43%
IDIV	4,94%	25,30%	-1,77%	16,88%	25,30%	101,09%	-	-	-
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	5,23%	19,71%	1,25%	14,58%	19,71%	34,53%	1,72%	5,093%	16,92%
PETROBRAS PN - PETR4	4,68%	8,27%	5,23%	30,15%	8,27%	140,30%	-	-	-
BB PETROBRAS FIAÇÕES	5,43%	0,54%	5,89%	27,47%	0,54%	103,67%	2,00%	10,042%	32,86%
IFIX	0,60%	19,41%	0,24%	7,34%	19,41%	58,02%	-	-	-
AGÊNCIAS CAIXA FII - AGCX11	0,18%	1,80%	-2,03%	-7,04%	1,80%	-	0,35%	9,511%	20,80%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	0,00%	4,90%	-2,72%	0,00%	4,90%	33,75%	1,20%	8,878%	23,30%
IPCA	0,44%	2,95%	1,14%	1,74%	2,95%	9,42%	-	-	-

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

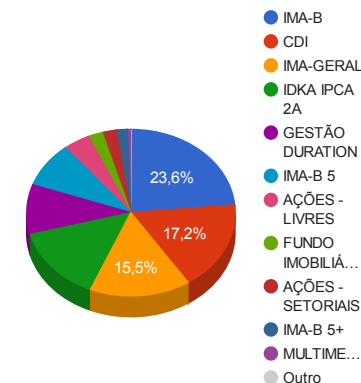
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BRS PARTICIPAÇÕES FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	0,22%	12,88%	14,86%	14,16%	12,88%	32,21%	1,50%	0,192%	15,38%
Não informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BANRISUL NOVAS FRONTEIRAS FII - BNFS11	-5,52%	0,00%	6,19%	3,90%	0,00%	35,69%	0,40%	23,199%	35,96%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	10.785.270,39	36,23%
BANRISUL	8.860.037,30	29,76%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	8.839.872,11	29,69%
Austro Capital	560.291,64	1,88%
Oliveira Trust	439.800,00	1,48%
BRB DTVM	135.343,19	0,45%
Rio Bravo Investimentos	125.212,00	0,42%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	26.349,51	0,09%

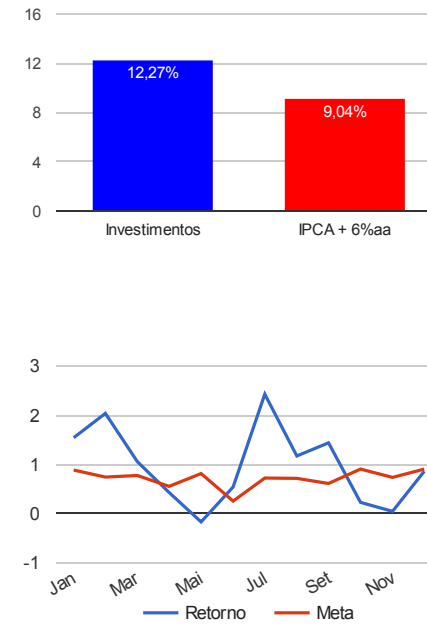


Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	7.014.259,37	23,56%
CDI	5.135.502,12	17,25%
IMA-GERAL	4.607.757,41	15,48%
IDKA IPCA 2A	4.306.762,08	14,47%
GESTÃO DURATION	2.868.629,56	9,64%
IMA-B 5	2.597.354,89	8,72%
AÇÕES - LIVRES	1.238.859,95	4,16%
FUNDO IMOBILIÁRIO	672.012,00	2,26%
AÇÕES - SETORIAIS	652.259,79	2,19%
IMA-B 5+	510.490,40	1,71%
MULTIMERCADO	141.939,06	0,48%
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA	26.349,51	0,09%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

**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 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	365.283,34	0,00	0,00	369.124,14	3.840,80	1,05%	0,57%	1,05%
BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	4.012.423,19	0,00	0,00	4.049.052,56	36.629,37	0,91%	0,46%	0,91%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA LP	3.929.921,93	0,00	8.500,00	3.957.082,41	35.660,48	0,91%	0,69%	0,91%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	846.160,04	0,00	0,00	853.776,21	7.616,17	0,90%	1,03%	0,90%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.826.131,64	16.951,26	0,00	2.868.629,56	25.546,66	0,90%	0,80%	0,90%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.899.201,68	0,00	0,00	2.923.752,90	24.551,22	0,85%	1,41%	0,85%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1.899.013,45	0,00	0,00	1.914.643,75	15.630,30	0,82%	1,39%	0,82%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL III FI RENDA FIXA LP	107.924,67	0,00	2.630,24	106.155,45	861,02	0,80%	1,37%	0,80%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	506.582,30	0,00	0,00	510.490,40	3.908,10	0,77%	1,79%	0,77%
BANRISUL PREVIDÊNCIA IPCA 2024 FI RENDA FIXA LP	646.045,00	0,00	0,00	650.675,00	4.630,00	0,72%	0,11%	0,72%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	791.946,44	0,00	0,00	797.578,48	5.632,04	0,71%	0,11%	0,71%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.309.860,00	0,00	0,00	1.319.062,00	9.202,00	0,70%	0,11%	0,70%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.533.454,06	577.000,00	0,00	5.135.502,12	25.048,06	0,49%	0,02%	0,52%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	256.807,61	0,00	0,00	257.709,52	901,91	0,35%	0,13%	0,35%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	905.989,50	0,00	0,00	909.168,75	3.179,25	0,35%	0,13%	0,35%
AUSTRO IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	418.835,13	0,00	0,00	418.352,58	-482,55	-0,12%	1,54%	-0,12%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>202.354,83</b>	<b>0,75%</b>	<b>0,63%</b>	

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 CONSUMO FIC AÇÕES	63.694,51	0,00	0,00	67.954,65	4.260,14	6,69%	6,02%	6,69%
BB PETROBRAS FIAÇÕES	32.467,97	0,00	0,00	34.232,59	1.764,62	5,43%	10,04%	5,43%
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	133.083,09	0,00	0,00	140.208,59	7.125,50	5,35%	6,19%	5,35%
BANRISUL ÍNDICE FIAÇÕES	63.927,39	0,00	0,00	67.278,56	3.351,17	5,24%	6,56%	5,24%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	494.405,56	0,00	0,00	520.279,23	25.873,67	5,23%	5,09%	5,23%
BANRISUL INFRA-ESTRUTURA FIAÇÕES	28.564,87	0,00	0,00	29.793,32	1.228,45	4,30%	5,66%	4,30%
BB PIPE FIC AÇÕES	862.498,28	0,00	0,00	896.029,61	33.531,33	3,89%	5,19%	3,89%
GERAÇÃO FIAÇÕES	130.331,64	0,00	0,00	135.343,19	5.011,55	3,85%	7,45%	3,85%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	105.500,00	0,00	0,00	107.000,00	1.500,00	1,42%	8,88%	1,42%
AGÊNCIAS CAIXA FII - AGCX11	124.101,00	0,00	0,00	125.212,00	1.111,00	0,90%	9,51%	0,90%
BRS PARTICIPAÇÕES FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	141.629,33	0,00	0,00	141.939,06	309,73	0,22%	0,19%	0,22%
BANRISUL NOVAS FRONTEIRAS FII - BNFS11	472.418,50	0,00	0,00	439.800,00	-32.618,50	-6,90%	23,20%	-6,90%
<b>Total Renda Variável</b>					<b>52.448,66</b>	<b>1,98%</b>	<b>8,47%</b>	

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 BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.185.000,49	880.896,22	8.600,00	5.135.502,12	78.205,41	1,70%	1,74%
BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	3.976.220,67	0,00	0,00	4.049.052,56	72.831,89	1,83%	1,83%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA LP	3.923.963,05	0,00	8.500,00	3.957.082,41	41.619,36	1,06%	1,06%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.288.040,00	0,00	0,00	1.319.062,00	31.022,00	2,41%	2,41%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.812.536,39	33.902,52	0,00	2.868.629,56	22.190,65	0,78%	0,78%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	778.559,67	0,00	0,00	797.578,48	19.018,81	2,44%	2,44%
BANRISUL PREVIDÊNCIA IPCA 2024 FI RENDA FIXA LP	635.100,00	0,00	0,00	650.675,00	15.575,00	2,45%	2,45%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	895.054,50	0,00	0,00	909.168,75	14.114,25	1,58%	1,58%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	363.270,50	0,00	0,00	369.124,14	5.853,64	1,61%	1,61%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	847.987,57	0,00	0,00	853.776,21	5.788,64	0,68%	0,68%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	253.718,76	0,00	0,00	257.709,52	3.990,76	1,57%	1,57%
AUSTRO IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	414.367,98	0,00	0,00	418.352,58	3.984,60	0,96%	0,86%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL III FI RENDA FIXA LP	114.776,58	0,00	8.198,36	106.155,45	-422,77	-0,35%	-0,35%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	514.960,60	0,00	0,00	510.490,40	-4.470,20	-0,87%	-0,87%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1.920.670,57	0,00	0,00	1.914.643,75	-6.026,82	-0,31%	-0,31%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.934.254,12	0,00	0,00	2.923.752,90	-10.501,22	-0,36%	-0,36%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>292.774,00</b>	<b>1,10%</b>	

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 (%)
BANRISUL NOVAS FRONTEIRAS FII - BNFS11	415.977,50	0,00	0,00	439.800,00	23.822,50	5,73%	6,19%
BRS PARTICIPAÇÕES FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	123.577,00	0,00	0,00	141.939,06	18.362,06	14,86%	14,86%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	513.876,28	0,00	0,00	520.279,23	6.402,95	1,25%	1,25%
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	137.768,86	0,00	0,00	140.208,59	2.439,73	1,77%	1,77%
BB PETROBRAS FIAÇÕES	32.328,46	0,00	0,00	34.232,59	1.904,13	5,89%	5,89%
BANRISUL ÍNDICE FIAÇÕES	65.784,47	0,00	0,00	67.278,56	1.494,09	2,27%	2,27%
BANRISUL INFRA-ESTRUTURA FIAÇÕES	28.826,64	0,00	0,00	29.793,32	966,68	3,35%	3,35%
BB CONSUMO FIC AÇÕES	68.036,54	0,00	0,00	67.954,65	-81,89	-0,12%	-0,12%
BB PIPE FIC AÇÕES	897.070,45	0,00	0,00	896.029,61	-1.040,84	-0,12%	-0,12%
AGÊNCIAS CAIXA FII - AGCX11	127.966,00	0,00	0,00	125.212,00	-2.754,00	-2,15%	-2,03%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	109.997,00	0,00	0,00	107.000,00	-2.997,00	-2,72%	-2,72%
GERAÇÃO FIAÇÕES	140.005,88	0,00	0,00	135.343,19	-4.662,69	-3,33%	-3,33%
<b>Total Renda Variável</b>					<b>43.855,72</b>	<b>1,65%</b>	



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 IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.782.395,00	1.051.400,00	6.230.368,97	0,00	396.573,97	8,63%	12,34%
BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	1.601.278,67	2.114.200,75	0,00	4.049.052,56	333.573,14	12,29%	12,44%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.766.038,50	864.835,36	0,00	2.923.752,90	292.879,04	12,63%	12,80%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA LP	0,00	3.740.000,00	8.500,00	3.957.082,41	225.582,41	6,03%	13,27%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.039.431,31	1.611.010,86	0,00	2.868.629,56	218.187,39	11,84%	12,26%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL FI RENDA FIXA LP	3.288.936,74	3.800,00	3.505.346,50	0,00	212.609,76	6,46%	12,95%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	5.027.596,22	8.600,00	5.135.502,12	116.505,90	2,65%	9,94%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	0,00	2.100.000,00	300.000,00	1.914.643,75	114.643,75	6,61%	12,36%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.280.769,00	0,00	72.879,29	1.319.062,00	111.172,29	8,97%	2,99%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	793.094,60	0,00	44.292,14	853.776,21	104.973,75	13,55%	13,60%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.782.427,00	33.379,33	1.910.275,35	0,00	94.469,02	5,27%	12,40%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL III FI RENDA FIXA LP	1.471.782,62	180.560,22	1.639.722,67	106.155,45	93.535,28	12,31%	12,30%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	871.982,25	0,00	49.256,15	909.168,75	86.442,65	10,20%	4,26%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	772.770,02	0,00	44.574,88	797.578,48	69.383,34	9,28%	9,30%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	479.405,50	0,00	26.129,65	510.490,40	57.214,55	12,10%	6,48%
BANRISUL PREVIDÊNCIA IPCA 2024 FI RENDA FIXA LP	630.470,00	0,00	35.837,38	650.675,00	56.042,38	9,18%	3,20%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	343.662,76	0,00	19.658,11	369.124,14	45.119,49	13,50%	7,41%
BANRISUL FOCO IMA-B FI RENDA FIXA LP	716.993,34	0,00	754.382,18	0,00	37.388,84	5,21%	11,86%
AUSTRO IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	390.035,46	0,00	0,00	418.352,58	28.317,12	7,26%	7,15%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	247.494,22	0,00	14.220,53	257.709,52	24.435,83	10,16%	10,19%
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>2.719.049,90</b>	<b>11,83%</b>	

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 (%)
BB PIPE FIC AÇÕES	684.917,14	0,00	0,00	896.029,61	211.112,47	30,82%	30,82%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	169.519,65	300.000,00	0,00	520.279,23	50.759,58	15,17%	19,71%
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	116.062,40	0,00	0,00	140.208,59	24.146,19	20,80%	20,80%
BRS PARTICIPAÇÕES FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	125.738,93	0,00	0,00	141.939,06	16.200,13	12,88%	12,88%
BB CONSUMO FIC AÇÕES	51.912,95	0,00	0,00	67.954,65	16.041,70	30,90%	30,90%
BANRISUL NOVAS FRONTEIRAS FII - BNFS11	425.249,95	0,00	0,00	439.800,00	14.550,05	3,42%	0,00%
BANRISUL ÍNDICE FIAÇÕES	54.978,61	0,00	0,00	67.278,56	12.299,95	22,37%	22,37%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	189.564,09	0,00	200.320,27	0,00	10.756,18	5,67%	12,08%
BANRISUL INFRA-ESTRUTURA FIAÇÕES	23.782,85	0,00	0,00	29.793,32	6.010,47	25,27%	25,27%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRH11	102.000,00	0,00	0,00	107.000,00	5.000,00	4,90%	4,90%
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE	0,00	200.108,00	204.714,00	0,00	4.606,00	2,30%	26,54%
AGÊNCIAS CAIXA FII - AGCX11	122.831,00	0,00	0,00	125.212,00	2.381,00	1,94%	1,80%
GERAÇÃO FIAÇÕES	133.176,67	0,00	0,00	135.343,19	2.166,52	1,63%	1,63%
BB PETROBRAS FIAÇÕES	34.049,02	0,00	0,00	34.232,59	183,57	0,54%	0,54%
CAIXA LOGÍSTICA FICFIP	437,67	0,00	437,67	0,00	0,00	0,00%	-
<b>Total Renda Variável</b>					<b>376.213,81</b>	<b>16,45%</b>	

