

### Investimentos em Taxa de Juros - Renda Fixa

Títulos Públicos	Volume R\$	% PL	Prazo Médio p/ Vencimento
LFT	5.309.254,78	0,1%	2 anos e 4 meses
LTN	115.425.722,38	2,1%	1 ano e 8 meses
NTN-B	3.774.209.606,77	67,4%	8 anos e 12 meses
NTN-F	60.145.206,28	1,1%	3 anos
OPERAÇÕES COMPROMISSADAS	298.896.636,95	5,3%	1 dia
<b>Total de Títulos Públicos</b>	<b>4.253.986.427,16</b>	<b>75,9%</b>	<b>8 anos e 1 mês</b>
Títulos Privados	Volume R\$	% PL	
<b>CDB</b>			
CEF	20.255.056,55	0,4%	1 ano e 7 meses
MERRIL	2.779.611,82	0,0%	1 ano e 2 meses
<b>Total de CDB</b>	<b>23.034.668,37</b>	<b>0,4%</b>	<b>1 ano e 6 meses</b>
<b>Debêntures</b>			
BNDSPAR	127.198.439,07	2,3%	1 ano e 2 meses
CACHOEIR	11.163.066,74	0,2%	5 anos e 8 meses
MILLS ES	11.125.878,56	0,2%	2 anos e 6 meses
NCF PART	13.715.160,97	0,2%	2 anos e 10 meses
TELEF BR	6.567.140,45	0,1%	2 anos e 5 meses
SANT LEA	31.576.566,25	0,6%	3 meses
<b>Total de Debêntures</b>	<b>201.346.252,04</b>	<b>3,6%</b>	<b>1 ano e 6 meses</b>
<b>Letras Financeiras</b>			
B VOTORA	3.986.851,22	0,1%	7 meses
B.BRASIL	48.712.978,94	0,9%	8 meses
BNP	12.584.066,86	0,2%	7 meses
BRADESCO	26.044.684,65	0,5%	2 anos e 11 meses
CITIBANK	920.873,58	0,0%	2 meses
DAYCOVAL	3.166.609,59	0,1%	1 ano e 4 meses
ITAU	24.247.497,10	0,4%	3 anos
SAFRA	6.588.183,02	0,1%	2 anos e 2 meses
<b>Total de Letras Financeiras</b>	<b>126.251.744,96</b>	<b>2,3%</b>	<b>1 ano e 8 meses</b>
<b>Total de Títulos Privados</b>	<b>350.632.665,37</b>	<b>6,3%</b>	<b>1 ano e 7 meses</b>
Cotas de Fundos	Volume R\$	% PL	
Fundos Caixa	289.834.453,97	5,2%	1 dia
<b>Total de Cotas de Fundos</b>	<b>289.834.453,97</b>	<b>5,2%</b>	<b>1 dia</b>
Operações com Participantes	Volume R\$	% PL	
<b>Empréstimos</b>			
Empréstimos	51.272.748,38	0,9%	2 anos e 5 meses
<b>Total de Operações com Participantes</b>	<b>51.272.748,38</b>	<b>0,9%</b>	<b>2 anos e 5 meses</b>
<b>Caixa</b>			
Saldo em C/C	71.235,88		
Contas a Pagar	-2.470.814,94		
Contas a Receber	1.887.705,34		
<b>Total de Caixa</b>	<b>-511.873,72</b>	<b>0,0%</b>	
<b>Total em Tx de Juros - Renda Fixa</b>	<b>4.945.214.421,16</b>	<b>88,3%</b>	<b>7 anos e 1 mês</b>

### Investimentos no Exterior

	Volume R\$	% PL	
IVVB11	14.002.046,00	0,2%	1 dia
BB_BLACK	13.315.975,09	0,2%	1 dia
<b>Total de Investimento no Exterior</b>	<b>27.318.021,09</b>	<b>0,5%</b>	<b>1 dia</b>

### Investimentos Estruturados

	Volume R\$	% PL	
Fundos Multimercado	68.123.773,37	1,2%	1 mês
<b>Total de Investimentos Estruturados</b>	<b>68.123.773,37</b>	<b>1,2%</b>	<b>1 mês</b>

### Investimentos em Bolsa - Renda Variável

Ações (Cód)	Empresa	Quantidade	Volume R\$	Cotação	% PL
ABEV3	AMBEV ON	444.157	9.771.454,00	22,00	0,2%
ALSC3	ALIANSC SHOPPING CENTERS SA	10.213	183.016,96	17,92	0,0%
ALUP11	ALUP - ALUPAR	343.001	6.242.618,20	18,20	0,1%
ARZZ3	AREZZO ON	4.500	252.450,00	56,10	0,0%
BBAS3	BRASILON EJ NM	125.435	5.243.183,00	41,80	0,1%
BBDC3	BRADESCOON EB N1	261.115	9.616.865,45	36,83	0,2%
BBDC4	BRADESCOPN EB N1	375.112	14.543.092,24	38,77	0,3%
BBSE3	BRASIL SEGURIDADE ON	68.670	1.998.297,00	29,10	0,0%
BEEF3	BEEF3 ON	659.793	5.990.920,44	9,08	0,1%
BRAP4	BRADESPARN N1	22.343	763.460,31	34,17	0,0%
BRFS3	BRF FOODS ON NM	194.017	5.804.988,64	29,92	0,1%
BRKM5	BRASKEMPNA N1	27.022	1.254.901,68	46,44	0,0%
BRML3	BR MALLS PARON	85.711	1.022.532,23	11,93	0,0%
BRSR6	BANRISUL PNB N1	17.855	324.068,25	18,15	0,0%
BTOW3	B2W COMPANHIA GLOBAL DO VARE.	66.892	1.591.360,68	23,79	0,0%
BVMF3	B3 SA ON NM	390.011	9.992.081,82	25,62	0,2%
CAML3	CAMIL ON	296.715	2.388.555,75	8,05	0,0%
CCRO3	CCR RODOVIAS ON NM	114.147	1.449.666,90	12,70	0,0%
CESP6	CESPPNB* N1	43.699	664.224,80	15,20	0,0%
CIEL3	CIELO ON NM	114.047	2.758.796,93	24,19	0,0%
CMIG10	CMIG RC PN	4.001	32.848,21	8,21	0,0%
CMIG4	CEMIGPN N1	98.659	809.990,39	8,21	0,0%
CMIG9	CEMIG - REC	230	1.688,20	7,34	0,0%
CPFE3	CPFL ENERGIA ON NM	5.500	132.385,00	24,07	0,0%
CPL6	COPELPNB*	10.381	263.158,35	25,35	0,0%
CRFB3	CRFB - ATACADAO SA ON NM	33.900	503.415,00	14,85	0,0%
CSAN3	COSAN ON NM	151.052	6.551.125,24	43,37	0,1%
CSMG3	COPASA ON NM	6.271	276.237,55	44,05	0,0%
CSNA3	SID NACIONAL ON	61.401	623.220,15	10,15	0,0%
CVCB3	CVC SA ON NM	13.850	777.539,00	56,14	0,0%
CYRE3	CYRELA REALTON NM	25.020	383.806,80	15,34	0,0%
DIRR3	DIRR - DIRECIONAL ON	20.327	120.945,65	5,95	0,0%
DTEX3	DURATEX ON MM	27.816	316.824,24	11,39	0,0%
ECOR3	ECORODOVIAS INFRAESTRUTURA	19.101	191.965,05	10,05	0,0%
EGIE3	TRACTEBEL ON NM	20.878	817.373,70	39,15	0,0%
ELET3	ELETROBRASON * N1	27.564	682.760,28	24,77	0,0%
ELET6	ELETROBRASPON * N1	23.106	644.657,40	27,90	0,0%
ELPL3	ELETROPAULON * N2	17.159	300.282,50	17,50	0,0%

EMBR3	EMBRAERON EJ NM	74.955	1.631.020,80	21,76	0,0%
ENBR3	ENERGIAS BRON NM	30.168	401.234,40	13,30	0,0%
ENGI11	ENERGISA UNT	116.363	3.839.979,00	33,00	0,1%
EQTL3	EQUATORIALON N2	20.235	1.448.826,00	71,60	0,0%
ESTC3	ESTACIO PART	31.506	1.068.053,40	33,90	0,0%
EVEN3	EVEN	97.045	587.122,25	6,05	0,0%
EZTC3	EZ TEC EMP E PART	5.739	139.515,09	24,31	0,0%
FIBR3	FIBRIA ON N1	23.429	1.444.866,43	61,67	0,0%
FLRY3	FLRY - FLEURY SA	31.117	844.204,21	27,13	0,0%
GFS3A	GAFISAON EB	4.741	73.153,63	15,43	0,0%
GFS3A9	GAFISA ON REC NM	4.248	65.546,64	15,43	0,0%
GOAU4	GERDAU METPN N1	58.978	464.746,64	7,88	0,0%
GOLL4	GOLPN EDJ N2	13.408	257.433,60	19,20	0,0%
HGT3X	CIA HERINGON N1	12.731	292.813,00	23,00	0,0%
HYPE3	HYPERA ON NM	40.593	1.401.270,36	34,52	0,0%
IGTA3	IGUATEMION NM	8.834	348.854,66	39,49	0,0%
ITSA2	ITAUSA DIR PRE N1	9.282	50.122,80	5,40	0,0%
ITSA4	ITAUSAPN N1	394.967	5.181.967,04	13,12	0,1%
ITUB4	ITAU UNIBANCO PN N1	320.373	16.140.391,74	50,38	0,3%
JBSS3	JBS SAON	159.573	1.581.368,43	9,91	0,0%
KLBN11	UNT N2	50.053	895.948,70	17,90	0,0%
KROT3	KROTONON	151.052	2.341.306,00	15,50	0,0%
LAME3	LOJAS AMERICON *	19.736	256.568,00	13,00	0,0%
LAME4	LOJAS AMERICPN *	398.559	6.727.675,92	16,88	0,1%
LIGT3	LIGHT S/AON *INT NM	9.950	151.936,50	15,27	0,0%
LINX3	LINX ON	13.461	255.489,78	18,98	0,0%
LREN3	LOJAS RENNERON NM	71.954	2.483.852,08	34,52	0,0%
MDIA3	M.DIASBRANCOON NM	8.689	519.862,87	59,83	0,0%
MGLU3	MAGAZ LUIZA ON	6.938	631.704,90	91,05	0,0%
MOVI3	MOVI ON NM	7.500	57.150,00	7,62	0,0%
MPLU3	MPLU3 ON	4.520	155.623,60	34,43	0,0%
MRFG3	MARFRIG ON	41.540	247.993,80	5,97	0,0%
MRVE3	MRV ENGENHARIA E PART	29.362	445.715,16	15,18	0,0%
MULT3	MULTIPLAN EMP IMOBILIÁRIOS	23.889	1.677.007,80	70,20	0,0%
MYPK3	IOCHP-MAXIONON N1	12.965	286.396,85	22,09	0,0%
NATU3	NATURAON NM	17.566	603.040,78	34,33	0,0%
ODPV3	ODONTOPREVON NM	25.885	396.299,35	15,31	0,0%
PCAR4	P.ACUCAR-CBDPN * N1	59.532	4.077.346,68	68,49	0,1%
PETR3	PETROBRASON	277.000	6.412.550,00	23,15	0,1%
PETR4	PETROBRASPN	469.478	10.074.997,88	21,46	0,2%
POMO4	MARCOPOLOPN N2	56.815	232.373,35	4,09	0,0%
PSSA3	PORTO SEGUROON NM	9.545	437.065,55	45,79	0,0%
QUAL3	QUAL ON	24.804	713.115,00	28,75	0,0%
RADL3	RADL - RAIADROGASIL ON	23.675	1.840.494,50	77,74	0,0%
RAIL3	RUMO SA ON	113.997	1.623.317,28	14,24	0,0%
RAPT4	RANDON PARTPN N1	18.460	170.939,60	9,26	0,0%
RENT3	LOCALIZAON NM	50.844	1.318.893,36	25,94	0,0%
RLOG3	RLOG - COSAN LOGISTICA SA	18.365	186.221,10	10,14	0,0%
SANB11	SANTANDER UNT N2	38.148	1.402.701,96	36,77	0,0%
SAPR11	SANEPARD11	94.565	5.059.227,50	53,50	0,1%
SAPR4	SANEPARPN	14.306	147.780,98	10,33	0,0%
SBSP3	SABESPON * NM	34.802	1.310.295,30	37,65	0,0%
SEER3	SEER ON	6.505	201.655,00	31,00	0,0%

## Fevereiro/2018

SMLS3	SMILES ON NM	5.955	501.887,40	84,28	0,0%
SMT03	SAO MARTINHOON NM	184.175	3.379.611,25	18,35	0,1%
SULA11	SUL AMÉRICA	28.489	608.240,15	21,35	0,0%
SUZB3	SUZANO PAPELON I06 N1	149.391	3.249.254,25	21,75	0,1%
TAE11	TAE - TAESA CDA	18.875	386.937,50	20,50	0,0%
TEND3	TENDA SA	62.518	1.420.408,96	22,72	0,0%
TIET11	CERTIF ON E PN	30.460	345.721,00	11,35	0,0%
TIMP3	TIM PART S/A ON	82.603	1.164.702,30	14,10	0,0%
TOTS3	TOTVSON ED NM	13.750	419.925,00	30,54	0,0%
TRPL4	TRAN PAULISTPN *ED N1	10.070	671.769,70	66,71	0,0%
UGPA3	ULTRAPARON N1	55.287	4.165.322,58	75,34	0,1%
USIM5	USIMINAS PNA N1	52.281	644.101,92	12,32	0,0%
VALE3	VALE R DOCEON N1	321.995	14.505.874,75	45,05	0,3%
VIVT4	VIVT - TELEF BRASIL PN	42.498	2.152.523,70	50,65	0,0%
VLID3	VALID ON EJ NM	7.090	140.452,90	19,81	0,0%
VVAR11	VVAR11	13.987	383.103,93	27,39	0,0%
WEGE3	WEGON EJ N1	58.232	1.363.211,12	23,41	0,0%
WIZS3	WIZS - SOLUÇÕES CORRET SEG SA	7.921	97.824,35	12,35	0,0%
<b>Total de Ações</b>			<b>223.170.922,36</b>	<b>4,0%</b>	<b>3 dias</b>
<b>Cotas de Fundos</b>			<b>Volume R\$</b>	<b>% PL</b>	
Fundo de Ações			336.628.199,20	6,0%	3 meses
<b>Total de Cotas de Fundos</b>			<b>336.628.199,20</b>	<b>6,0%</b>	<b>3 meses</b>
<b>Proventos</b>					
Saldo Anterior			1.318.859,34		
Juros e Dividendos Recebidos			200.857,27		
Juros e Dividendos provisionados			860.073,72		
<b>Total de Proventos</b>			<b>1.978.075,79</b>	<b>0,0%</b>	<b>2 anos e 10 meses</b>
<b>Derivativos</b>					
Opções			6.774,19	0,0%	2 meses
<b>Total de Opções</b>			<b>6.774,19</b>	<b>0,0%</b>	<b>2 meses</b>
Futuros			-49.019.478,50	-0,9%	4 meses
<b>Total de Futuros</b>			<b>-49.019.478,50</b>	<b>-0,9%</b>	<b>4 meses</b>
<b>Total em Inv em Bolsa - Renda Variável</b>			<b>561.783.971,54</b>	<b>10,0%</b>	<b>2 meses</b>
<b>Total de Patrimônio</b>			<b>5.602.440.187,16</b>	<b>100,0%</b>	<b>6 anos e 3 meses</b>