

# Relatório Analítico dos Investimentos em fevereiro de 2017



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
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	30.575.335,62	10,07%	643	0,65%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	19.247.453,67	6,34%	156	1,77%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	11.113.955,03	3,66%	117	1,40%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	4.095.608,99	1,35%	21	1,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.180.650,20	1,05%	203	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	2.870.683,58	0,95%	32	5,90%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	819.709,91	0,27%	712	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	13.181.411,73	4,34%	611	0,36%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	40.501.887,74	13,34%	223	1,31%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	4.282.588,03	1,41%	1.341	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.236.332,95	0,74%	1.177	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.176.970,61	0,39%	248	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.028.114,99	0,67%	722	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	4.070.180,36	1,34%	193	1,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2024	733.717,16	0,24%	17	0,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	843.598,72	0,28%	1.598	1,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	7.023.197,16	2,31%	286	0,53%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	32.313.410,25	10,64%	51	7,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	D+1	Não há	2.645.383,59	0,87%	14	0,80%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	57.587.314,79	18,97%	334	2,28%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRASESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.015.219,01	0,66%	84	0,22%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	2.543.598,58	0,84%	143	0,25%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "

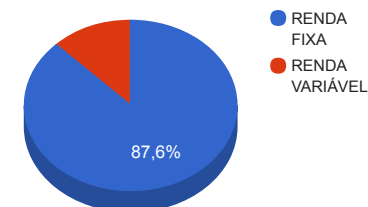
Carteira consolidada de investimentos - base (fevereiro / 2017)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	6.221.255,28	2,05%	776	0,13%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	817.642,16	0,27%	411	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.737.999,84	1,89%	433	0,30%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	16/05/2023	4.094.055,44	1,35%	52	1,49%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.156.791,54	0,38%	196	0,37%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+30 a D+2880	Não há	1.585.493,79	0,52%	51	0,46%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	1.292.992,00	0,43%	100	0,61%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BB CIELO FI AÇÕES	D+4	Não há	1.635.791,22	0,54%	5.761	1,25%	Artigo 8º, Inciso III
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	D+4	Não há	4.352.816,21	1,43%	4.185	5,05%	Artigo 8º, Inciso III
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	1.539.131,82	0,51%	5.826	0,92%	Artigo 8º, Inciso III
BB PIPE FIC AÇÕES	D+4	03/06/2018	1.078.718,02	0,36%	43	1,13%	Artigo 8º, Inciso III
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	2.684.863,38	0,88%	27	6,46%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	1.707.449,82	0,56%	131	1,12%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	D+12	Não há	1.767.426,67	0,58%	368	2,32%	Artigo 8º, Inciso III
XP INVESTOR FI AÇÕES	D+4	Não há	2.226.161,15	0,73%	6.493	0,51%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	2.981.071,22	0,98%	342	9,67%	Artigo 8º, Inciso III
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	D+4	Não há	3.144.567,63	1,04%	8.286	2,01%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.425.756,31	0,80%	2.843	0,88%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	D+5	Não há	2.189.010,50	0,72%	33	0,84%	Artigo 8º, Inciso IV
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	9.831.829,44	3,24%	555	5,97%	Artigo 8º, Inciso IV
<b>TOTAL -</b>			<b>303.557.146,11</b>				

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

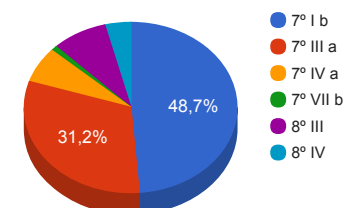
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	147.981.396,45	48,75%	0,00%	0,00%	0,00%	-147.981.396,45
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	94.561.327,64	31,15%	0,00%	0,00%	0,00%	-94.561.327,64
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	20.571.342,84	6,78%	0,00%	0,00%	0,00%	-20.571.342,84
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	2.878.485,79	0,95%	0,00%	0,00%	0,00%	-2.878.485,79
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>265.992.552,72</b>	<b>87,63%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>-</b>

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Resolução %	Carteira \$	Carteira %	Estratégia de Alocação			GAP Superior
				Inferior %	Alvo %	Superior %	
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	25.543.753,45	8,41%	0,00%	0,00%	0,00%	-25.543.753,45
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	12.020.839,94	3,96%	0,00%	0,00%	0,00%	-12.020.839,94
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>37.564.593,39</b>	<b>12,37%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>-</b>

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 " b "	147.981.396,45	48,75%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	94.561.327,64	31,15%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	20.571.342,84	6,78%	0,00%	0,00%
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	2.878.485,79	0,95%	0,00%	0,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>265.992.552,72</b>	<b>87,63%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>

Artigos - Renda Variável	Base: fevereiro / 2017		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira (\$)	Carteira (%)		
Artigo 8º, Inciso III	25.543.753,45	8,41%	0,00%	0,00%
Artigo 8º, Inciso IV	12.020.839,94	3,96%	0,00%	0,00%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>37.564.593,39</b>	<b>12,37%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>

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
IDKA IPCA 20 Anos	9,07%	12,84%	20,91%	17,92%	70,03%	58,98%	-	-	-
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7,28%	10,31%	16,54%	15,91%	50,24%	51,03%	0,20%	3,233%	14,80%
IMA-B 5+	5,06%	7,41%	11,40%	11,75%	35,35%	43,21%	-	-	-
BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	5,10%	7,50%	11,53%	11,78%	35,13%	42,14%	0,20%	2,524%	10,57%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4,97%	7,26%	11,23%	11,54%	34,89%	41,79%	0,20%	2,447%	10,42%
IMA-B	3,85%	5,79%	8,86%	9,92%	26,69%	38,66%	-	-	-
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	3,82%	5,79%	8,79%	10,22%	25,97%	38,77%	0,15%	1,853%	7,74%
BRASESCO 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%
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 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,48%	2,26%	4,07%	5,31%	16,38%	-	0,20%	6,140%	8,52%
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%
IRF-M 1+	2,37%	5,09%	7,31%	11,32%	28,78%	37,63%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,40%	5,16%	7,35%	11,36%	28,98%	37,66%	0,20%	1,255%	5,29%
IMA Geral	2,26%	4,11%	6,07%	8,66%	21,43%	34,20%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,24%	4,03%	6,02%	8,81%	21,40%	33,51%	0,20%	0,910%	3,63%
IRF-M	2,01%	4,34%	6,27%	10,02%	23,33%	35,09%	-	-	-

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
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%	-	-	-
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%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,48%	2,63%	4,05%	6,38%	13,17%	31,63%	0,20%	0,715%	2,39%
IDKA IPCA 2 Anos	1,35%	2,45%	3,77%	6,37%	12,42%	33,17%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,33%	2,42%	3,70%	6,10%	12,74%	31,60%	0,20%	0,609%	2,20%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,29%	2,37%	3,63%	6,06%	12,84%	31,83%	0,20%	0,596%	2,15%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,97%	1,99%	3,13%	5,65%	12,31%	-	0,20%	0,424%	1,21%
IRF-M 1	1,01%	2,31%	3,53%	6,86%	14,23%	30,27%	-	-	-
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	1,14%	2,56%	3,91%	7,20%	14,77%	30,39%	0,50%	0,254%	0,60%
BRDESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1,01%	2,27%	3,47%	6,77%	14,07%	29,93%	0,20%	0,076%	0,30%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,99%	2,27%	3,47%	6,76%	14,05%	29,83%	0,20%	0,083%	0,30%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,99%	2,26%	3,45%	6,72%	13,95%	29,58%	0,10%	0,083%	0,31%
Selic	0,87%	1,96%	3,11%	6,44%	13,90%	29,39%	-	-	-
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,87%	1,98%	3,12%	6,65%	14,17%	29,75%	0,20%	0,006%	0,05%
CDI	0,86%	1,96%	3,10%	6,43%	13,88%	29,35%	-	-	-

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 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,90%	2,01%	3,14%	6,44%	13,86%	28,91%	0,20%	0,049%	0,09%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,89%	2,00%	3,16%	6,52%	13,85%	29,49%	0,20%	0,015%	0,17%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,81%	1,83%	2,90%	6,01%	12,94%	27,21%	0,80%	0,005%	0,02%

IPCA + 6,00% ao ano	0,75%	1,65%	2,47%	4,47%	11,04%	29,84%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,70%	4,13%	5,96%	7,60%	21,08%	34,12%	0,15%	1,773%	6,59%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,76%	1,70%	2,46%	4,74%	11,79%	31,63%	0,20%	0,147%	0,27%

IPCA	0,33%	0,71%	1,01%	1,54%	4,76%	15,61%	-	-	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	2,22%	3,64%	5,35%	8,11%	17,83%	34,47%	0,20%	1,336%	4,46%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,94%	1,88%	3,12%	5,03%	13,46%	-	0,20%	0,441%	1,88%



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

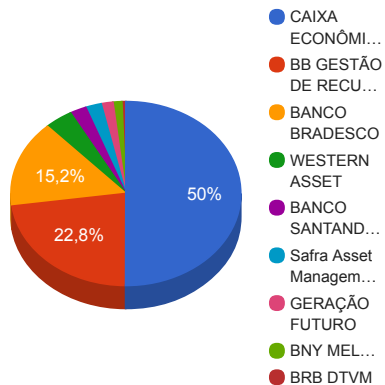
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDIV	7,00%	16,18%	15,16%	29,01%	90,61%	38,26%	-	-	-
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	4,63%	14,00%	14,91%	14,17%	50,78%	47,79%	3,00%	5,325%	18,09%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	1,64%	6,56%	8,93%	8,12%	8,78%	9,93%	3,00%	8,247%	21,12%
IFNC	5,79%	15,09%	13,35%	17,81%	67,73%	39,85%	-	-	-
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	5,63%	14,72%	12,95%	16,69%	65,47%	36,99%	1,00%	8,692%	29,41%
BBSEGURIDADE ON NM - BBSE3	5,59%	4,13%	4,17%	1,09%	25,59%	-0,46%	-	-	-
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	5,33%	3,75%	3,65%	0,26%	23,29%	-3,54%	1,5%	11,411%	35,84%
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%
Ibovespa	3,08%	10,68%	7,68%	15,13%	55,78%	29,23%	-	-	-
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	5,85%	11,73%	11,34%	7,03%	52,75%	11,68%	2,00%	6,618%	22,14%
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	3,34%	8,72%	6,77%	10,79%	39,41%	26,29%	1,00%	6,954%	20,83%
XP INVESTOR FI AÇÕES	3,19%	11,66%	11,19%	12,64%	60,90%	56,31%	2,00%	5,342%	19,94%
BB PIPE FIC AÇÕES	0,93%	5,92%	6,67%	2,93%	25,77%	24,06%	1,20%	6,571%	15,67%
GERAÇÃO FI AÇÕES	0,82%	6,85%	9,57%	15,56%	20,35%	21,39%	3,00%	8,497%	21,80%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	0,45%	4,55%	9,91%	9,16%	19,43%	22,42%	2,00%	8,342%	21,47%
CIELO ON NM - CIEL3	2,98%	-1,80%	-7,85%	-17,79%	7,77%	-8,60%	-	-	-

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

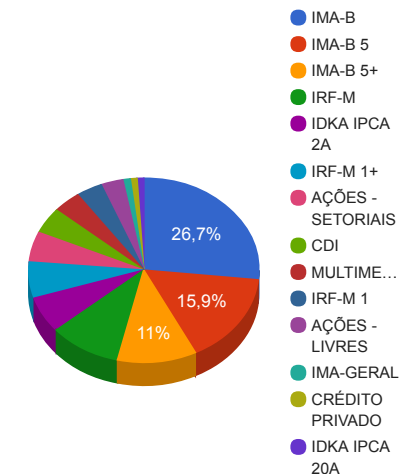
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB CIELO FI AÇÕES	2,84%	-2,03%	-8,06%	-18,17%	5,96%	-11,50%	1,50%	12,116%	30,92%
CDI	0,86%	1,96%	3,10%	6,43%	13,88%	29,35%	-	-	-
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	0,97%	2,88%	4,31%	8,83%	17,40%	39,83%	2,00%	0,978%	1,88%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	151.880.558,44	50,03%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	69.121.807,05	22,77%
BANCO BRADESCO	46.260.226,45	15,24%
WESTERN ASSET	12.020.839,94	3,96%
BANCO SANTANDER	7.023.197,16	2,31%
Safra Asset Management	6.740.992,58	2,22%
GERAÇÃO FUTURO	5.036.781,70	1,66%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	3.765.292,97	1,24%
BRB DTVM	1.707.449,82	0,56%



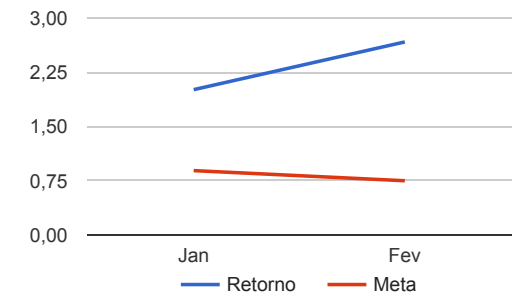
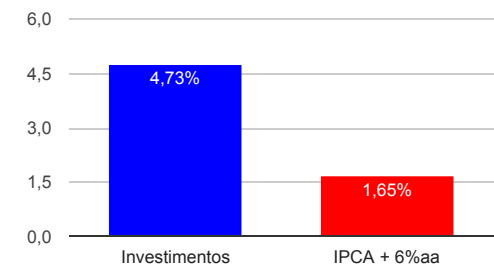
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	81.011.848,71	26,69%
IMA-B 5	48.344.794,81	15,93%
IMA-B 5+	33.490.380,86	11,03%
IRF-M	30.575.335,62	10,07%
IDKA IPCA 2A	19.279.707,08	6,35%
IRF-M 1+	19.247.453,67	6,34%
AÇÕES - SETORIAIS	16.079.134,41	5,30%
CDI	13.933.688,82	4,59%
MULTIMERCADO	12.020.839,94	3,96%
IRF-M 1	11.179.523,58	3,68%
AÇÕES - LIVRES	9.464.619,04	3,12%
IMA-GERAL	3.180.650,20	1,05%
CRÉDITO PRIVADO	2.878.485,79	0,95%
IDKA IPCA 20A	2.870.683,58	0,95%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	289.253.086,32	79.253.804,09	79.346.450,27	294.967.303,19	5.806.863,05	2,01%	0,89%	225,57%	2,71%
Fevereiro	294.967.303,19	19.962.969,81	19.256.670,24	303.557.146,11	7.883.543,35	2,67%	0,75%	355,51%	2,49%
Acumulado no ano					13.690.406,40	4,73%	1,65%	287,09%	

**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 IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.675.943,73	0,00	0,00	2.870.683,58	194.739,85	7,28%	3,23%	7,28%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	21.055.915,43	10.000.000,00	0,00	32.313.410,25	1.257.494,82	4,05%	2,52%	5,10%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	831.568,23	300.000,00	0,00	1.176.970,61	45.402,38	4,01%	2,45%	4,97%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	812.579,59	0,00	0,00	843.598,72	31.019,13	3,82%	1,85%	3,82%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	10.706.242,24	0,00	0,00	11.113.955,03	407.712,79	3,81%	1,86%	3,81%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	55.388.764,43	105.360,61	0,00	57.587.314,79	2.093.189,75	3,77%	1,78%	3,78%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	3.948.015,40	0,00	0,00	4.095.608,99	147.593,59	3,74%	1,98%	3,74%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	730.191,19	0,00	19.979,07	733.717,16	23.505,04	3,22%	6,14%	0,48%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.986.578,56	0,00	0,00	4.094.055,44	107.476,88	2,70%	1,77%	2,70%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	17.648.183,23	1.169.225,56	0,00	19.247.453,67	430.044,88	2,29%	1,26%	2,40%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.111.031,71	0,00	0,00	3.180.650,20	69.618,49	2,24%	0,91%	2,24%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1.551.115,86	0,00	0,00	1.585.493,79	34.377,93	2,22%	1,34%	2,22%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	29.785.855,01	191.163,16	0,00	30.575.335,62	598.317,45	2,00%	0,95%	2,01%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	6.920.702,18	0,00	0,00	7.023.197,16	102.494,98	1,48%	0,72%	1,48%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	807.773,90	0,00	0,00	819.709,91	11.936,01	1,48%	0,72%	1,48%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.001.573,44	0,00	0,00	2.028.114,99	26.541,55	1,33%	0,61%	1,33%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	13.013.259,90	0,00	0,00	13.181.411,73	168.151,83	1,29%	0,60%	1,29%
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	2.615.636,72	0,00	0,00	2.645.383,59	29.746,87	1,14%	0,25%	1,14%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.240.423,00	0,00	0,00	4.282.588,03	42.165,03	0,99%	0,08%	0,99%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.214.477,30	0,00	0,00	2.236.332,95	21.855,65	0,99%	0,08%	0,99%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	41.253.577,67	0,00	1.149.246,49	40.501.887,74	397.556,56	0,96%	5,12%	-1,82%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.147.763,12	0,00	117.352,21	4.070.180,36	39.769,45	0,96%	0,42%	0,97%

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(%)
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.280.933,00	0,00	0,00	1.292.992,00	12.059,00	0,94%	0,44%	0,94%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.686.813,03	0,00	0,00	5.737.999,84	51.186,81	0,90%	0,05%	0,90%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.166.276,71	0,00	0,00	6.221.255,28	54.978,57	0,89%	0,02%	0,89%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	810.567,52	0,00	0,00	817.642,16	7.074,64	0,87%	0,01%	0,87%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.597.956,70	0,00	73.810,95	2.543.598,58	19.452,83	0,75%	0,15%	0,76%
BRDESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	11.930.012,08	0,00	10.000.000,00	2.015.219,01	85.206,93	0,71%	0,08%	1,01%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	847.125,76	8.197.220,48	7.896.281,52	1.156.791,54	8.726,82	0,10%	0,00%	0,81%
Total Renda Fixa					6.519.396,51	2,51%	1,97%	

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(%)
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	2.816.284,43	0,00	0,00	2.981.071,22	164.786,79	5,85%	6,62%	5,85%
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	4.120.674,79	0,00	0,00	4.352.816,21	232.141,42	5,63%	8,69%	5,63%
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	2.985.570,11	0,00	0,00	3.144.567,63	158.997,52	5,33%	11,41%	5,33%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	9.384.505,84	0,00	0,00	9.831.829,44	447.323,60	4,77%	2,18%	4,77%
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.470.973,15	0,00	0,00	1.539.131,82	68.158,67	4,63%	5,32%	4,63%
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	2.598.183,52	0,00	0,00	2.684.863,38	86.679,86	3,34%	6,95%	3,34%
XP INVESTOR FI AÇÕES	2.157.258,75	0,00	0,00	2.226.161,15	68.902,40	3,19%	5,34%	3,19%
BB CIELO FI AÇÕES	1.590.641,31	0,00	0,00	1.635.791,22	45.149,91	2,84%	12,12%	2,84%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.386.555,20	0,00	0,00	2.425.756,31	39.201,11	1,64%	8,25%	1,64%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	2.167.969,50	0,00	0,00	2.189.010,50	21.041,00	0,97%	0,98%	0,97%
BB PIPE FIC AÇÕES	1.068.726,58	0,00	0,00	1.078.718,02	9.991,44	0,93%	6,57%	0,93%
GERAÇÃO FI AÇÕES	1.693.584,29	0,00	0,00	1.707.449,82	13.865,53	0,82%	8,50%	0,82%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	1.759.519,08	0,00	0,00	1.767.426,67	7.907,59	0,45%	8,34%	0,45%
<b>Total Renda Variável</b>					<b>1.364.146,84</b>	<b>3,77%</b>	<b>6,17%</b>	