

# Relatório Analítico dos Investimentos em março e 1º Trimestre 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 (março / 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	9.875.888,40	2,83%	718	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	15.257.543,90	4,37%	116	1,88%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	6.113.892,24	1,75%	628	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.957.167,22	2,28%	609	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.941.484,36	0,84%	1.170	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	19.527.774,79	5,60%	719	0,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	72.209.379,42	20,69%	766	1,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	25.250.448,93	7,23%	303	1,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	47.596.283,66	13,64%	273	3,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1901	Não há	3.466.134,88	0,99%	10	6,82%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	D+1471	Não há	2.455.128,33	0,70%	31	2,18%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	1.034.341,31	0,30%	23	5,72%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	8.869.784,24	2,54%	35	1,65%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	488.053,75	0,14%	433	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	12.940.790,94	3,71%	63	17,28%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	18.863.552,00	5,40%	754	0,30%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	16/05/2023	11.095.085,49	3,18%	52	3,97%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	12.268.326,92	3,52%	62	0,89%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	5.083.700,56	1,46%	70	3,49%	Artigo 7º, Inciso VI
TRX CORPORATIVO I FIDC SÊNIOR	D+1401	Não Informado	2.525.443,67	0,72%	7	20,78%	Artigo 7º, Inciso VI
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	13.864.662,51	3,97%			Artigo 7º, Inciso VI
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	2.133.612,69	0,61%	916	7,94%	Artigo 8º, Inciso III

Carteira consolidada de investimentos - base (março / 2017)

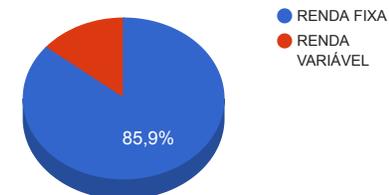
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	4.635.137,72	1,33%	1.108	4,55%	Artigo 8º, Inciso III
CONSTÂNCIA BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	2.123.697,00	0,61%	81	3,52%	Artigo 8º, Inciso III
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	D+13	Não há	2.076.684,49	0,60%	283	3,18%	Artigo 8º, Inciso III
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	3.115.304,74	0,89%	138	4,12%	Artigo 8º, Inciso III
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+180	Não há	6.153.865,84	1,76%	26	4,02%	Artigo 8º, Inciso IV
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	3.621.790,10	1,04%	40	11,35%	Artigo 8º, Inciso IV
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	10.229.606,70	2,93%			Artigo 8º, Inciso V
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	6.469.815,40	1,85%	8	14,08%	Artigo 8º, Inciso V
CSHG BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	Não se aplica	Não se aplica	1.314.523,47	0,38%		0,11%	Artigo 8º, Inciso VI
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	Não se aplica	Não se aplica	7.447.168,46	2,13%		4,91%	Artigo 8º, Inciso VI
		<b>Total</b>	<b>349.006.074,13</b>				

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

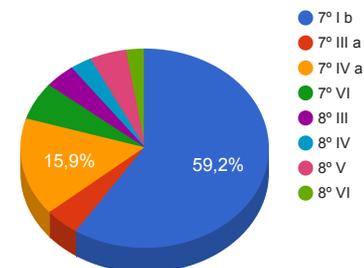
Artigos	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	206.729.862,92	59,23%	30,00%	35,00%	70,00%	37.574.388,97
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	15.825.388,76	4,53%	15,00%	20,00%	60,00%	193.578.255,72
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	55.655.809,10	15,95%	5,00%	5,00%	30,00%	49.046.013,14
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	21.473.806,74	6,15%	5,00%	10,00%	15,00%	30.877.104,38
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	17.450.303,71
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	17.450.303,71
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	14.084.436,64	4,04%	5,00%	10,00%	15,00%	38.266.474,48
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	9.775.655,94	2,80%	2,00%	5,00%	5,00%	7.674.647,77
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	16.699.422,10	4,78%	2,00%	5,00%	5,00%	750.881,61
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	8.761.691,93	2,51%	2,00%	5,00%	5,00%	8.688.611,78
<b>Total Carteira</b>		<b>349.006.074,13</b>					

RENDA FIXA	299.684.867,52	85,87%
RENDA VARIÁVEL	49.321.206,61	14,13%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: março / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	206.729.862,92	59,23%	30,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	15.825.388,76	4,53%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	55.655.809,10	15,95%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	21.473.806,74	6,15%	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	14.084.436,64	4,04%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	9.775.655,94	2,80%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	16.699.422,10	4,78%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	8.761.691,93	2,51%	2,00%	5,00%
<b>Total</b>	<b>349.006.074,13</b>	<b>100,00%</b>	<b>66,00</b>	<b>215,00</b>

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDKA IPCA 2 Anos	1,62%	4,11%	4,11%	6,49%	14,06%	33,81%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,42%	3,82%	3,82%	6,15%	13,74%	32,33%	0,20%	0,660%	1,88%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,41%	3,87%	3,87%	6,17%	13,72%	32,21%	0,20%	0,680%	1,94%
IMA-B 5	1,39%	4,09%	4,09%	6,45%	14,11%	32,99%	-	-	-
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1,50%	4,06%	4,06%	6,39%	14,24%	-	0,97%	0,840%	2,19%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,38%	4,05%	4,05%	6,36%	13,89%	32,16%	0,20%	0,760%	2,16%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	1,13%	3,53%	3,53%	5,75%	-	-	0,70%	5,740%	8,28%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,49%	1,95%	1,95%	4,28%	12,90%	9,20%	0,70%	0,960%	2,83%
IRF-M 1	1,12%	3,46%	3,46%	6,79%	14,08%	30,52%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,10%	3,39%	3,39%	6,65%	13,82%	29,85%	0,10%	0,130%	0,30%
CDI	1,05%	3,03%	3,03%	6,37%	13,75%	29,37%	-	-	-
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	1,42%	3,54%	3,54%	7,16%	15,37%	33,01%	0,75%	4,010%	5,00%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,07%	3,05%	3,05%	6,39%	13,77%	29,47%	0,20%	0,030%	0,06%
IMA-B	1,04%	6,89%	6,89%	9,36%	21,56%	40,51%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,03%	6,83%	6,83%	9,33%	21,40%	38,26%	0,20%	2,050%	6,15%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,02%	6,84%	6,84%	9,22%	21,32%	39,81%	0,20%	2,050%	6,16%
BRAPRES INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1,01%	6,76%	6,76%	9,23%	21,22%	39,47%	0,20%	2,060%	6,17%

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

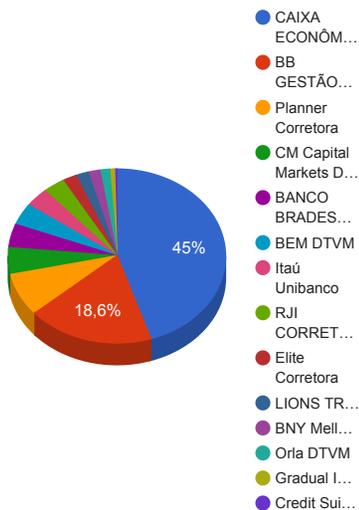
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5+	0,88%	8,35%	8,35%	10,88%	26,07%	45,95%	-	-	-
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	2,63%	5,75%	5,75%	12,51%	49,17%	60,74%	0,50%	1,200%	11,08%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,84%	8,15%	8,15%	10,63%	25,55%	44,50%	0,20%	2,720%	8,47%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,83%	8,16%	8,16%	10,58%	25,74%	45,01%	0,20%	2,740%	8,46%
IPCA + 7,00% ao ano	0,87%	2,69%	2,69%	5,18%	11,92%	30,93%	-	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	4,41%	2,52%	2,52%	-22,63%	-55,02%	-57,39%	0,00%	7,770%	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1,05%	2,61%	2,61%	5,22%	12,24%	30,02%	1,65%	-	-
IPCA + 6,00% ao ano	0,78%	2,44%	2,44%	4,69%	10,87%	28,50%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,63%	5,83%	5,83%	7,96%	18,57%	36,60%	0,15%	1,600%	5,54%
IPCA	0,25%	0,96%	0,96%	1,71%	4,57%	14,39%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,32%	6,11%	6,11%	9,19%	20,42%	-	0,40%	1,520%	4,02%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,05%	3,09%	3,09%	6,39%	13,73%	29,03%	0,20%	0,060%	0,08%
TRX CORPORATIVO I FIDC SÊNIOR	-12,66%	-56,02%	-56,02%	-75,80%	-	-	1,55%	55,550%	-

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

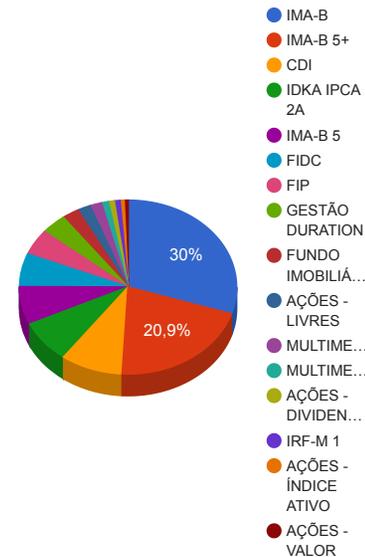
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	1,05%	3,03%	3,03%	6,37%	13,75%	29,37%	-	-	-
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	1,64%	3,79%	3,79%	7,66%	16,57%	37,74%	1,00%	3,350%	17,62%
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	0,33%	3,14%	3,14%	6,45%	14,49%	31,72%	0,55%	1,180%	1,21%
Ibovespa	-2,52%	7,90%	7,90%	11,34%	29,83%	27,05%	-	-	-
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1,13%	10,12%	10,12%	15,39%	38,29%	42,73%	1,85%	4,160%	12,60%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	-1,29%	10,76%	10,76%	14,95%	36,04%	36,25%	2,00%	5,680%	15,13%
CONSTÂNCIA BRASIL FI AÇÕES	-1,86%	6,87%	6,87%	10,57%	24,60%	16,76%	2,00%	7,730%	18,81%
IBX	-2,35%	8,14%	8,14%	10,88%	29,76%	26,48%	-	-	-
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	-1,59%	6,22%	6,22%	3,79%	17,75%	15,84%	2,00%	5,130%	13,81%
IDIV	-1,85%	14,03%	14,03%	26,96%	55,13%	41,56%	-	-	-
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	-0,78%	5,35%	5,35%	-0,35%	13,78%	22,62%	2,00%	4,970%	12,67%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	0,74%	0,91%	0,91%	-10,78%	-11,50%	-19,58%	0,00%	0,460%	18,86%
CSHG BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	-5,82%	8,37%	8,37%	10,44%	42,86%	-	0,60%	12,390%	18,03%
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	-	-	-	-	-	-	1,35%	0,000%	0,00%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	156.990.324,45	44,98%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	64.928.685,81	18,60%
Planner Corretora	27.826.529,05	7,97%
CM Capital Markets DTVM	17.330.797,39	4,97%
BANCO BRADESCO	15.257.543,90	4,37%
BEM DTVM	14.084.436,64	4,04%
Itaú Unibanco	12.268.326,92	3,52%
RJI CORRETORA DE VALORES	11.324.912,57	3,24%
Elite Corretora	7.447.168,46	2,13%
LIONS TRUST	6.469.815,40	1,85%
BNY Mellon Serviços Financeiros	6.153.865,84	1,76%
Orla DTVM	5.083.700,56	1,46%
Gradual Investimentos	2.525.443,67	0,72%
Credit Suisse Hedging-Griffo Corretora	1.314.523,47	0,38%



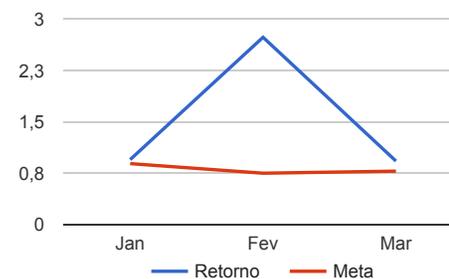
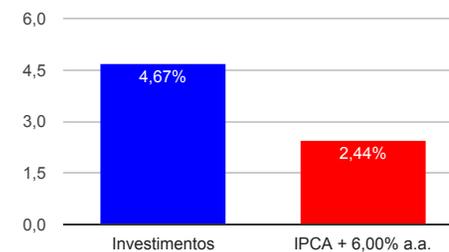
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	104.675.901,05	29,99%
IMA-B 5+	72.846.732,59	20,87%
CDI	32.292.396,69	9,25%
IDKA IPCA 2A	27.484.942,01	7,88%
IMA-B 5	24.666.935,85	7,07%
FIDC	21.473.806,74	6,15%
FIP	16.699.422,10	4,78%
GESTÃO DURATION	13.302.668,23	3,81%
FUNDO IMOBILIÁRIO	8.761.691,93	2,51%
AÇÕES - LIVRES	6.768.750,41	1,94%
MULTIMERCADO - CRÉDITO PRIVADO	6.153.865,84	1,76%
MULTIMERCADO - MODERADO	3.621.790,10	1,04%
AÇÕES - DIVIDENDOS	3.115.304,74	0,89%
IRF-M 1	2.941.484,36	0,84%
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	2.123.697,00	0,61%
AÇÕES - VALOR	2.076.684,49	0,60%



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%
Março	345.675.439,19	6.995.766,92	6.873.075,36	349.006.074,13	3.207.943,38	0,93%	0,78%	118,24%	2,54%
Acumulado no ano					15.575.336,61	4,67%	2,44%	191,16%	

**Acumulado no Ano**



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	1.007.857,59	0,00	0,00	1.034.341,31	26.483,72	2,63%	1,20%	2,63%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.917.481,21	0,00	0,00	11.095.085,49	177.604,28	1,63%	1,60%	1,63%
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	3.415.055,83	0,00	0,00	3.466.134,88	51.079,05	1,50%	0,84%	1,50%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.845.814,29	0,00	0,00	7.957.167,22	111.352,93	1,42%	0,66%	1,42%
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	12.759.875,43	0,00	0,00	12.940.790,94	180.915,51	1,42%	4,01%	1,42%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	19.256.606,82	0,00	0,00	19.527.774,79	271.167,97	1,41%	0,68%	1,41%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.741.715,73	0,00	0,00	9.875.888,40	134.172,67	1,38%	0,76%	1,38%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	12.156.320,76	0,00	47.771,72	12.268.326,92	159.777,88	1,31%	1,52%	1,32%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	2.427.772,75	0,00	0,00	2.455.128,33	27.355,58	1,13%	5,74%	1,13%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.985.419,72	0,00	76.769,88	2.941.484,36	32.834,52	1,10%	0,13%	1,10%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	17.874.653,13	1.121.958,32	333.755,30	18.863.552,00	200.695,85	1,06%	0,03%	1,07%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	13.720.063,56	0,00	0,00	13.864.662,51	144.598,95	1,05%	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.474.557,94	0,00	2.012.551,20	488.053,75	26.047,01	1,05%	0,06%	1,05%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	70.080.032,78	1.393.196,22	0,00	72.209.379,42	736.150,42	1,03%	2,05%	1,03%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.052.222,71	0,00	0,00	6.113.892,24	61.669,53	1,02%	2,05%	1,02%
TRX CORPORATIVO I FIDC SÊNIOR	2.891.517,54	0,00	393.961,06	2.525.443,67	27.887,19	0,96%	55,55%	-12,66%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	5.035.916,50	0,00	0,00	5.083.700,56	47.784,06	0,95%	7,77%	4,41%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	19.095.113,07	0,00	4.000.000,00	15.257.543,90	162.430,83	0,85%	2,06%	1,01%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	46.779.041,32	424.612,38	0,00	47.596.283,66	392.629,96	0,83%	2,72%	0,84%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	25.042.280,85	0,00	0,00	25.250.448,93	208.168,08	0,83%	2,74%	0,83%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	8.826.194,69	0,00	0,00	8.869.784,24	43.589,55	0,49%	0,96%	0,49%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>3.224.395,54</b>	<b>1,07%</b>	<b>2,49%</b>	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	3.563.264,66	0,00	0,00	3.621.790,10	58.525,44	1,64%	3,35%	1,64%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4.583.422,39	0,00	0,00	4.635.137,72	51.715,33	1,13%	4,16%	1,13%
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	6.380.974,93	56.000,00	0,00	6.469.815,40	32.840,47	0,51%	0,46%	0,74%
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	6.133.426,24	0,00	0,00	6.153.865,84	20.439,60	0,33%	1,18%	0,33%
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	7.443.315,28	0,00	0,00	7.447.168,46	3.853,18	0,05%	0,00%	0,05%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	1.080.166,65	1.000.000,00	0,00	2.076.684,49	-3.482,16	-0,17%	5,13%	-1,59%
W7 MULTIELSTRATÉGIA FIP	10.252.366,40	0,00	0,00	10.229.606,70	-22.759,70	-0,22%	-	-
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.129.377,72	1.000.000,00	0,00	3.115.304,74	-14.072,98	-0,45%	4,97%	-0,78%
CONSTÂNCIA BRASIL FI AÇÕES	1.138.036,43	1.000.000,00	0,00	2.123.697,00	-14.339,43	-0,67%	7,73%	-1,86%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	1.158.217,17	1.000.000,00	0,00	2.133.612,69	-24.604,48	-1,14%	5,68%	-1,29%
CSHG BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	1.427.357,10	0,00	8.266,20	1.314.523,47	-104.567,43	-7,33%	12,39%	-5,82%
Total Renda Variável					-16.452,16	-0,03%	2,88%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre / 2017

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	46.390.258,49	21.654.492,42	0,00	72.209.379,42	4.164.628,51	6,25%	6,83%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	24.769.567,73	19.603.418,47	0,00	47.596.283,66	3.223.297,46	7,33%	8,15%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.587.848,74	12.000.000,00	0,00	25.250.448,93	1.662.600,19	7,05%	8,16%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	18.067.287,64	0,00	4.000.000,00	15.257.543,90	1.190.256,26	6,59%	6,76%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	30.654.139,26	0,00	12.000.000,00	19.527.774,79	873.635,53	3,93%	3,87%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	11.607.637,71	0,00	47.771,72	12.268.326,92	708.460,93	6,10%	6,11%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.484.255,57	0,00	0,00	11.095.085,49	610.829,92	5,83%	5,83%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	21.281.598,30	3.869.924,29	6.867.226,10	18.863.552,00	579.255,51	2,90%	3,05%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	24.300.404,23	0,00	15.000.000,00	9.875.888,40	575.484,17	4,14%	4,05%
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	12.498.340,31	0,00	0,00	12.940.790,94	442.450,63	3,54%	3,54%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.722.507,90	0,00	0,00	6.113.892,24	391.384,34	6,84%	6,84%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	15.566.145,35	0,00	8.000.000,00	7.957.167,22	391.021,87	3,77%	3,82%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	13.511.642,84	0,00	0,00	13.864.662,51	353.019,67	2,61%	2,61%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	8.699.769,04	0,00	0,00	8.869.784,24	170.015,20	1,95%	1,95%
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	3.330.876,94	0,00	0,00	3.466.134,88	135.257,94	4,06%	4,06%
LME REC IPCA FIDC MULTISSECTORIAL SÊNIOR	4.958.570,12	0,00	0,00	5.083.700,56	125.130,44	2,52%	2,52%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.160.909,18	0,00	4.783.428,86	488.053,75	110.573,43	3,09%	3,09%
TRX CORPORATIVO I FIDC SÊNIOR	5.742.577,25	0,00	3.321.052,28	2.525.443,67	103.918,70	2,60%	-56,02%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.072.181,68	0,00	232.143,04	2.941.484,36	101.445,72	3,38%	3,39%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	2.371.440,05	0,00	0,00	2.455.128,33	83.688,28	3,53%	3,53%
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%	3,41%
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	0,00	1.000.000,00	0,00	1.034.341,31	34.341,31	3,43%	5,75%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>16.097.488,39</b>	<b>5,60%</b>	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre / 2017

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4.209.111,27	0,00	0,00	4.635.137,72	426.026,45	10,12%	10,12%
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	5.966.581,79	0,00	0,00	6.153.865,84	187.284,05	3,14%	3,14%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	3.489.703,06	0,00	0,00	3.621.790,10	132.087,04	3,79%	3,79%
CSHG BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	1.214.712,10	0,00	24.798,60	1.314.523,47	124.609,97	10,26%	8,37%
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.005.504,94	1.000.000,00	0,00	3.115.304,74	109.799,80	5,70%	5,35%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	1.032.220,98	1.000.000,00	0,00	2.133.612,69	101.391,71	10,93%	10,76%
CONSTÂNCIA BRASIL FI AÇÕES	1.045.097,33	1.000.000,00	0,00	2.123.697,00	78.599,67	8,16%	6,87%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	1.000.749,28	1.000.000,00	0,00	2.076.684,49	75.935,21	7,76%	6,22%
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	6.370.623,06	56.000,00	0,00	6.469.815,40	43.192,34	0,67%	0,91%
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	10.288.177,28	0,00	0,00	10.229.606,70	-58.570,58	-0,57%	-
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	9.189.675,90	0,00	0,00	7.447.168,46	-1.742.507,44	-18,96%	-
<b>Total Renda Variável</b>					<b>-522.151,78</b>	<b>-1,14%</b>	