



CARTEIRA DOS INVESTIMENTOS

PCA	Valor em R\$ Mil	Mensal	Anual	% da Carteira	Alocação PI Gerencial	Alocação PI*	PORTFÓLIO
Renda Fixa	573.025	0,57%	5,51%	77,94%	72,30%	86,30%	
ALM	431.890	0,46%	5,21%	58,74%	-	-	
CDI	139.644	0,90%	6,62%	18,99%	-	-	
Créditos	351	0,99%	-54,94%	0,05%	-	-	
Outros	1.140	0,77%	6,54%	0,16%	-	-	
Renda Variável	47.445	7,40%	22,17%	6,45%	6,40%	6,40%	
Ativista	8.524	5,72%	23,46%	1,16%	-	-	
Valor	38.921	3,98%	6,61%	5,29%	-	-	
Investimentos Estruturados	5.978	0,15%	-1,17%	0,81%	5,50%	5,50%	
Fundo de Participações	5.978	0,15%	-1,17%	0,81%	-	-	
Imóveis	106.234	0,70%	-0,73%	14,45%	15,50%	1,50%	
Magé	4.731	0,95%	25,29%	0,64%	-	-	
Niterói	95.165	0,73%	-1,81%	12,94%	-	-	
Petrópolis	6.337	0,08%	0,10%	0,86%	-	-	
Operações com Participantes	2.520	1,26%	9,75%	0,34%	0,30%	0,30%	
Total dos Investimentos	735.202	0,80%	4,96%	100,00%	100,00%	100,00%	

* Considerando venda do imóvel

PACV	Valor em R\$ Mil	Mensal	Anual	% da Carteira	Alocação PI	PORTFÓLIO
Renda Fixa	256.896	1,32%	6,43%	83,99%	73,10%	
ALM	115.574	0,45%	5,05%	37,79%	-	
CDI	87.712	0,90%	6,63%	28,68%	-	
IMA-B	53.376	4,00%	9,74%	17,45%	-	
Créditos	234	0,99%	-54,94%	0,08%	-	
Renda Variável	42.703	4,65%	10,35%	13,96%	14,20%	
Ativista	6.467	5,28%	20,85%	2,11%	-	
Core	1.161	12,53%	16,98%	0,38%	-	
Valor	35.075	3,98%	7,92%	11,47%	-	
Investimentos Estruturados	4.435	1,41%	0,00%	1,45%	6,40%	
Fundo de Participações	3.985	0,15%	-1,17%	1,30%	-	
Fundo Imobiliário	450	14,27%	12,27%	0,15%	-	
Investimentos no Exterior	-	-	-	-	5,50%	
Operações com Participantes	1.814	1,24%	10,23%	0,59%	0,80%	
Total dos Investimentos	305.848	1,77%	7,06%	100,00%	100,00%	

PGA	Valor em R\$ Mil	Mensal	Anual	% da Carteira	Alocação PI	PORTFÓLIO
Renda Fixa	7.237	0,90%	6,63%	100,00%	100,00%	
CDI	7.237	0,90%	6,63%	100,00%	100,00%	
Total dos Investimentos	7.237	0,90%	6,63%	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%
Fevereiro	0,24%	0,69%	0,08%	0,33%	0,87%	0,89%	1,04%	3,85%	1,49%	5,06%	3,08%	3,30%	3,47%	-0,89%	1,57%	0,87%
Março	0,32%	0,77%	0,01%	0,25%	1,05%	1,08%	1,26%	1,04%	1,39%	0,88%	-2,52%	-2,35%	-2,19%	2,23%	0,61%	0,69%
Abril	0,08%	0,53%	-1,10%	0,14%	0,79%	0,81%	0,95%	-0,32%	0,71%	-0,82%	0,65%	0,88%	1,04%	0,95%	0,57%	0,77%
Mai	0,36%	0,81%	-0,93%	0,31%	0,93%	0,95%	1,11%	-1,19%	0,08%	-1,78%	-4,12%	-3,66%	-3,50%	1,42%	-0,14%	0,53%
Junho	-0,30%	0,15%	-0,67%	-0,23%	0,81%	0,84%	0,97%	0,16%	0,52%	-0,06%	0,30%	0,30%	0,46%	1,99%	0,75%	0,81%
Julho	0,17%	0,62%	-0,72%	0,27%	0,80%	0,82%	0,96%	4,00%	2,85%	4,67%	4,80%	4,91%	5,08%	-5,37%	1,74%	0,15%
Acumulado	1,30%	4,51%	-2,65%	1,46%	6,50%	6,70%	7,81%	9,67%	8,47%	10,43%	9,45%	10,59%	11,88%	-3,94%	6,93%	4,48%