

Relatório Analítico dos Investimentos em janeiro 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 (janeiro / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	9.599.864,09	2,85%	714	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	5.828.047,88	1,73%	604	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	18.394.613,39	5,47%	114	2,56%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.744.125,01	2,60%	619	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	19.004.599,26	5,65%	728	0,35%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.032.797,59	0,90%	1.181	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	44.389.691,73	13,20%	216	4,65%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	23.851.725,23	7,09%	258	1,70%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	66.247.669,77	19,69%	730	1,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	8.726.746,34	2,59%	37	1,57%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	D+1471	Não há	2.435.206,75	0,72%	33	2,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1901	Não há	3.366.591,98	1,00%	10	6,97%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	17.502.222,30	5,20%	770	0,25%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	16/05/2023	10.630.876,19	3,16%	52	3,97%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	12.643.597,03	3,76%	65	17,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.072.392,91	0,91%	439	0,15%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	11.853.509,05	3,52%	62	0,92%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	4.980.515,30	1,48%	70	2,98%	Artigo 7º, Inciso VI
TRX CORPORATIVO I FIDC SÊNIOR	D+1401	Não Informado	3.700.874,20	1,10%	7	20,78%	Artigo 7º, Inciso VI
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	13.638.213,17	4,05%	33	4,89%	Artigo 7º, Inciso VI
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	1.109.686,77	0,33%	444	5,50%	Artigo 8º, Inciso III
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	4.474.652,62	1,33%	715	4,99%	Artigo 8º, Inciso III

Carteira consolidada de investimentos - base (janeiro / 2017)

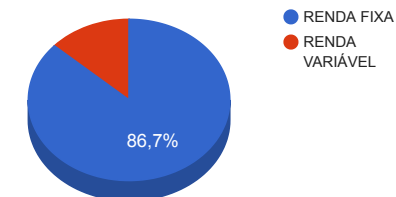
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	D+13	Não há	1.050.086,40	0,31%	215	1,88%	Artigo 8º, Inciso III
CONSTÂNCIA BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	1.102.528,22	0,33%	81	1,95%	Artigo 8º, Inciso III
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.069.396,18	0,62%	139	2,84%	Artigo 8º, Inciso III
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+180	Não há	6.045.955,08	1,80%	28	3,90%	Artigo 8º, Inciso IV
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	3.525.321,09	1,05%	36	13,54%	Artigo 8º, Inciso IV
W7 MULTIELSTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	10.269.527,26	3,05%			Artigo 8º, Inciso V
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	6.378.001,52	1,90%	8	14,08%	Artigo 8º, Inciso V
CSHG BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	Não se aplica	Não se aplica	1.245.045,46	0,37%		0,11%	Artigo 8º, Inciso VI
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	Não se aplica	Não se aplica	7.458.927,32	2,22%		4,91%	Artigo 8º, Inciso VI
Total			336.373.007,09				

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

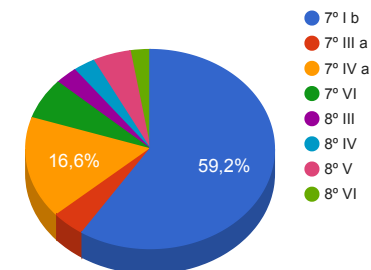
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	199.093.133,95	59,19%	30,00%	35,00%	70,00%	36.367.971,01
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	14.528.545,07	4,32%	15,00%	20,00%	60,00%	187.295.259,18
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	55.702.597,48	16,56%	5,00%	5,00%	30,00%	45.209.304,65
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	22.319.602,67	6,64%	5,00%	10,00%	15,00%	28.136.348,39
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	16.818.650,35
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	16.818.650,35
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	9.806.350,19	2,92%	5,00%	10,00%	15,00%	40.649.600,87
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	9.571.276,17	2,85%	2,00%	5,00%	5,00%	7.247.374,18
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	16.647.528,78	4,95%	2,00%	5,00%	5,00%	171.121,57
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	8.703.972,78	2,59%	2,00%	5,00%	5,00%	8.114.677,57
Total Carteira		336.373.007,09					

RENTA FIXA	291.643.879,17	86,70%
RENTA VARIÁVEL	44.729.127,92	13,30%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: janeiro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	199.093.133,95	59,19%	30,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	14.528.545,07	4,32%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	55.702.597,48	16,56%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	22.319.602,67	6,64%	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%
Artigo 8º, Inciso III	9.806.350,19	2,92%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	9.571.276,17	2,85%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	16.647.528,78	4,95%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	8.703.972,78	2,59%	2,00%	5,00%
Total	336.373.007,09	100,00%	66,00	215,00

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5+	2,24%	2,24%	3,87%	7,30%	32,37%	36,55%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,18%	2,18%	3,79%	7,13%	31,98%	35,25%	0,20%	4,406%	10,58%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,17%	2,17%	3,70%	7,12%	32,11%	35,89%	0,20%	4,499%	10,62%

IMA-B	1,87%	1,87%	3,55%	6,79%	24,76%	34,25%	-	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,84%	1,84%	3,47%	6,69%	24,54%	33,54%	0,20%	3,342%	7,49%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,84%	1,84%	3,55%	6,75%	24,64%	32,05%	0,20%	3,342%	7,48%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1,81%	1,81%	3,51%	6,68%	24,49%	33,16%	0,20%	3,355%	7,50%

IRF-M 1	1,29%	1,29%	3,58%	7,06%	14,32%	29,93%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,26%	1,26%	3,49%	6,90%	14,07%	29,23%	0,10%	0,297%	0,32%

IMA-B 5	1,16%	1,16%	2,97%	6,05%	13,45%	32,16%	-	-	-
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	2,69%	2,69%	2,80%	7,13%	-	-	0,70%	3,442%	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,14%	1,14%	2,92%	5,95%	13,21%	31,19%	0,20%	1,254%	2,49%
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1,07%	1,07%	2,80%	5,94%	13,28%	-	0,97%	1,431%	2,56%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,31%	0,31%	2,06%	5,14%	6,35%	9,06%	0,70%	2,077%	10,73%

IDKA IPCA 2 Anos	1,09%	1,09%	2,97%	6,30%	12,25%	32,94%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,08%	1,08%	2,89%	6,06%	12,74%	31,45%	0,20%	1,089%	2,32%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,06%	1,06%	2,89%	5,98%	12,92%	31,70%	0,20%	1,042%	2,26%

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

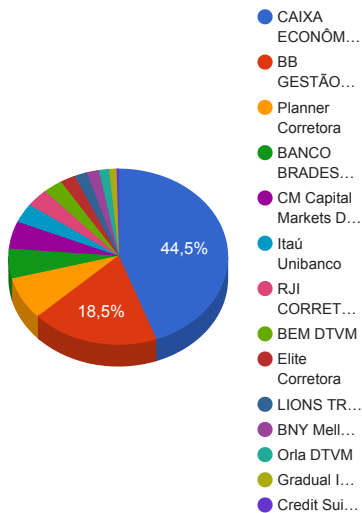
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	1,08%	1,08%	3,28%	6,80%	14,03%	29,29%	-	-	-
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	1,16%	1,16%	3,66%	7,37%	15,41%	32,59%	0,75%	3,555%	4,66%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,07%	1,07%	3,27%	6,77%	14,03%	29,36%	0,20%	0,035%	0,05%
IPCA + 7,00% ao ano	0,97%	0,97%	2,61%	5,20%	12,76%	33,46%	-	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	17,42%	17,42%	20,22%	-14,78%	-54,94%	-49,37%	0,00%	27,916%	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	0,94%	0,94%	2,72%	5,54%	13,52%	31,29%	1,65%	-	-
IPCA + 6,00% ao ano	0,89%	0,89%	2,37%	4,70%	11,70%	30,99%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,40%	1,40%	2,99%	6,20%	21,41%	31,09%	0,15%	2,851%	6,75%
IPCA	0,38%	0,38%	0,86%	1,65%	5,35%	16,63%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2,12%	2,12%	4,05%	7,96%	22,33%	-	0,40%	2,037%	4,55%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,10%	1,10%	3,27%	6,75%	13,98%	28,81%	0,20%	0,052%	0,09%
TRX CORPORATIVO I FIDC SÊNIOR	-35,55%	-35,55%	-64,76%	-63,73%	-	-	1,55%	47,995%	-

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

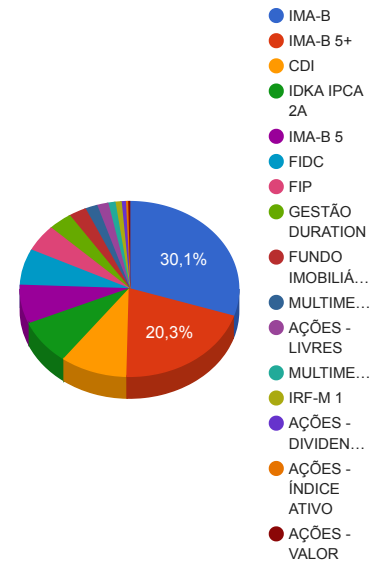
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDIV	8,58%	8,58%	5,25%	22,83%	92,63%	42,36%	-	-	-
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	3,19%	3,19%	-4,08%	-2,61%	29,70%	27,99%	2,00%	5,235%	14,11%
Ibovespa	7,38%	7,38%	-0,39%	12,85%	60,05%	37,87%	-	-	-
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	7,50%	7,50%	2,82%	12,57%	50,69%	44,22%	2,00%	7,030%	17,51%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	6,31%	6,31%	3,18%	12,02%	48,22%	42,56%	1,85%	4,850%	13,45%
CONSTÂNCIA BRASIL FI AÇÕES	5,50%	5,50%	0,04%	10,54%	42,88%	22,58%	2,00%	8,283%	21,98%
IBX	7,21%	7,21%	-0,75%	11,82%	56,33%	36,38%	-	-	-
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	4,93%	4,93%	-3,41%	1,65%	24,92%	22,62%	2,00%	5,608%	14,77%
CDI	1,08%	1,08%	3,28%	6,80%	14,03%	29,29%	-	-	-
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1,33%	1,33%	3,47%	6,87%	15,59%	32,01%	0,55%	0,283%	1,28%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	1,02%	1,02%	3,65%	6,60%	16,66%	37,33%	1,00%	4,161%	18,28%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CSHG BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	2,51%	2,51%	4,02%	13,10%	53,59%	-	0,60%	5,968%	18,40%
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	0,12%	0,12%	-15,15%	-11,12%	-28,96%	-20,79%	0,00%	0,215%	32,69%
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	-	-	-	-	-	-	1,35%	0,000%	0,00%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	149.555.965,81	44,46%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	62.348.046,15	18,54%
Planner Corretora	26.438.445,38	7,86%
BANCO BRADESCO	18.394.613,39	5,47%
CM Capital Markets DTVM	17.004.805,15	5,06%
Itaú Unibanco	11.853.509,05	3,52%
RJI CORRETORA DE VALORES	11.161.953,09	3,32%
BEM DTVM	9.806.350,19	2,92%
Elite Corretora	7.458.927,32	2,22%
LIONS TRUST	6.378.001,52	1,90%
BNY Mellon Serviços Financeiros	6.045.955,08	1,80%
Orla DTVM	4.980.515,30	1,48%
Gradual Investimentos	3.700.874,20	1,10%
Credit Suisse Hedging-Griffo Corretora	1.245.045,46	0,37%

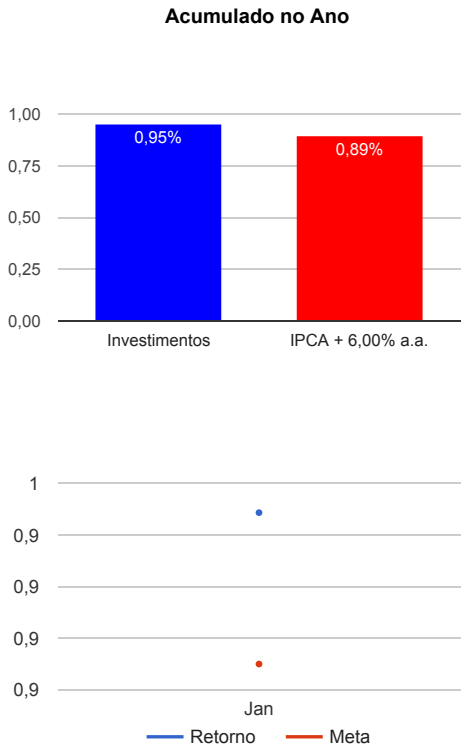


Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	101.101.207,23	30,06%
IMA-B 5+	68.241.416,96	20,29%
CDI	33.218.212,24	9,88%
IDKA IPCA 2A	27.748.724,27	8,25%
IMA-B 5	24.128.409,16	7,17%
FIDC	22.319.602,67	6,64%
FIP	16.647.528,78	4,95%
GESTÃO DURATION	11.853.509,05	3,52%
FUNDO IMOBILIÁRIO	8.703.972,78	2,59%
MULTIMERCADO - CRÉDITO PRIVADO	6.045.955,08	1,80%
AÇÕES - LIVRES	5.584.339,39	1,66%
MULTIMERCADO - MODERADO	3.525.321,09	1,05%
IRF-M 1	3.032.797,59	0,90%
AÇÕES - DIVIDENDOS	2.069.396,18	0,62%
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	1.102.528,22	0,33%
AÇÕES - VALOR	1.050.086,40	0,31%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	333.191.383,73	50.805.024,13	50.784.536,34	336.373.007,09	3.161.135,57	0,95%	0,89%	106,36%	3,77%
Acumulado no ano					3.161.135,57	0,95%	0,89%	106,36%	



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	2.371.440,05	0,00	0,00	2.435.206,75	63.766,70	2,69%	3,44%	2,69%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	11.607.637,71	0,00	0,00	11.853.509,05	245.871,34	2,12%	2,04%	2,12%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.722.507,90	0,00	0,00	5.828.047,88	105.539,98	1,84%	3,34%	1,84%
BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	18.067.287,64	0,00	0,00	18.394.613,39	327.325,75	1,81%	3,35%	1,81%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	24.769.567,73	19.002.705,01	0,00	44.389.691,73	617.418,99	1,41%	4,41%	2,18%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.484.255,57	0,00	0,00	10.630.876,19	146.620,62	1,40%	2,85%	1,40%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	46.390.258,49	19.000.000,00	0,00	66.247.669,77	857.411,28	1,31%	3,34%	1,84%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.072.181,68	0,00	78.093,63	3.032.797,59	38.709,54	1,26%	0,30%	1,26%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	24.300.404,23	0,00	15.000.000,00	9.599.864,09	299.459,86	1,23%	1,25%	1,14%
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	12.498.340,31	0,00	0,00	12.643.597,03	145.256,72	1,16%	3,55%	1,16%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	15.566.145,35	0,00	7.000.000,00	8.744.125,01	177.979,66	1,14%	1,04%	1,06%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	30.654.139,26	0,00	12.000.000,00	19.004.599,26	350.460,00	1,14%	1,09%	1,08%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.587.848,74	12.000.000,00	0,00	23.851.725,23	263.876,49	1,12%	4,50%	2,17%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.160.909,18	0,00	2.145.388,18	3.072.392,91	56.871,91	1,10%	0,05%	1,10%
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	3.330.876,94	0,00	0,00	3.366.591,98	35.715,04	1,07%	1,43%	1,07%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	21.281.598,30	802.319,12	4.797.296,99	17.502.222,30	215.601,87	0,98%	0,03%	1,07%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	13.511.642,84	0,00	0,00	13.638.213,17	126.570,33	0,94%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.601.268,41	0,00	7.668.060,79	0,00	66.792,38	0,88%	0,29%	1,26%
TRX CORPORATIVO I FIDC SÊNIOR	5.742.577,25	0,00	2.087.430,55	3.700.874,20	45.727,50	0,80%	47,99%	-35,55%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	4.958.570,12	0,00	0,00	4.980.515,30	21.945,18	0,44%	27,92%	17,42%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	8.699.769,04	0,00	0,00	8.726.746,34	26.977,30	0,31%	2,08%	0,31%
Total Renda Fixa					4.235.898,44	1,47%	3,94%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	1.032.220,98	0,00	0,00	1.109.686,77	77.465,79	7,50%	7,03%	7,50%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4.209.111,27	0,00	0,00	4.474.652,62	265.541,35	6,31%	4,85%	6,31%
CONSTÂNCIA BRASIL FI AÇÕES	1.045.097,33	0,00	0,00	1.102.528,22	57.430,89	5,50%	8,28%	5,50%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	1.000.749,28	0,00	0,00	1.050.086,40	49.337,12	4,93%	5,61%	4,93%
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.005.504,94	0,00	0,00	2.069.396,18	63.891,24	3,19%	5,24%	3,19%
CSHG BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	1.214.712,10	0,00	8.266,20	1.245.045,46	38.599,56	3,18%	5,97%	2,51%
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	5.966.581,79	0,00	0,00	6.045.955,08	79.373,29	1,33%	0,28%	1,33%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	3.489.703,06	0,00	0,00	3.525.321,09	35.618,03	1,02%	4,16%	1,02%
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	6.370.623,06	0,00	0,00	6.378.001,52	7.378,46	0,12%	0,21%	0,12%
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	10.288.177,28	0,00	0,00	10.269.527,26	-18.650,02	-0,18%	-	-
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	9.189.675,90	0,00	0,00	7.458.927,32	-1.730.748,58	-18,83%	0,00%	-18,83%
Total Renda Variável					-1.074.762,87	-2,35%	2,34%	