

Investimentos em Taxa de Juros - Renda Fixa

Títulos Públicos	Volume R\$	% PL	Prazo Médio p/ Vencimento
LFT	11.789.218,77	0,2%	2 anos e 3 meses
LTN	126.378.372,60	2,3%	1 ano e 8 meses
NTN-B	3.722.996.290,91	68,1%	8 anos e 11 meses
NTN-F	7.465.217,66	0,1%	4 anos e 5 meses
OPERAÇÕES COMPROMISSADAS	252.969.928,77	4,6%	1 dia
Total de Títulos Públicos	4.121.599.028,71	75,4%	8 anos e 1 mês
Títulos Privados	Volume R\$	% PL	
CDB			
B VOTORA	18.962.521,19	0,3%	0 mês
B.ALFA	19.016.528,78	0,3%	0 mês
BNP	13.417.992,64	0,2%	0 mês
CEF	37.871.553,55	0,7%	2 anos e 5 meses
MERRIL	2.749.380,84	0,1%	1 ano e 4 meses
Total de CDB	92.017.977,00	1,7%	1 ano e 1 mês
Debêntures			
BNDESPAR	125.574.508,76	2,3%	1 ano e 4 meses
BRADLEAS	36.221.753,78	0,7%	0 mês
CACHOEIR	11.798.700,93	0,2%	5 anos e 10 meses
MILLS ES	19.453.906,34	0,4%	2 anos e 7 meses
NCF PART	13.578.649,66	0,2%	2 anos e 12 meses
TELEF BR	6.658.911,28	0,1%	2 anos e 7 meses
SANT LEA	31.242.945,99	0,6%	5 meses
Total de Debêntures	244.529.376,74	4,5%	1 ano e 6 meses
Letras Financeiras			
B VOTORA	3.943.709,43	0,1%	9 meses
B.BRASIL	48.046.540,84	0,9%	10 meses
BNP	12.449.790,39	0,2%	9 meses
CEF	5.640.492,44	0,1%	1 mês
CITIBANK	911.005,29	0,0%	4 meses
DAYCOVAL	3.129.619,96	0,1%	1 ano e 6 meses
ITAU	27.872.577,01	0,5%	1 ano e 11 meses
SAFRA	6.515.446,86	0,1%	2 anos e 4 meses
Total de Letras Financeiras	108.509.182,22	2,0%	1 ano e 2 meses
Total de Títulos Privados	445.056.535,96	8,1%	1 ano e 4 meses
Cotas de Fundos	Volume R\$	% PL	
Fundos Caixa	246.642.454,71	4,5%	1 dia
Total de Cotas de Fundos	246.642.454,71	4,5%	1 dia
Operações com Participantes	Volume R\$	% PL	
Empréstimos			
Empréstimos	53.444.729,76	1,0%	2 anos e 7 meses
Total de Operações com Participantes	53.444.729,76	1,0%	2 anos e 7 meses
Caixa			
Saldo em C/C	76.818,89		
Contas a Pagar	-829.208,06		
Contas a Receber	1.945.990,11		
Total de Caixa	1.193.600,94	0,0%	

Total em Tx de Juros - Renda Fixa **4.867.936.350,08** **89,1%** **6 anos e 12 meses**

Investimentos no Exterior

	Volume R\$	% PL	
IVVB11	14.145.695,50	0,3%	1 dia
BB_BLACK	13.698.594,40	0,3%	1 dia
Total de Investimento no Exterior	27.844.289,90	0,5%	1 dia

Investimentos Estruturados

	Volume R\$	% PL	
Fundos Multimercado	65.903.161,58	1,2%	1 mês
Total de Investimentos Estruturados	65.903.161,58	1,2%	1 mês

Investimentos em Bolsa - Renda Variável

Ações (Cód)	Empresa	Quantidade	Volume R\$	Cotação	% PL
ABEV3	AMBEV ON	443.657	9.441.020,96	21,28	0,2%
ALSC3	ALIANSC SHOPPING CENTERS SA	10.213	184.242,52	18,04	0,0%
ALUP11	ALUP - ALUPAR	312.241	5.760.846,45	18,45	0,1%
ARZZ3	AREZZO ON	4.400	240.680,00	54,70	0,0%
BBAS3	BRASILON EJ NM	125.235	3.984.977,70	31,82	0,1%
BBDC3	BRADESCOON EB N1	321.561	10.309.245,66	32,06	0,2%
BBDC4	BRADESCOPN EB N1	299.328	10.132.252,80	33,85	0,2%
BBSE3	BRASIL SEGURIDADE ON	68.670	1.956.408,30	28,49	0,0%
BEEF3	BEEF3 ON	566.425	6.032.426,25	10,65	0,1%
BRAP4	BRADESPARP N1	22.143	635.946,96	28,72	0,0%
BRDT3	PETROBRAS BRON	22.942	392.308,20	17,10	0,0%
BRFS3	BRF FOODS ON NM	275.694	10.090.400,40	36,60	0,2%
BRKM5	BRASKEMPNA N1	27.022	1.158.433,14	42,87	0,0%
BRML3	BR MALLS PARON	85.611	1.089.828,03	12,73	0,0%
BRSR6	BANRISUL PNB N1	17.755	264.549,50	14,90	0,0%
BTOW3	B2W COMPANHIA GLOBAL DO VARE	16.977	348.028,50	20,50	0,0%
BVMF3	B3 SA ON NM	207.921	4.736.440,38	22,78	0,1%
CAML3	CAMIL ON	291.352	2.281.286,16	7,83	0,0%
CCRO3	CCR RODOVIAS ON NM	113.947	1.840.244,05	16,15	0,0%
CESP6	CESPPNB* N1	183.517	2.422.424,40	13,20	0,0%
CIEL3	CIELO ON NM	113.647	2.672.977,44	23,52	0,0%
CMIG10	CMIG RC PN	4.001	27.486,87	6,87	0,0%
CMIG4	CEMIGPN N1	98.559	677.100,33	6,87	0,0%
CMIG9	CEMIG - REC	230	1.474,30	6,41	0,0%
CPFE3	CPFL ENERGIA ON NM	5.400	104.490,00	19,35	0,0%
CPL6	COPELPNB*	10.381	259.005,95	24,95	0,0%
CRFB3	CRFB - ATACADAO SA ON NM	33.800	515.450,00	15,25	0,0%
CSAN3	COSAN ON NM	159.616	6.624.064,00	41,50	0,1%
CSMG3	COPASA ON NM	6.271	272.098,69	43,39	0,0%
CSNA3	SID NACIONAL ON	61.501	515.378,38	8,38	0,0%
CVCB3	CVC SA ON NM	13.850	671.725,00	48,50	0,0%
CYRE3	CYRELA REALT ON NM	25.020	330.764,40	13,22	0,0%
DTEX3	DURATEX ON MM	27.716	254.987,20	9,20	0,0%
ECOR3	ECORODOVIAS INFRAESTRUTURA	19.001	233.712,30	12,30	0,0%

EGIE3	TRACTEBEL ON NM	20.778	737.826,78	35,51	0,0%
ELET3	ELETROBRASON * N1	27.564	533.087,76	19,34	0,0%
ELET6	ELETROBRASPNB* N1	23.106	524.506,20	22,70	0,0%
ELPL3	ELETROPAULON * N2	17.059	278.914,65	16,35	0,0%
EMBR3	EMBRAERON EJ NM	74.855	1.497.100,00	20,00	0,0%
ENBR3	ENERGIAS BRON NM	30.168	422.352,00	14,00	0,0%
ENGI11	ENERGISA UNT	184.044	5.024.401,20	27,30	0,1%
EQTL3	EQUATORIALON N2	20.235	1.328.427,75	65,65	0,0%
ESTC3	ESTACIO PART	31.506	1.034.026,92	32,82	0,0%
EVEN3	EVEN	205.323	1.178.554,02	5,74	0,0%
EZTC3	EZ TEC EMP E PART	5.739	124.249,35	21,65	0,0%
FIBR3	FIBRIA ON N1	23.429	1.121.077,65	47,85	0,0%
FLRY3	FLRY - FLEURY SA	30.917	915.452,37	29,61	0,0%
GFGSA1	GAFISA DIR	2.022	6.672,60	3,30	0,0%
GFGSA3	GAFISAON EB	4.741	97.000,86	20,46	0,0%
GOAU4	GERDAU METPN N1	58.978	341.482,62	5,79	0,0%
GOLL4	GOLPN EDJ N2	13.408	195.756,80	14,60	0,0%
HGTX3	CIA HERINGON N1	12.731	326.168,22	25,62	0,0%
HYPE3	HYPERMARCAS ON NM	40.493	1.457.748,00	36,00	0,0%
IGTA3	IGUATEMION NM	8.834	347.971,26	39,39	0,0%
ITSA4	ITAUSAPN N1	394.267	4.265.968,94	10,82	0,1%
ITUB4	ITAU UNIBANCO PN N1	318.473	13.560.580,34	42,58	0,2%
JBSS3	JBS SAON	159.273	1.562.468,13	9,81	0,0%
KLBN11	UNT N2	162.138	2.853.628,80	17,60	0,1%
KROT3	KROTONON	150.852	2.775.676,80	18,40	0,1%
LAME3	LOJAS AMERICON *	19.736	259.133,68	13,13	0,0%
LAME4	LOJAS AMERICPN *	437.633	7.461.642,65	17,05	0,1%
LIGT3	LIGHT S/AON *INT NM	10.050	167.734,50	16,69	0,0%
LINX3	LINX ON	13.461	288.334,62	21,42	0,0%
LREN3	LOJAS RENNERTON NM	71.854	2.550.098,46	35,49	0,0%
MDIA3	M.DIASBRANCOON NM	8.689	452.696,90	52,10	0,0%
MGLU3	MAGAZ LUIZA ON	6.938	556.566,36	80,22	0,0%
MOVI3	MOVI ON NM	7.500	52.875,00	7,05	0,0%
MPLU3	MPLU3 ON	4.520	158.200,00	35,00	0,0%
MRFG3	MARFRIG ON	41.340	302.608,80	7,32	0,0%
MRVE3	MRV ENGENHARIA E PART	29.462	443.108,48	15,04	0,0%
MULT3	MULTIPLAN EMP IMOBILIÁRIOS	9.090	644.481,00	70,90	0,0%
MYPK3	IOCHP-MAXIONON N1	12.865	295.895,00	23,00	0,0%
NATU3	NATURAON NM	17.566	580.731,96	33,06	0,0%
ODPV3	ODONTOPREVN NM	25.385	403.875,35	15,91	0,0%
PCAR4	P.ACUCAR-CBDPN * N1	63.482	5.010.634,26	78,93	0,1%
PETR3	PETROBRASON	342.539	5.792.334,49	16,91	0,1%
PETR4	PETROBRASPN	512.218	8.246.709,80	16,10	0,2%
POMO4	MARCOPOLOPN N2	56.715	226.292,85	3,99	0,0%
PSSA3	PORTO SEGUROON NM	9.545	346.769,85	36,33	0,0%
QUAL3	QUAL ON	24.804	768.924,00	31,00	0,0%
RADL3	RADL - RAIADROGASIL ON	21.634	1.986.001,20	91,80	0,0%
RAIL3	RUMO SA ON	113.897	1.477.244,09	12,97	0,0%
RAPT4	RANDON PARTPN N1	18.360	131.641,20	7,17	0,0%
RENT3	LOCALIZAON NM	50.744	1.119.412,64	22,06	0,0%
SANB11	SANTANDER UNT N2	38.148	1.216.158,24	31,88	0,0%
SAPR11	SANEPARD11	71.091	4.258.350,90	59,90	0,1%
SAPR4	SANEPARPN	14.306	167.380,20	11,70	0,0%

Dezembro/2017

SBSP3	SABESPON * NM	34.702	1.191.319,66	34,33	0,0%
SEER3	SEER ON	6.505	203.606,50	31,30	0,0%
SMLS3	SMILES ON NM	5.955	451.984,50	75,90	0,0%
SMT03	SAO MARTINHOON NM	191.731	3.700.408,30	19,30	0,1%
SULA11	SUL AMÉRICA	28.489	531.604,74	18,66	0,0%
SUZB3	SUZANO PAPELON I06 N1	97.004	1.813.004,76	18,69	0,0%
TAE11	TAE - TAESA CDA	18.875	402.792,50	21,34	0,0%
TEND3	TENDA SA	62.495	1.249.900,00	20,00	0,0%
TIET11	CERTIF ON E PN	30.460	388.365,00	12,75	0,0%
TIMP3	TIM PART S/A ON	82.603	1.082.099,30	13,10	0,0%
TOTS3	TOTVSON ED NM	13.750	410.987,50	29,89	0,0%
TRPL4	TRAN PAULISTPN *ED N1	10.070	673.683,00	66,90	0,0%
UGPA3	ULTRAPARON N1	55.187	4.139.025,00	75,00	0,1%
USIM5	USIMINAS PNA N1	52.181	474.847,10	9,10	0,0%
VALE3	VALE R DOCEON N1	321.595	12.947.414,70	40,26	0,2%
VIVT4	VIVT - TELEF BRASIL PN	42.398	2.061.390,76	48,62	0,0%
VLID3	VALID ON EJ NM	7.090	131.448,60	18,54	0,0%
VVAR11	VVAR11	13.887	339.814,89	24,47	0,0%
WEGE3	WEGON EJ N1	58.232	1.403.973,52	24,11	0,0%
WIZS3	WIZS - SOLUÇÕES CORRET SEG SA	8.021	94.006,12	11,72	0,0%
Total de Ações			209.281.425,81	3,8%	3 dias
Cotas de Fundos			Volume R\$	% PL	
Fundo de Ações			291.708.802,61	5,3%	3 meses
Total de Cotas de Fundos			291.708.802,61	5,3%	3 meses
Proventos					
Saldo Anterior			833.904,92		
Juros e Dividendos Recebidos			1.079.377,83		
Juros e Dividendos provisionados			1.544.442,52		
Total de Proventos			1.298.969,61	0,0%	5 anos e 8 meses
Total em Inv em Bolsa - Renda Variável			502.289.198,03	9,2%	2 meses
Total de Patrimônio			5.463.972.999,59	100,0%	6 anos e 3 meses