

Relatório Analítico dos Investimentos em fevereiro 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 (fevereiro / 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 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	70.080.032,78	20,27%	746	1,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	19.095.113,07	5,52%	117	2,40%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	25.042.280,85	7,24%	282	1,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	19.256.606,82	5,57%	722	0,36%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	46.779.041,32	13,53%	248	3,41%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	6.052.222,71	1,75%	624	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.985.419,72	0,86%	1.177	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.845.814,29	2,27%	611	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	9.741.715,73	2,82%	712	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1901	Não há	3.415.055,83	0,99%	10	6,97%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	1.007.857,59	0,29%	22	7,65%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	D+1471	Não há	2.427.772,75	0,70%	32	2,17%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	8.826.194,69	2,55%	36	1,64%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	17.874.653,13	5,17%	764	0,28%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	16/05/2023	10.917.481,21	3,16%	52	3,97%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.474.557,94	0,72%	433	0,13%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	12.759.875,43	3,69%	63	17,20%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	12.156.320,76	3,52%	62	0,89%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TRX CORPORATIVO I FIDC SÊNIOR	D+1401	Não Informado	2.891.517,54	0,84%	7	20,78%	Artigo 7º, Inciso VI
LME REC IPCA FIDC MULTISSECTORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	5.035.916,50	1,46%	70	3,61%	Artigo 7º, Inciso VI
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	13.720.063,56	3,97%			Artigo 7º, Inciso VI
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	1.158.217,17	0,34%	675	5,08%	Artigo 8º, Inciso III

Carteira consolidada de investimentos - base (fevereiro / 2017)

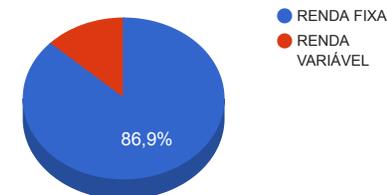
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	4.583.422,39	1,33%	946	4,72%	Artigo 8º, Inciso III
CONSTÂNCIA BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	1.138.036,43	0,33%	80	1,88%	Artigo 8º, Inciso III
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.129.377,72	0,62%	139	2,82%	Artigo 8º, Inciso III
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	D+13	Não há	1.080.166,65	0,31%	242	1,69%	Artigo 8º, Inciso III
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+180	Não há	6.133.426,24	1,77%	28	3,90%	Artigo 8º, Inciso IV
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	3.563.264,66	1,03%	38	12,49%	Artigo 8º, Inciso IV
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	6.380.974,93	1,85%	8	14,08%	Artigo 8º, Inciso V
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	10.252.366,40	2,97%			Artigo 8º, Inciso V
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	Não se aplica	Não se aplica	7.443.315,28	2,15%		4,91%	Artigo 8º, Inciso VI
CSHG BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	Não se aplica	Não se aplica	1.427.357,10	0,41%		0,11%	Artigo 8º, Inciso VI
		Total	345.675.439,19				

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

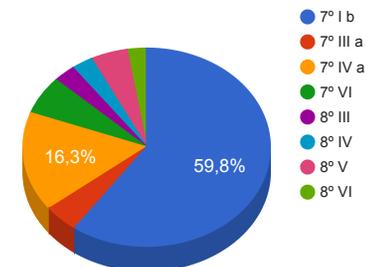
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	206.878.247,29	59,85%	30,00%	35,00%	70,00%	35.094.560,14
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	15.676.880,86	4,54%	15,00%	20,00%	60,00%	191.728.382,65
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	56.182.888,47	16,25%	5,00%	5,00%	30,00%	47.519.743,29
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	21.647.497,60	6,26%	5,00%	10,00%	15,00%	30.203.818,28
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	17.283.771,96
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	17.283.771,96
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	10.089.220,36	2,92%	5,00%	10,00%	15,00%	41.762.095,52
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	9.696.690,90	2,81%	2,00%	5,00%	5,00%	7.587.081,06
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	16.633.341,33	4,81%	2,00%	5,00%	5,00%	650.430,63
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	8.870.672,38	2,57%	2,00%	5,00%	5,00%	8.413.099,58
Total Carteira		345.675.439,19					

RENDA FIXA	300.385.514,22	86,90%
RENDA VARIÁVEL	45.289.924,97	13,10%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: fevereiro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	206.878.247,29	59,85%	30,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	15.676.880,86	4,54%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	56.182.888,47	16,25%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	21.647.497,60	6,26%	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	10.089.220,36	2,92%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	9.696.690,90	2,81%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	16.633.341,33	4,81%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	8.870.672,38	2,57%	2,00%	5,00%
Total	345.675.439,19	100,00%	66,00	215,00

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5+	5,06%	7,41%	11,40%	11,75%	35,35%	43,21%	-	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4,99%	7,26%	11,25%	11,47%	35,16%	42,32%	0,20%	2,464%	10,46%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4,97%	7,26%	11,23%	11,54%	34,89%	41,79%	0,20%	2,447%	10,42%
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	1,03%	3,05%	5,24%	13,51%	59,22%	50,99%	0,50%	1,740%	12,16%

IMA-B	3,85%	5,79%	8,86%	9,92%	26,69%	38,66%	-	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,85%	5,76%	8,82%	9,81%	26,50%	37,94%	0,20%	1,855%	7,39%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,83%	5,74%	8,78%	9,92%	26,54%	36,41%	0,20%	1,859%	7,37%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	3,81%	5,69%	8,74%	9,83%	26,39%	37,57%	0,20%	1,861%	7,40%

IMA-B 5	1,49%	2,67%	4,10%	6,47%	13,40%	32,51%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,48%	2,63%	4,05%	6,38%	13,17%	31,63%	0,20%	0,715%	2,39%
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1,44%	2,53%	3,97%	6,34%	13,48%	-	0,97%	0,699%	2,47%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1,14%	1,45%	3,00%	5,05%	11,07%	9,24%	0,70%	0,510%	9,70%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	-0,31%	2,38%	3,49%	5,68%	-	-	0,70%	2,156%	-

IDKA IPCA 2 Anos	1,35%	2,45%	3,77%	6,37%	12,42%	33,17%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,33%	2,42%	3,70%	6,10%	12,74%	31,60%	0,20%	0,609%	2,20%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,29%	2,37%	3,63%	6,06%	12,84%	31,83%	0,20%	0,596%	2,15%

IRF-M 1	1,01%	2,31%	3,53%	6,86%	14,23%	30,27%	-	-	-
---------	-------	-------	-------	-------	--------	--------	---	---	---

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

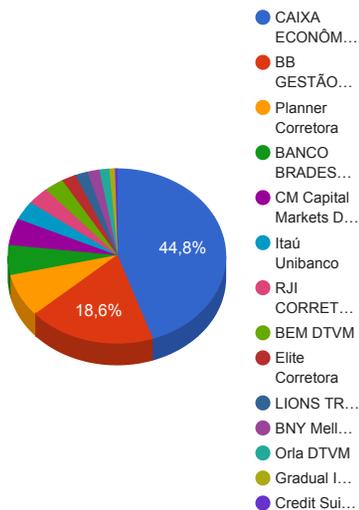
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,99%	2,26%	3,45%	6,72%	13,95%	29,58%	0,10%	0,083%	0,31%
CDI	0,86%	1,96%	3,10%	6,43%	13,88%	29,35%	-	-	-
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	0,92%	2,09%	3,48%	7,04%	15,27%	32,71%	0,75%	1,702%	4,57%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,88%	1,96%	3,09%	6,43%	13,90%	29,43%	0,20%	0,044%	0,05%
IPCA + 7,00% ao ano	0,82%	1,80%	2,71%	4,95%	12,09%	32,29%	-	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	0,60%	1,54%	2,41%	5,00%	12,52%	30,55%	1,65%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-16,37%	-1,80%	-1,02%	-30,35%	-61,90%	-58,31%	0,00%	-	-
IPCA + 6,00% ao ano	0,75%	1,65%	2,47%	4,47%	11,04%	29,84%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,70%	4,13%	5,96%	7,60%	21,08%	34,12%	0,15%	1,773%	6,59%
IPCA	0,33%	0,71%	1,01%	1,54%	4,76%	15,61%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2,55%	4,73%	6,95%	9,72%	23,39%	-	0,40%	1,168%	4,57%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,90%	2,01%	3,14%	6,44%	13,86%	28,91%	0,20%	0,049%	0,09%
TRX CORPORATIVO I FIDC SÊNIOR	-21,87%	-49,65%	-72,70%	-72,00%	-	-	1,55%	37,509%	-

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

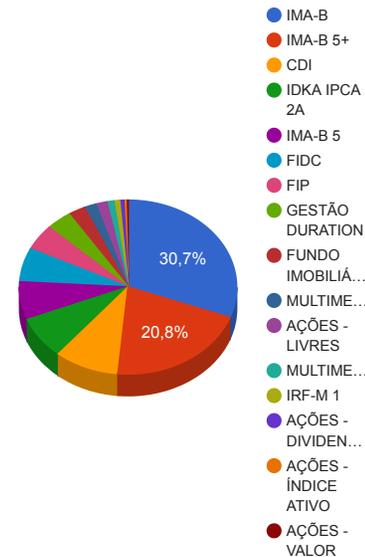
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDIV	7,00%	16,18%	15,16%	29,01%	90,61%	38,26%	-	-	-
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	2,90%	6,18%	5,70%	-0,01%	27,80%	25,55%	2,00%	4,390%	13,75%
IBX	3,30%	10,75%	7,92%	14,24%	53,37%	28,87%	-	-	-
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	2,86%	7,94%	7,39%	5,89%	27,34%	20,21%	2,00%	5,086%	14,51%
Ibovespa	3,08%	10,68%	7,68%	15,13%	55,78%	29,23%	-	-	-
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	4,37%	12,21%	11,34%	16,94%	57,10%	40,19%	2,00%	5,889%	17,40%
CONSTÂNCIA BRASIL FI AÇÕES	3,22%	8,89%	8,29%	13,64%	41,83%	17,79%	2,00%	7,099%	20,85%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2,43%	8,89%	10,17%	14,82%	46,75%	39,78%	1,85%	4,707%	13,37%
CDI	0,86%	1,96%	3,10%	6,43%	13,88%	29,35%	-	-	-
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1,45%	2,80%	4,13%	7,16%	15,52%	32,53%	0,55%	0,421%	1,23%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	1,08%	2,11%	3,39%	8,73%	16,95%	38,23%	1,00%	1,227%	18,18%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CSHG BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	12,25%	15,07%	16,86%	22,62%	68,04%	-	0,60%	9,622%	18,36%
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	0,05%	0,16%	-0,08%	-11,20%	-6,38%	-20,56%	0,00%	0,257%	22,32%
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	-	-	-	-	-	-	1,35%	0,000%	0,00%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	154.795.815,19	44,78%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	64.254.011,31	18,59%
Planner Corretora	27.583.364,08	7,98%
BANCO BRADESCO	19.095.113,07	5,52%
CM Capital Markets DTVM	17.135.119,39	4,96%
Itaú Unibanco	12.156.320,76	3,52%
RJI CORRETORA DE VALORES	11.253.967,44	3,26%
BEM DTVM	10.089.220,36	2,92%
Elite Corretora	7.443.315,28	2,15%
LIONS TRUST	6.380.974,93	1,85%
BNY Mellon Serviços Financeiros	6.133.426,24	1,77%
Orla DTVM	5.035.916,50	1,46%
Gradual Investimentos	2.891.517,54	0,84%
Credit Suisse Hedging-Griffo Corretora	1.427.357,10	0,41%



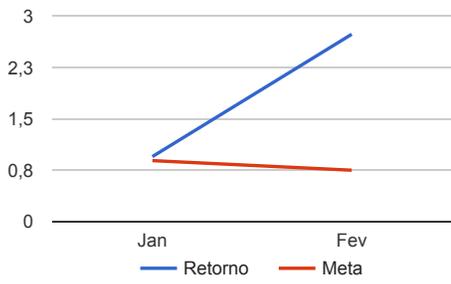
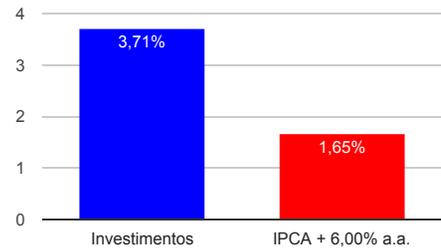
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	106.144.849,77	30,71%
IMA-B 5+	71.821.322,17	20,78%
CDI	33.109.086,50	9,58%
IDKA IPCA 2A	27.102.421,11	7,84%
IMA-B 5	24.410.739,00	7,06%
FIDC	21.647.497,60	6,26%
FIP	16.633.341,33	4,81%
GESTÃO DURATION	13.164.178,35	3,81%
FUNDO IMOBILIÁRIO	8.870.672,38	2,57%
MULTIMERCADO - CRÉDITO PRIVADO	6.133.426,24	1,77%
AÇÕES - LIVRES	5.741.639,56	1,66%
MULTIMERCADO - MODERADO	3.563.264,66	1,03%
IRF-M 1	2.985.419,72	0,86%
AÇÕES - DIVIDENDOS	2.129.377,72	0,62%
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	1.138.036,43	0,33%
AÇÕES - VALOR	1.080.166,65	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%
Fevereiro	336.373.007,09	4.383.044,13	4.286.869,69	345.675.439,19	9.206.257,66	2,74%	0,75%	365,57%	1,99%
Acumulado no ano					12.367.393,23	3,71%	1,65%	225,30%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	23.851.725,23	0,00	0,00	25.042.280,85	1.190.555,62	4,99%	2,46%	4,99%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	44.389.691,73	176.101,08	0,00	46.779.041,32	2.213.248,51	4,97%	2,45%	4,97%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.828.047,88	0,00	0,00	6.052.222,71	224.174,83	3,85%	1,85%	3,85%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	66.247.669,77	1.261.296,20	0,00	70.080.032,78	2.571.066,81	3,81%	1,86%	3,83%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	18.394.613,39	0,00	0,00	19.095.113,07	700.499,68	3,81%	1,86%	3,81%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.630.876,19	0,00	0,00	10.917.481,21	286.605,02	2,70%	1,77%	2,70%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	11.853.509,05	0,00	0,00	12.156.320,76	302.811,71	2,55%	1,17%	2,55%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.599.864,09	0,00	0,00	9.741.715,73	141.851,64	1,48%	0,72%	1,48%
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	3.366.591,98	0,00	0,00	3.415.055,83	48.463,85	1,44%	0,70%	1,44%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	19.004.599,26	0,00	0,00	19.256.606,82	252.007,56	1,33%	0,61%	1,33%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.744.125,01	0,00	1.000.000,00	7.845.814,29	101.689,28	1,16%	0,60%	1,29%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	8.726.746,34	0,00	0,00	8.826.194,69	99.448,35	1,14%	0,51%	1,14%
LME REC IPCA FIDC MULTISSECTORIAL SÊNIOR	4.980.515,30	0,00	0,00	5.035.916,50	55.401,20	1,11%	-	-16,37%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.032.797,59	0,00	77.279,53	2.985.419,72	29.901,66	0,99%	0,08%	0,99%
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	12.643.597,03	0,00	0,00	12.759.875,43	116.278,40	0,92%	1,70%	0,92%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.072.392,91	0,00	625.489,48	2.474.557,94	27.654,51	0,90%	0,05%	0,90%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	17.502.222,30	1.945.646,85	1.736.173,81	17.874.653,13	162.957,79	0,84%	0,04%	0,88%
TRX CORPORATIVO I FIDC SÊNIOR	3.700.874,20	0,00	839.660,67	2.891.517,54	30.304,01	0,82%	37,51%	-21,87%
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	0,00	1.000.000,00	0,00	1.007.857,59	7.857,59	0,79%	1,74%	1,03%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	13.638.213,17	0,00	0,00	13.720.063,56	81.850,39	0,60%	-	-
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	2.435.206,75	0,00	0,00	2.427.772,75	-7.434,00	-0,31%	2,16%	-0,31%
Total Renda Fixa					8.637.194,41	2,96%	1,97%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CSHG BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	1.245.045,46	0,00	8.266,20	1.427.357,10	190.577,84	15,31%	9,62%	12,25%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	1.109.686,77	0,00	0,00	1.158.217,17	48.530,40	4,37%	5,89%	4,37%
CONSTÂNCIA BRASIL FI AÇÕES	1.102.528,22	0,00	0,00	1.138.036,43	35.508,21	3,22%	7,10%	3,22%
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.069.396,18	0,00	0,00	2.129.377,72	59.981,54	2,90%	4,39%	2,90%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	1.050.086,40	0,00	0,00	1.080.166,65	30.080,25	2,86%	5,09%	2,86%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4.474.652,62	0,00	0,00	4.583.422,39	108.769,77	2,43%	4,71%	2,43%
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	6.045.955,08	0,00	0,00	6.133.426,24	87.471,16	1,45%	0,42%	1,45%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	3.525.321,09	0,00	0,00	3.563.264,66	37.943,57	1,08%	1,23%	1,08%
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	6.378.001,52	0,00	0,00	6.380.974,93	2.973,41	0,05%	0,26%	0,05%
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	10.269.527,26	0,00	0,00	10.252.366,40	-17.160,86	-0,17%	-	-
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	7.458.927,32	0,00	0,00	7.443.315,28	-15.612,04	-0,21%	0,00%	-0,21%
Total Renda Variável					569.063,25	1,27%	2,10%	