

Relatório de Análise, Enquadramento, Rentabilidade e Risco - 28/02/2018
Retorno e Meta Atuarial - Fevereiro de 2018

RENTA FIXA

Ativo		Rentabilidade				Enquadramento
CNPJ	FUNDO	Valor Anterior (R\$)	Mês	Rentabilidade (R\$)	Valor do Mês (R\$)	
10.740.670/0001-06	22 - CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	207.251.351,45	0,57%	546.505,69	53.490.482,89	Artigo 7º, Inciso I Alinea "b"
19.768.733/0001-07	95 - CAIXA FI BRASIL 2018 II TP RF	43.230.968,54	0,24%	102.638,45	42.180.138,26	
21.919.953/0001-28	96 - CAIXA TITULOS PUBLICOS 2020	22.427.569,31	0,65%	144.954,99	21.995.212,67	
18.687.230/0001-36	97 - ITAU INSTITUCIONAL TITULOS PUBLICOS RF FI	6.324.254,26	0,33%	21.178,12	6.345.432,38	
14.386.926/0001-71	98 - CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A RF LP	75.560.871,50	0,57%	427.975,93	75.988.847,43	
13.327.340/0001-73	100 - BB PREVID RF IMA-B 5+	120.492.571,45	0,54%	647.161,34	121.139.732,79	
10.396.381/0001-23	115 - ITAU INSTITUCIONAL RF PRE LP FICFI	39.677.702,02	1,36%	538.341,97	40.216.043,99	
10.577.519/0001-90	116 - CAIXA FI BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP	211.223.765,50	1,10%	2.321.606,83	173.545.372,33	
07.111.384/0001-69	119 - BB PREV. IRF-M	81.002.657,33	3,63%	2.937.356,78	262.611.694,16	
11.328.882/0001-35	120 - BB PREV. RF IRF-M1	18.658.828,74	0,07%	12.851,31	-	
10.577.503/0001-88	122 - CAIXA FI BRASIL IMA-B5+ TP RF LP	194.811.079,90	0,00%	6.418,85	104.817.498,75	
13.455.197/0001-03	128 - SANTANDER FI IRF-M TITULOS PUBLICOS RF	-	1,16%	810.807,92	70.810.807,92	
SUBTOTAL		1.020.661.620,00		8.517.798,18	973.141.263,57	
00.832.435/0001-00	69 - ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA REFERENCIADO DI FI	2.981.727,33	0,08%	2.286,85	0,00	
03.737.206/0001-97	79 - CAIXA FI BRASIL REF DI LONGO PRAZO	1.348.155,11	0,09%	1.237,77	0,00	
03.399.411/0001-90	125 - BRADESCO FI RF REFERENCIADO DI PREMIUM	20.151.868,68	0,49%	98.967,92	20.250.836,60	
SUBTOTAL		24.481.751,12		102.492,54	20.250.836,60	
13.077.418/0001-49	59 - BB PREV. RF PERFIL	2.172.457,85	0,08%	1.675,06	0,00	Artigo 7º, Inciso IV, Alinea "a"
10.787.647/0001-69	81 - SAFRA - EXECUTIVE 2 FI RF	26.170.320,91	0,65%	170.284,96	26.340.605,87	
15.078.010/0001-17	82 - ULTRA FI RENDA FIXA CREDITO PRIVADO	3.483.585,36	-2,05%	71.349,28	3.412.236,08	
13.594.673/0001-69	94 - TMJ IMA-B FI RF	12.878.435,52	0,52%	67.031,48	12.945.467,00	
21.838.150/0001-49	103 - ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FIC FI	17.975.437,18	0,74%	132.219,68	18.107.656,86	
25.306.703/0001-73	109 - ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA II RF FIC FI	103.482.303,02	0,75%	778.666,61	104.260.969,63	
23.215.097/0001-55	113 - CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA	22.639.360,12	0,00%	396,36	0,00	
19.418.031/0001-95	134 - ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RF LP	-	0,13%	19.180,79	15.019.180,79	
10.922.432/0001-03	135 - ICATU VANGUARDA INFLAÇÃO CURTA FI RF	-	0,11%	16.814,34	15.016.814,34	
SUBTOTAL		188.801.899,96		1.114.920,00	195.102.930,57	
13.344.834/0001-66	62 - INCENTIVO FIDC MULTISSETORIAL II	6.547.600,78	0,15%	9.520,96	6.557.121,74	Artigo 7º, Inciso VII, Alinea "a"
23.431.871/0001-65	93 - TRX FIDC SENIOR	567.748,00	0,76%	4.287,79	512.258,09	
17.013.985/0001-92	106 - FIDC GGR PRIME I	42.265.741,47	-1,13%	478.438,15	41.787.303,32	
23.750.225/0001-60	91 - FIDC BMC	3.251.688,92	0,70%	22.747,47	3.153.160,97	
09.257.784/0001-02	117 - SUL INVEST - FIDC MULTISSETORIAL - SENIOR6	19.377.928,96	0,69%	133.912,09	16.272.584,98	
SUBTOTAL		72.010.708,13		307.969,84	68.282.429,10	
TOTAL RENDA FIXA		1.305.955.979,21		9.427.240,88	1.256.777.459,84	

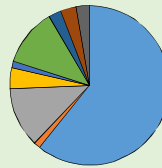
RENTA VARIÁVEL

Ativo		Rentabilidade				Enquadramento
CNPJ	FUNDO	Valor Anterior (R\$)	Mês	Rentabilidade (R\$)	Valor do Mês (R\$)	
01.699.688/0001-02	129 - SANTANDER FI IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL AÇÕES	-	3,09%	309.458,06	10.309.458,06	Artigo 8º, Inciso I, Alinea "a"
03.394.711/0001-86	132 - BRADESCO FIA IBOVESPA PLUS	-	1,77%	176.640,42	10.176.640,42	
SUBTOTAL		-		486.098,48	20.486.098,48	
17.073.556/0001-00	68 - KINEA PIPE FIA	16.738.281,69	*	2.451.142,89	14.287.138,80	Artigo 8º, Inciso II, Alinea "a"
02.895.694/0001-06	74 - FRANKLIN VALOR E LIQUIDEZ FVL FIA	23.909.949,27	0,83%	198.611,32	24.108.560,59	
15.862.830/0001-03	87 - APEX AÇÕES 30 FIC FIA	35.613.595,70	1,99%	709.958,09	36.323.553,79	
11.182.064/0001-77	112 - CONSTANCIA FUNDAMENTO FIA	3.657.509,61	2,21%	80.762,46	3.738.272,07	
11.392.165/0001-72	123 - AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC DE FIA	22.664.391,96	1,49%	336.772,52	23.001.164,48	
06.916.384/0001-73	126 - BRADESCO FIA DIVIDENDOS	43.693.491,10	1,65%	719.979,39	44.413.470,49	
02.436.763/0001-05	130 - SANTANDER FIC FI SELEÇÃO TOP AÇÕES	-	2,34%	350.567,50	15.350.567,50	
07.279.657/0001-89	131 - AZ QUEST AÇÕES FIC FIA	-	4,87%	730.364,75	15.730.364,75	
23.731.629/0001-07	133 - ITAU INSTITUCIONAL AÇÕES PHOENIX FI	-	2,72%	272.156,86	10.272.156,86	
SUBTOTAL		146.277.219,33		948.030,00	187.225.249,33	
09.412.687/0001-47	84 - CAPITÂNIA MULTI CREDITO PRIVADO	23.049.672,03	0,39%	89.178,25	23.138.850,28	Artigo 8º, Inciso III
17.253.869/0001-40	108 - SAFRA - CRT - CART PREMIUM MM	16.958.541,88	0,24%	41.047,38	16.999.589,26	
SUBTOTAL		40.008.213,91		130.225,63	40.138.439,54	
12.312.767/0001-35	63 - ATICO FLORESTAL FIP	11.904.471,78	-0,11%	13.045,46	11.891.426,32	Artigo 8º, Inciso IV, Alinea "a"
16.676.620/0001-85	66 - FIP CAIXA CYRELA	4.130.279,93	-0,10%	4.222,26	4.126.057,67	
14.584.094/0001-06	67 - BTG PAÇTUAL INFRAESTRUTURA II FIC FIP	3.878.331,19	*	1.717.860,06	3.826.496,58	
15.711.367/0001-90	88 - W7 FIP	15.975.969,04	-0,15%	24.645,01	15.951.324,03	
14.721.044/0001-15	121- INFRA SANEAMENTO FIP	15.691.154,10	-0,14%	22.632,57	15.668.521,53	
SUBTOTAL		51.580.206,04		1.653.314,76	51.463.826,13	
12.887.506/0001-43	37 - CAIXA FII CX TRX	573.530,00	-0,62%	3.530,00	570.000,00	Artigo 8º, Inciso IV, Alinea "b"
14.423.780/0001-97	44 - ITAU - FII KII REAL	4.219.862,90	-1,32%	55.884,94	4.163.977,96	
18.369.510/0001-04	80 - FII INFRA REAL ESTATE FII	21.164.634,07	0,24%	51.345,47	21.215.979,54	
15.461.076/0001-91	105 - FII BR HOTEIS	16.960.239,85	-0,04%	7.465,20	16.952.774,65	
SUBTOTAL		42.918.266,82		15.534,67	42.902.732,15	
TOTAL RENDA VARIÁVEL		280.783.906,10		3.202.134,20	342.216.345,63	
Total de Recursos (Mês Anterior)		1.586.739.885,31	CRESCIMENTO DA CARTEIRA NO MÊS DE FEVEREIRO/2018			
Total de Recursos (Mês Atual)		1.608.993.805,47	1,40%			

Retorno e Meta Atuarial - Fevereiro de 2018

Enquadramento da Resolução CMN nº 3.922	Enquadramento	% da Carteira
Fundo RF - 100% Títulos do Tesouro Nacional	Artigo 7º, I, "b"	60,48%
Fundo RF - Referenciado	Artigo 7º, III, "a"	1,26%
Fundo RF - Geral	Artigo 7º, IV, "a"	12,13%
Fundo RF - FIDC - Direitos Creditórios	Artigo 7º, VII, "a"	4,24%
Fundo RV - Ações 50+ Ativos	Artigo 8º, I, "a"	1,27%
Fundo RV - Ações Geral	Artigo 8º, II, "a"	11,64%
Fundo RV - Multimercado	Artigo 8º, III	2,49%
Fundo RV - FIP - Participações	Artigo 8º, IV, "a"	3,20%
Fundo RV - FII - Imobiliário	Artigo 8º, IV, "b"	2,67%

% da Carteira



- Fundo RF - 100% Títulos do Tesouro Nacional
- Fundo RF - Referenciado
- Fundo RF - Geral
- Fundo RF - FIDC - Direitos Creditórios
- Fundo RV - Ações 50+ Ativos
- Fundo RV - Ações Geral
- Fundo RV - Multimercado
- Fundo RV - FIP - Participações
- Fundo RV - FII - Imobiliário

ACOMPANHAMENTO DE RECURSOS NO ANO DE 2018

Período	Recursos (R\$)	Contribuição (R\$)	Rentabilidade no Mês	Crescimento do P.L.	Rendimento Mensal	Rendimento Trimestral	Rendimento Semestral
Janeiro	1.586.739.885,31	13.592.996,14	42.022.803,20	3,20%	2,73%		
Fevereiro	1.608.993.805,47	13.536.101,34	12.629.375,08	1,40%	0,80%	-	
Março							
Abril							
Maio							
Junho							
Julho							
Agosto							
Setembro							
Outubro							
Novembro							
Dezembro							

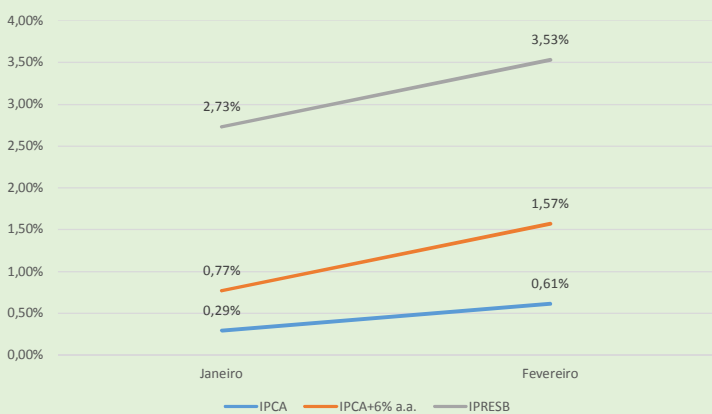
DESEMPENHO E INDICADORES

MÊS	IPCA		IPCA+6% a.a.		IPRESB		
	MENSAL	ACUMULADO	MENSAL	ACUMULADO	MENSAL	ACUMULADO	MÉDIA MENSAL
Janeiro	0,29%	0,29%	0,77%	0,77%	2,73%	2,73%	2,73%
Fevereiro	0,32%	0,61%	0,80%	1,57%	0,80%	3,53%	1,77%
Março	-	-	-	-	-	-	-
Abril	-	-	-	-	-	-	-
Maio	-	-	-	-	-	-	-
Junho	-	-	-	-	-	-	-
Julho	-	-	-	-	-	-	-
Agosto	-	-	-	-	-	-	-
Setembro	-	-	-	-	-	-	-
Outubro	-	-	-	-	-	-	-
Novembro	-	-	-	-	-	-	-
Dezembro	-	-	-	-	-	-	-

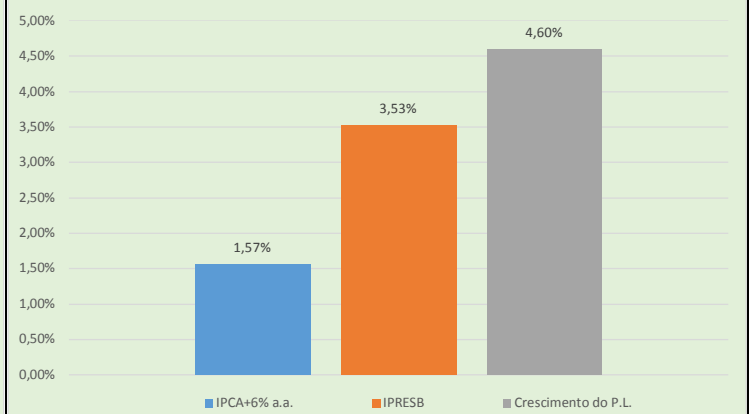
INDICADORES DE REFERÊNCIA

INDICADOR	MÊS	ACUMULADO	ANO (Previsto)	
	IBOVESPA	0,52%	11,66%	-
	CDI	0,46%	1,05%	-
	IPCA+6% a.a.	0,80%	1,57%	10,30%

Comparativo de Rentabilidades



Acompanhamento de Variação



RESUMO DAS INFORMAÇÕES

RECURSO INICIAL EM JANEIRO 2018	R\$ 1.537.489.252,41
TOTAL DE RECURSOS INVESTIDOS	R\$ 1.608.993.805,47
TOTAL DAS CONTRIBUIÇÕES 2018	R\$ 27.129.097,48
TOTAL DE RENDIMENTOS 2018	R\$ 54.652.178,28
VARIAÇÃO AUMENTATIVA DO P.L.	4,65%
META ATUARIAL IPCA+6% a.a.	1,57%
RENDIMENTO DA CARTEIRA DE INVESTIMENTOS EM % 2018	3,53%
CUMPRIMENTO DA META ATUARIAL EM 2018	224,84%

* Os fundos de investimentos abaixo receberam valores de Dividendos:

17.073.556/0001-00 Kinea PIPE FIA
14.584.094/0001-06 BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC FIP

* Fora solicitado o resgate no fundo investimentos abaixo, o valor pernitoiu em conta corrente por motivo de horario para o investimento, o mesmo já consta junto ao total de recursos investidos.

115 - ITAÚ INSTITUCIONAL RF PRE LP FICFI sob CNPJ.: 10.396.381/0001-23 no valor de R\$ 10.000.000,00