



CARTEIRA DOS INVESTIMENTOS

PCA	Valor em R\$ Mil	Mensal	Anual	% da Carteira	Alocação PI Gerencial	Alocação PI*	PORTFÓLIO
Renda Fixa	600.052	1,05%	1,05%	82,44%	72,30%	86,30%	
ALM	420.079	0,95%	0,95%	57,71%	-	-	
CDI	178.102	1,28%	1,28%	24,47%	-	-	
Créditos	789	1,30%	1,30%	0,11%	-	-	
Outros	1.082	1,08%	1,08%	0,15%	-	-	
Renda Variável	7.346	6,41%	6,41%	1,01%	6,40%	6,40%	
Ativista	7.346	6,41%	6,41%	1,01%	-	-	
Investimentos Estruturados	6.020	-0,49%	-0,49%	0,83%	5,50%	5,50%	
Fundo de Participações	6.020	-0,49%	-0,49%	0,83%	-	-	
Imóveis	111.960	0,58%	0,58%	15,38%	15,50%	1,50%	
Magé	4.060	1,04%	1,04%	0,56%	-	-	
Niterói	101.550	0,62%	0,62%	13,95%	-	-	
Petrópolis	6.350	-0,34%	-0,34%	0,87%	-	-	
Operações com Participantes	2.485	1,39%	1,39%	0,34%	0,30%	0,30%	
Total dos Investimentos	727.863	1,02%	1,02%	100,00%	100,00%	100,00%	

* Considerando venda do imóvel

PACV	Valor em R\$ Mil	Mensal	Anual	% da Carteira	Alocação PI	PORTFÓLIO
Renda Fixa	257.665	1,25%	1,25%	88,32%	73,10%	
ALM	110.879	0,92%	0,92%	38,01%	-	
CDI	96.688	1,28%	1,28%	33,14%	-	
IMA-B	49.572	1,92%	1,92%	16,99%	-	
Créditos	526	1,30%	1,30%	0,18%	-	
Renda Variável	27.813	5,79%	5,79%	9,53%	14,20%	
Ativista	6.459	5,07%	5,07%	2,21%	-	
Core	14.159	6,69%	6,69%	4,85%	-	
Dividendos	-	1,16%	1,16%	0,00%	-	
Valor	7.194	7,94%	7,94%	2,47%	-	
Investimentos Estruturados	4.433	-0,85%	-0,85%	1,52%	6,40%	
Fundo de Participações	4.013	-0,49%	-0,49%	1,38%	-	
Fundo Imobiliário	420	-4,20%	-4,20%	0,14%	-	
Investimentos no Exterior	-	-	-	-	5,50%	
Operações com Participantes	1.822	1,25%	1,25%	0,62%	0,80%	
Total dos Investimentos	291.732	1,71%	1,71%	100,00%	100,00%	

PGA	Valor em R\$ Mil	Mensal	Anual	% da Carteira	Alocação PI	PORTFÓLIO
Renda Fixa	7.665	1,28%	1,28%	100,00%	100,00%	
CDI	7.665	1,28%	1,28%	100,00%	100,00%	
Total dos Investimentos	7.665	1,28%	1,28%	100,00%	100,00%	

INDICADORES ECONÔMICOS

Ano	INPC	INPC + 5,5%aa	IGP-M	IPCA	CDI	103% CDI	120% CDI	IMA-B	IMA-B 5	IMA-B 5+	Ibovespa	IBX-100	IBX-100 + 2%aa	Dolar (PTAX)	Índice Pós-Fixado	Índice Pré-Fixado
2009	4,11%	9,84%	-1,71%	4,31%	9,90%	10,21%	11,88%	18,95%	14,97%	-	82,66%	72,84%	76,29%	-25,49%	23,20%	10,42%
2010	6,47%	12,32%	11,32%	5,91%	9,74%	10,05%	11,69%	17,04%	13,04%	21,85%	1,04%	2,62%	4,67%	-4,31%	10,05%	12,45%
2011	6,08%	11,91%	5,10%	6,50%	11,59%	11,96%	13,91%	15,11%	15,69%	14,48%	-18,11%	-11,39%	-9,62%	12,58%	6,51%	12,55%
2012	6,20%	12,04%	7,81%	5,84%	8,41%	8,68%	10,10%	26,68%	16,98%	34,21%	7,40%	11,55%	13,78%	8,94%	16,94%	12,31%
2013	5,56%	11,37%	5,53%	5,91%	8,05%	8,30%	9,66%	-10,02%	2,78%	-17,07%	-15,50%	-3,13%	-1,19%	14,64%	-9,80%	11,77%
2014	6,23%	12,07%	3,67%	6,41%	10,81%	11,15%	12,97%	14,54%	11,64%	16,60%	-2,92%	-2,78%	-0,84%	13,39%	8,04%	12,18%
2015	11,28%	17,40%	10,54%	10,67%	13,23%	13,65%	15,87%	8,88%	15,46%	5,71%	-13,31%	-12,41%	-10,66%	47,01%	1,56%	17,07%
2016	6,58%	12,44%	7,17%	6,29%	14,00%	14,45%	16,80%	24,81%	15,48%	31,04%	38,93%	36,69%	39,43%	-16,54%	17,13%	13,30%
2017																
Ano	INPC	INPC + 5,5%aa	IGP-M	IPCA	CDI	103% CDI	120% CDI	IMA-B	IMA-B 5	IMA-B 5+	Ibovespa	IBX-100	IBX-100 + 2%aa	Dolar (PTAX)	Índice Pós-Fixado	Índice Pré-Fixado
Janeiro	0,42%	0,87%	0,64%	0,38%	1,09%	1,12%	1,30%	1,87%	1,16%	2,24%	7,38%	7,21%	7,39%	-4,05%	1,64%	0,59%
Acumulado	0,42%	0,87%	0,64%	0,38%	1,09%	1,12%	1,30%	1,87%	1,16%	2,24%	7,38%	7,21%	7,39%	-4,05%	1,64%	0,59%