

## Relatório Analítico dos Investimentos em setembro e 3º Trimestre de 2017



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

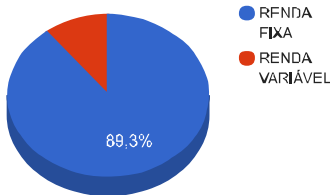
Carteira consolidada de investimentos - base (setembro / 2017)

| Produto / Fundo                                             | Disponibilidade Resgate | Carência        | Saldo         | Particip.<br>S/ Total | Qtde.<br>Cotistas | % S/ PL<br>Fundo | RESOLUÇÃO<br>3.922/2010 - 4.392/2014 |
|-------------------------------------------------------------|-------------------------|-----------------|---------------|-----------------------|-------------------|------------------|--------------------------------------|
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | D+0                     | Não há          | 353.232,27    | 0,71%                 | 601               | 0,01%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "    |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA         | D+0                     | Não há          | 11.119.101,72 | 22,25%                | 1.382             | 0,07%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "    |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO     | D+1                     | Não há          | 13.481.838,97 | 26,97%                | 701               | 0,26%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "    |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO   | D+0                     | Não há          | 2.241.285,81  | 4,48%                 | 1.221             | 0,02%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "    |
| TOWER BRIDGE II IMA-B 5 FI RENDA FIXA                       | D+1471                  | Não há          | 301.275,44    | 0,60%                 | 29                | 0,26%            | Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "  |
| TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA                          | D+1471                  | Não há          | 1.119.592,36  | 2,24%                 | 34                | 0,20%            | Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "  |
| CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO                    | D+0                     | Não há          | 820.545,66    | 1,64%                 | 15.157            | 0,01%            | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "   |
| CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP              | D+0                     | Não há          | 7.551.917,37  | 15,11%                | 442               | 0,39%            | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "   |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO                      | D+0                     | Não há          | 236,64        | 0,00%                 | 642               | 0,00%            | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "   |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO                     | D+0                     | Não há          | 3.048.256,41  | 6,10%                 | 763               | 0,07%            | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "   |
| GGR PRIME I FIDC                                            | D+1601                  | 29 dias         | 2.004.380,53  | 4,01%                 | 35                | 0,62%            | Artigo 7º, Inciso VI                 |
| AR CAPITAL IMOBILIÁRIOS I FIDC Sênior                       | Não possui              | 1008 dias úteis | 1.804.235,15  | 3,61%                 | 8                 | 5,93%            | Artigo 7º, Inciso VI                 |
| LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR                     | D+1260                  | 90 dias         | 791.047,45    | 1,58%                 | 70                | 1,01%            | Artigo 7º, Inciso VI                 |
| LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO                       | D+1                     | Não há          | 340.213,89    | 0,68%                 | 13                | 1,16%            | Artigo 8º, Inciso IV                 |
| SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO                    | D+91 ou D+1441          | Não há          | 1.414.139,59  | 2,83%                 | 15                | 0,62%            | Artigo 8º, Inciso IV                 |
| W7 MULTISTRATÉGIA FIP                                       | Não se aplica           | Não se aplica   | 2.287.067,79  | 4,58%                 |                   |                  | Artigo 8º, Inciso V                  |
| ÁTICO RENDA FII- ATCR11                                     | Não se aplica           | Não se aplica   | 1.304.339,17  | 2,61%                 |                   | 8,78%            | Artigo 8º, Inciso VI                 |
| TOTAL -                                                     |                         |                 | 49.982.706,22 |                       |                   |                  |                                      |

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

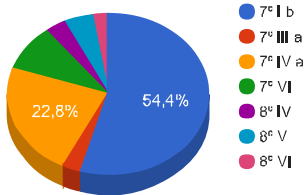
| Artigos - Renda Fixa                | Resolução %    | Carteira \$          | Carteira %    | Estratégia de Alocação |              |               | GAP Superior  |
|-------------------------------------|----------------|----------------------|---------------|------------------------|--------------|---------------|---------------|
|                                     |                |                      |               | Inferior %             | Alvo %       | Superior %    |               |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "   | 100,00%        | 27.195.458,77        | 54,41%        | 30,00%                 | 35,00%       | 70,00%        | 7.792.435,58  |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a " | 80,00%         | 1.420.867,80         | 2,84%         | 15,00%                 | 20,00%       | 60,00%        | 28.568.755,93 |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "  | 30,00%         | 11.420.956,08        | 22,85%        | 5,00%                  | 5,00%        | 30,00%        | 3.573.855,79  |
| Artigo 7º, Inciso VI                | 15,00%         | 4.599.663,13         | 9,20%         | 5,00%                  | 10,00%       | 15,00%        | 2.897.742,80  |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a " | 5,00%          | 0,00                 | 0,00%         | 0,00%                  | 2,50%        | 5,00%         | 2.499.135,31  |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b " | 5,00%          | 0,00                 | 0,00%         | 0,00%                  | 2,50%        | 5,00%         | 2.499.135,31  |
| <b>Total Renda Fixa</b>             | <b>100,00%</b> | <b>44.636.945,78</b> | <b>89,30%</b> | <b>55,00</b>           | <b>75,00</b> | <b>185,00</b> | <b>-</b>      |

Distribuição por Segmento



| Artigos - Renda Variável    | Resolução %   | Carteira \$         | Carteira %    | Estratégia de Alocação |              |              | GAP Superior |
|-----------------------------|---------------|---------------------|---------------|------------------------|--------------|--------------|--------------|
|                             |               |                     |               | Inferior %             | Alvo %       | Superior %   |              |
| Artigo 8º, Inciso III       | 15,00%        | 0,00                | 0,00%         | 5,00%                  | 10,00%       | 15,00%       | 7.497.405,93 |
| Artigo 8º, Inciso IV        | 5,00%         | 1.754.353,48        | 3,51%         | 2,00%                  | 5,00%        | 5,00%        | 744.781,83   |
| Artigo 8º, Inciso V         | 5,00%         | 2.287.067,79        | 4,58%         | 2,00%                  | 5,00%        | 5,00%        | 212.067,52   |
| Artigo 8º, Inciso VI        | 5,00%         | 1.304.339,17        | 2,61%         | 2,00%                  | 5,00%        | 5,00%        | 1.194.796,14 |
| <b>Total Renda Variável</b> | <b>30,00%</b> | <b>5.345.760,44</b> | <b>10,70%</b> | <b>11,00</b>           | <b>25,00</b> | <b>30,00</b> | <b>-</b>     |

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

| Artigos - Renda Fixa                | Base: setembro / 2017 |              | Limite Inferior (%) | Limite Superior (%) |
|-------------------------------------|-----------------------|--------------|---------------------|---------------------|
|                                     | Carteira (\$)         | Carteira (%) |                     |                     |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "   | 27.195.458,77         | 54,41%       | 30,00%              | 70,00%              |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a " | 1.420.867,80          | 2,84%        | 15,00%              | 60,00%              |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "  | 11.420.956,08         | 22,85%       | 5,00%               | 30,00%              |
| Artigo 7º, Inciso VI                | 4.599.663,13          | 9,20%        | 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                    | 44.636.945,78         | 89,30%       | 55,00               | 185,00              |

| Artigos - Renda Variável | Base: setembro / 2017 |              | Limite Inferior (%) | Limite Superior (%) |
|--------------------------|-----------------------|--------------|---------------------|---------------------|
|                          | Carteira (\$)         | Carteira (%) |                     |                     |
| Artigo 8º, Inciso III    | 0,00                  | 0,00%        | 5,00%               | 15,00%              |
| Artigo 8º, Inciso IV     | 1.754.353,48          | 3,51%        | 2,00%               | 5,00%               |
| Artigo 8º, Inciso V      | 2.287.067,79          | 4,58%        | 2,00%               | 5,00%               |
| Artigo 8º, Inciso VI     | 1.304.339,17          | 2,61%        | 2,00%               | 5,00%               |
| Total Renda Variável     | 5.345.760,44          | 10,70%       | 11,00               | 30,00               |

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

|                                       | Mês    | Ano    | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | Taxa adm | VaR - Mês | Volatilidade - 12 meses |
|---------------------------------------|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| IMA-B 5                               | 1,01%  | 10,94% | 5,18%   | 6,58%   | 13,45%   | 34,82%   | -        | -         | -                       |
| TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA    | 1,02%  | 7,28%  | 4,50%   | 5,22%   | 9,73%    | 11,24%   | 0,70%    | 0,737%    | 4,54%                   |
| TOWER BRIDGE II IMA-B 5 FI RENDA FIXA | -0,51% | 5,90%  | 1,12%   | 2,29%   | 8,18%    | -        | 0,70%    | 1,521%    | 7,28%                   |

|                                                             |       |        |       |       |        |        |       |        |       |
|-------------------------------------------------------------|-------|--------|-------|-------|--------|--------|-------|--------|-------|
| IDKA IPCA 2 Anos                                            | 0,91% | 11,13% | 4,46% | 6,74% | 13,66% | 34,61% | -     | -      | -     |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0,89% | 10,30% | 4,32% | 6,24% | 12,77% | 33,38% | 0,20% | 0,491% | 2,83% |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO     | 0,86% | 10,29% | 4,33% | 6,18% | 12,73% | 33,31% | 0,20% | 0,476% | 2,90% |

|                                       |       |       |       |       |        |        |       |        |   |
|---------------------------------------|-------|-------|-------|-------|--------|--------|-------|--------|---|
| IPCA + 8,00% ao ano                   | 0,77% | 7,80% | 2,58% | 4,73% | 10,67% | 29,66% | -     | -      | - |
| AR CAPITAL IMOBILIÁRIOS I FIDC Sênior | 0,78% | 8,00% | 1,95% | 4,80% | -      | -      | 0,008 | 0,084% | - |

|                                                           |       |       |       |       |        |        |       |        |       |
|-----------------------------------------------------------|-------|-------|-------|-------|--------|--------|-------|--------|-------|
| IRF-M 1                                                   | 0,74% | 9,14% | 2,72% | 5,49% | 12,65% | 29,70% | -     | -      | -     |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA       | 0,71% | 8,98% | 2,67% | 5,39% | 12,45% | 29,31% | 0,20% | 0,071% | 0,67% |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,71% | 8,94% | 2,67% | 5,37% | 12,38% | 29,13% | 0,10% | 0,074% | 0,68% |

|                                         |       |         |        |         |         |         |       |        |       |
|-----------------------------------------|-------|---------|--------|---------|---------|---------|-------|--------|-------|
| IPCA + 7,00% ao ano                     | 0,70% | 7,05%   | 2,33%  | 4,25%   | 9,66%   | 27,28%  | -     | -      | -     |
| LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR | 2,49% | -44,76% | 5,12%  | -46,12% | -58,31% | -78,58% | 0,00% | 6,295% | -     |
| GGR PRIME I FIDC                        | 1,19% | 3,87%   | -0,15% | 1,23%   | 6,51%   | 23,31%  | 0,15% | 3,277% | 2,75% |

|                                                |       |       |       |       |        |        |       |        |       |
|------------------------------------------------|-------|-------|-------|-------|--------|--------|-------|--------|-------|
| CDI                                            | 0,64% | 8,03% | 2,25% | 4,85% | 11,53% | 27,29% | -     | -      | -     |
| CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0,65% | 8,02% | 2,29% | 4,79% | 11,48% | 27,22% | 0,20% | 0,030% | 0,16% |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO        | 0,65% | 8,10% | 2,27% | 4,86% | 11,65% | 27,28% | 0,20% | 0,014% | 0,11% |

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

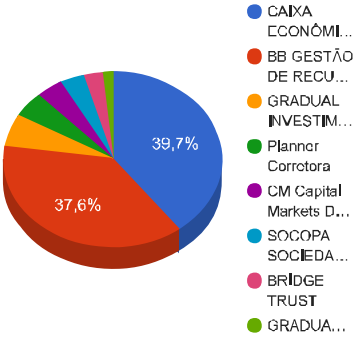
|                                          | Mês   | Ano   | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | Taxa adm | VaR - Mês | Volatilidade - 12 meses |
|------------------------------------------|-------|-------|---------|---------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO   | 0,56% | 7,26% | 1,99%   | 4,33%   | 10,54%   | 25,16%   | 1,00%    | 0,013%    | 0,11%                   |
| CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO | 0,24% | 4,09% | 0,97%   | 2,29%   | 6,15%    | 15,25%   | 5,00%    | 0,012%    | 0,11%                   |

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

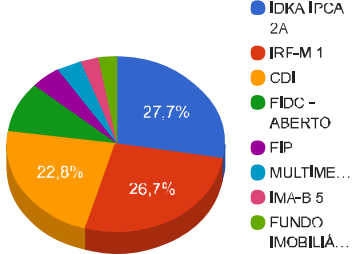
|                                           | Mês   | Ano    | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | Taxa adm | VaR - Mês | Volatilidade - 12 meses |
|-------------------------------------------|-------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| IFIX                                      | 6,58% | 19,16% | 7,09%   | 9,30%   | 22,30%   | 58,65%   | -        | -         | -                       |
| ÁTICO RENDA FII - ATCR11                  | 0,00% | 0,00%  | 0,00%   | 0,00%   | 0,00%    | 0,00%    | 1,20%    | -         | -                       |
|                                           |       |        |         |         |          |          |          |           |                         |
| CDI                                       | 0,64% | 8,03%  | 2,25%   | 4,85%   | 11,53%   | 27,29%   | -        | -         | -                       |
| LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO     | 0,72% | 9,10%  | 2,60%   | 5,49%   | -28,87%  | -31,97%  | 0,00%    | 0,186%    | 36,52%                  |
|                                           |       |        |         |         |          |          |          |           |                         |
| IPCA + 6,00% ao ano                       | 0,62% | 6,30%  | 2,09%   | 3,77%   | 8,64%    | 24,92%   | -        | -         | -                       |
| SCULPTOR FII MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO | 0,33% | 4,39%  | 1,12%   | 2,90%   | 7,24%    | 19,40%   | 1,50%    | 9,624%    | 8,36%                   |
|                                           |       |        |         |         |          |          |          |           |                         |
| Não informado                             | -     | -      | -       | -       | -        | -        | -        | -         | -                       |
| W7 MULTISTRATÉGIA FIP                     | -     | -      | -       | -       | -        | -        | 1,50%    | -         | -                       |

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

| Administrador                            | Valor         | %      |
|------------------------------------------|---------------|--------|
| CAIXA ECONÔMICA FEDERAL                  | 19.844.797,02 | 39,70% |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM               | 18.771.617,83 | 37,56% |
| GRADUAL INVESTIMENTOS                    | 3.058.692,65  | 6,12%  |
| Planner Corretora                        | 2.287.067,79  | 4,58%  |
| CM Capital Markets DTVM                  | 2.004.380,53  | 4,01%  |
| SOCOPA SOCIEDADE CORRETORA PAULISTA S.A. | 1.804.235,15  | 3,61%  |
| BRIDGE TRUST                             | 1.420.867,80  | 2,84%  |
| GRADUAL CCTVM S/A                        | 791.047,45    | 1,58%  |



| Sub-segmento      | Valor         | %      |
|-------------------|---------------|--------|
| IDKA IPCA 2A      | 13.835.071,24 | 27,68% |
| IRF-M 1           | 13.360.387,53 | 26,73% |
| CDI               | 11.420.956,08 | 22,85% |
| FIDC - ABERTO     | 4.599.663,13  | 9,20%  |
| FIP               | 2.287.067,79  | 4,58%  |
| MULTIMERCADO      | 1.754.353,48  | 3,51%  |
| IMA-B 5           | 1.420.867,80  | 2,84%  |
| FUNDO IMOBILIÁRIO | 1.304.339,17  | 2,61%  |

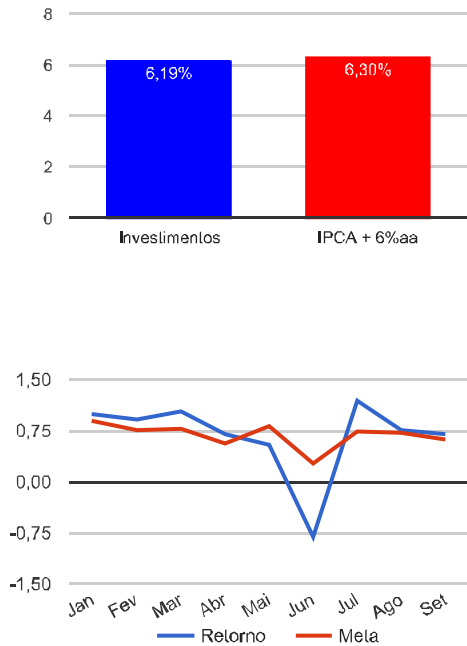




Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

| Mês              | Saldo Anterior | Aplicações   | Resgates     | Saldo Atual   | Retorno (\$) | Retorno (%) | Meta (%) | Gap (%)  | VaR (%) |
|------------------|----------------|--------------|--------------|---------------|--------------|-------------|----------|----------|---------|
| Janeiro          | 45.884.674,47  | 233.229,78   | 105.504,86   | 46.468.027,11 | 455.627,72   | 0,99%       | 0,89%    | 111,02%  | 1,50%   |
| Fevereiro        | 46.468.027,11  | 413.235,42   | 36.865,38    | 47.277.002,73 | 432.605,58   | 0,92%       | 0,75%    | 123,39%  | 0,49%   |
| Março            | 47.277.002,73  | 1.147.468,25 | 1.014.181,74 | 47.899.799,26 | 489.510,02   | 1,03%       | 0,78%    | 131,60%  | 0,62%   |
| Abril            | 47.899.799,26  | 308.644,26   | 166.107,80   | 48.378.365,12 | 336.029,40   | 0,70%       | 0,56%    | 125,43%  | 0,25%   |
| Maio             | 48.378.365,12  | 320.560,68   | 157.765,46   | 48.806.630,12 | 265.469,78   | 0,55%       | 0,82%    | 66,57%   | 1,72%   |
| Junho            | 48.806.630,12  | 1.300.853,48 | 1.159.887,29 | 48.553.944,26 | -393.652,05  | -0,80%      | 0,26%    | -314,60% | 1,79%   |
| Julho            | 48.553.944,26  | 208.144,00   | 152.971,02   | 49.188.222,98 | 579.105,74   | 1,19%       | 0,73%    | 163,66%  | 0,75%   |
| Agosto           | 49.188.222,98  | 212.646,31   | 170.732,82   | 49.601.597,86 | 371.461,39   | 0,75%       | 0,72%    | 104,18%  | 0,43%   |
| Setembro         | 49.601.597,86  | 3.919.701,51 | 3.888.779,70 | 49.982.706,22 | 350.186,55   | 0,71%       | 0,62%    | 113,02%  | 0,74%   |
| Acumulado no ano |                |              |              |               | 2.886.344,13 | 6,19%       | 6,30%    | 98,18%   |         |

Acumulado no Ano



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de setembro / 2017

| Ativos de Renda Fixa                                         | Sado Anterior | Aplicações   | Resgates     | Saldo Atual   | Retorno (R\$) | Retorno (%) | VaR - Mês (%) | Instituição(%) |
|--------------------------------------------------------------|---------------|--------------|--------------|---------------|---------------|-------------|---------------|----------------|
| LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR                      | 771.840,59    | 0,00         | 0,00         | 791.047,45    | 19.206,86     | 2,49%       | 6,29%         | 2,49%          |
| GGR PRIME I FIDC                                             | 1.980.792,92  | 0,00         | 0,00         | 2.004.380,53  | 23.587,61     | 1,19%       | 3,28%         | 1,19%          |
| TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA                           | 1.108.268,25  | 0,00         | 0,00         | 1.119.592,36  | 11.324,11     | 1,02%       | 0,74%         | 1,02%          |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP  | 350.110,39    | 0,00         | 0,00         | 353.232,27    | 3.121,88      | 0,89%       | 0,49%         | 0,89%          |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO      | 13.367.285,89 | 0,00         | 0,00         | 13.481.838,97 | 114.573,08    | 0,86%       | 0,48%         | 0,86%          |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA          | 11.040.203,51 | 0,00         | 0,00         | 11.119.101,72 | 78.898,21     | 0,71%       | 0,07%         | 0,71%          |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO    | 2.225.456,95  | 0,00         | 0,00         | 2.241.285,81  | 15.828,86     | 0,71%       | 0,07%         | 0,71%          |
| CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP               | 7.502.814,88  | 0,00         | 0,00         | 7.551.917,37  | 49.102,49     | 0,65%       | 0,03%         | 0,65%          |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO                      | 3.028.581,55  | 0,00         | 0,00         | 3.048.256,41  | 19.674,86     | 0,65%       | 0,01%         | 0,65%          |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO                       | 1.279,30      | 1.855.590,13 | 1.862.832,32 | 236,64        | 6.199,53      | 0,33%       | 0,01%         | 0,56%          |
| AR CAPITAL IMOBILIÁRIOS I FIDC Sênior                        | 0,00          | 1.800.000,00 | 0,00         | 1.804.235,15  | 4.235,15      | 0,24%       | 0,08%         | 0,78%          |
| CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO                     | 724.853,63    | 284.111,38   | 170.357,25   | 820.545,66    | 1.937,90      | 0,20%       | 0,01%         | 0,24%          |
| SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 1.311.742,10  | 0,00         | 1.312.632,97 | 0,00          | 890,87        | 0,07%       | 0,01%         | 0,63%          |
| SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA                              | 542.875,02    | 0,00         | 542.957,16   | 0,00          | 82,14         | 0,02%       | 0,16%         | 0,80%          |
| TOWER BRIDGE II IMA-B 5 FI RENDA FIXA                        | 302.813,28    | 0,00         | 0,00         | 301.275,44    | -1.537,84     | -0,51%      | 1,52%         | -0,51%         |
| Total Renda Fixa                                             |               |              |              |               | 347.125,71    | 0,78%       | 0,47%         |                |

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de setembro / 2017

| Ativos de Renda Variável                 | Sado Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual  | Retorno (R\$) | Retorno (%) | VaR - Mês (%) | Instituição(%) |
|------------------------------------------|---------------|------------|----------|--------------|---------------|-------------|---------------|----------------|
| LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO    | 337.788,97    | 0,00       | 0,00     | 340.213,89   | 2.424,92      | 0,72%       | 0,19%         | 0,72%          |
| SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO | 1.409.463,42  | 0,00       | 0,00     | 1.414.139,59 | 4.676,17      | 0,33%       | 9,62%         | 0,33%          |
| ÁTICO RENDA FII- ATCR11                  | 1.305.213,49  | 0,00       | 0,00     | 1.304.339,17 | -874,32       | -0,07%      | -             | 0,00%          |
| W7 MULTISTRATÉGIA FIP                    | 2.290.233,72  | 0,00       | 0,00     | 2.287.067,79 | -3.165,93     | -0,14%      | -             | -              |
| Total Renda Variável                     |               |            |          |              | 3.060,84      | 0,06%       | 7,79%         |                |

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre / 2017

| Ativos de Renda Fixa                                         | Sado Anterior | Aplicações   | Resgates     | Saldo Atual   | Retorno (R\$) | Retorno (%) | Instituição (%) |
|--------------------------------------------------------------|---------------|--------------|--------------|---------------|---------------|-------------|-----------------|
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO      | 12.922.261,25 | 0,00         | 0,00         | 13.481.838,97 | 559.577,72    | 4,33%       | 4,33%           |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA          | 10.829.918,93 | 0,00         | 0,00         | 11.119.101,72 | 289.182,79    | 2,67%       | 2,67%           |
| CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP               | 7.382.966,00  | 0,00         | 0,00         | 7.551.917,37  | 168.951,37    | 2,29%       | 2,29%           |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO                      | 2.980.742,45  | 0,00         | 0,00         | 3.048.256,41  | 67.513,96     | 2,27%       | 2,27%           |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO    | 2.183.055,16  | 0,00         | 0,00         | 2.241.285,81  | 58.230,65     | 2,67%       | 2,67%           |
| TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA                           | 1.071.349,07  | 0,00         | 0,00         | 1.119.592,36  | 48.243,29     | 4,50%       | 4,50%           |
| LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR                      | 752.530,87    | 0,00         | 0,00         | 791.047,45    | 38.516,58     | 5,12%       | 5,12%           |
| SAFRA SOBERANO REGIME PRÓPRIO FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 1.291.277,77  | 0,00         | 1.312.632,97 | 0,00          | 21.355,20     | 1,65%       | 2,22%           |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP  | 338.599,09    | 0,00         | 0,00         | 353.232,27    | 14.633,18     | 4,32%       | 4,32%           |
| SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA                              | 531.925,72    | 0,00         | 542.957,16   | 0,00          | 11.031,44     | 2,07%       | 2,87%           |
| CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO                     | 622.642,10    | 684.901,69   | 494.055,44   | 820.545,66    | 7.057,31      | 0,79%       | 0,97%           |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO                       | 1.286,98      | 1.855.590,13 | 1.862.837,97 | 236,64        | 6.217,50      | 1,76%       | 1,99%           |
| AR CAPITAL IMOBILIÁRIOS I FIDC Sênior                        | 0,00          | 1.800.000,00 | 0,00         | 1.804.235,15  | 4.235,15      | 0,24%       | 1,95%           |
| TOWER BRIDGE II IMA-B 5 FI RENDA FIXA                        | 297.924,01    | 0,00         | 0,00         | 301.275,44    | 3.351,43      | 1,12%       | 1,12%           |
| GGR PRIME I FIDC                                             | 2.007.302,19  | 0,00         | 0,00         | 2.004.380,53  | -2.921,66     | -0,15%      | -0,15%          |
| Total Renda Fixa                                             |               |              |              |               | 1.295.175,91  | 2,99%       |                 |

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre / 2017

| Ativos de Renda Variável                 | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual  | Retorno (R\$) | Retorno (%) | Instituição (%) |
|------------------------------------------|----------------|------------|----------|--------------|---------------|-------------|-----------------|
| SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO | 1.398.513,97   | 0,00       | 0,00     | 1.414.139,59 | 15.625,62     | 1,12%       | 1,12%           |
| LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO    | 331.580,80     | 0,00       | 0,00     | 340.213,89   | 8.633,09      | 2,60%       | 2,60%           |
| ÁTICO RENDA FII- ATCR11                  | 1.312.127,05   | 0,00       | 0,00     | 1.304.339,17 | -7.787,88     | -0,59%      | 0,00%           |
| W7 MULTISTRATÉGIA FIP                    | 2.297.960,85   | 0,00       | 0,00     | 2.287.067,79 | -10.893,06    | -0,47%      | -               |
| Total Renda Variável                     |                |            |          |              | 5.577,77      | 0,10%       |                 |