Relatório Analítico dos Investimentos em agosto de 2017

Engenharia Financeira

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 (agosto / 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	30.692.734,62	8,36%	754	0,55%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	6.990.008,37	1,90%	295	0,39%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.060.679,52	0,29%	610	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	28.775.064,36	7,84%	276	2,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	21.747.691,13	5,93%	1.211	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	10.413.993,28	2,84%	711	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	12.636.198,15	3,44%	113	1,65%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.231.884,47	1,43%	601	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	20.869.553,91	5,69%	707	0,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	17.679.515,73	4,82%	1.381	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	4.235.862,76	1,15%	20	14,61%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	D+1471	Não há	2.524.273,67	0,69%	29	2,19%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1461	Não há	5.146.936,71	1,40%	9	19,54%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1901	Não há	3.695.038,93	1,01%	10	6,12%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	9.238.605,28	2,52%	34	1,63%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
MULTINVEST GRAU DE INVESTIMENTO FIC FI DE RENDA FIXA	D+4	Não há	5.191.704,39	1,41%	5	20,29%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	508.099,74	0,14%	440	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	12.734.060,63	3,47%	62	0,85%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	16/05/2023	11.387.999,16	3,10%	52	3,97%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	57.251.310,54	15,60%	771	0,98%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	13.568.124,65	3,70%	60	14,56%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	Não possui	1008 dias úteis	3.051.869,35	0,83%	6	12,76%	Artigo 7º, Inciso VI

Crédito & Mercado Engenharia Financeira
Rua Tapinas, 22 - 5º Andar - São Paulo - SP - Telefone: (11) 3168-0053

Carteira consolidada de investimentos - base (agosto / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	13.869.371,17	3,78%	34	4,47%	Artigo 7º, Inciso VI
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	2.672.616,48	0,73%	70	3,49%	Artigo 7º, Inciso VI
TRX CORPORATIVO I FIDC SÊNIOR	D+1401	Não Informado	1.102.579,81	0,30%	7	20,78%	Artigo 7º, Inciso VI
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	D+13	Não há	3.358.225,90	0,92%	325	4,42%	Artigo 8º, Inciso III
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	5.006.854,76	1,36%	1.683	4,02%	Artigo 8º, Inciso III
META VALOR FI AÇÕES	D+4	Não há	1.104.504,16	0,30%	17	1,92%	Artigo 8º, Inciso III
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	4.670.907,36	1,27%	132	5,35%	Artigo 8º, Inciso III
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	3.525.929,44	0,96%	1.275	7,83%	Artigo 8º, Inciso III
CONSTÂNCIA BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	3.385.970,24	0,92%	74	4,13%	Artigo 8º, Inciso III
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	3.798.767,69	1,04%	50	5,80%	Artigo 8º, Inciso IV
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+180	Não há	6.309.336,11	1,72%	24	4,06%	Artigo 8º, Inciso IV
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	10.138.028,48	2,76%			Artigo 8º, Inciso V
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	14.671.033,72	4,00%	8	14,08%	Artigo 8º, Inciso V
CSHG BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	Não se aplica	Não se aplica	1.316.500,17	0,36%		0,11%	Artigo 8º, Inciso VI
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	Não se aplica	Não se aplica	7.452.313,36	2,03%		4,91%	Artigo 8º, Inciso VI
		Total	**367.014.148,20**				

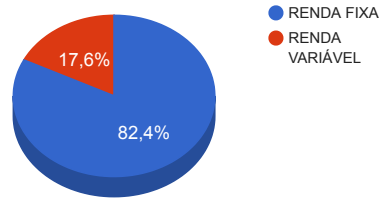
Crédito & Mercado Engenharia Financeira
Rua Tapinas, 22 - 5º Andar - São Paulo - SP - Telefone: (11) 3168-0053

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

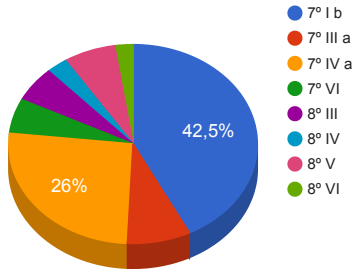
Artigos	Resolução %	Carteira $	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	156.097.323,54	42,53%	30,00%	35,00%	70,00%	100.812.580,20
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	30.032.421,74	8,18%	15,00%	20,00%	60,00%	190.176.067,18
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	95.449.594,72	26,01%	5,00%	5,00%	30,00%	14.654.649,74
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	20.696.436,81	5,64%	5,00%	10,00%	15,00%	34.355.685,42
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	18.350.707,41
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	18.350.707,41
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	21.052.391,86	5,74%	5,00%	10,00%	15,00%	33.999.730,37
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	10.108.103,80	2,75%	2,00%	5,00%	5,00%	8.242.603,61
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	24.809.062,20	6,76%	2,00%	5,00%	5,00%	-6.458.354,79
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	8.768.813,53	2,39%	2,00%	5,00%	5,00%	9.581.893,88
Total Carteira		367.014.148,20					

RENDA FIXA	302.275.776,81	82,36%
RENDA VARIÁVEL	64.738.371,39	17,64%

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Crédito & Mercado Engenharia Financeira
Rua Tapinas, 22 - 5º Andar - São Paulo - SP - Telefone: (11) 3168-0053

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Base: agosto / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira ($)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	156.097.323,54	42,53%	30,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	30.032.421,74	8,18%	15,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	95.449.594,72	26,01%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	20.696.436,81	5,64%	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	21.052.391,86	5,74%	5,00%	15,00%
Artigo 8º, Inciso IV	10.108.103,80	2,75%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	24.809.062,20	6,76%	2,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	8.768.813,53	2,39%	2,00%	5,00%
Total	367.014.148,20	100,00%	66,00	215,00

Crédito & Mercado Engenharia Financeira
Rua Tapinas, 22 - 5º Andar - São Paulo - SP - Telefone: (11) 3168-0053

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5+	1,36%	11,93%	6,04%	4,21%	16,45%	51,77%	-	-	-
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	1,75%	12,48%	5,18%	9,15%	23,90%	73,04%	0,50%	1,721%	6,61%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,34%	11,49%	6,00%	3,94%	15,86%	50,41%	0,20%	2,654%	12,85%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,33%	11,73%	5,93%	4,17%	16,18%	50,38%	0,20%	2,644%	12,76%
IMA-B	1,34%	11,14%	5,57%	5,06%	15,49%	44,95%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,33%	11,00%	5,51%	4,97%	15,39%	43,43%	0,20%	1,813%	9,83%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,32%	10,97%	5,49%	4,92%	15,22%	44,11%	0,20%	1,808%	9,85%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1,31%	10,68%	5,33%	4,73%	15,02%	43,63%	0,20%	1,815%	9,84%
MULTINVEST GRAU DE INVESTIMENTO FIC FI DE RENDA FIXA	1,05%	12,19%	5,09%	4,82%	16,77%	-	0,65%	1,098%	10,17%
IMA-B 5	1,25%	9,83%	4,68%	6,98%	13,91%	34,53%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,24%	9,71%	4,63%	6,90%	13,72%	33,75%	0,20%	0,717%	3,64%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1,21%	6,19%	3,89%	4,67%	9,96%	10,62%	0,70%	0,593%	4,54%
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1,15%	10,93%	5,02%	8,20%	15,06%	33,35%	0,97%	0,702%	3,37%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1,09%	9,18%	4,21%	6,51%	14,35%	28,61%	0,70%	0,459%	4,06%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	0,20%	6,44%	2,07%	3,97%	9,88%	-	0,70%	1,064%	7,23%
IDKA IPCA 2 Anos	0,97%	10,12%	4,34%	7,49%	14,33%	34,57%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,98%	9,35%	4,08%	6,76%	13,28%	33,34%	0,20%	0,487%	2,90%

Crédito & Mercado Engenharia Financeira
Rua Tapinas, 22 - 5º Andar - São Paulo - SP - Telefone: (11) 3168-0053

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,96%	9,32%	4,05%	6,79%	13,26%	33,40%	0,20%	0,491%	2,83%
IRF-M 1	0,90%	8,33%	2,86%	5,88%	13,15%	29,98%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,89%	8,21%	2,82%	5,81%	12,96%	29,61%	0,20%	0,081%	0,67%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,88%	8,17%	2,83%	5,78%	12,88%	29,36%	0,10%	0,081%	0,68%
IPCA + 8,00% ao ano	0,90%	6,97%	2,21%	4,92%	10,62%	30,19%	-	-	-
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	0,96%	7,17%	2,16%	5,18%	-	-	0,35%	-	-
IPCA + 7,00% ao ano	0,81%	6,31%	1,96%	4,43%	9,60%	27,80%	-	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1,59%	-46,10%	-47,66%	-45,11%	-61,77%	-78,88%	0,00%	8,285%	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	-0,21%	2,65%	-0,41%	1,09%	6,15%	23,00%	1,65%	1,254%	1,98%
CDI	0,80%	7,34%	2,43%	5,28%	12,05%	27,88%	-	-	-
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	0,91%	8,56%	2,44%	6,33%	13,82%	31,88%	0,75%	1,480%	9,19%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,79%	7,38%	2,42%	5,31%	12,08%	27,93%	0,20%	0,007%	0,11%
IPCA + 6,00% ao ano	0,72%	5,65%	1,72%	3,93%	8,58%	25,42%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,67%	11,58%	5,71%	7,16%	15,30%	42,49%	0,15%	1,271%	7,00%
IPCA	0,19%	1,62%	0,20%	0,90%	2,46%	11,65%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,18%	10,13%	4,75%	5,16%	15,38%	38,65%	0,40%	1,008%	6,26%

Crédito & Mercado Engenharia Financeira
Rua Tapinas, 22 - 5º Andar - São Paulo - SP - Telefone: (11) 3168-0053

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,80%	7,32%	2,45%	5,20%	11,97%	27,62%	0,20%	0,019%	0,15%
TRX CORPORATIVO I FIDC SÊNIOR	-27,85%	-80,80%	-38,94%	-61,87%	-89,32%	-	1,55%	-	-

Crédito & Mercado Engenharia Financeira
Rua Tapinas, 22 - 5º Andar - São Paulo - SP - Telefone: (11) 3168-0053

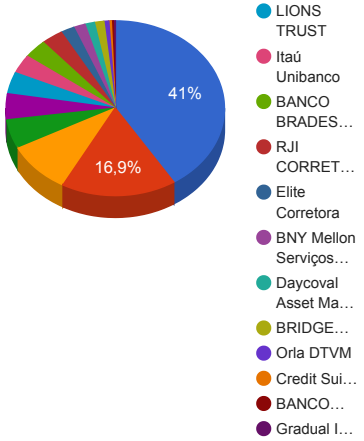
Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (agosto / 2017)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Ibovespa	7,46%	17,61%	12,95%	6,26%	22,34%	51,93%	-	-	-
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	8,94%	24,32%	14,61%	10,80%	29,57%	65,08%	2,00%	5,030%	16,17%
CONSTÂNCIA BRASIL FI AÇÕES	6,95%	16,39%	11,91%	6,88%	21,46%	42,15%	2,00%	5,148%	18,03%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3,61%	18,95%	8,56%	9,24%	25,42%	58,75%	1,85%	3,410%	12,29%
IBX	7,35%	18,72%	12,96%	7,20%	22,46%	50,80%	-	-	-
META VALOR FI AÇÕES	9,51%	27,79%	17,56%	13,06%	31,75%	64,16%	2,50%	8,381%	25,61%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	5,25%	16,03%	10,79%	7,50%	13,83%	32,95%	2,00%	4,168%	14,97%
IDIV	6,96%	20,19%	10,75%	3,45%	33,46%	71,33%	-	-	-
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	8,88%	19,46%	13,24%	12,51%	12,49%	49,49%	2,00%	5,168%	13,27%
CDI	0,80%	7,34%	2,43%	5,28%	12,05%	27,88%	-	-	-
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	0,99%	8,86%	2,81%	6,61%	15,92%	34,81%	1,00%	0,726%	11,64%
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-0,32%	5,74%	1,51%	2,87%	10,23%	26,81%	0,55%	1,279%	1,73%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CSHG BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	2,56%	8,37%	0,09%	-5,82%	15,48%	-	0,60%	5,570%	15,78%
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	-0,00%	128,81%	126,61%	128,44%	102,85%	85,05%	0,00%	0,149%	127,40%
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	-	-	-	-	-	-	1,35%	0,000%	0,00%

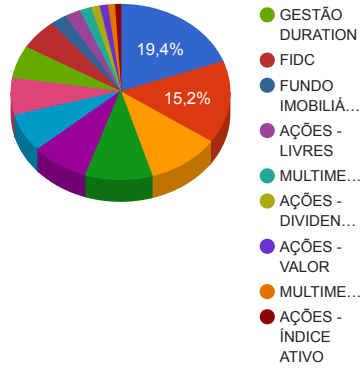
Crédito & Mercado Engenharia Financeira
Rua Tapinas, 22 - 5º Andar - São Paulo - SP - Telefone: (11) 3168-0053

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	150.552.602,74	41,02%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	62.055.932,09	16,91%
Planner Corretora	34.792.652,93	9,48%
BEM DTVM	19.947.887,70	5,44%
CM Capital Markets DTVM	17.564.410,10	4,79%
LIONS TRUST	14.671.033,72	4,00%
Itaú Unibanco	12.734.060,63	3,47%
BANCO BRADESCO	12.636.198,15	3,44%
RJI CORRETORA DE VALORES	11.762.878,95	3,21%
Elite Corretora	7.452.313,36	2,03%
BNY Mellon Serviços Financeiros	6.309.336,11	1,72%
Daycoval Asset Management	5.191.704,39	1,41%
BRIDGE ADMINISTRADORA DE RECURSOS	5.146.936,71	1,40%
Orla DTVM	2.672.616,48	0,73%
Credit Suisse Hedging-Griffo Corretora	1.316.500,17	0,36%
BANCO DAYCOVAL	1.104.504,16	0,30%
Gradual Investimentos	1.102.579,81	0,30%



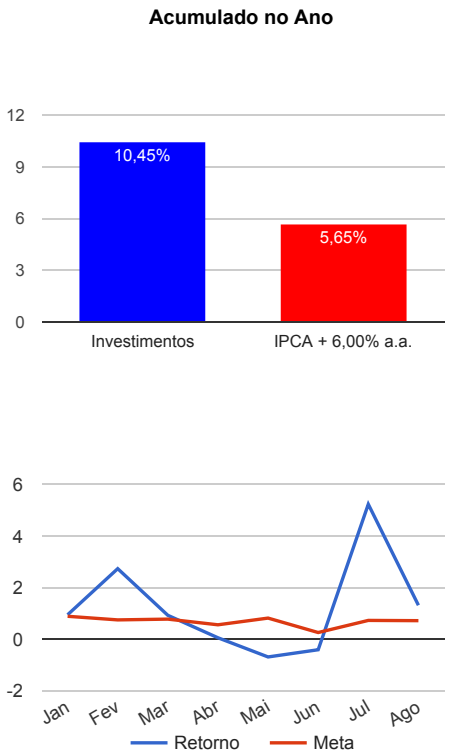
Sub-segmento	Valor	%
CDI	71.327.534,93	19,43%
IMA-B	55.777.611,45	15,20%
IRF-M 1	39.427.206,86	10,74%
IMA-B 5+	35.765.072,73	9,74%
IMA-B 5	31.018.847,87	8,45%
IDKA IPCA 2A	26.101.438,38	7,11%
FIP	24.809.062,20	6,76%
GESTÃO DURATION	22.161.627,78	6,04%
FIDC	20.696.436,81	5,64%
FUNDO IMOBILIÁRIO	8.768.813,53	2,39%
AÇÕES - LIVRES	8.532.784,20	2,32%
MULTIMERCADO - CRÉDITO PRIVADO	6.309.336,11	1,72%
AÇÕES - DIVIDENDOS	4.670.907,36	1,27%
AÇÕES - VALOR	4.462.730,06	1,22%
MULTIMERCADO - MODERADO	3.798.767,69	1,04%
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	3.385.970,24	0,92%



Crédito & Mercado Engenharia Financeira
Rua Tapinas, 22 - 5º Andar - São Paulo - SP - Telefone: (11) 3168-0053

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%
Abril	349.006.074,13	15.352.991,65	15.257.588,01	349.300.105,27	198.627,50	0,06%	0,56%	10,20%	1,98%
Maio	349.300.105,27	6.301.198,84	6.303.707,04	346.899.240,40	-2.398.356,67	-0,69%	0,82%	-83,57%	10,57%
Junho	346.899.240,40	10.500.098,33	10.679.315,80	345.307.845,94	-1.412.176,99	-0,41%	0,26%	-159,24%	2,76%
Julho	345.307.845,94	10.537.265,29	10.443.369,99	363.480.150,15	18.078.408,91	5,23%	0,73%	719,04%	11,02%
Agosto	363.480.150,15	86.068.892,19	87.324.843,80	367.014.148,20	4.789.949,66	1,32%	0,72%	181,95%	1,22%
Acumulado no ano					34.831.789,02	10,45%	5,65%	185,08%	



Crédito & Mercado Engenharia Financeira
Rua Tapinas, 22 - 5º Andar - São Paulo - SP - Telefone: (11) 3168-0053

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de agosto / 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	4.162.965,20	0,00	0,00	4.235.862,76	72.897,56	1,75%	1,72%	1,75%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.200.883,98	0,00	0,00	11.387.999,16	187.115,18	1,67%	1,27%	1,67%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	2.630.676,68	0,00	0,00	2.672.616,48	41.939,80	1,59%	8,28%	1,59%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.046.834,16	0,00	0,00	1.060.679,52	13.845,36	1,32%	1,81%	1,32%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	12.473.130,76	0,00	0,00	12.636.198,15	163.067,39	1,31%	1,82%	1,31%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.286.477,48	0,00	0,00	10.413.993,28	127.515,80	1,24%	0,72%	1,24%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	9.127.897,37	0,00	0,00	9.238.605,28	110.707,91	1,21%	0,59%	1,21%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	25.685.623,97	0,00	19.000.000,00	6.990.008,37	304.384,40	1,19%	2,65%	1,34%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	12.585.489,13	0,00	0,00	12.734.060,63	148.571,50	1,18%	1,01%	1,18%
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	3.652.946,68	0,00	0,00	3.695.038,93	42.092,25	1,15%	0,70%	1,15%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	45.855.263,21	0,00	17.585.457,91	28.775.064,36	505.259,06	1,10%	2,64%	1,33%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	5.091.638,01	0,00	0,00	5.146.936,71	55.298,70	1,09%	0,46%	1,09%
MULTINVEST GRAU DE INVESTIMENTO FIC FI DE RENDA FIXA	5.137.716,78	0,00	0,00	5.191.704,39	53.987,61	1,05%	1,10%	1,05%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	20.666.133,59	0,00	0,00	20.869.553,91	203.420,32	0,98%	0,49%	0,98%
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	3.022.716,81	0,00	0,00	3.051.869,35	29.152,54	0,96%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.181.931,70	0,00	0,00	5.231.884,47	49.952,77	0,96%	0,49%	0,96%
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	13.446.380,34	0,00	0,00	13.568.124,65	121.744,31	0,91%	1,48%	0,91%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	74.040.340,19	0,00	44.000.000,00	30.692.734,62	652.394,43	0,88%	1,81%	1,33%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	504.071,27	0,00	0,00	508.099,74	4.028,47	0,80%	0,02%	0,80%
TRX CORPORATIVO I FIDC SÊNIOR	1.528.153,99	0,00	436.349,27	1.102.579,81	10.775,09	0,71%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.747.185,38	19.000.000,00	117.865,67	21.747.691,13	118.371,42	0,54%	0,08%	0,88%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	17.585.457,91	0,00	17.679.515,73	94.057,82	0,53%	0,08%	0,89%

Crédito & Mercado Engenharia Financeira
Rua Tapinas, 22 - 5º Andar - São Paulo - SP - Telefone: (11) 3168-0053

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	13.616.332,57	49.483.434,28	6.164.611,25	57.251.310,54	316.154,94	0,50%	0,01%	0,79%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	2.519.110,13	0,00	0,00	2.524.273,67	5.163,54	0,20%	1,06%	0,20%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	13.898.941,82	0,00	0,00	13.869.371,17	-29.570,65	-0,21%	1,25%	-0,21%
			Total Renda Fixa		3.402.327,52	1,13%	1,05%	

Crédito & Mercado Engenharia Financeira
Rua Tapinas, 22 - 5º Andar - São Paulo - SP - Telefone: (11) 3168-0053

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
META VALOR FI AÇÕES	1.008.577,91	0,00	0,00	1.104.504,16	95.926,25	9,51%	8,38%	9,51%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	3.236.529,75	0,00	0,00	3.525.929,44	289.399,69	8,94%	5,03%	8,94%
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	4.290.032,66	0,00	0,00	4.670.907,36	380.874,70	8,88%	5,17%	8,88%
CONSTÂNCIA BRASIL FI AÇÕES	3.166.036,75	0,00	0,00	3.385.970,24	219.933,49	6,95%	5,15%	6,95%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	3.190.808,89	0,00	0,00	3.358.225,90	167.417,01	5,25%	4,17%	5,25%
CSHG BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	1.268.328,59	0,00	7.427,60	1.316.500,17	55.599,18	4,38%	5,57%	2,56%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4.832.597,26	0,00	0,00	5.006.854,76	174.257,50	3,61%	3,41%	3,61%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	3.761.577,57	0,00	0,00	3.798.767,69	37.190,12	0,99%	0,73%	0,99%
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	14.671.370,68	0,00	13.132,10	14.671.033,72	12.795,14	0,09%	0,15%	-0,00%
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	7.451.338,18	0,00	0,00	7.452.313,36	975,18	0,01%	0,00%	0,03%
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	10.164.654,16	0,00	0,00	10.138.028,48	-26.625,68	-0,26%	-	-
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	6.329.456,55	0,00	0,00	6.309.336,11	-20.120,44	-0,32%	1,28%	-0,32%
			Total Renda Variável		1.387.622,14	2,19%	2,20%	

Crédito & Mercado Engenharia Financeira
Rua Tapinas, 22 - 5º Andar - São Paulo - SP - Telefone: (11) 3168-0053