

Relatório Analítico dos Investimentos em março e 1º Trimestre de 2017



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
BRDESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	D+1	16/05/2019	17.361.916,07	3,33%	11	22,61%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	19.344.414,68	3,71%	223	0,62%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	8.631.958,46	1,66%	22	2,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	37.024.674,72	7,10%	167	3,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.451.416,38	1,62%	766	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	10.928.303,48	2,10%	152	1,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	18/08/2018	43.577.172,34	8,36%	100	3,78%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2018	8.124.746,00	1,56%	54	2,96%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.572.642,66	1,07%	1.342	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	10.975.294,80	2,10%	6	24,52%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	2.749.918,69	0,53%	1.895	3,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	14.664.565,91	2,81%	72	1,54%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	17.895.638,32	3,43%	36	2,83%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	42.735.896,78	8,19%	116	5,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	20.803.748,18	3,99%	719	0,39%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	D+1	Não há	23.074.441,11	4,42%	14	6,73%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	17.840.233,26	3,42%	257	1,37%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	15.464.940,33	2,97%	1.328	0,26%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	52.348.281,29	10,04%	419	0,69%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	69.442.092,19	13,31%	754	1,12%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	10.177.511,67	1,95%	62	0,74%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	1.611.229,72	0,31%	98	1,53%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "

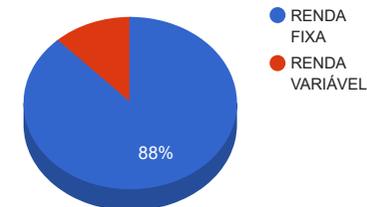
Carteira consolidada de investimentos - base (março / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	6.748.356,01	1,29%	41	1,29%	Artigo 8º, Inciso I
BRDESCO H REGIMES DE PREVIDÊNCIA IBOVESPA FIC AÇÕES	D+5	Não há	6.013.600,70	1,15%	11	7,29%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ FOF RPI 30 IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+25	Não há	2.190.079,80	0,42%	16	2,12%	Artigo 8º, Inciso I
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	5.530.701,46	1,06%	200	1,28%	Artigo 8º, Inciso III
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou D+33	Não há	4.713.280,76	0,90%	366	1,71%	Artigo 8º, Inciso III
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	5.718.910,15	1,10%	729	3,11%	Artigo 8º, Inciso III
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	6.799.408,48	1,30%	84	5,42%	Artigo 8º, Inciso III
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	13.644.694,16	2,62%	721	2,15%	Artigo 8º, Inciso IV
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	D+5	Não há	8.844.320,61	1,70%	33	3,42%	Artigo 8º, Inciso IV
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	2.560.859,05	0,49%	19	3,21%	Artigo 8º, Inciso V
TOTAL -			521.565.248,22				

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

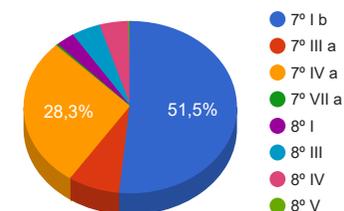
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	0,00	0,00%	3,00%	3,00%	3,00%	15.646.957,45
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	268.842.307,47	51,55%	60,00%	65,00%	70,00%	96.253.366,28
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	40.914.674,37	7,84%	10,00%	15,00%	20,00%	63.398.375,27
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	147.432.825,48	28,27%	20,00%	27,00%	30,00%	9.036.748,99
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	1.611.229,72	0,31%	1,00%	3,00%	3,00%	14.035.727,73
Total Renda Fixa	100,00%	458.801.037,04	87,97%	94,00	113,00	126,00	-

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	14.952.036,51	2,87%	0,00%	4,00%	10,00%	37.204.488,31
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	22.762.300,85	4,36%	5,00%	5,00%	10,00%	29.394.223,97
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	22.489.014,77	4,31%	3,00%	4,00%	5,00%	3.589.247,64
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	2.560.859,05	0,49%	2,00%	3,00%	3,00%	13.086.098,40
Total Renda Variável	30,00%	62.764.211,18	12,03%	10,00	16,00	28,00	-

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 "	0,00	0,00%	3,00%	3,00%
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	268.842.307,47	51,55%	60,00%	70,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	40.914.674,37	7,84%	10,00%	20,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	147.432.825,48	28,27%	20,00%	30,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	1.611.229,72	0,31%	1,00%	3,00%
Total Renda Fixa	458.801.037,04	87,97%	94,00	126,00

Artigos - Renda Variável	Base: março / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso I	14.952.036,51	2,87%	0,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso III	22.762.300,85	4,36%	5,00%	10,00%
Artigo 8º, Inciso IV	22.489.014,77	4,31%	3,00%	5,00%
Artigo 8º, Inciso V	2.560.859,05	0,49%	2,00%	3,00%
Total Renda Variável	62.764.211,18	12,03%	10,00	28,00

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%	-	-	-
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%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,33%	3,34%	3,34%	5,62%	-	-	0,20%	0,520%	-
IRF-M 1	1,12%	3,46%	3,46%	6,79%	14,08%	30,52%	-	-	-
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	1,15%	3,74%	3,74%	7,16%	14,67%	30,48%	0,50%	0,370%	0,62%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,11%	3,41%	3,41%	6,70%	13,92%	30,12%	0,20%	0,130%	0,29%
Selic	1,05%	3,03%	3,03%	6,38%	13,77%	29,41%	-	-	-
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,05%	3,05%	3,05%	6,61%	14,06%	29,75%	0,20%	0,000%	0,06%
CDI	1,05%	3,03%	3,03%	6,37%	13,75%	29,37%	-	-	-
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 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%	-	-	-
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%
BRADERCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	1,41%	4,08%	4,08%	0,25%	4,99%	-	0,20%	0,710%	6,58%
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%
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%

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

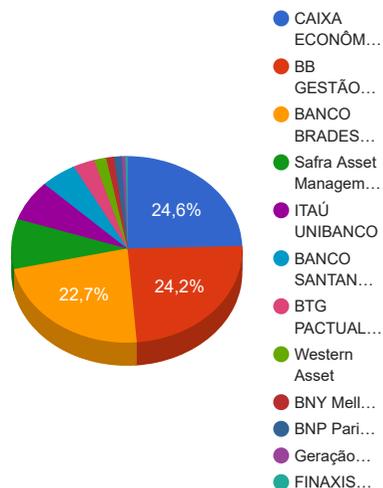
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	1,10%	6,96%	6,96%	9,51%	21,53%	40,69%	0,15%	2,130%	6,42%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,05%	6,96%	6,96%	9,42%	21,57%	40,08%	0,30%	2,060%	6,13%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,03%	6,83%	6,83%	9,33%	21,40%	38,26%	0,20%	2,050%	6,15%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP	1,02%	6,84%	6,84%	9,24%	21,40%	40,16%	0,20%	2,050%	6,16%
BRDESCO 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%
101,50% do IPCA + 5,75% ao ano	0,75%	2,36%	2,36%	4,52%	10,50%	27,70%	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,45%	-1,32%	-1,32%	-3,77%	-13,20%	-19,19%	0,25%	0,350%	2,12%
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%
CAIXA BRASIL 2018 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,33%	0,49%	0,49%	2,71%	7,14%	-	0,20%	0,520%	4,35%

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

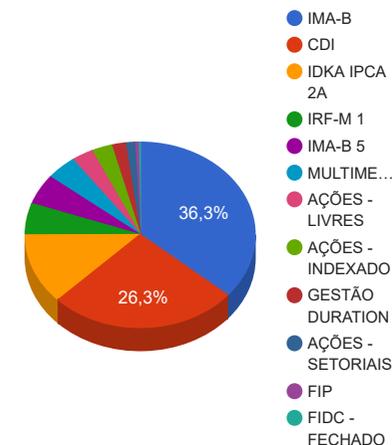
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	1,05%	3,03%	3,03%	6,37%	13,75%	29,37%	-	-	-
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	1,15%	3,56%	3,56%	6,68%	14,52%	29,84%	0,50%	0,410%	1,24%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	0,62%	3,52%	3,52%	8,63%	17,02%	38,22%	2,00%	0,880%	1,85%
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%
ITAÚ FOF RPI 30 IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	-1,35%	8,97%	8,97%	9,43%	28,87%	28,49%	1,50%	7,230%	17,11%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	-1,50%	6,27%	6,27%	14,03%	30,63%	37,35%	2,00%	4,470%	8,77%
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%
SMLL	-1,45%	16,10%	16,10%	13,15%	43,44%	26,69%	-	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	-2,35%	14,00%	14,00%	16,71%	34,43%	33,47%	2,00%	8,910%	18,53%
IGC	-1,17%	9,62%	9,62%	10,65%	26,61%	22,61%	-	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	-1,19%	9,36%	9,36%	10,30%	25,91%	21,84%	1,00%	7,840%	19,27%
Não Possui	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTIESTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,50%	0,009%	14,80%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	128.160.736,87	24,57%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	126.045.236,98	24,17%
BANCO BRADESCO	118.459.694,84	22,71%
Safra Asset Management	45.351.093,73	8,70%
ITAÚ UNIBANCO	37.011.585,80	7,10%
BANCO SANTANDER	26.393.243,81	5,06%
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS	15.688.575,56	3,01%
Western Asset	8.844.320,61	1,70%
BNY Mellon Serviços Financeiros	5.718.910,15	1,10%
BNP Paribas	5.530.701,46	1,06%
Geração Futuro	2.749.918,69	0,53%
FINAXIS Corretora	1.611.229,72	0,31%



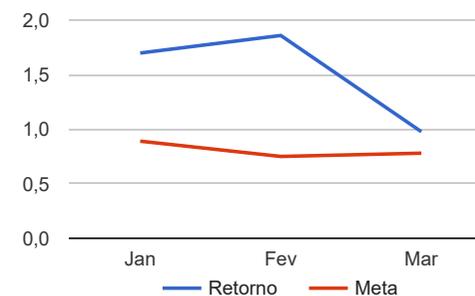
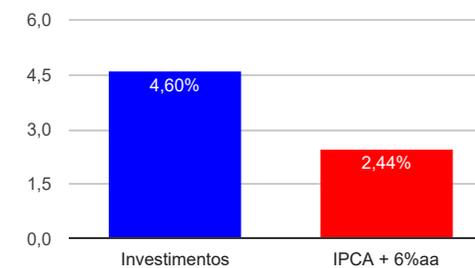
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	189.259.816,87	36,29%
CDI	137.255.313,81	26,32%
IDKA IPCA 2A	64.380.920,52	12,34%
IRF-M 1	28.647.083,77	5,49%
IMA-B 5	27.469.160,68	5,27%
MULTIMERCADO	22.489.014,77	4,31%
AÇÕES - LIVRES	15.962.892,37	3,06%
AÇÕES - INDEXADO	14.952.036,51	2,87%
GESTÃO DURATION	10.177.511,67	1,95%
AÇÕES - SETORIAIS	6.799.408,48	1,30%
FIP	2.560.859,05	0,49%
FIDC - FECHADO	1.611.229,72	0,31%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	493.641.105,99	18.071.369,17	12.464.392,56	507.717.797,54	8.469.714,94	1,70%	0,89%	190,20%	1,68%
Fevereiro	507.717.797,54	14.946.396,47	15.100.992,32	516.991.834,67	9.428.632,98	1,86%	0,75%	248,12%	1,59%
Março	516.991.834,67	22.850.873,14	23.326.907,92	521.565.248,22	5.049.448,33	0,98%	0,78%	124,49%	1,32%
Acumulado no ano					22.947.796,25	4,60%	2,44%	188,04%	

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(%)
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	36.472.443,91	0,00	0,00	37.024.674,72	552.230,81	1,51%	0,87%	1,51%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.821.960,00	0,00	0,00	10.975.294,80	153.334,80	1,42%	1,43%	1,42%
BRADESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	17.120.191,42	0,00	0,00	17.361.916,07	241.724,65	1,41%	0,71%	1,41%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	20.514.861,68	0,00	0,00	20.803.748,18	288.886,50	1,41%	0,68%	1,41%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	19.090.971,84	0,00	0,00	19.344.414,68	253.442,84	1,33%	0,52%	1,33%
CAIXA BRASIL 2018 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.018.416,00	0,00	0,00	8.124.746,00	106.330,00	1,33%	0,52%	1,33%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	43.007.285,98	0,00	0,00	43.577.172,34	569.886,36	1,33%	0,52%	1,33%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	10.045.269,67	0,00	0,00	10.177.511,67	132.242,00	1,32%	1,52%	1,32%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	8.526.839,99	0,00	0,00	8.631.958,46	105.118,47	1,23%	2,24%	1,23%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	14.492.919,27	0,00	0,00	14.664.565,91	171.646,64	1,18%	1,67%	1,18%
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	22.812.773,54	0,00	0,00	23.074.441,11	261.667,57	1,15%	0,37%	1,15%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.758.957,37	0,00	250.000,00	5.572.642,66	63.685,29	1,11%	0,13%	1,11%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	2.719.974,49	0,00	0,00	2.749.918,69	29.944,20	1,10%	2,13%	1,10%
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	15.301.034,00	0,00	0,00	15.464.940,33	163.906,33	1,07%	0,03%	1,07%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	51.803.622,04	0,00	0,00	52.348.281,29	544.659,25	1,05%	0,00%	1,05%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.035.718,10	2.621.821,57	0,00	17.840.233,26	182.693,59	1,03%	2,06%	1,05%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIX...	10.817.625,97	0,00	0,00	10.928.303,48	110.677,51	1,02%	2,05%	1,02%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	42.306.846,93	0,00	0,00	42.735.896,78	429.049,85	1,01%	2,06%	1,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA	17.717.190,62	0,00	0,00	17.895.638,32	178.447,70	1,01%	2,05%	1,01%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	954.970,11	7.415.360,17	0,00	8.451.416,38	81.086,10	0,97%	2,05%	1,03%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	69.169.892,65	12.813.691,40	13.292.397,12	69.442.092,19	750.905,26	0,92%	0,03%	1,07%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.374.074,17	0,00	7.415.595,07	0,00	41.520,90	0,56%	0,66%	1,42%

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(%)
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.362.244,84	0,00	2.368.915,73	0,00	6.670,89	0,28%	0,01%	1,07%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.618.572,31	0,00	0,00	1.611.229,72	-7.342,59	-0,45%	0,35%	-0,45%
Total Renda Fixa					5.412.414,92	1,19%	0,85%	

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(%)
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	13.489.697,19	0,00	0,00	13.644.694,16	154.996,97	1,15%	0,41%	1,15%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4.681.132,74	0,00	0,00	4.713.280,76	32.148,02	0,69%	7,44%	0,69%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	8.789.495,96	0,00	0,00	8.844.320,61	54.824,65	0,62%	0,88%	0,62%
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTISTRATÉGIA FIP	2.564.767,96	0,00	0,00	2.560.859,05	-3.908,91	-0,15%	0,01%	-0,15%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	6.881.240,72	0,00	0,00	6.799.408,48	-81.832,24	-1,19%	7,84%	-1,19%
ITAÚ FOF RPI 30 IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	2.220.063,38	0,00	0,00	2.190.079,80	-29.983,58	-1,35%	7,23%	-1,35%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	5.615.195,59	0,00	0,00	5.530.701,46	-84.494,13	-1,50%	4,47%	-1,50%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	6.876.564,09	0,00	0,00	6.748.356,01	-128.208,08	-1,86%	8,25%	-1,86%
BRDESCO H REGIMES DE PREVIDÊNCIA IBOVESPA FIC AÇÕES	6.152.727,59	0,00	0,00	6.013.600,70	-139.126,89	-2,26%	7,86%	-2,26%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	5.856.292,55	0,00	0,00	5.718.910,15	-137.382,40	-2,35%	8,91%	-2,35%
Total Renda Variável					-362.966,59	-0,57%	4,72%	

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 (%)
BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	40.029.612,29	0,00	0,00	42.735.896,78	2.706.284,49	6,76%	6,76%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	65.409.416,10	36.587.090,31	34.673.912,32	69.442.092,19	2.119.498,10	2,68%	3,05%
BRASESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	50.799.817,36	0,00	0,00	52.348.281,29	1.548.463,93	3,05%	3,05%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	36.533.020,51	0,00	1.055.211,72	37.024.674,72	1.546.865,93	4,28%	4,29%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	43.401.438,02	0,00	1.252.012,33	43.577.172,34	1.427.746,65	3,33%	3,34%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA	16.760.885,78	0,00	0,00	17.895.638,32	1.134.752,54	6,77%	6,77%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.566.750,49	3.288.162,57	0,00	17.840.233,26	985.320,20	6,82%	6,96%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	14.178.658,11	0,00	401.202,31	14.664.565,91	887.110,11	6,29%	3,43%
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	22.243.308,88	0,00	0,00	23.074.441,11	831.132,23	3,74%	3,74%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	20.029.431,14	0,00	0,00	20.803.748,18	774.317,04	3,87%	3,87%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIX...	10.228.774,85	0,00	0,00	10.928.303,48	699.528,63	6,84%	6,84%
BRASESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	16.680.592,97	0,00	0,00	17.361.916,07	681.323,10	4,08%	4,08%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	19.251.505,51	0,00	541.708,89	19.344.414,68	634.618,06	3,33%	0,48%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	9.591.870,13	0,00	0,00	10.177.511,67	585.641,54	6,11%	6,11%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.692.395,10	0,00	292.097,93	10.975.294,80	574.997,63	5,42%	2,65%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	8.082.487,18	0,00	0,00	8.631.958,46	549.471,28	6,80%	6,80%
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	15.005.234,29	0,00	0,00	15.464.940,33	459.706,04	3,06%	3,06%
CAIXA BRASIL 2018 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.085.434,00	0,00	226.919,47	8.124.746,00	266.231,47	3,33%	0,49%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.077.548,73	0,00	9.295.397,94	0,00	217.849,21	2,79%	3,82%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.238.564,19	4.954.556,31	780.000,00	5.572.642,66	159.522,16	2,70%	3,41%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	8.358.271,37	0,00	8.451.416,38	93.145,01	2,26%	6,83%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	547.506,00	2.116.201,69	0,00	2.749.918,69	86.211,00	4,79%	6,96%

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 (%)
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.754.688,80	564.356,53	2.368.915,73	0,00	49.870,40	2,22%	3,09%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.632.751,62	0,00	4.914,16	1.611.229,72	-16.607,74	-1,02%	-1,32%
				Total Renda Fixa	19.002.999,01	4,32%	

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 (%)
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	5.016.639,12	0,00	0,00	5.718.910,15	702.271,03	14,00%	14,00%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	6.217.587,16	0,00	0,00	6.799.408,48	581.821,32	9,36%	9,36%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	6.194.419,44	0,00	0,00	6.748.356,01	553.936,57	8,94%	8,94%
BRADESCO H REGIMES DE PREVIDÊNCIA IBOVESPA FIC AÇÕES	5.532.686,02	0,00	0,00	6.013.600,70	480.914,68	8,69%	8,69%
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	13.175.682,62	0,00	0,00	13.644.694,16	469.011,54	3,56%	3,56%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4.353.189,63	0,00	0,00	4.713.280,76	360.091,13	8,27%	8,27%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	5.204.209,10	0,00	0,00	5.530.701,46	326.492,36	6,27%	6,27%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	8.543.722,48	0,00	0,00	8.844.320,61	300.598,13	3,52%	3,52%
ITAÚ FOF RPI 30 IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	2.009.789,51	0,00	0,00	2.190.079,80	180.290,29	8,97%	8,97%
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTIESTRATÉGIA FIP	2.571.488,86	0,00	0,00	2.560.859,05	-10.629,81	-0,41%	-
Total Renda Variável					3.944.797,24	6,71%	