

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 3.922/2010 - 4.392/2014
TÍTULOS PÚBLICOS			116.913.014,16	12,96%			Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	7.193.851,71	0,80%	69	0,66%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	38.299.430,82	4,25%	36	6,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	3.335.033,53	0,37%	107	0,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	12.308.510,68	1,36%	74	0,63%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	6.015.306,20	0,67%	6	13,63%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	66.744.522,57	7,40%	286	5,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	6.605.473,83	0,73%	282	0,35%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	4.029.120,71	0,45%	223	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	6.151.882,98	0,68%	11	7,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2030	12.742.938,42	1,41%	27	5,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	11.957.161,68	1,33%	72	1,38%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	798.837,54	0,09%	193	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SUL AMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	D+2	Não há	50.433.436,40	5,59%	100	14,59%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BTG PACTUAL TESOURO IPCA GERAL FI RENDA FIXA	D+2	Não há	18.517.119,74	2,05%	322	8,41%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	83.094.831,71	9,21%	117	10,46%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	4.552.831,29	0,50%	14	3,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	4.545.485,22	0,50%	643	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	6.655.775,17	0,74%	21	1,66%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	127.476.257,95	14,13%	746	2,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	15.817.365,12	1,75%	167	1,45%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	49.128.644,64	5,45%	253	3,83%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "

Carteira consolidada de investimentos - base (fevereiro / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	57.010.720,22	6,32%	98	3,48%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.408.541,34	0,82%	334	0,29%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	10.469.793,22	1,16%	319	0,54%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	3.809.802,15	0,42%	1.336	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	5.799.052,61	0,64%	599	0,47%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	23.239.014,17	2,58%	433	1,22%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	588.775,54	0,07%	63	0,79%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRB DI 1 MILHÃO FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	796.887,14	0,09%	40	0,18%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	24.376.614,47	2,70%	62	1,79%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
GÁVEA SUL FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP	Não se aplica	Não se aplica	2.419.656,01	0,27%	17	5,20%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
LAVORO II FIDC SÊNIOR 2	Não se aplica		334.108,41	0,04%	6	9,24%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
SUL INVEST FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 6	Não se aplica	Não se aplica	966.339,46	0,11%	22	1,16%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
SILVERADO MAXIMUM II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	Não se aplica	Não se aplica	108.598,47	0,01%	91	2,50%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
BELSUL 500 FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	107.832,73	0,01%	6	2,10%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
BRADESCO H REGIMES DE PREVIDÊNCIA IBOVESPA FIC AÇÕES	D+5	Não há	9.443.451,59	1,05%	11	11,19%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	6.589.824,07	0,73%	41	1,23%	Artigo 8º, Inciso I
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	4.334.579,80	0,48%	21.549	0,79%	Artigo 8º, Inciso I
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	D+12	Não há	2.158.283,56	0,24%	368	2,83%	Artigo 8º, Inciso III
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	D+13	Não há	3.095.261,20	0,34%	242	4,83%	Artigo 8º, Inciso III
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou D+33	Não há	15.946.191,87	1,77%	357	5,89%	Artigo 8º, Inciso III
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	4.564.858,95	0,51%	38	16,00%	Artigo 8º, Inciso IV
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	D+5	Não há	6.740.182,85	0,75%	33	2,58%	Artigo 8º, Inciso IV

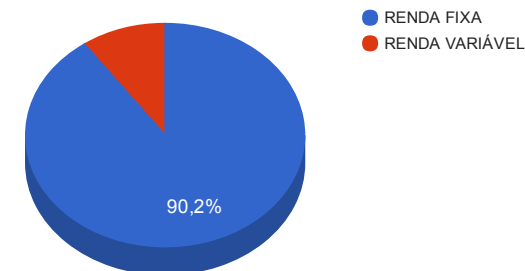
Carteira consolidada de investimentos - base (fevereiro / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	9.455.469,18	1,05%	555	5,74%	Artigo 8º, Inciso IV
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+180	Não há	1.227.259,42	0,14%	28	0,78%	Artigo 8º, Inciso IV
SUL AMÉRICA HIGH YIELD FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+361	2 anos	3.885.104,51	0,43%	12	10,53%	Artigo 8º, Inciso IV
SUL AMÉRICA CRÉDITO ATIVO FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+30	Não há	3.833.920,06	0,43%	160	0,96%	Artigo 8º, Inciso IV
XP LONG SHORT FIC MULTIMERCADO	D+2 ou D+16	Não há	3.378.397,27	0,37%	5.829	0,53%	Artigo 8º, Inciso IV
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	4.909.984,00	0,54%	686	0,81%	Artigo 8º, Inciso IV
LSH FIP	Não se aplica	Não se aplica	4.645.669,92	0,51%			Artigo 8º, Inciso V
RIO BRAVO ENERGIA I FIP	Não se aplica	Não se aplica	401.474,40	0,04%			Artigo 8º, Inciso V
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	705.481,47	0,08%			Artigo 8º, Inciso V
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	S/Info	Não se aplica	2.273.711,37	0,25%		14,59%	Artigo 8º, Inciso VI
DOMO FII - DOMC11	Não se aplica	Não se aplica	1.040.000,00	0,12%		1,14%	Artigo 8º, Inciso VI
LAVORO II FIDC SUBORDINADA PREFERENCIAL 2	Não se aplica	Não se aplica	59.745,80	0,01%	3	10,84%	Desenquadrado - RF
HSBC NILO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	D+4 a D+5	Não há	22.643.380,15	2,51%	8	5,52%	Desenquadrado - RF
		TOTAL -	902.084.799,45				

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

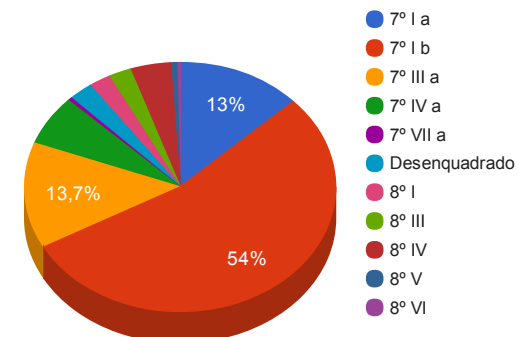
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	116.913.014,16	12,96%	8,00%	10,00%	15,00%	18.399.705,76
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	487.275.173,27	54,02%	39,00%	40,00%	60,00%	53.975.706,40
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	124.017.699,42	13,75%	8,00%	10,00%	30,00%	146.607.740,42
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	58.610.146,08	6,50%	5,00%	6,50%	30,00%	212.015.293,76
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,50%	10,00%	90.208.479,95
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	3.936.535,08	0,44%	0,00%	5,00%	5,00%	41.167.704,89
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	45.104.239,97
Desenquadrado - RF	0,00%	22.703.125,95	2,52%	0,00%	0,00%	0,00%	-22.703.125,95
Total Renda Fixa	100,00%	813.455.693,96	90,18%	60,00	80,00	155,00	-

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	20.367.855,46	2,26%	2,00%	5,00%	10,00%	69.840.624,49
Artigo 8º, Inciso II	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	5,00%	45.104.239,97
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	21.199.736,63	2,35%	1,00%	3,00%	10,00%	69.008.743,32
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	37.995.176,24	4,21%	3,00%	5,00%	5,00%	7.109.063,73
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5.752.625,79	0,64%	0,00%	3,00%	5,00%	39.351.614,18
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	3.313.711,37	0,37%	0,00%	3,00%	5,00%	41.790.528,60
Total Renda Variável	30,00%	88.629.105,49	9,82%	6,00	19,50	40,00	-

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: fevereiro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	116.913.014,16	12,96%	8,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	487.275.173,27	54,02%	39,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	124.017.699,42	13,75%	8,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	58.610.146,08	6,50%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	3.936.535,08	0,44%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Desenquadrado - RF	22.703.125,95	2,52%	0,00%	0,00%
Total Renda Fixa	813.455.693,96	90,18%	60,00	155,00

Artigos - Renda Variável	Base: fevereiro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I	20.367.855,46	2,26%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso III	21.199.736,63	2,35%	1,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV	37.995.176,24	4,21%	3,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	5.752.625,79	0,64%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	3.313.711,37	0,37%	0,00%	5,00%
Total Renda Variável	88.629.105,49	9,82%	6,00	40,00

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%
IMA-B	3,85%	5,79%	8,86%	9,92%	26,69%	38,66%	-	-	-
HSBC NILO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	4,29%	6,81%	10,20%	11,59%	27,92%	39,16%	0,30%	2,124%	9,24%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	3,95%	5,95%	9,14%	10,32%	27,01%	38,37%	0,20%	1,937%	7,54%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,89%	5,85%	8,91%	10,06%	26,52%	38,15%	0,30%	1,866%	7,32%
SUL AMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	3,88%	5,79%	8,71%	10,14%	27,33%	37,88%	0,40%	1,901%	7,14%
BTG PACTUAL TESOURO IPCA GERAL FI RENDA FIXA	3,84%	5,75%	8,80%	9,81%	26,62%	37,88%	0,20%	1,856%	7,45%
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%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA	3,81%	5,71%	8,74%	9,65%	26,06%	37,36%	0,40%	1,865%	7,36%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	3,78%	5,74%	8,70%	9,99%	26,42%	37,57%	0,20%	1,780%	6,94%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	3,74%	5,50%	8,40%	9,38%	24,35%	38,28%	0,45%	1,981%	7,20%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,02%	3,92%	7,39%	7,17%	25,07%	-	0,20%	6,479%	10,51%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,59%	2,74%	4,19%	6,44%	13,77%	-	0,20%	0,854%	2,56%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,44%	2,22%	3,99%	5,24%	16,16%	-	0,20%	6,212%	8,55%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,98%	0,23%	1,79%	3,85%	8,25%	-	0,20%	5,730%	6,17%

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
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,82%	-0,83%	0,28%	2,67%	6,01%	-	0,20%	5,124%	4,62%
IMA Geral ex-C	2,24%	4,04%	6,06%	8,87%	21,52%	34,17%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,27%	4,12%	6,12%	8,51%	-	-	0,30%	0,962%	-
IRF-M	2,01%	4,34%	6,27%	10,02%	23,33%	35,09%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,01%	4,35%	6,23%	9,96%	23,21%	34,54%	0,20%	0,949%	3,52%
IMA-B 5	1,49%	2,67%	4,10%	6,47%	13,40%	32,51%	-	-	-
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	2,10%	3,65%	5,44%	7,51%	15,39%	34,06%	0,40%	1,138%	3,66%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	1,48%	2,64%	4,06%	6,38%	13,19%	32,03%	0,10%	0,717%	2,39%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,48%	2,63%	4,03%	6,35%	13,21%	31,75%	0,20%	0,718%	2,39%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	1,46%	2,60%	4,00%	6,27%	12,95%	31,42%	0,40%	0,715%	2,38%
IDKA IPCA 2 Anos	1,35%	2,45%	3,77%	6,37%	12,42%	33,17%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,49%	2,65%	3,93%	3,54%	6,95%	-	0,20%	0,694%	5,08%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,97%	1,99%	3,13%	5,65%	12,31%	-	0,20%	0,424%	1,21%
135% do CDI	1,17%	2,65%	4,21%	8,77%	19,17%	41,53%	-	-	-
GÁVEA SUL FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP	-3,23%	-5,90%	-4,47%	-0,28%	9,25%	29,74%	0,40%	7,730%	-
130% do CDI	1,12%	2,55%	4,05%	8,43%	18,40%	39,73%	-	-	-

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
SILVERADO MAXIMUM II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-100,00%	-	2,50%	-	-
IPCA + 8,00% ao ano	0,88%	1,95%	2,94%	5,43%	13,14%	34,76%	-	-	-
BELSUL 500 FIDC SÊNIOR	-0,52%	-0,95%	-1,35%	-35,41%	-26,35%	-23,07%	1,00%	0,707%	-
LAVORO II FIDC SUBORDINADA PREFERENCIAL 2	-49,24%	-	-73,62%	-84,07%	-86,05%	-91,74%	0,50%	88,914%	50,05%
LAVORO II FIDC SÊNIOR 2	-49,52%	-65,96%	-77,99%	-84,88%	-87,40%	-92,87%	5,30%	88,885%	50,02%
CDI	0,86%	1,96%	3,10%	6,43%	13,88%	29,35%	-	-	-
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	0,92%	2,09%	3,48%	7,04%	15,27%	32,71%	0,75%	1,702%	4,57%
BRB DI 1 MILHÃO FIC RENDA FIXA LP	0,91%	2,05%	2,60%	5,72%	12,92%	29,24%	0,25%	0,012%	0,79%
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%
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,87%	1,97%	3,12%	6,47%	13,96%	29,54%	0,20%	0,006%	0,03%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,80%	1,83%	2,90%	6,03%	13,03%	27,35%	1,00%	0,007%	0,08%
IPCA + 7,50% ao ano	0,85%	1,87%	2,83%	5,19%	12,62%	33,52%	-	-	-
SUL INVEST FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 6	0,86%	1,98%	2,81%	5,32%	-2,30%	-1,37%	0,20%	0,262%	-
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	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,37%	1,21%	3,07%	4,82%	12,94%	-	0,15%	5,284%	7,10%

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
IFIX	4,86%	8,80%	10,40%	14,77%	49,01%	48,14%	-	-	-
DOMO FII - DOMC11	6,77%	7,44%	-7,13%	13,04%	-4,59%	-21,21%	0,95%	9,750%	64,24%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	-	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-	0,14%	-	-

S&P 500	3,88%	5,74%	7,66%	9,05%	22,52%	12,49%	-	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	4,77%	6,90%	10,28%	15,22%	37,79%	42,88%	1,00%	2,182%	10,19%

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%	-	-	-
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	3,50%	11,01%	9,35%	12,03%	43,11%	29,64%	1,50%	6,562%	18,69%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3,41%	7,53%	6,21%	1,24%	25,85%	21,05%	3,00%	6,704%	17,66%
BRADERCO H REGIMES DE PREVIDÊNCIA IBOVESPA FIC AÇÕES	3,06%	11,21%	9,49%	13,47%	39,08%	25,65%	1,00%	6,476%	18,88%
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	0,81%	7,10%	8,62%	14,93%	19,70%	19,63%	4,00%	8,399%	21,87%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	0,45%	4,55%	9,91%	9,16%	19,43%	22,42%	2,00%	8,342%	21,47%

IPCA + 8,00% ao ano	0,88%	1,95%	2,94%	5,43%	13,14%	34,76%	-	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	-	-	-	-	-	-	2,00%	-	-

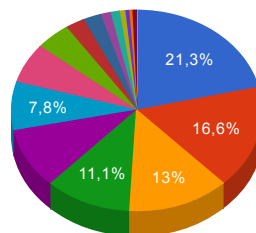
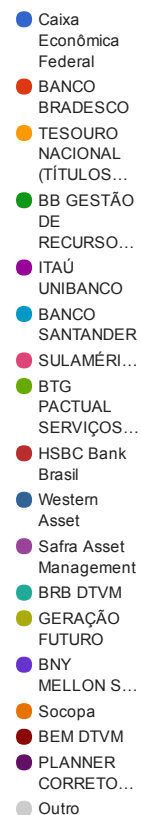
CDI	0,86%	1,96%	3,10%	6,43%	13,88%	29,35%	-	-	-
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1,45%	2,80%	4,13%	7,16%	15,52%	32,53%	0,55%	0,421%	1,23%

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

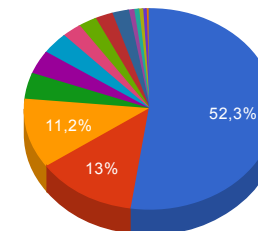
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	1,08%	2,11%	3,39%	8,73%	16,95%	38,23%	1,00%	1,227%	18,18%
SUL AMÉRICA CRÉDITO ATIVO FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1,07%	2,16%	3,29%	7,38%	14,02%	30,96%	0,60%	0,292%	0,82%
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	1,06%	2,38%	3,83%	6,77%	14,50%	30,47%	0,50%	0,326%	1,31%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	0,97%	2,88%	4,31%	8,83%	17,40%	39,83%	2,00%	0,978%	1,88%
XP LONG SHORT FIC MULTIMERCADO	0,24%	1,98%	2,86%	7,16%	23,45%	40,91%	2,00%	1,201%	3,52%
IPCA	0,33%	0,71%	1,01%	1,54%	4,76%	15,61%	-	-	-
SUL AMÉRICA HIGH YIELD FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1,48%	2,79%	4,15%	7,72%	6,67%	22,68%	1,50%	0,499%	3,82%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
LSH FIP	-	-	-	-	-	-	1,15%	-	-
RIO BRAVO ENERGIA I FIP	-	-	-	-	-	-	1,65%	-	-

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

Administrador	Valor	%
Caixa Econômica Federal	192.335.023,67	21,32%
BANCO BRADESCO	149.549.003,52	16,58%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	116.913.014,16	12,96%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	100.358.503,89	11,13%
ITAÚ UNIBANCO	87.726.263,02	9,72%
BANCO SANTANDER	70.554.324,72	7,82%
SULAMÉRICA INVESTIMENTOS	58.152.460,97	6,45%
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS	40.478.617,81	4,49%
HSBC Bank Brasil	22.643.380,15	2,51%
Western Asset	20.748.483,32	2,30%
Safra Asset Management	11.565.759,17	1,28%
BRB DTVM	10.596.191,55	1,17%
GERAÇÃO FUTURO	6.492.863,36	0,72%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	4.605.656,69	0,51%
Socopa	3.493.828,20	0,39%
BEM DTVM	3.095.261,20	0,34%
PLANNER CORRETORA	2.273.711,37	0,25%
Banco PETRA	334.108,41	0,04%
Gradual Investimentos	108.598,47	0,01%
FINAXIS Corretora	59.745,80	0,01%



Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	471.814.590,99	52,30%
TÍTULOS PÚBLICOS	116.913.014,16	12,96%
IMA-B 5	101.439.812,00	11,25%
MULTIMERCADO	37.995.176,24	4,21%
CDI	34.233.531,61	3,79%
GESTÃO DURATION	31.570.466,18	3,50%
CRÉDITO PRIVADO	22.643.380,15	2,51%
AÇÕES - LIVRES	21.199.736,63	2,35%
AÇÕES - INDEXADO	20.367.855,46	2,26%
IMA-B 5+	19.348.412,25	2,14%
IDKA IPCA 3A	6.151.882,98	0,68%
FIP	5.752.625,79	0,64%
IRF-M	4.545.485,22	0,50%
FIDC - FECHADO	3.996.280,88	0,44%
FUNDO IMOBILIÁRIO	3.313.711,37	0,37%
IDKA IPCA 2A	798.837,54	0,09%



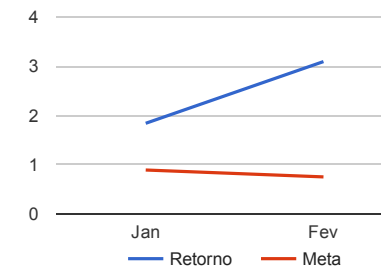
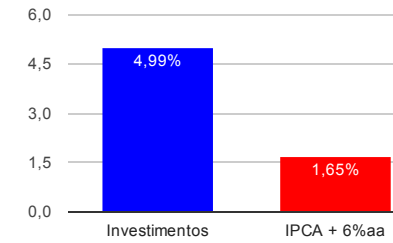
Carteira de Títulos Públicos - base (fevereiro / 2017)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde.	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	GAP (Atual - Pago)
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2017	21/11/2016	1362	2.936,992217	3.023,967026	4.000.183,40	4.118.643,09	118.459,69
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2019	25/08/2015	7659	2.636,195170	3.068,230561	20.190.618,81	23.499.577,87	3.308.959,06
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2021	17/08/2016	4750	2.964,257204	3.089,650031	14.080.221,72	14.675.837,65	595.615,93
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2023	03/09/2015	6730	2.515,509771	3.114,668162	16.929.380,76	20.961.716,73	4.032.335,97
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	14/03/2014	6185	2.315,991673	3.109,635985	14.324.408,50	19.233.098,57	4.908.690,07
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2026	27/04/2016	2200	2.838,144079	3.132,179665	6.243.916,97	6.890.795,26	646.878,29
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	21/12/2015	8310	2.412,107871	3.313,278580	20.044.616,41	27.533.345,00	7.488.728,59

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	828.893.781,13	47.766.588,98	25.523.451,58	866.785.517,97	15.648.599,44	1,84%	0,89%	206,58%	3,01%
Fevereiro Mês	866.785.517,97 Saldo Anterior	18.702.369,80 Aplicações	16.849.535,52 Resgates	895.492.935,23 Saldo Atual	26.854.582,98 Retorno (\$)	3,09% Retorno (%)	0,75% Meta (%)	412,21% Gap (%)	2,10% VaR (%)
Acumulado no ano					42.503.182,42	4,99%	1,65%	302,85%	

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 FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.520.678,82	1.347.579,41	1.298.765,76	5.799.052,61	1.229.560,14	20,95%	0,01%	0,80%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.291.437,58	0,00	0,00	6.605.473,83	314.036,25	4,99%	2,46%	4,99%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.490.898,90	0,00	349.328,74	12.742.938,42	601.368,26	4,81%	6,48%	2,02%
HSBC NILO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	21.712.272,43	0,00	0,00	22.643.380,15	931.107,72	4,29%	2,12%	4,29%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	54.842.893,40	0,00	0,00	57.010.720,22	2.167.826,82	3,95%	1,94%	3,95%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	47.290.003,61	0,00	0,00	49.128.644,64	1.838.641,03	3,89%	1,87%	3,89%
SUL AMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	48.550.530,08	0,00	0,00	50.433.436,40	1.882.906,32	3,88%	1,90%	3,88%
BTG PACTUAL TESOURO IPCA GERAL FI RENDA FIXA	17.833.139,98	0,00	0,00	18.517.119,74	683.979,76	3,84%	1,86%	3,84%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	122.239.704,71	555.671,72	0,00	127.476.257,95	4.680.881,52	3,81%	1,86%	3,83%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	80.046.517,59	0,00	0,00	83.094.831,71	3.048.314,12	3,81%	1,86%	3,81%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA	36.894.819,31	0,00	0,00	38.299.430,82	1.404.611,51	3,81%	1,86%	3,81%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	7.138.953,62	0,00	0,00	7.408.541,34	269.587,72	3,78%	1,78%	3,78%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	6.415.920,79	0,00	0,00	6.655.775,17	239.854,38	3,74%	1,98%	3,74%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	11.904.997,16	0,00	331.005,84	11.957.161,68	383.170,36	3,22%	6,21%	0,44%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	23.769.397,45	0,00	0,00	24.376.614,47	607.217,02	2,55%	1,17%	2,55%
TÍTULOS PÚBLICOS	114.089.441,51	0,00	0,00	116.913.014,16	2.823.572,65	2,47%	-	-
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.037.481,65	0,00	162.360,47	6.015.306,20	140.185,02	2,32%	5,28%	-0,37%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.034.098,14	0,00	0,00	7.193.851,71	159.753,57	2,27%	0,96%	2,27%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	4.459.259,04	0,00	0,00	4.552.831,29	93.572,25	2,10%	1,14%	2,10%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.456.112,57	0,00	0,00	4.545.485,22	89.372,65	2,01%	0,95%	2,01%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.367.986,94	0,00	96.426,67	3.335.033,53	63.473,26	1,88%	5,73%	-0,98%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	16.022.166,90	0,00	457.624,09	15.817.365,12	252.822,31	1,58%	0,85%	1,59%

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(%)
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.061.469,59	0,00	0,00	6.151.882,98	90.413,39	1,49%	0,69%	1,49%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	65.770.467,80	0,00	0,00	66.744.522,57	974.054,77	1,48%	0,72%	1,48%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	10.317.304,59	0,00	0,00	10.469.793,22	152.488,63	1,48%	0,72%	1,48%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	12.131.000,91	0,00	0,00	12.308.510,68	177.509,77	1,46%	0,71%	1,46%
LAVORO II FIDC SUBORDINADA PREFERENCIAL 2	117.701,37	0,00	59.597,97	59.745,80	1.642,40	1,40%	88,91%	-49,24%
GÁVEA SUL FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP	2.500.350,75	0,00	107.832,73	2.419.656,01	27.137,99	1,09%	7,73%	-3,23%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.103.898,69	0,00	114.326,84	4.029.120,71	39.548,86	0,96%	5,12%	-1,82%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	814.064,38	0,00	23.032,23	798.837,54	7.805,39	0,96%	0,42%	0,97%
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	583.410,14	0,00	0,00	588.775,54	5.365,40	0,92%	1,70%	0,92%
BRB DI 1 MILHÃO FIC RENDA FIXA LP	789.695,50	0,00	0,00	796.887,14	7.191,64	0,91%	0,01%	0,91%
LAVORO II FIDC SÊNIOR 2	661.810,45	0,00	333.713,28	334.108,41	6.011,24	0,91%	88,88%	-49,52%
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	3.787.209,48	0,00	10.171,25	3.809.802,15	32.763,92	0,87%	0,01%	0,87%
SUL INVEST FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 6	958.077,52	0,00	0,00	966.339,46	8.261,94	0,86%	0,26%	0,86%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	22.739.509,21	13.799.118,67	13.505.349,65	23.239.014,17	205.735,94	0,56%	0,05%	0,90%
SILVERADO MAXIMUM II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	110.755,11	0,00	0,00	108.598,47	-2.156,64	-1,95%	-	-1,93%
BELSUL 500 FIDC SÊNIOR	770.390,60	0,00	0,00	107.832,73	-662.557,87	-86,00%	0,71%	-0,52%
Total Renda Fixa					24.977.031,41	3,16%	1,86%	

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(%)
DOMO FII - DOMC11	974.040,00	0,00	0,00	1.040.000,00	65.960,00	6,77%	9,75%	6,77%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	9.025.269,03	0,00	0,00	9.455.469,18	430.200,15	4,77%	2,18%	4,77%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	6.367.259,83	0,00	0,00	6.589.824,07	222.564,24	3,50%	6,56%	3,50%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	15.420.647,37	0,00	0,00	15.946.191,87	525.544,50	3,41%	6,70%	3,41%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	0,00	3.000.000,00	0,00	3.095.261,20	95.261,20	3,18%	5,09%	2,86%
BRADESCO H REGIMES DE PREVIDÊNCIA IBOVESPA FIC AÇÕES	9.162.825,96	0,00	0,00	9.443.451,59	280.625,63	3,06%	6,48%	3,06%
SUL AMÉRICA HIGH YIELD FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	3.828.366,98	0,00	0,00	3.885.104,51	56.737,53	1,48%	0,50%	1,48%
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.209.757,00	0,00	0,00	1.227.259,42	17.502,42	1,45%	0,42%	1,45%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	2.248.721,84	0,00	0,00	2.273.711,37	24.989,53	1,11%	-	-
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	4.516.249,87	0,00	0,00	4.564.858,95	48.609,08	1,08%	1,23%	1,08%
SUL AMÉRICA CRÉDITO ATIVO FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	3.793.161,21	0,00	0,00	3.833.920,06	40.758,85	1,07%	0,29%	1,07%
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	4.858.322,76	0,00	0,00	4.909.984,00	51.661,24	1,06%	0,33%	1,06%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	6.675.395,47	0,00	0,00	6.740.182,85	64.787,38	0,97%	0,98%	0,97%
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	4.299.547,22	0,00	0,00	4.334.579,80	35.032,58	0,81%	8,40%	0,81%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	2.148.627,26	0,00	0,00	2.158.283,56	9.656,30	0,45%	8,34%	0,45%
XP LONG SHORT FIC MULTIMERCADO	3.364.389,07	0,00	0,00	3.378.397,27	14.008,20	0,42%	1,20%	0,24%
RIO BRAVO ENERGIA I FIP	401.306,20	0,00	0,00	401.474,40	168,20	0,04%	-	-
LSH FIP	4.646.721,70	0,00	0,00	4.645.669,92	-1.051,78	-0,02%	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	763.468,91	0,00	0,00	705.481,47	-57.987,44	-7,60%	-	-
Total Renda Variável					1.925.027,81	2,22%	4,14%	