

# 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 3.922/2010 - 4.392/2014
TÍTULOS PÚBLICOS			118.341.462,51	12,94%			Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	12.475.074,66	1,36%	76	0,63%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	3.389.866,74	0,37%	107	0,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2030	12.839.422,00	1,40%	27	5,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BTG PACTUAL TESOUREO IPCA GERAL FI RENDA FIXA	D+2	Não há	18.706.708,80	2,05%	411	8,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	6.100.536,21	0,67%	6	13,63%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SUL AMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	D+2	Não há	51.060.830,71	5,58%	107	14,33%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	6.238.892,47	0,68%	11	7,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	12.098.776,12	1,32%	72	1,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	38.685.183,03	4,23%	36	6,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	809.387,60	0,09%	193	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	6.660.382,92	0,73%	303	0,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	16.056.856,50	1,76%	167	1,45%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	128.795.076,12	14,09%	766	2,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	83.796.426,42	9,16%	116	10,31%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	4.082.609,44	0,45%	223	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	6.737.827,24	0,74%	22	1,57%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	4.612.527,81	0,50%	662	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	4.624.971,59	0,51%	14	3,52%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	67.668.111,92	7,40%	272	6,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	7.280.534,56	0,80%	80	0,58%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	57.617.812,75	6,30%	103	3,45%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "

Carteira consolidada de investimentos - base (março / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.478.868,57	0,82%	340	0,29%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	10.614.369,51	1,16%	327	0,54%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	49.642.309,72	5,43%	257	3,81%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	597.123,48	0,07%	63	0,80%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	21.138.192,89	2,31%	433	1,11%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	6.850.672,34	0,75%	604	0,56%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRB DI 1 MILHÃO FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	805.627,13	0,09%	41	0,18%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	24.697.522,95	2,70%	62	1,79%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	3.820.165,94	0,42%	1.328	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SUL INVEST FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 6	Não se aplica	Não se aplica	974.213,60	0,11%	22	1,16%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
GÁVEA SUL FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP	Não se aplica	Não se aplica	2.342.481,64	0,26%	17	5,20%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
SILVERADO MAXIMUM II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	Não se aplica	Não se aplica	107.973,82	0,01%	91	2,50%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
BELSUL 500 FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	20.116,93	0,00%	6	14,91%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	6.466.962,03	0,71%	41	1,24%	Artigo 8º, Inciso I
BRASESCO H REGIMES DE PREVIDÊNCIA IBOVESPA FIC AÇÕES	D+5	Não há	9.229.914,09	1,01%	11	11,19%	Artigo 8º, Inciso I
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	4.236.461,64	0,46%	21.337	0,79%	Artigo 8º, Inciso I
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	D+13	Não há	3.045.972,82	0,33%	283	4,67%	Artigo 8º, Inciso III
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou D+33	Não há	16.055.703,49	1,76%	366	5,84%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	D+12	Não há	2.148.736,00	0,23%	364	2,94%	Artigo 8º, Inciso III
SUL AMÉRICA HIGH YIELD FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+361	2 anos	3.938.415,83	0,43%	12	10,53%	Artigo 8º, Inciso IV
XP LONG SHORT FIC MULTIMERCADO	D+2 ou D+16	Não há	3.329.022,47	0,36%	5.718	0,54%	Artigo 8º, Inciso IV
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	9.541.692,78	1,04%	763	5,42%	Artigo 8º, Inciso IV

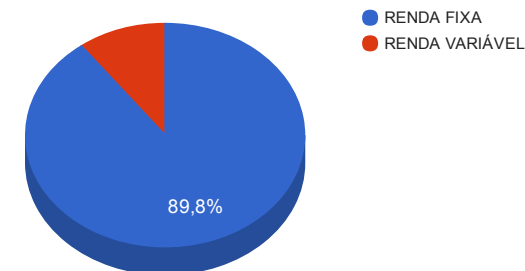
Carteira consolidada de investimentos - base (março / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
SUL AMÉRICA CRÉDITO ATIVO FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+30	Não há	3.883.984,59	0,42%	160	0,97%	Artigo 8º, Inciso IV
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	D+5	Não há	6.782.224,86	0,74%	33	2,62%	Artigo 8º, Inciso IV
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	4.966.399,85	0,54%	721	0,78%	Artigo 8º, Inciso IV
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+180	Não há	1.231.349,25	0,13%	26	0,80%	Artigo 8º, Inciso IV
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	4.639.835,24	0,51%	40	14,54%	Artigo 8º, Inciso IV
RIO BRAVO ENERGIA I FIP	Não se aplica	Não se aplica	401.497,04	0,04%			Artigo 8º, Inciso V
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	782.995,50	0,09%			Artigo 8º, Inciso V
LSH FIP	Não se aplica	Não se aplica	4.644.322,69	0,51%			Artigo 8º, Inciso V
MÉRITO DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - MFII11	Não se aplica	Não se aplica	5.072.018,00	0,55%		11,31%	Artigo 8º, Inciso VI
DOMO FII - DOMC11	Não se aplica	Não se aplica	988.600,00	0,11%		1,14%	Artigo 8º, Inciso VI
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	S/Info	Não se aplica	2.295.278,65	0,25%		14,73%	Artigo 8º, Inciso VI
HSBC NILO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	D+4 a D+5	Não há	22.954.807,78	2,51%	8	5,66%	Desenquadrado - RF
		<b>TOTAL -</b>	<b>914.405.111,24</b>				

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

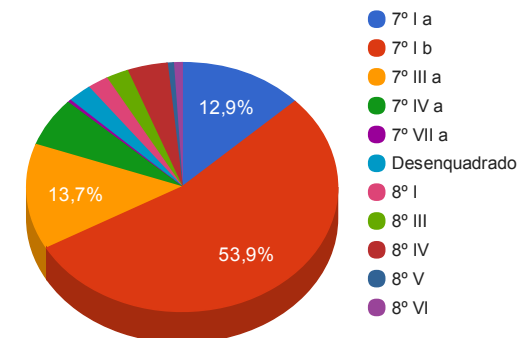
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	118.341.462,51	12,94%	8,00%	10,00%	15,00%	18.819.304,18
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	492.720.002,86	53,88%	39,00%	40,00%	60,00%	55.923.063,88
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	125.353.360,55	13,71%	8,00%	10,00%	30,00%	148.968.172,82
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	57.909.304,73	6,33%	5,00%	6,50%	30,00%	216.412.228,64
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,50%	10,00%	91.440.511,12
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	3.444.785,99	0,38%	0,00%	5,00%	5,00%	42.275.469,57
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	45.720.255,56
Desenquadrado - RF	0,00%	22.954.807,78	2,51%	0,00%	0,00%	0,00%	-22.954.807,78
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>820.723.724,42</b>	<b>89,75%</b>	<b>60,00</b>	<b>80,00</b>	<b>155,00</b>	<b>-</b>

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	19.933.337,76	2,18%	2,00%	5,00%	10,00%	71.507.173,36
Artigo 8º, Inciso II	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	5,00%	45.720.255,56
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	21.250.412,31	2,32%	1,00%	3,00%	10,00%	70.190.098,81
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	38.312.924,87	4,19%	3,00%	5,00%	5,00%	7.407.330,69
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5.828.815,23	0,64%	0,00%	3,00%	5,00%	39.891.440,33
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	8.355.896,65	0,91%	0,00%	3,00%	5,00%	37.364.358,91
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>93.681.386,82</b>	<b>10,25%</b>	<b>6,00</b>	<b>19,50</b>	<b>40,00</b>	<b>-</b>

Distribuição por Artigo / Resolução



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos - Renda Fixa	Base: março / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	118.341.462,51	12,94%	8,00%	15,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	492.720.002,86	53,88%	39,00%	60,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	125.353.360,55	13,71%	8,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	57.909.304,73	6,33%	5,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VI	0,00	0,00%	0,00%	10,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	3.444.785,99	0,38%	0,00%	5,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Desenquadrado - RF	22.954.807,78	2,51%	0,00%	0,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>820.723.724,42</b>	<b>89,75%</b>	<b>60,00</b>	<b>155,00</b>

Artigos - Renda Variável	Base: março / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I	19.933.337,76	2,18%	2,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso III	21.250.412,31	2,32%	1,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV	38.312.924,87	4,19%	3,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	5.828.815,23	0,64%	0,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso VI	8.355.896,65	0,91%	0,00%	5,00%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>93.681.386,82</b>	<b>10,25%</b>	<b>6,00</b>	<b>40,00</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%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,41%	4,10%	4,10%	3,21%	7,78%	-	0,20%	0,710%	4,83%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,32%	3,33%	3,33%	5,63%	12,85%	-	0,20%	0,520%	1,20%
IRF-M	1,50%	5,91%	5,91%	9,53%	21,05%	37,17%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,47%	5,89%	5,89%	9,44%	20,94%	36,63%	0,20%	1,330%	3,26%
135% do CDI	1,42%	4,11%	4,11%	8,69%	19,00%	41,56%	-	-	-
GÁVEA SUL FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP	-3,19%	-8,90%	-8,90%	-4,89%	4,13%	23,87%	0,40%	7,150%	-
IMA-B 5	1,39%	4,09%	4,09%	6,45%	14,11%	32,99%	-	-	-
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	1,58%	5,29%	5,29%	7,36%	16,15%	34,88%	0,40%	1,300%	3,35%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	1,38%	4,06%	4,06%	6,37%	13,91%	32,53%	0,10%	0,760%	2,15%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,38%	4,05%	4,05%	6,34%	13,92%	32,29%	0,20%	0,760%	2,16%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	1,35%	3,99%	3,99%	6,25%	13,66%	31,90%	0,40%	0,760%	2,15%
130% do CDI	1,37%	3,95%	3,95%	8,35%	18,24%	39,75%	-	-	-
SILVERADO MAXIMUM II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	-	-3,37%	-3,37%	-6,28%	-91,65%	-94,57%	2,50%	-	-
IMA Geral ex-C	1,22%	5,32%	5,32%	8,47%	19,01%	35,68%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,20%	5,37%	5,37%	8,12%	-	-	0,30%	1,210%	-
CDI	1,05%	3,03%	3,03%	6,37%	13,75%	29,37%	-	-	-

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
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	1,42%	3,54%	3,54%	7,16%	15,37%	33,01%	0,75%	4,010%	5,00%
BRB DI 1 MILHÃO FIC RENDA FIXA LP	1,10%	3,17%	3,17%	5,65%	13,52%	29,14%	0,25%	0,020%	0,52%
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,07%	3,06%	3,06%	6,44%	13,88%	29,56%	0,20%	0,030%	0,04%
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%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,97%	2,82%	2,82%	5,95%	12,94%	27,36%	1,00%	0,000%	0,09%

IMA-B	1,04%	6,89%	6,89%	9,36%	21,56%	40,51%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,64%	1,88%	1,88%	4,03%	8,82%	-	0,20%	1,070%	5,74%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,51%	4,29%	4,29%	6,57%	14,32%	32,43%	0,20%	0,870%	2,36%
HSBC NILO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	1,38%	8,28%	8,28%	10,96%	24,89%	41,96%	0,30%	2,440%	8,08%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,33%	0,48%	0,48%	2,65%	6,98%	16,84%	0,20%	0,520%	4,43%
SUL AMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	1,24%	7,11%	7,11%	9,61%	22,09%	40,61%	0,40%	1,910%	5,88%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	1,23%	6,80%	6,80%	9,04%	20,35%	39,07%	0,45%	2,240%	6,33%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,18%	3,43%	3,43%	5,30%	12,96%	22,21%	0,20%	1,670%	7,55%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	1,06%	7,08%	7,08%	9,67%	22,16%	40,35%	0,20%	2,130%	6,37%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,05%	6,96%	6,96%	9,42%	21,57%	40,08%	0,30%	2,060%	6,13%
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%



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
BTG PACTUAL TESOURO IPCA GERAL FI RENDA FIXA	1,02%	6,83%	6,83%	9,17%	21,32%	39,78%	0,20%	2,050%	6,25%
BRANCO 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%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA	1,01%	6,77%	6,77%	9,10%	20,97%	39,19%	0,40%	2,050%	6,15%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	0,95%	6,74%	6,74%	9,38%	21,28%	38,79%	0,20%	1,980%	5,84%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,76%	4,71%	4,71%	7,28%	16,94%	27,24%	0,20%	2,220%	8,85%
IPCA + 8,00% ao ano	0,96%	2,92%	2,92%	5,67%	12,97%	33,38%	-	-	-
BELSUL 500 FIDC SÊNIOR	-97,37%	-97,40%	-97,40%	-98,29%	-98,31%	-98,02%	1,00%	-	-
IPCA + 7,50% ao ano	0,91%	2,81%	2,81%	5,43%	12,45%	32,15%	-	-	-
SUL INVEST FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 6	0,81%	2,81%	2,81%	5,31%	-2,53%	-2,70%	0,20%	0,280%	-
IMA-B 5+	0,88%	8,35%	8,35%	10,88%	26,07%	45,95%	-	-	-
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	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	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,42%	2,65%	2,65%	4,85%	10,41%	-	0,15%	1,430%	6,36%

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

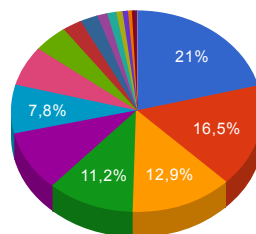
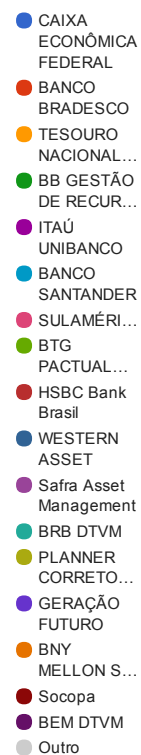
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	1,05%	3,03%	3,03%	6,37%	13,75%	29,37%	-	-	-
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	1,64%	3,79%	3,79%	7,66%	16,57%	37,74%	1,00%	3,350%	17,62%
SUL AMÉRICA CRÉDITO ATIVO FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1,31%	3,49%	3,49%	7,32%	15,19%	31,17%	0,60%	0,280%	0,60%
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	1,15%	3,56%	3,56%	6,68%	14,52%	29,84%	0,50%	0,410%	1,24%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	0,62%	3,52%	3,52%	8,63%	17,02%	38,22%	2,00%	0,880%	1,85%
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	0,33%	3,14%	3,14%	6,45%	14,49%	31,72%	0,55%	1,180%	1,21%
XP LONG SHORT FIC MULTIMERCADO	-1,46%	0,49%	0,49%	4,87%	18,51%	38,47%	2,00%	3,320%	3,93%
IPCA + 8,00% ao ano	0,96%	2,92%	2,92%	5,67%	12,97%	33,38%	-	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	-	-	-	-	-	-	2,00%	-	-
IPCA	0,25%	0,96%	0,96%	1,71%	4,57%	14,39%	-	-	-
SUL AMÉRICA HIGH YIELD FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1,37%	4,20%	4,20%	7,53%	11,90%	23,13%	1,50%	0,380%	2,18%
IFIX	0,20%	9,01%	9,01%	11,89%	36,84%	50,85%	-	-	-
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-	0,14%	-	-
DOMO FII - DOMC11	-4,94%	2,13%	2,13%	-2,89%	-8,46%	-18,97%	0,95%	12,470%	63,73%
Ibovespa	-2,52%	7,90%	7,90%	11,34%	29,83%	27,05%	-	-	-
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,69%	8,27%	8,27%	3,16%	16,09%	20,20%	3,00%	7,440%	16,82%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	-0,44%	4,09%	4,09%	7,73%	25,52%	18,30%	2,00%	8,050%	20,37%

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

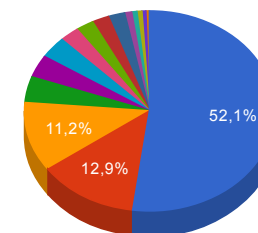
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	-1,86%	8,94%	8,94%	10,18%	27,90%	25,87%	1,50%	8,250%	17,89%
BRDESCO H REGIMES DE PREVIDÊNCIA IBOVESPA FIC AÇÕES	-2,26%	8,69%	8,69%	11,07%	25,61%	21,63%	1,00%	7,860%	18,15%
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	-2,26%	4,67%	4,67%	11,27%	23,53%	13,12%	4,00%	9,150%	21,12%
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%
S&P 500	-0,20%	5,53%	5,53%	8,97%	14,71%	14,26%	-	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	0,91%	7,87%	7,87%	15,36%	29,40%	45,23%	1,00%	3,500%	9,93%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
MÉRITO DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - MFII11	-0,75%	-0,83%	-0,83%	2,03%	3,69%	3,53%	0,15%	0,960%	11,35%
LSH FIP	-	-	-	-	-	-	1,15%	-	-
RIO BRAVO ENERGIA I FIP	-	-	-	-	-	-	1,65%	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	191.995.904,42	21,00%
BANCO BRADESCO	150.644.153,26	16,47%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	118.341.462,51	12,94%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	102.527.040,96	11,21%
ITAÚ UNIBANCO	88.563.635,14	9,69%
BANCO SANTANDER	71.488.277,86	7,82%
SULAMÉRICA INVESTIMENTOS	58.883.231,13	6,44%
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS	40.862.948,50	4,47%
HSBC Bank Brasil	22.954.807,78	2,51%
Administrador	Valor	%
WESTERN ASSET	20.948.889,23	2,29%
Safra Asset Management	11.704.227,09	1,28%
BRB DTVM	10.686.908,54	1,17%
PLANNER CORRETORA	7.367.296,65	0,81%
GERAÇÃO FUTURO	6.385.197,64	0,70%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	4.560.371,72	0,50%
Socopa	3.336.812,17	0,36%
BEM DTVM	3.045.972,82	0,33%
Gradual Investimentos	107.973,82	0,01%



Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	476.777.212,19	52,14%
TÍTULOS PÚBLICOS	118.341.462,51	12,94%
IMA-B 5	102.855.003,86	11,25%
MULTIMERCADO	38.312.924,87	4,19%
CDI	33.211.781,78	3,63%
GESTÃO DURATION	31.978.057,51	3,50%
CRÉDITO PRIVADO	22.954.807,78	2,51%
AÇÕES - LIVRES	21.250.412,31	2,32%
AÇÕES - INDEXADO	19.933.337,76	2,18%
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5+	19.499.804,92	2,13%
FUNDO IMOBILIÁRIO	8.355.896,65	0,91%
IDKA IPCA 3A	6.238.892,47	0,68%
FIP	5.828.815,23	0,64%
IRF-M	4.612.527,81	0,50%
FIDC - FECHADO	3.444.785,99	0,38%
IDKA IPCA 2A	809.387,60	0,09%



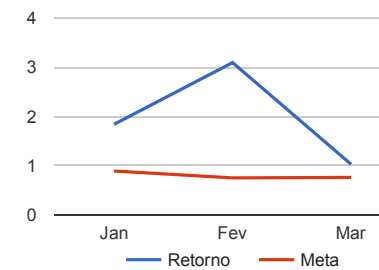
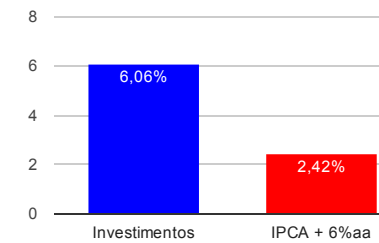
Carteira de Títulos Públicos - base (março / 2017)

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	3.043,689006	4.000.183,40	4.145.504,43	145.321,03
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2019	25/08/2015	7659	2.636,195170	3.112,398993	20.190.618,81	23.837.863,89	3.647.245,08
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2021	17/08/2016	4750	2.964,257204	3.140,487288	14.080.221,72	14.917.314,62	837.092,90
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2023	03/09/2015	6730	2.515,509771	3.165,903064	16.929.380,76	21.306.527,62	4.377.146,86
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	14/03/2014	6185	2.315,991673	3.147,114897	14.324.408,50	19.464.905,64	5.140.497,14
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2026	27/04/2016	2200	2.838,144079	3.165,804634	6.243.916,97	6.964.770,19	720.853,22
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	21/12/2015	8310	2.412,107871	3.333,884010	20.044.616,41	27.704.576,12	7.659.959,72

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 (%)
Março	895.492.935,23	19.432.119,68	16.389.391,95	907.759.892,74	9.224.229,78	1,03%	0,76%	134,29%	2,05%
Acumulado no ano					51.727.412,20	6,06%	2,42%	250,22%	

**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(%)
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.335.033,53	0,00	0,00	3.389.866,74	54.833,21	1,64%	1,07%	1,64%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	4.552.831,29	0,00	0,00	4.624.971,59	72.140,30	1,58%	1,30%	1,58%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.817.365,12	0,00	0,00	16.056.856,50	239.491,38	1,51%	0,87%	1,51%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.545.485,22	0,00	0,00	4.612.527,81	67.042,59	1,47%	1,33%	1,47%
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	588.775,54	0,00	0,00	597.123,48	8.347,94	1,42%	4,01%	1,42%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.015.306,20	0,00	0,00	6.100.536,21	85.230,01	1,42%	1,43%	1,42%
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.151.882,98	0,00	0,00	6.238.892,47	87.009,49	1,41%	0,71%	1,41%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	66.744.522,57	0,00	0,00	67.668.111,92	923.589,35	1,38%	0,76%	1,38%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	10.469.793,22	0,00	0,00	10.614.369,51	144.576,29	1,38%	0,76%	1,38%
HSBC NILO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	22.643.380,15	0,00	0,00	22.954.807,78	311.427,63	1,38%	2,44%	1,38%
GÁVEA SUL FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP	2.419.656,01	0,00	110.322,12	2.342.481,64	33.147,75	1,37%	7,15%	-3,19%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	12.308.510,68	0,00	0,00	12.475.074,66	166.563,98	1,35%	0,76%	1,35%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.029.120,71	0,00	0,00	4.082.609,44	53.488,73	1,33%	0,52%	1,33%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	798.837,54	0,00	0,00	809.387,60	10.550,06	1,32%	0,52%	1,32%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	24.376.614,47	0,00	0,00	24.697.522,95	320.908,48	1,32%	1,52%	1,32%
SUL AMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	50.433.436,40	0,00	0,00	51.060.830,71	627.394,31	1,24%	1,91%	1,24%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	6.655.775,17	0,00	0,00	6.737.827,24	82.052,07	1,23%	2,24%	1,23%
TÍTULOS PÚBLICOS	116.913.014,16	0,00	0,00	118.341.462,51	1.428.448,35	1,22%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.193.851,71	0,00	0,00	7.280.534,56	86.682,85	1,20%	1,21%	1,20%
LAVORO II FIDC SUBORDINADA PREFERENCIAL 2	59.745,80	0,00	60.462,47	0,00	716,67	1,20%	-	-
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	11.957.161,68	0,00	0,00	12.098.776,12	141.614,44	1,18%	1,67%	1,18%
BRB DI 1 MILHÃO FIC RENDA FIXA LP	796.887,14	0,00	0,00	805.627,13	8.739,99	1,10%	0,02%	1,10%

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(%)
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	3.809.802,15	1.000,00	31.281,63	3.820.165,94	40.645,42	1,07%	0,03%	1,07%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	57.010.720,22	0,00	0,00	57.617.812,75	607.092,53	1,06%	2,13%	1,06%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	49.128.644,64	0,00	0,00	49.642.309,72	513.665,08	1,05%	2,06%	1,05%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	127.476.257,95	0,00	0,00	128.795.076,12	1.318.818,17	1,03%	2,05%	1,03%
BTG PACTUAL TESOURO IPCA GERAL FI RENDA FIXA	18.517.119,74	0,00	0,00	18.706.708,80	189.589,06	1,02%	2,05%	1,02%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA	38.299.430,82	0,00	0,00	38.685.183,03	385.752,21	1,01%	2,05%	1,01%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	7.408.541,34	0,00	0,00	7.478.868,57	70.327,23	0,95%	1,98%	0,95%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.799.052,61	1.084.450,55	96.698,29	6.850.672,34	63.867,47	0,93%	0,00%	0,97%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	83.094.831,71	0,00	0,00	83.796.426,42	701.594,71	0,84%	2,06%	1,01%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.605.473,83	0,00	0,00	6.660.382,92	54.909,09	0,83%	2,74%	0,83%
SUL INVEST FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 6	966.339,46	0,00	0,00	974.213,60	7.874,14	0,81%	0,28%	0,81%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.742.938,42	0,00	0,00	12.839.422,00	96.483,58	0,76%	2,22%	0,76%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	23.239.014,17	13.347.669,13	15.694.891,88	21.138.192,89	246.401,47	0,67%	0,06%	1,05%
LAVORO II FIDC SÊNIOR 2	334.108,41	0,00	336.173,74	0,00	2.065,33	0,62%	-	-
SILVERADO MAXIMUM II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	108.598,47	0,00	0,00	107.973,82	-624,65	-0,58%	-	-0,58%
BELSUL 500 FIDC SÊNIOR	107.832,73	0,00	60.561,82	20.116,93	-27.153,98	-25,18%	-	-97,37%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>9.225.302,73</b>	<b>1,13%</b>	<b>1,72%</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(%)	
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	705.481,47	0,00	0,00	782.995,50	77.514,03	10,99%	-	-	
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	4.564.858,95	0,00	0,00	4.639.835,24	74.976,29	1,64%	3,35%	1,64%	
MÉRITO DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - MFII11	0,00	5.000.000,00	0,00	5.072.018,00	72.018,00	1,44%	0,96%	-0,75%	
SUL AMÉRICA HIGH YIELD FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	3.885.104,51	0,00	0,00	3.938.415,83	53.311,32	1,37%	0,38%	1,37%	
SUL AMÉRICA CRÉDITO ATIVO FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	3.833.920,06	0,00	0,00	3.883.984,59	50.064,53	1,31%	0,28%	1,31%	
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	4.909.984,00	0,00	0,00	4.966.399,85	56.415,85	1,15%	0,41%	1,15%	
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	2.273.711,37	0,00	0,00	2.295.278,65	21.567,28	0,95%	-	0,00%	
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	9.455.469,18	0,00	0,00	9.541.692,78	86.223,60	0,91%	3,50%	0,91%	
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	15.946.191,87	0,00	0,00	16.055.703,49	109.511,62	0,69%	7,44%	0,69%	
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	6.740.182,85	0,00	0,00	6.782.224,86	42.042,01	0,62%	0,88%	0,62%	
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.227.259,42	0,00	0,00	1.231.349,25	4.089,83	0,33%	1,18%	0,33%	
RIO BRAVO ENERGIA I FIP	401.474,40	0,00	0,00	401.497,04	22,64	0,01%	-	-	
LSH FIP	4.645.669,92	0,00	0,00	4.644.322,69	-1.347,23	-0,03%	-	-	
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	2.158.283,56	0,00	0,00	2.148.736,00	-9.547,56	-0,44%	8,05%	-0,44%	
XP LONG SHORT FIC MULTIMERCADO	3.378.397,27	0,00	0,00	3.329.022,47	-49.374,80	-1,46%	3,32%	-1,46%	
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	3.095.261,20	0,00	0,00	3.045.972,82	-49.288,38	-1,59%	5,13%	-1,59%	
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	6.589.824,07	0,00	0,00	6.466.962,03	-122.862,04	-1,86%	8,25%	-1,86%	
BRADERCO H REGIMES DE PREVIDÊNCIA IBOVESPA FIC AÇÕES	9.443.451,59	0,00	0,00	9.229.914,09	-213.537,50	-2,26%	7,86%	-2,26%	
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	4.334.579,80	0,00	0,00	4.236.461,64	-98.118,16	-2,26%	9,15%	-2,26%	
DOMO FII - DOMC11	1.040.000,00	0,00	0,00	988.600,00	-51.400,00	-4,94%	12,47%	-4,94%	
Total Renda Variável						52.281,33	0,06%	4,75%	

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	120.028.096,07	555.671,72	0,00	128.795.076,12	8.211.308,33	6,82%	6,83%
TÍTULOS PÚBLICOS	112.263.694,43	0,00	0,00	118.341.462,51	6.077.768,08	5,41%	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	78.622.117,61	0,00	0,00	83.796.426,42	5.174.308,81	6,58%	6,76%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	53.807.183,46	0,00	0,00	57.617.812,75	3.810.629,29	7,08%	7,08%
SUL AMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	47.672.715,49	0,00	0,00	51.060.830,71	3.388.115,22	7,11%	7,11%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	46.412.384,27	0,00	0,00	49.642.309,72	3.229.925,45	6,96%	6,96%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	65.029.021,89	0,00	0,00	67.668.111,92	2.639.090,03	4,06%	4,06%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA	36.232.176,93	0,00	0,00	38.685.183,03	2.453.006,10	6,77%	6,77%
HSBC NILO FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO LP	21.199.889,92	0,00	0,00	22.954.807,78	1.754.917,86	8,28%	8,28%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	23.276.360,70	0,00	0,00	24.697.522,95	1.421.162,25	6,11%	6,11%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.365.655,58	3.865.102,72	1.714.193,82	6.850.672,34	1.334.107,86	23,11%	2,82%
BTG PACTUAL TESOURO IPCA GERAL FI RENDA FIXA	17.510.539,45	0,00	0,00	18.706.708,80	1.196.169,35	6,83%	6,83%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.262.145,42	0,00	349.328,74	12.839.422,00	926.605,32	7,58%	4,71%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	11.697.885,31	0,00	331.005,84	12.098.776,12	731.896,65	6,29%	3,43%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.843.635,96	0,00	457.624,09	16.056.856,50	670.844,63	4,28%	4,29%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.626.157,75	65.821.266,26	46.942.157,97	21.138.192,89	632.926,85	1,69%	3,09%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.158.108,96	0,00	0,00	6.660.382,92	502.273,96	8,16%	8,16%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	11.996.464,29	0,00	0,00	12.475.074,66	478.610,37	3,99%	3,99%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	7.006.656,34	0,00	0,00	7.478.868,57	472.212,23	6,74%	6,74%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	6.308.927,76	0,00	0,00	6.737.827,24	428.899,48	6,80%	6,80%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	10.201.225,45	0,00	0,00	10.614.369,51	413.144,06	4,05%	4,05%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	6.929.037,76	0,00	7.280.534,56	351.496,80	5,07%	5,37%

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 (%)
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.943.288,51	0,00	162.360,47	6.100.536,21	319.608,17	5,42%	2,65%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.356.164,07	0,00	0,00	4.612.527,81	256.363,74	5,89%	5,89%
ITAÚ INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.993.307,70	0,00	0,00	6.238.892,47	245.584,77	4,10%	4,10%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	4.392.685,93	0,00	0,00	4.624.971,59	232.285,66	5,29%	5,29%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.327.227,92	0,00	96.426,67	3.389.866,74	159.065,49	4,83%	1,88%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.063.001,10	0,00	114.326,84	4.082.609,44	133.935,18	3,33%	0,48%
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.158.812,15	3.364.971,34	809.068,80	3.820.165,94	105.451,25	2,66%	3,06%
GÁVEA SUL FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP	2.571.253,72	0,00	325.657,70	2.342.481,64	96.885,62	3,93%	-8,90%
SUL INVEST FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 6	947.576,94	0,00	0,00	974.213,60	26.636,66	2,81%	2,81%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	805.959,37	0,00	23.032,23	809.387,60	26.460,46	3,32%	3,33%
BRB DI 1 MILHÃO FIC RENDA FIXA LP	780.843,34	0,00	0,00	805.627,13	24.783,79	3,17%	3,17%
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	576.707,60	0,00	0,00	597.123,48	20.415,88	3,54%	3,54%
LAVORO II FIDC SÊNIOR 2	981.573,01	0,00	999.981,45	0,00	18.408,44	2,60%	-100,00%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VIII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.912.345,64	0,00	6.929.037,76	0,00	16.692,12	0,24%	2,97%
LAVORO II FIDC SUBORDINADA PREFERENCIAL 2	173.243,06	0,00	178.614,85	0,00	5.371,79	4,40%	-
SILVERADO MAXIMUM II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	111.733,27	0,00	0,00	107.973,82	-3.759,45	-3,36%	-3,37%
BELSUL 500 FIDC SÊNIOR	773.474,30	0,00	60.561,82	20.116,93	-692.795,55	-89,57%	-97,40%
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>47.290.813,00</b>	<b>6,09%</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 (%)
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	14.829.059,74	0,00	0,00	16.055.703,49	1.226.643,75	8,27%	8,27%
BRADERCO H REGIMES DE PREVIDÊNCIA IBOVESPA FIC AÇÕES	8.491.787,04	0,00	0,00	9.229.914,09	738.127,05	8,69%	8,69%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	8.845.339,16	0,00	0,00	9.541.692,78	696.353,62	7,87%	7,87%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	5.936.123,59	0,00	0,00	6.466.962,03	530.838,44	8,94%	8,94%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	6.551.712,63	0,00	0,00	6.782.224,86	230.512,23	3,52%	3,52%
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	4.047.277,82	0,00	0,00	4.236.461,64	189.183,82	4,67%	4,67%
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	4.795.688,89	0,00	0,00	4.966.399,85	170.710,96	3,56%	3,56%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	4.470.620,02	0,00	0,00	4.639.835,24	169.215,22	3,79%	3,79%
SUL AMÉRICA HIGH YIELD FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	3.779.712,19	0,00	0,00	3.938.415,83	158.703,64	4,20%	4,20%
SUL AMÉRICA CRÉDITO ATIVO FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	3.752.835,43	0,00	0,00	3.883.984,59	131.149,16	3,49%	3,49%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	2.064.354,90	0,00	0,00	2.148.736,00	84.381,10	4,09%	4,09%
MÉRITO DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - MFII11	0,00	5.000.000,00	0,00	5.072.018,00	72.018,00	1,44%	-0,83%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	2.225.525,62	0,00	0,00	2.295.278,65	69.753,03	3,13%	0,00%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	0,00	3.000.000,00	0,00	3.045.972,82	45.972,82	1,53%	6,22%
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.193.874,91	0,00	0,00	1.231.349,25	37.474,34	3,14%	3,14%
DOMO FII - DOMC11	968.000,00	0,00	0,00	988.600,00	20.600,00	2,13%	2,13%
XP LONG SHORT FIC MULTIMERCADO	3.312.772,70	0,00	0,00	3.329.022,47	16.249,77	0,49%	0,49%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	767.474,91	0,00	0,00	782.995,50	15.520,59	2,02%	-
RIO BRAVO ENERGIA I FIP	403.265,92	0,00	0,00	401.497,04	-1.768,88	-0,44%	-
LSH FIP	4.648.079,18	0,00	0,00	4.644.322,69	-3.756,49	-0,08%	-
Total Renda Variável					4.597.882,17	5,58%	