



TRINUS

C A P I T A L

Instituto de Previdência dos
Servidores Municipais de Goiânia

Janeiro - 2017

Dados do Ente Federativo

Ente Federativo	Prefeitura Municipal de Goiânia
CNPJ	01.612.092/0001-23
Endereço	Avenida do Cerrado, n°999
E-mail	
Telefone	(62) 3524-1003
Prefeito	Iris Rezende Machado
Início da Gestão	01/01/2017
E-mail	

Dados da Unidade Gestora do RPPS do Município de Goiânia

Unidade Gestora	Instituto de Previdência dos Servidores do Município de Goiânia
Nome Fantasia	IPSM
CNPJ	08.948.407/0001-57
Endereço	Av. B, Quadra C1, Lote 16/18
CEP	74110-030
Telefone	(62) 3524-5800
E-mail	ipsm@goiania.go.gov.br

Representante Legal	Gestor de Recursos
Cargo	Cargo
Início da Gestão	Início da Gestão
E-mail	E-mail
Telefone	Telefone
Certificação	Certificação
Validade	Validade

Membros da Unidade Gestora do RPPS do Município de Goiânia

Comitê de Investimentos

Cargo

Conselho

Cargo

Evolução Patrimônio Líquido

Jan R\$ 649.489.243,65

Fev

Mar

Abr

Mai

Jun

Jul

Ago

Set

Out

Nov

Dez

700.000.000,00

23,52%

600.000.000,00

500.000.000,00

400.000.000,00

300.000.000,00

200.000.000,00

100.000.000,00

0,00

FEV/16

MAR/16

ABR/16

MAI/16

JUN/16

JUL/16

AGO/16

SET/16

OUT/16

NOV/16

DEZ/16

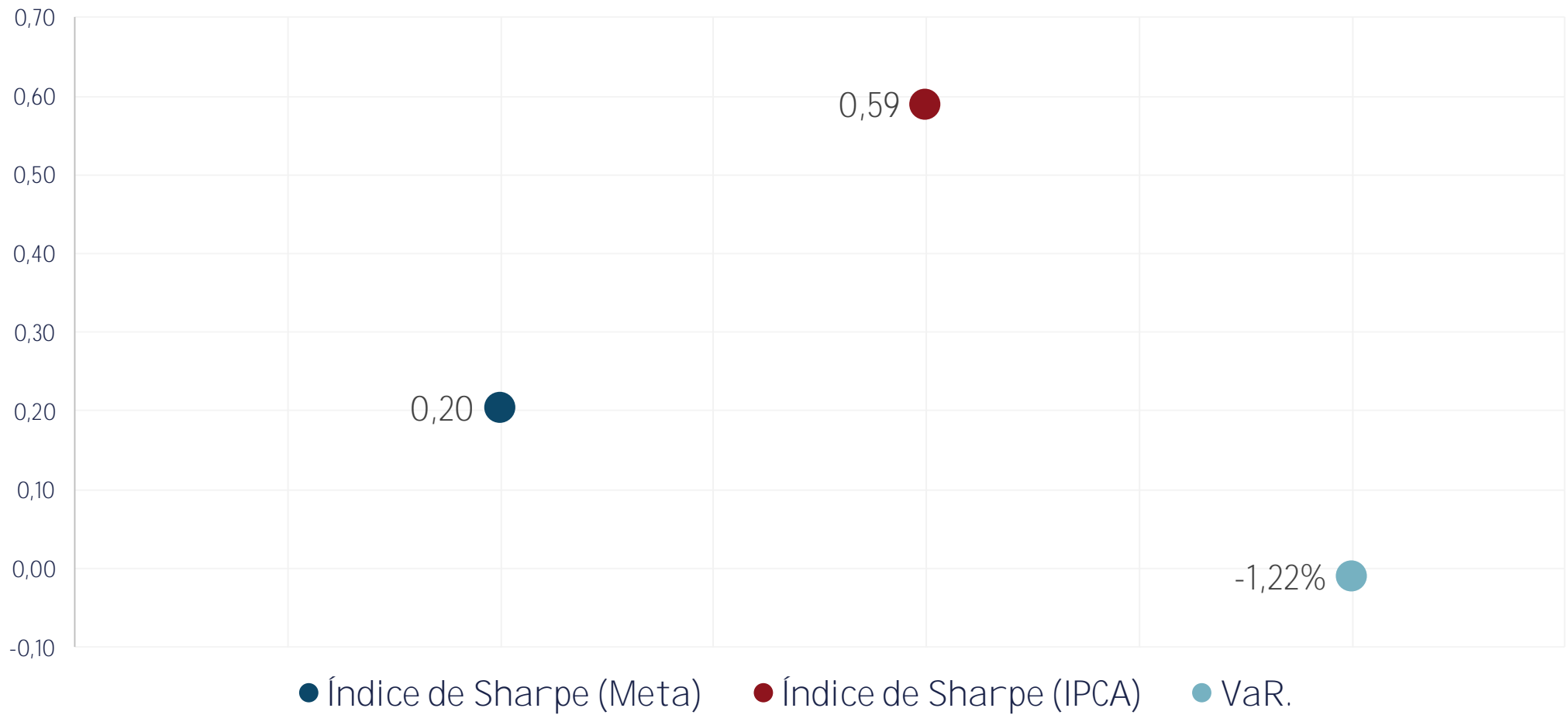
JAN/17

+ 55 62 3924-6211

Av. Olinda, N° 960, Qd. H4, Lt. 01/03 – Ed. Lozandes Corporate Design, Torre 01 – Sala 806 Goiânia – GO CEP: 74.884-120

www.trinuscapital.com contato@trinuscapital.com

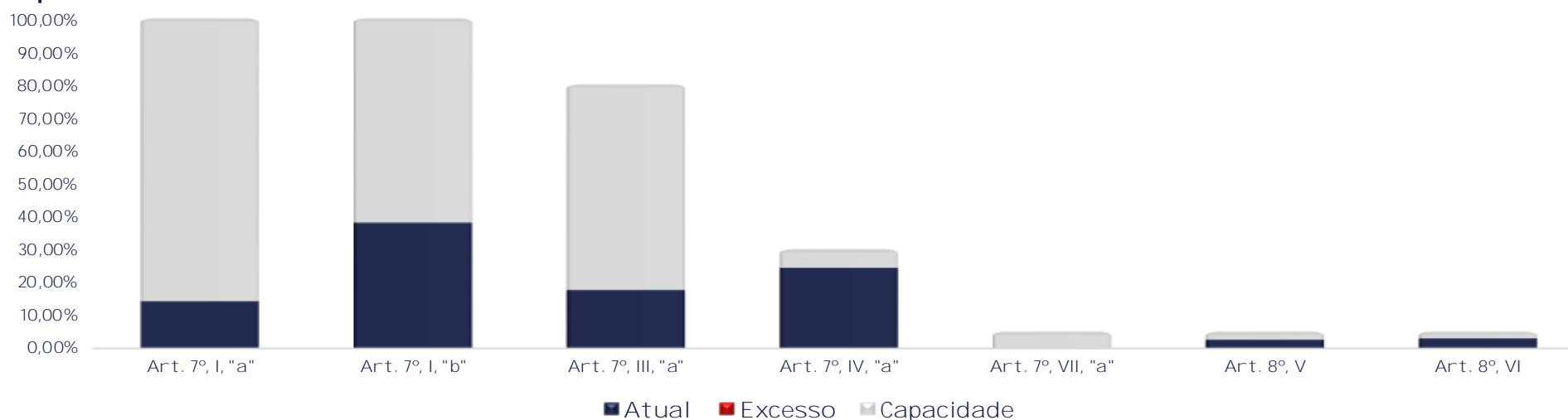
Índice de Sharpe e Var da Carteira



Fundos	Saldo no Mês	% do RPPS	Lt. do RPPS	Lt. por fundo	Status
Renda Fixa	572.783.602,40	94,42%	100%		
Art. 7º, I, "a" - Títulos Públicos Federais - SELIC	86.375.053,61	14,24%	100%		OK
NTN-B IPSM	11.802.981,69	1,95%			
NTN-F IPSM	74.572.071,92	12,29%			
Art. 7º, I, "b" - FI (100% TPF) - IMA ou IDKA	231.148.010,32	38,10%	100%		OK
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.257.880,03	1,36%			
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.119.621,23	0,18%			
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	367.236,09	0,06%			
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	121.466.738,86	20,02%			
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	570.668,76	0,09%			
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.997.678,61	0,49%			
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	43.572.066,13	7,18%			
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	939.559,78	0,15%			
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	51.319.669,53	8,46%			
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	536.891,30	0,09%			
Art. 7º, II - Compromissadas	0,00	0,00%	15%		OK
Art. 7º, III, "a" - FI Referenciado RF ou RF - IMA ou IDKA	106.943.976,39	17,63%	80%	20% por fundo	OK
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	527.777,94	0,09%			
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	44.297.606,53	7,30%			
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.865.320,87	0,31%			
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	50.254.168,27	8,28%			
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	627.793,94	0,10%			
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	7.188.564,83	1,19%			
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	2.182.744,01	0,36%			
Art. 7º, III, "b" - FI de Índices RF - IMA ou IDKA	0,00	0,00%	80%	20% por fundo	OK
Art. 7º, IV, "a" - FI Referenciado RF ou RF	147.941.190,95	24,39%	30%	20% por fundo	OK
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	273.420,37	0,05%			
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	109.509.380,56	18,05%			
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.088.402,11	0,34%			
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	544.781,83	0,09%			
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	34.358.891,71	5,66%			
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	881.507,86	0,15%			
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	284.806,51	0,05%			
Art. 7º, IV, "b" - FI de Índices RF	0,00	0,00%	30%	20% por fundo	OK
Art. 7º, V, "a" - Poupança	0,00	0,00%	20%		OK
Art. 7º, V, "b" - LIG - Letras Imobiliárias Garantidas	0,00	0,00%	20%		OK
Art. 7º, VI - FIDC Aberto	0,00	0,00%	15%		OK
Art. 7º, VII, "a" - FIDC Fechado	375.371,13	0,06%	5%		OK
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	375.371,13	0,06%			
Art. 7º, VII, "b" - FI Crédito Privado	0,00	0,00%	5%		OK

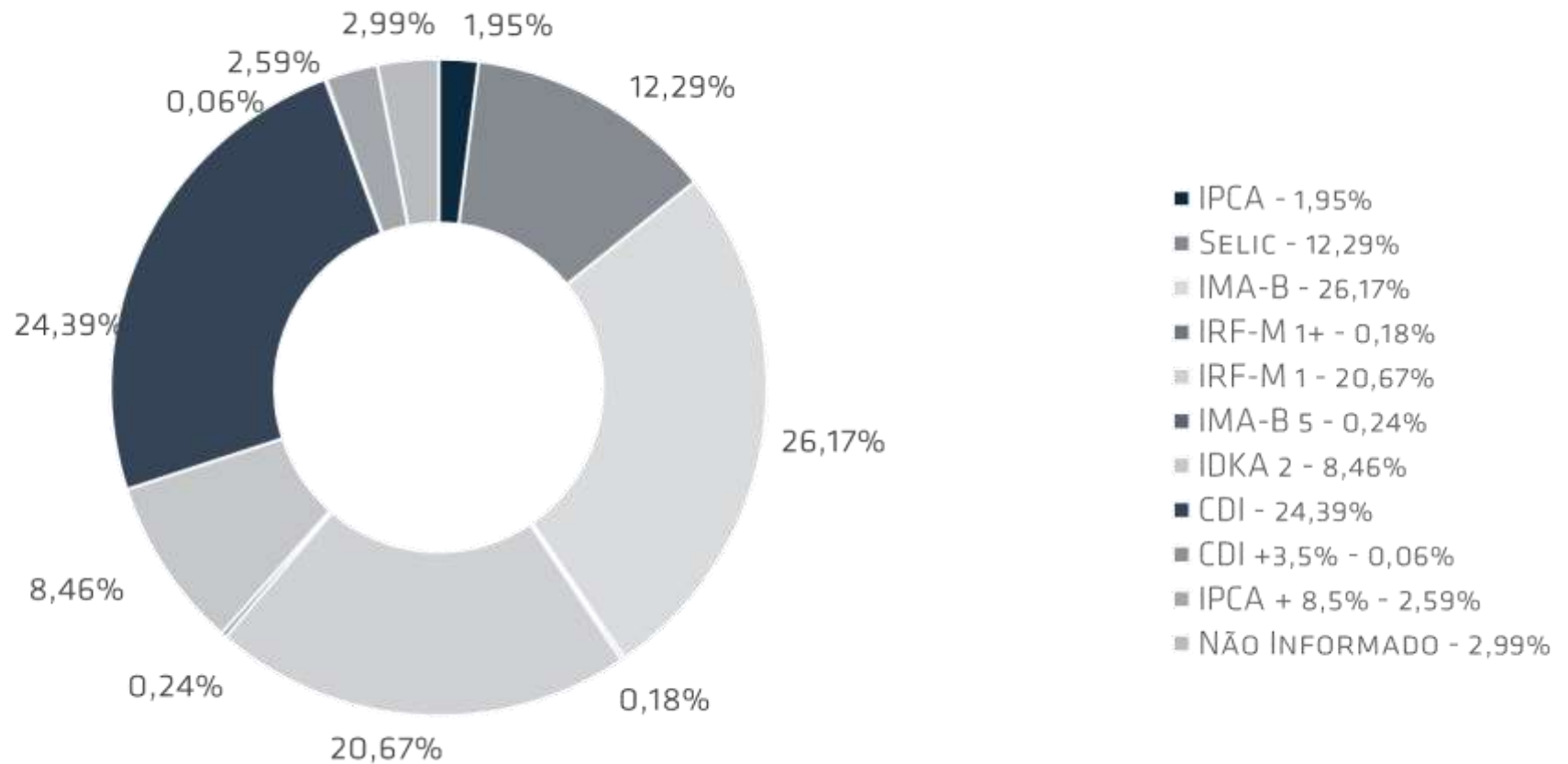
Renda Variável	33.838.362,16	5,58%	30%		
Art. 8º, I - FIA Referenciado - IBOV ou IBrX ou IBrX-50	0,00	0,00%	30%	20% por fundo	OK
Art. 8º, II - ETF Referenciado - IBOV ou IBrX ou IBrX-50	0,00	0,00%	20%		OK
Art. 8º, III - FIA - Fundo de Ações	0,00	0,00%	15%		OK
Art. 8º, IV - FI Multimercado - FIM	0,00	0,00%	5%		OK
Art. 8º, V - FI em Participações - FIP	15.682.935,75	2,59%	5%		OK
CONQUEST FIP - FCCQ11	15.682.935,75	2,59%			
Art. 8º, VI - FI Imobiliário - FII	18.155.426,41	2,99%	5%		OK
ÁQUILLA FII - AOLL11	6.538.441,66	1,08%			
FIRENZE FII	11.616.984,75	1,92%			
Não Enquadra	0,00	0,00%			OK
Aplicações	606.621.964,56	93,40%			
Imóveis	0,00	0,00%			
Art. 3º - Integralização em Imóveis	0,00	0,00%			OK
Conta Corrente	42.867.279,09	6,60%			
CARTEIRA	649.489.243,65	100,00%			

Disponibilidade 3.922

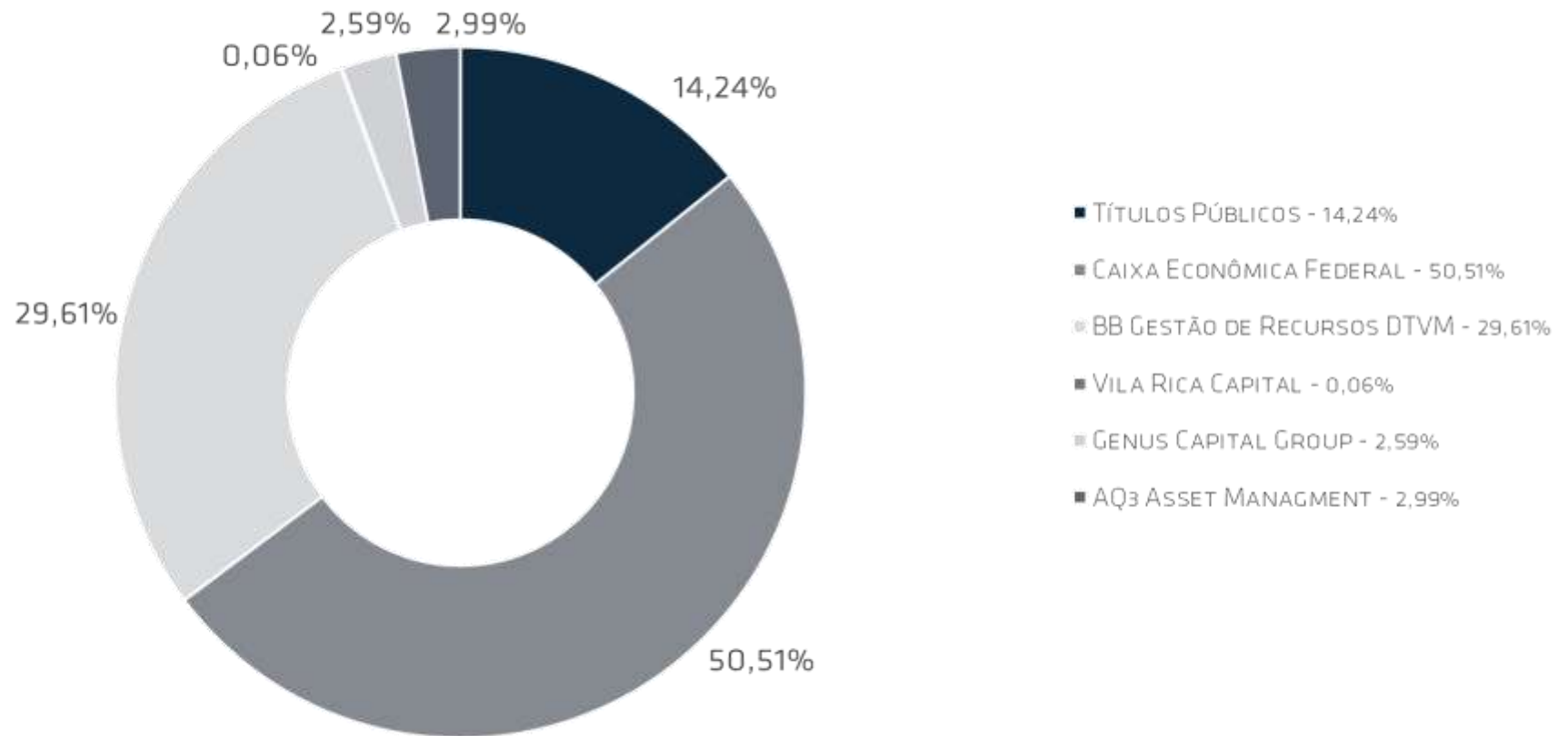


Fundos	CNPJ	Gestão	Taxa de Administração	Benchmark	Resgate
NTN-B IPSM	0.000.000/0000-C	Títulos Públicos	0,00%	IPCA	-
NTN-F IPSM	0.000.000/0000-0	Títulos Públicos	0,00%	Selic	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.740.658/0001-93	Caixa Econômica Federal	0,20%	IMA-B	D+0
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.577.519/0001-90	Caixa Econômica Federal	0,20%	IRF-M 1+	D+0
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.740.670/0001-06	Caixa Econômica Federal	0,20%	IRF-M 1	D+0
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.328.882/0001-35	BB Gestão de Recursos DTVM	0,10%	IRF-M 1	D+0
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.744.078/0001-01	BB Gestão de Recursos DTVM	0,20%	IMA-B	D+1
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.060.913/0001-10	Caixa Econômica Federal	0,20%	IMA-B 5	D+0
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	14.386.926/0001-71	Caixa Econômica Federal	0,20%	IDKA 2	D+0
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	13.543.447/0001-01	BB Gestão de Recursos DTVM	0,20%	IMA-B	D+1
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	17.861.554/0001-22	BB Gestão de Recursos DTVM	0,30%	IMA-B	D+1
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	10.646.895/0001-90	Caixa Econômica Federal	0,20%	IMA-B	D+0
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	14.508.643/0001-55	Caixa Econômica Federal	0,80%	CDI	D+0
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	13.737.206/0001-97	Caixa Econômica Federal	0,20%	CDI	D+0
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.077.418/0001-49	BB Gestão de Recursos DTVM	0,20%	CDI	D+0
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	3.990.000/0001-28	Vila Rica Capital	0,39%	CDI + 3,5%	Não se aplica
CONQUEST FIP - FCCQ11	10.625.626/0001-47	Genus Capital Group	0,30%	IPCA + 8,5%	Não se aplica
ÁQUILLA FII - AQLL11	13.555.918/0001-49	AQ3 Asset Management	1,50%	Não Informado	Não se aplica
FIRENZE FII	14.074.721/0001-50	AQ3 Asset Management	1,50%	Não Informado	Não se aplica

DISTRIBUIÇÃO POR INDICADOR - JANEIRO - 2017



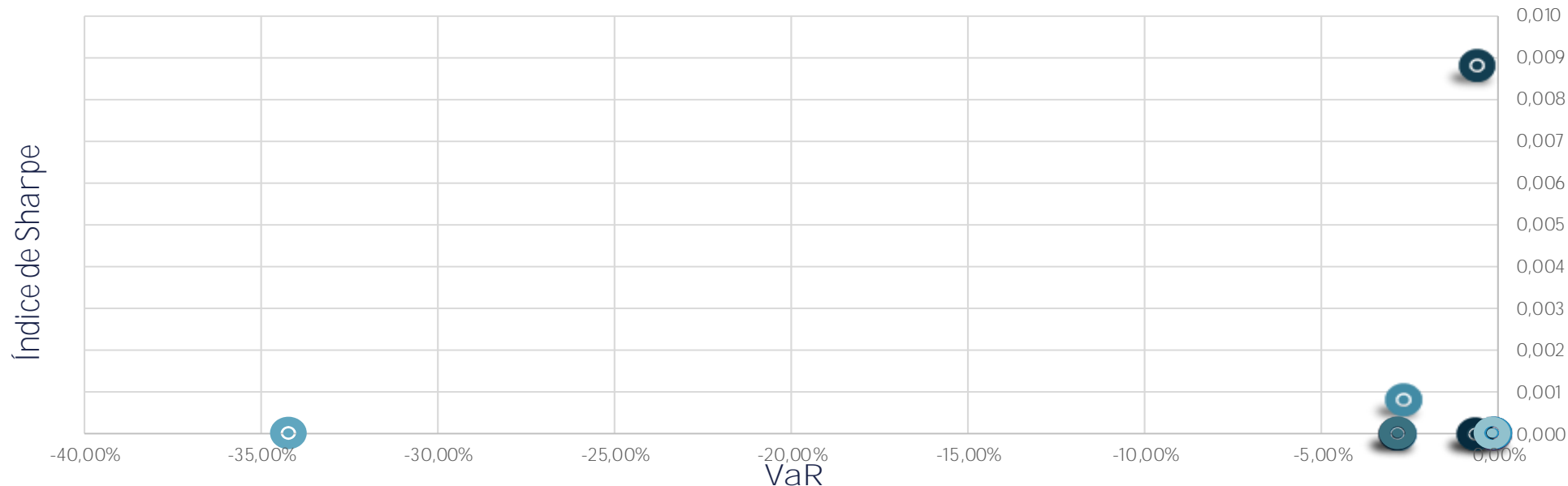
DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO - JANEIRO - 2017



Aplicações do Instituto de Previdência dos Servidores do Município de Goiânia

Ativos	Cc vinculada	Data da Aplicação	Aplicação Inicial	Valor Atual
NTN-B IPSM		Anterior a 2016	R\$ 8.809.488,07	R\$ 11.802.981,69
NTN-F IPSM		Anterior a 2016	R\$ 63.534.614,73	R\$ 74.572.071,92
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS F	Ag. 2510 cc 267-1	Anterior a 2016	R\$ 5.209.634,42	R\$ 8.257.880,03
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICO	Ag. 2510 cc 267-1	Anterior a 2016	R\$ 841.573,56	R\$ 1.119.621,23
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS	Ag. 2510 cc 278-7	out/16	R\$ 182.825,44	R\$ 367.236,09
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS	Ag. 2510 cc 267-1	nov/16	R\$ 118.814.599,88	R\$ 121.466.738,86
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA	Ag. 86-8 cc 18272-9	Anterior a 2016	R\$ 492.271,91	R\$ 570.668,76
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA	Ag. 86-8 cc 17879-9	Anterior a 2016	R\$ 3.685.464,59	R\$ 2.997.678,61
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI.	Ag. 86-8 cc 15852-6	Anterior a 2016	R\$ 34.359.512,10	R\$ 43.572.066,13
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS	Ag. 2510 cc 278-7	jun/16	R\$ 875.000,00	R\$ 939.559,78
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚB	Ag. 2510 cc 267-1	nov/16	R\$ 50.000.000,00	R\$ 51.319.669,53
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS	Ag. 2510 cc 281-7	jun/16	R\$ 500.000,00	R\$ 536.891,30
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁ	Ag. 86-8 cc 18272-9	Anterior a 2016	R\$ 572.496,36	R\$ 527.777,94
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁ	Ag. 86-8 cc 15852-6	Anterior a 2016	R\$ 34.020.619,77	R\$ 44.297.606,53
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁ	Ag. 86-8 cc 17879-9	Anterior a 2016	R\$ 675.474,10	R\$ 1.865.320,87
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIC	Ag. 86-8 cc 15852-6	Anterior a 2016	R\$ 39.628.516,90	R\$ 50.254.168,27
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FI>	Ag. 2510 cc 281-7	jun/16	R\$ 430.000,00	R\$ 627.793,94
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FI>	Ag. 2510 cc 267-1	jul/16	R\$ 4.000.000,00	R\$ 7.188.564,83
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FI>	Ag. 2510 cc 278-7	jun/16	R\$ 1.400.000,00	R\$ 2.182.744,01
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI REND	Ag. 2510 cc 269-8	dez/16	R\$ 905.000,00	R\$ 273.420,37
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCI,	Ag. 2510 cc 267-1	Anterior a 2016	R\$ 15.543.026,66	R\$ 109.509.380,56
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCI,	Ag. 2510 cc 278-7	Anterior a 2016	R\$ 475.969,46	R\$ 2.088.402,11
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCI,	Ag. 2510 cc 281-7	Anterior a 2016	R\$ 283.653,04	R\$ 544.781,83
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁF	Ag. 86-8 cc 15852-6	Anterior a 2016	R\$ 91.466.722,28	R\$ 34.358.891,71
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁF	Ag. 86-8 cc 17879-9	Anterior a 2016	R\$ 4.178.635,73	R\$ 881.507,86
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁF	Ag. 86-8 cc 18272-9	Anterior a 2016	R\$ 1.195.426,25	R\$ 284.806,51
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR		Anterior a 2016	R\$ 1.431.332,13	R\$ 375.371,13
CONQUEST FIP - FCCQ11		Anterior a 2016	R\$ 15.878.139,83	R\$ 15.682.935,75
ÁQUILLA FII - AOLL11		Anterior a 2016	R\$ 6.445.989,98	R\$ 6.538.441,66
FIRENZE FII		Anterior a 2016	R\$ 12.046.111,57	R\$ 11.616.984,75

Índice de Sharpe e VaR



- CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP
- CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP
- CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA
- BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO
- BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO
- CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP
- CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP
- BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP
- BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO
- CAIXA NOVO BRASIL IMA- B FIC RENDA FIXA LP
- CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA
- CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP
- BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO
- ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR
- CONQUEST FIP - FCCQ11

Fundos	2016	12 meses	nov/16	dez/16	jan/17	2017
Renda Fixa						
Art. 7º, I, "a" - Títulos Públicos Federais - SELIC						
NTN-B IPSM	30,28%	30,28%	30,28%	30,28%	30,28%	2,84%
NTN-F IPSM	33,38%	33,38%	33,38%	33,38%	33,38%	-2,02%
Art. 7º, I, "b" - FI (100% TPF) - IMA ou IDKA						
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	24,56%	24,64%	-1,17%	2,88%	1,84%	1,84%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	29,55%	28,55%	-0,05%	2,08%	2,69%	2,69%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	14,58%	14,17%	1,03%	1,18%	1,26%	1,26%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	14,58%	14,17%	1,03%	1,18%	1,26%	1,26%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14,48%	14,07%	1,02%	1,17%	1,26%	1,26%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14,48%	14,07%	1,02%	1,17%	1,26%	1,26%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	24,52%	24,54%	-1,26%	2,89%	1,84%	1,84%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	15,19%	13,21%	0,38%	1,38%	1,14%	1,14%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	14,94%	12,92%	0,57%	1,23%	1,06%	1,06%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	15,19%	13,21%	0,38%	1,38%	1,14%	1,14%
Art. 7º, II - Compromissadas						
Art. 7º, III, "a" - FI Referenciado RF ou RF - IMA ou IDKA						
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	15,28%	13,25%	0,38%	1,36%	1,14%	1,14%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	15,28%	13,25%	0,38%	1,36%	1,14%	1,14%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	15,28%	13,25%	0,38%	1,36%	1,14%	1,14%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	24,46%	24,48%	-1,21%	2,88%	1,89%	1,89%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	24,14%	24,43%	-1,15%	2,80%	1,89%	1,89%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	24,14%	24,43%	-1,15%	2,80%	1,89%	1,89%
Art. 7º, III, "b" - FI de Índices RF - IMA ou IDKA						
Art. 7º, IV, "a" - FI Referenciado RF ou RF						
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	13,05%	13,09%	0,97%	1,05%	1,01%	1,01%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	14,00%	14,03%	1,05%	1,11%	1,07%	1,07%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	14,00%	14,03%	1,05%	1,11%	1,07%	1,07%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	14,00%	14,03%	1,05%	1,11%	1,07%	1,07%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13,88%	13,93%	1,05%	1,13%	1,10%	1,10%
Art. 7º, IV, "b" - FI de Índices RF						
Art. 7º, V, "a" - Poupança						
Art. 7º, V, "b" - LIG - Letras Imobiliárias Garantidas						
Art. 7º, VI - FIDC Aberto						
Art. 7º, VII, "a" - FIDC Fechado						
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-65,83%		0,90%	1,71%	0,24%	0,24%
Art. 7º, VII, "b" - FI Crédito Privado						

Renda Variável

Art. 8º, I - FIA Referenciado - IBOV ou IBrX ou IBrX-50

Art. 8º, II - ETF Referenciado - IBOV ou IBrX ou IBrX-50

Art. 8º, III - FIA - Fundo de Ações

Art. 8º, IV - FI Multimercado - FIM

Art. 8º, V - FI em Participações - FIP

CONQUEST FIP - FCCQ11	-1,10%				-0,11%
-----------------------	--------	--	--	--	--------

Art. 8º, VI - FI Imobiliário - FII

ÁQUILLA FII - AOLL11	1,45%	-32,66%	0,00%	0,00%	-0,01%
----------------------	-------	---------	-------	-------	--------

FIRENZE FII	-4,34%				0,81%
-------------	--------	--	--	--	-------

Imóveis

Art. 3º - Integralização em Imóveis

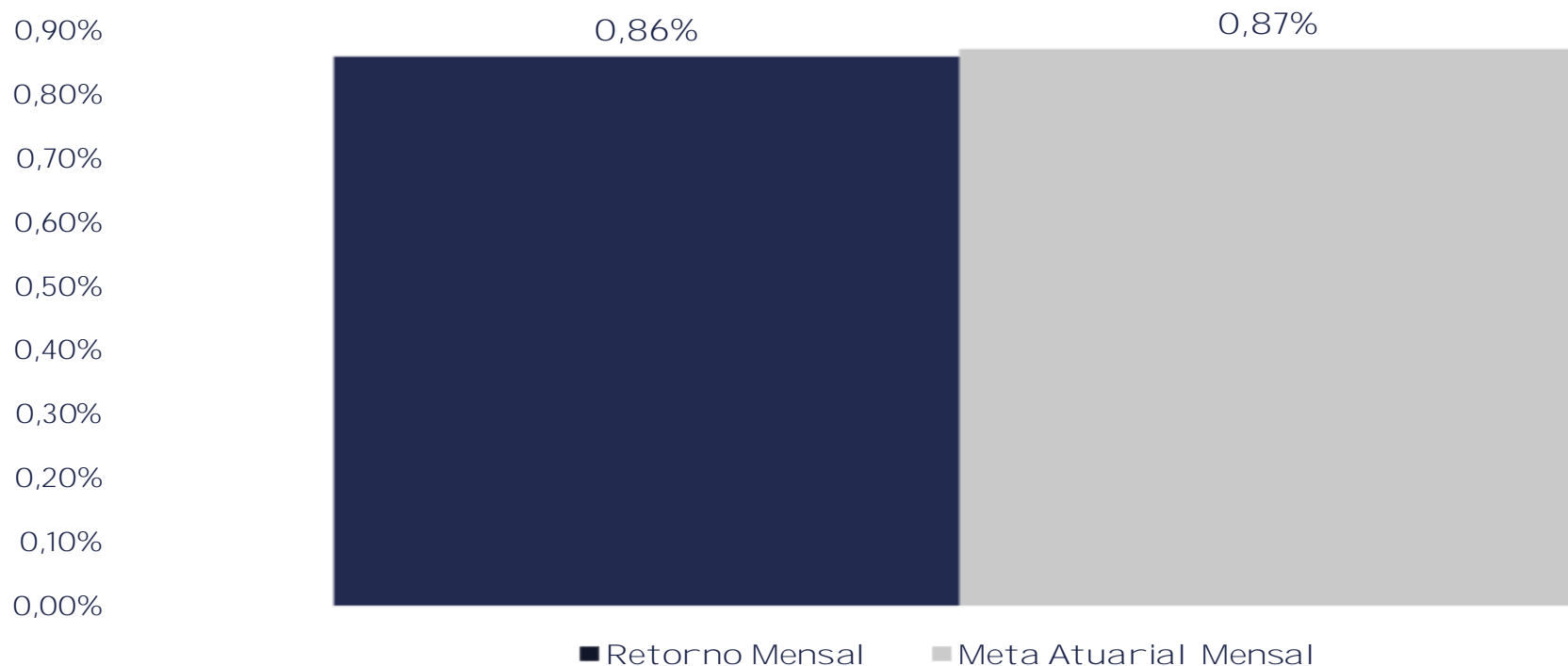
Não Enquadra

Performance Absoluta

	jan-17	fev-17	mar-17	abr-17	mai-17	jun-17
Carteira	0,86%					
Retorno Financeiro	5.173.648,13					
Meta Atuarial	0,87%					

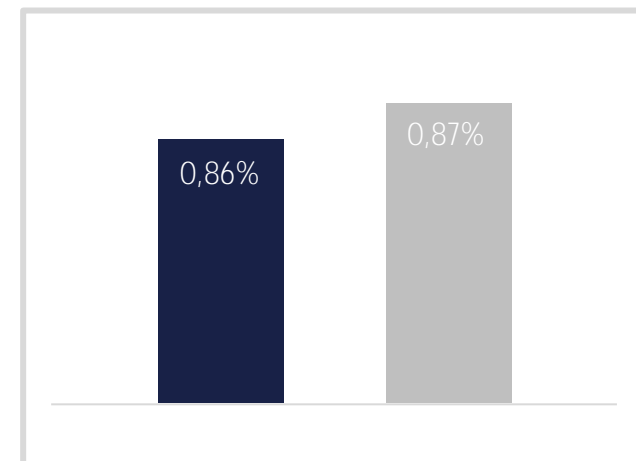
	jul-17	ago-17	set-17	out-17	nov-17	dez-17
Carteira						
Retorno Financeiro						
Meta Atuarial						

Retorno Mensal X Meta Atuarial Mensal



Estatística		
Meses positivos:	1	
Meses negativos:	0	
Meses acima da Meta Atuarial:	0	
Meses abaixo da Meta Atuarial:	1	
Retorno Mensal Máximo	0,86%	jan-17
Retorno Mensal Médio	0,86%	
Retorno Mensal Mínimo	0,86%	jan-17
Sharpe	0,26	
Volatilidade	15,54%	
VaR	-1,14%	
Meta Atuarial	IPCA + 6%	

Consolidado - 2017	
Carteira	0,86%
Retorno	R\$ 5.173.648,13
Meta	0,87%



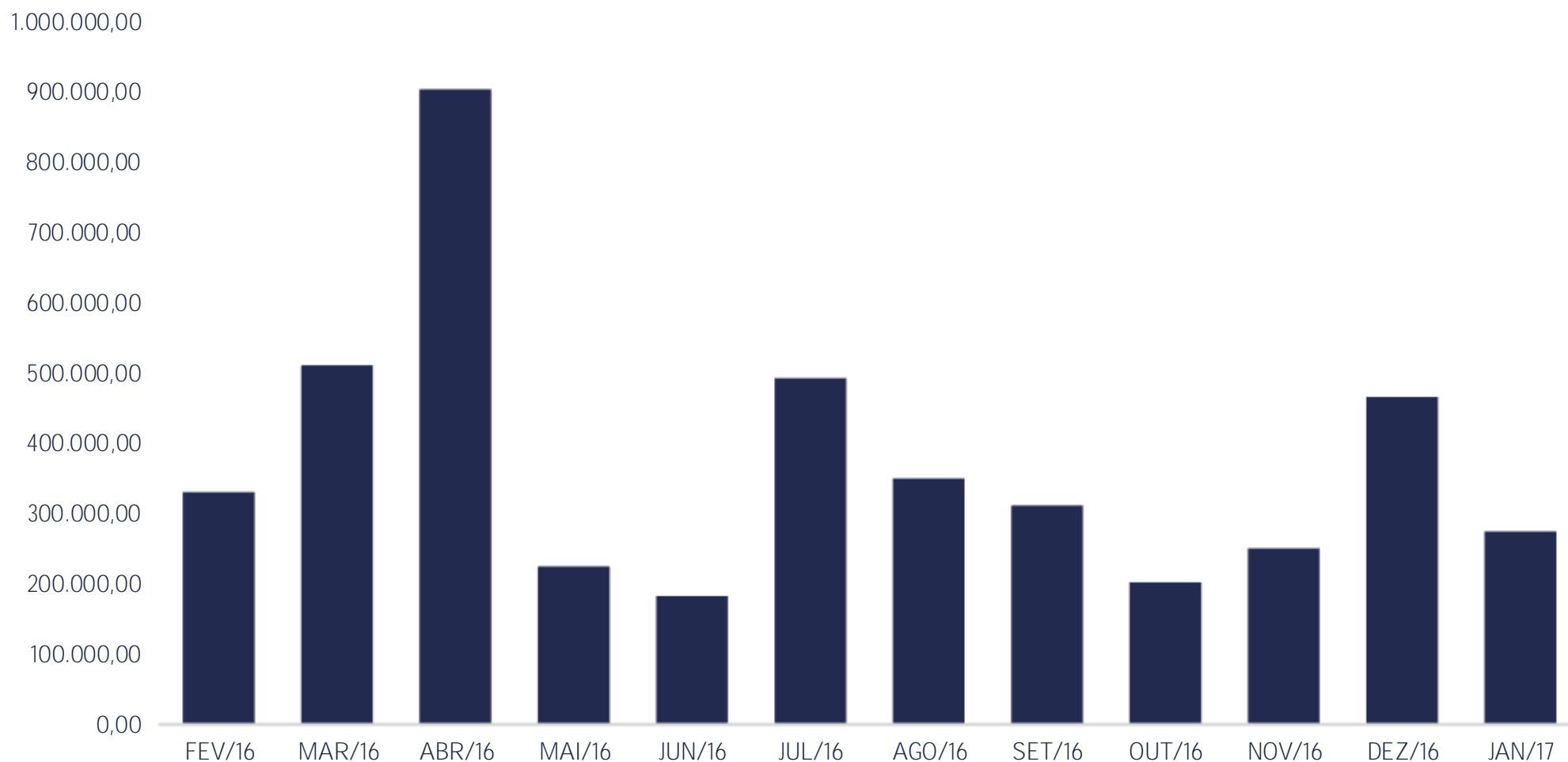
Jan/17

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
NTN-B IPSM		11.477.445,00				325.536,69	2,84%	11.802.981,69
NTN-F IPSM		76.108.499,33			3.672.865,96	-1.536.427,41	-2,02%	74.572.071,92
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	8.108.475,23				149.404,80	1,84%	8.257.880,03
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	1.090.240,93				29.380,30	2,69%	1.119.621,23
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 278-7	362.671,07				4.565,02	1,26%	367.236,09
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 267-1	119.956.819,09				1.509.919,77	1,26%	121.466.738,86
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 18272-9	563.567,80				7.100,96	1,26%	570.668,76
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 17879-9	2.960.377,80				37.300,81	1,26%	2.997.678,61
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	42.783.020,59				789.045,54	1,84%	43.572.066,13
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 278-7	928.991,84				10.567,94	1,14%	939.559,78
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	50.779.453,94				540.215,59	1,06%	51.319.669,53
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 281-7	530.852,48				6.038,82	1,14%	536.891,30
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 18272-9	521.839,95				5.937,99	1,14%	527.777,94
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 15852-6	43.799.217,81				498.388,72	1,14%	44.297.606,53
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 17879-9	1.844.334,30				20.986,57	1,14%	1.865.320,87
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	49.321.539,24				932.629,03	1,89%	50.254.168,27
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 281-7	616.159,82				11.634,12	1,89%	627.793,94
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	7.055.348,18				133.216,65	1,89%	7.188.564,83
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 278-7	2.142.293,95				40.450,06	1,89%	2.182.744,01
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 269-8	464.404,74		-195.345,46		4.361,09	1,62%	273.420,37
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 267-1	108.345.364,65				1.164.015,91	1,07%	109.509.380,56
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 278-7	2.066.203,71				22.198,40	1,07%	2.088.402,11
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 281-7	538.991,14				5.790,69	1,07%	544.781,83
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	33.985.777,11				373.114,60	1,10%	34.358.891,71
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 17879-9	871.935,28				9.572,58	1,10%	881.507,86
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 18272-9	281.713,70				3.092,81	1,10%	284.806,51
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR		377.980,53			3.516,63	907,23	0,24%	375.371,13
CONQUEST FIP - FCCQ11		15.700.656,17				-17.720,42	-0,11%	15.682.935,75
ÁQUILLA FII - AQLL11		6.539.263,25				-821,59	-0,01%	6.538.441,66
FIRENZE FII		11.523.739,89				93.244,86	0,81%	11.616.984,75
Aplicações		601.647.178,52						606.621.964,56
Imóveis		0,00						0,00
Conta Corrente		2.328.124,50						42.867.279,09
Caixa 267-1		221.776,52						6.340.246,58
Caixa 278-7		0,00						97.996,42
Caixa 281-7		0,00						0,00
Banco do Brasil 17160-3		0,00						37.314,95
Banco do Brasil 15853-4		0,00						0,00
Banco do Brasil 15854-2		158,73						3.645,23
Banco do Brasil 15852-6		0,00						23.407,33
Banco do Brasil 17879-9		0,00						0,00
Banco do Brasil 18272-9		0,00						0,00
Caixa 271-0		704.793,81						690.373,66
Caixa 269-8		0,00						0,00
Caixa 266-3		1.401.344,30						35.674.243,78
Caixa 538-7		51,14						51,14
Final		603.975.303,02	0,00	-195.345,46	3.676.382,59	5.173.648,13	0,86%	649.489.243,65

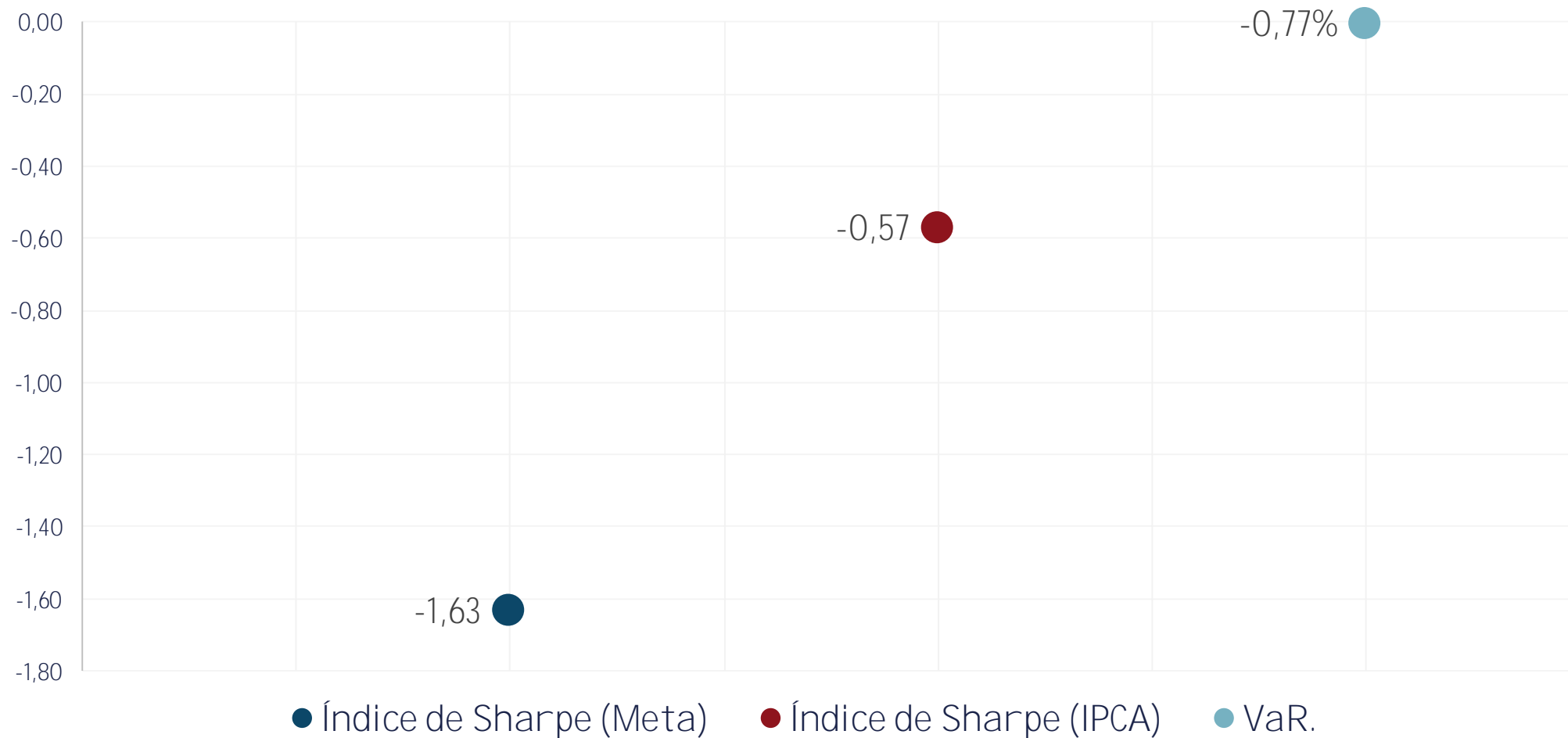
16

Evolução Patrimônio Líquido - Fundo Administrativo

Jan R\$ 273.420,37 Feb Mar Abr
Mai Jun Jul Ago
Set Out Nov Dez

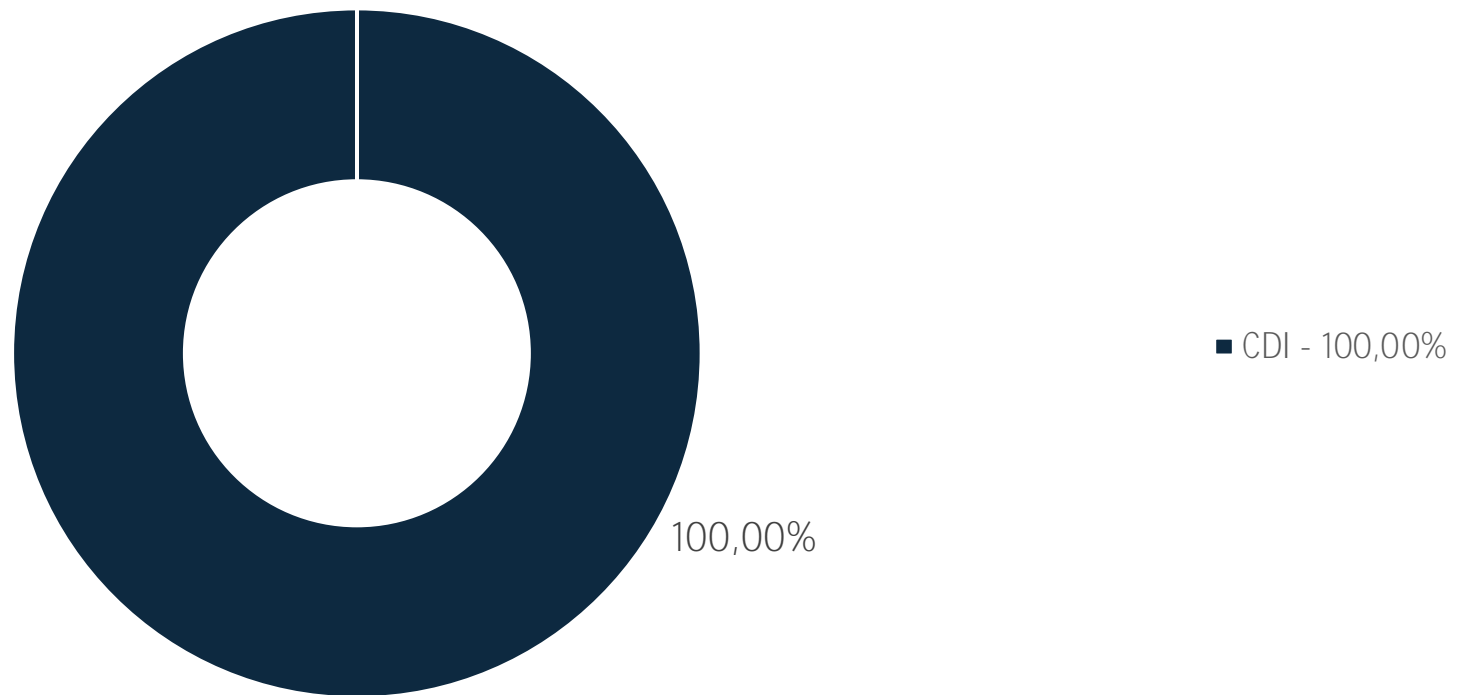


Índice de Sharpe e Var da Carteira

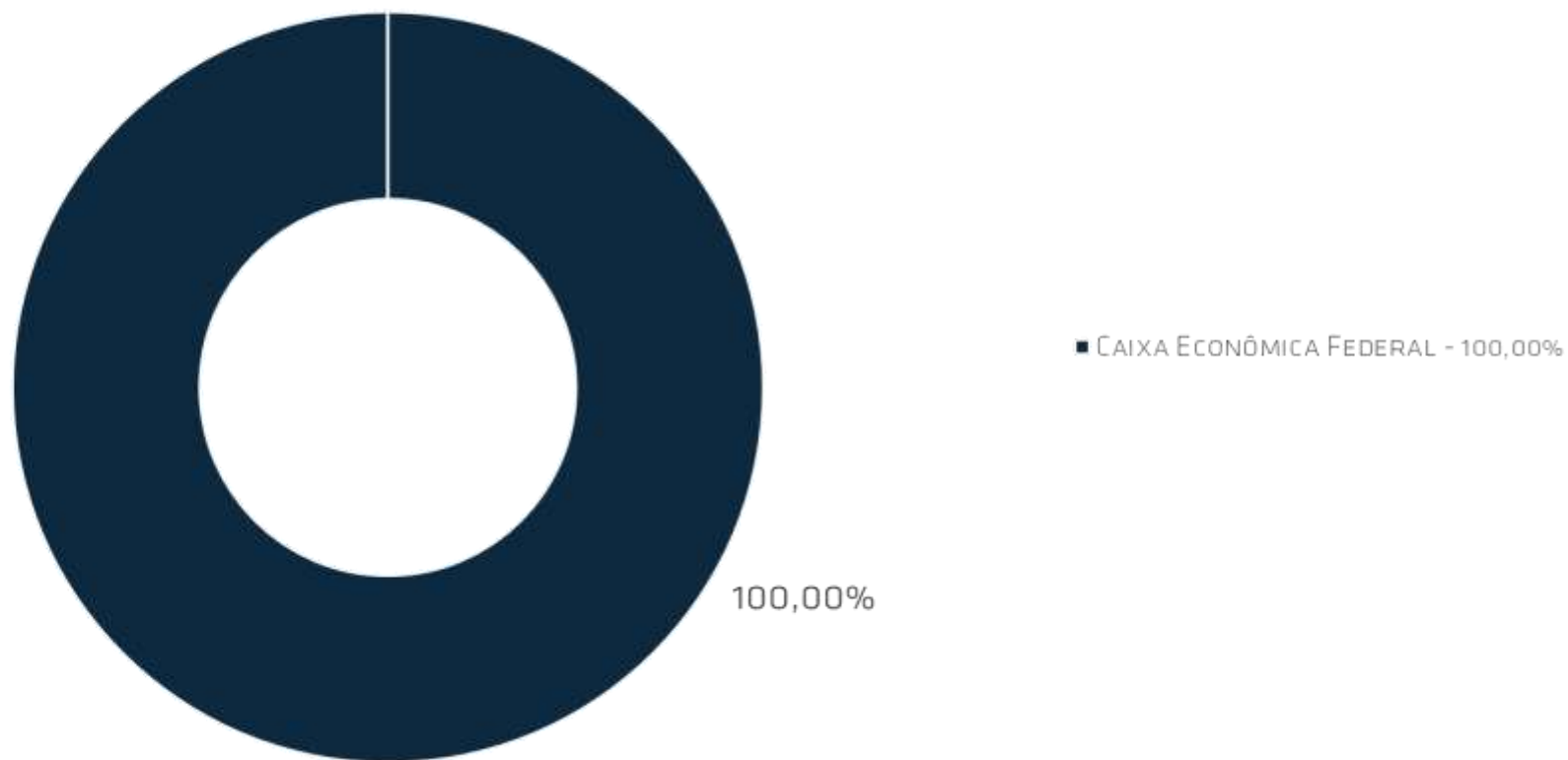


Fundos	CNPJ	Gestão	Taxa de Administração	Benchmark	Resgate
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	14.508.643/0001-5E	Caixa Econômica Federal	0,80%	CDI	D+0

Distribuição por Indicador - Janeiro - 2017



DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO - JANEIRO - 2017

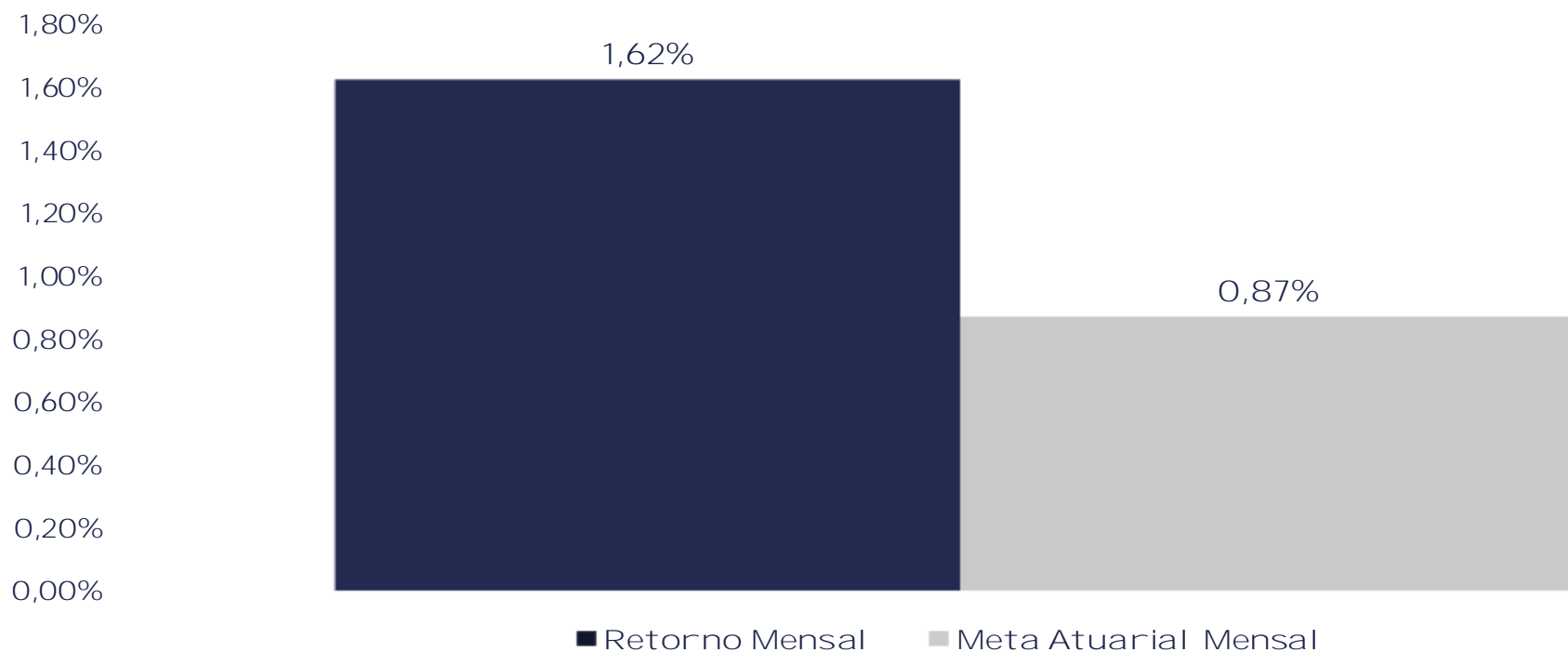


Performance Absoluta

	jan-17	fev-17	mar-17	abr-17	mai-17	jun-17
Carteira	1,62%					
Retorno Financeiro	4.361,09					
Meta Atuarial	0,87%					

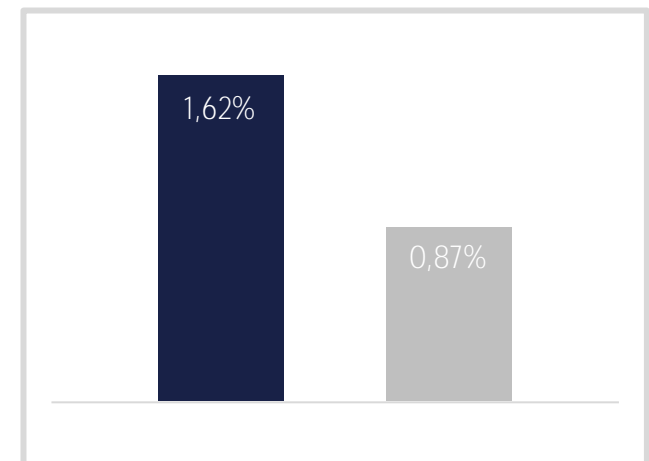
	jul-17	ago-17	set-17	out-17	nov-17	dez-17
Carteira						
Retorno Financeiro						
Meta Atuarial						

Retorno Mensal X Meta Atuarial Mensal



Estatística		
Meses positivos:	1	
Meses negativos:	0	
Meses acima da Meta Atuarial:	1	
Meses abaixo da Meta Atuarial:	0	
Retorno Mensal Máximo	1,62%	jan-17
Retorno Mensal Médio	1,62%	
Retorno Mensal Mínimo	1,62%	jan-17
Sharpe	-1,63	
Volatilidade	5,96%	
VaR	-0,77%	
Meta Atuarial	IPCA + 6%	

Consolidado - 2017	
Carteira	1,62%
Retorno	R\$ 4.361,09
Meta	0,87%

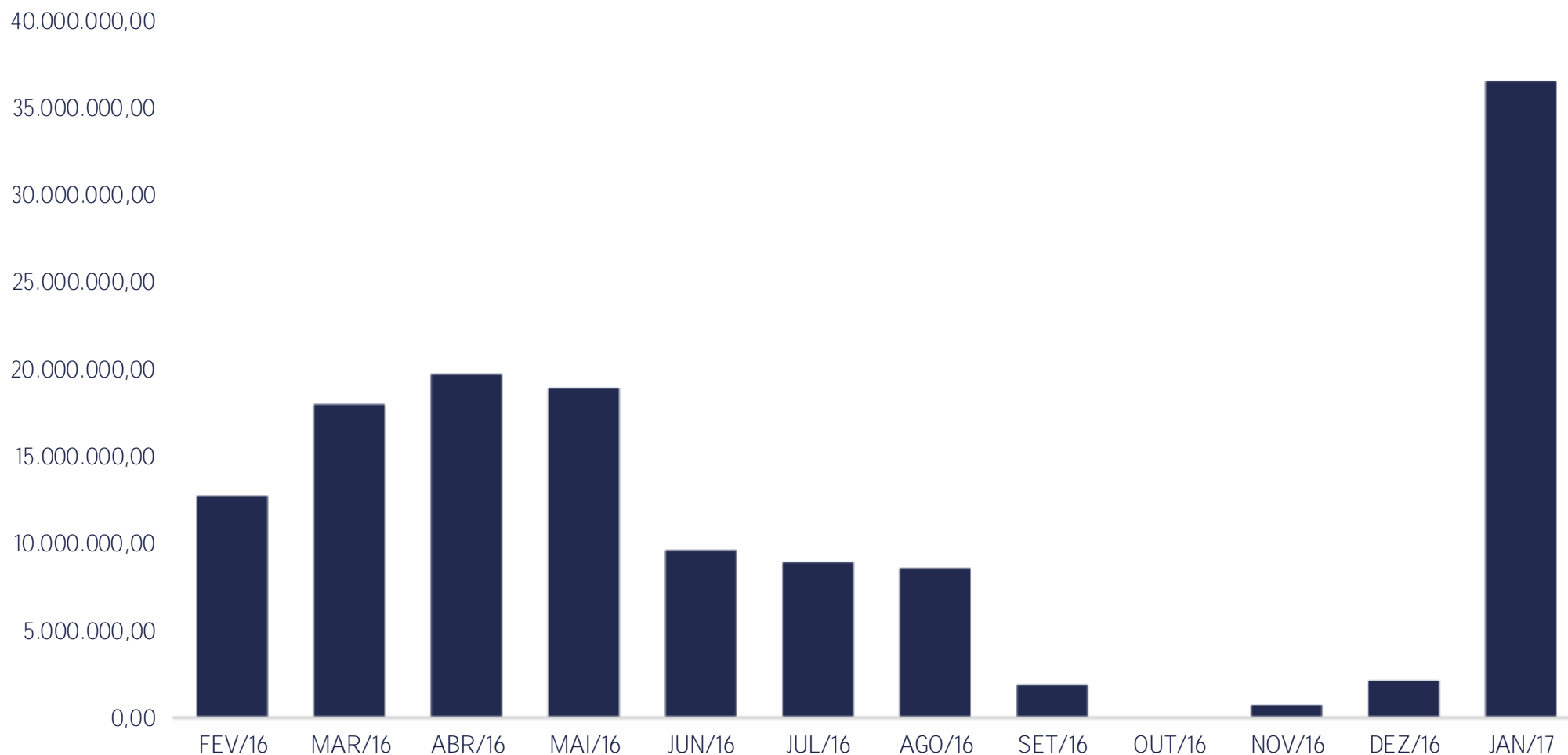


jan/17

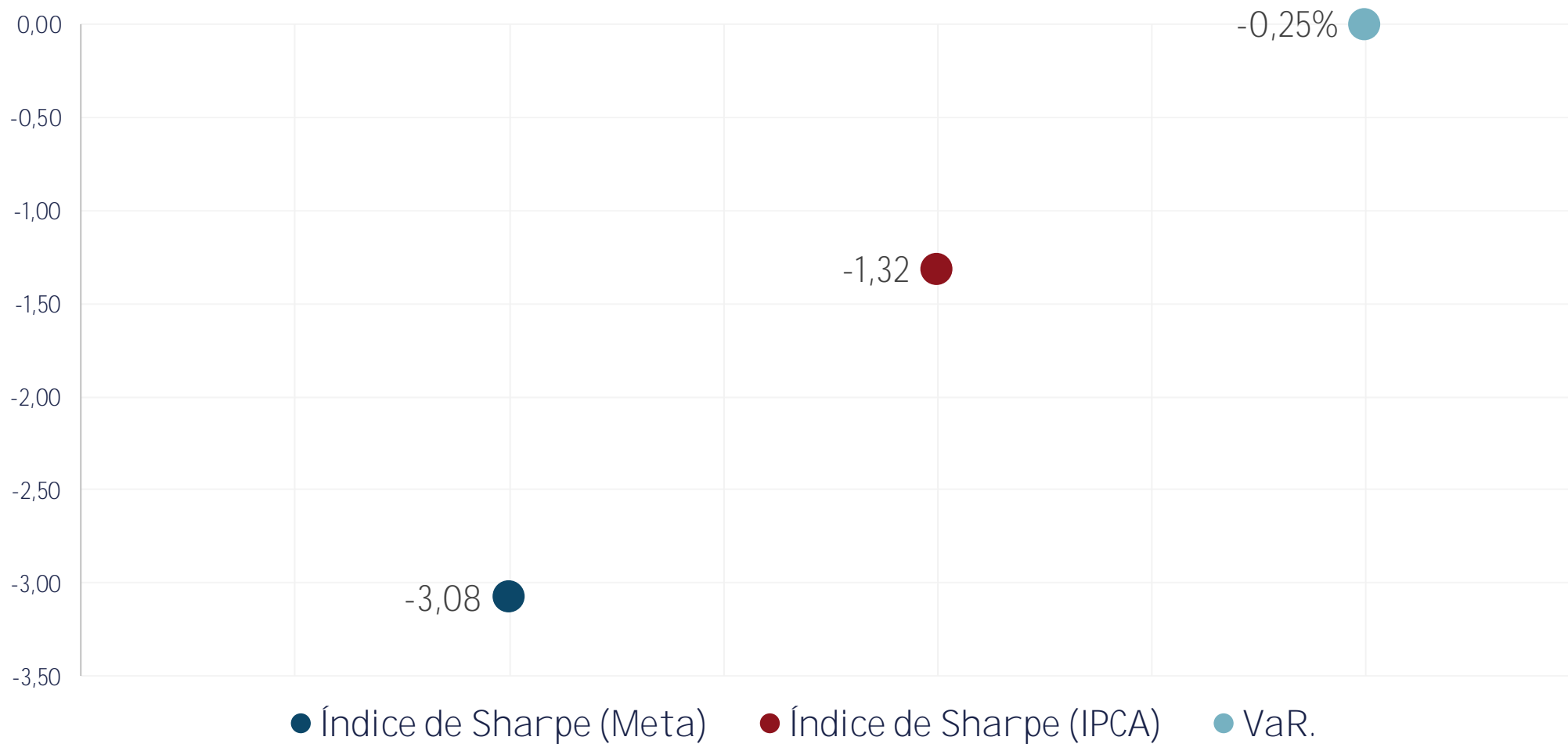
Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 269-8	464.404,74		-195.345,46		4.361,09	1,62%	273.420,37
Aplicações		464.404,74						273.420,37
Imóveis		0,00						0,00
Conta Corrente		0,00						0,00
Banco do Brasil 15853-4		0,00						0,00
Caixa 269-8		0,00						0,00
Final		464.404,74	0,00	-195.345,46	0,00	4.361,09	1,62%	273.420,37

Evolução Patrimônio Líquido - Fundo I

Jan R\$ 36.405.577,62 Fev Mar Abr
Mai Jun Jul Ago
Set Out Nov Dez



Índice de Sharpe e Var da Carteira

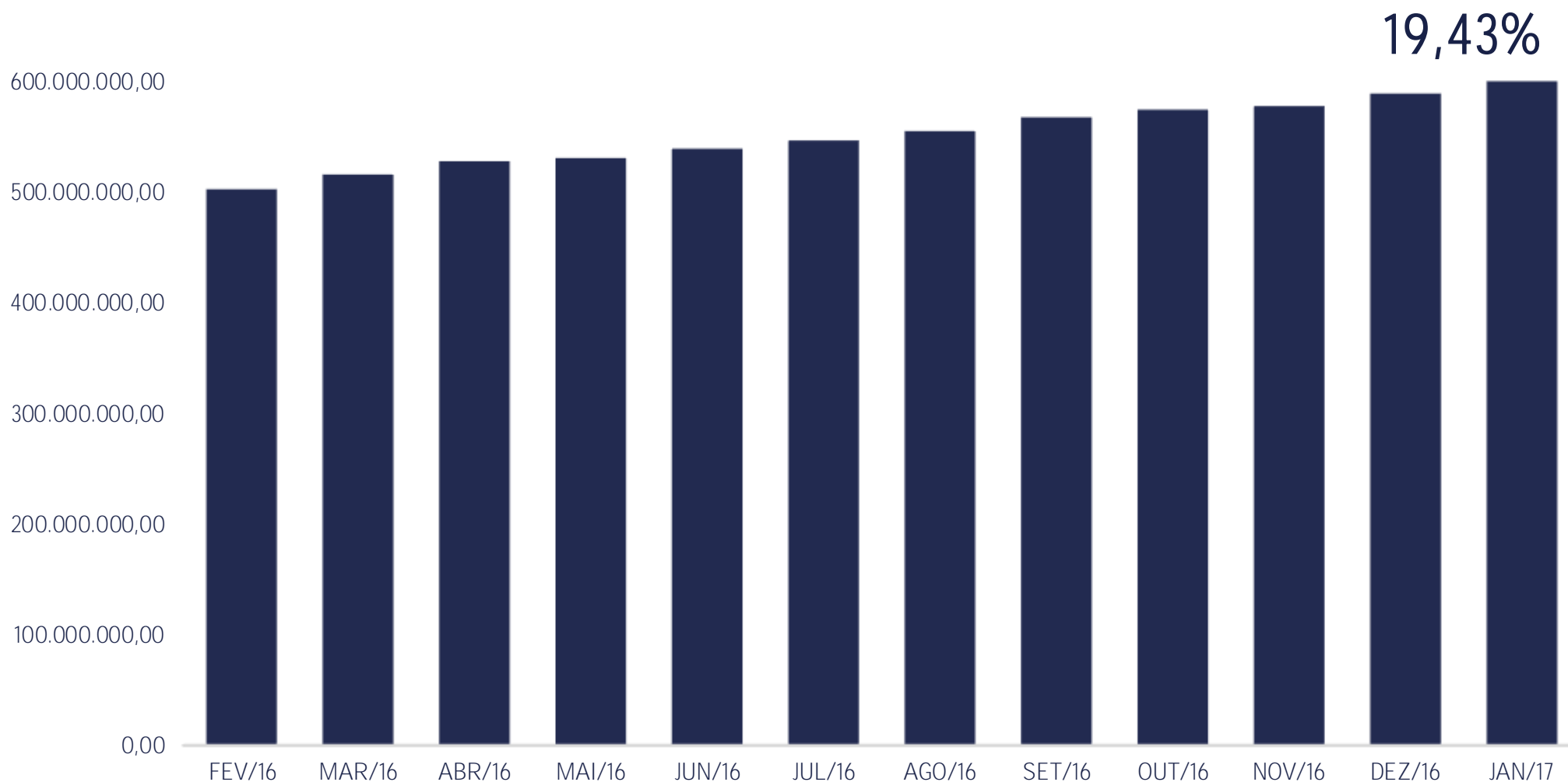


jan/17

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
Aplicações		0,00						0,00
Imóveis		0,00						0,00
Conta Corrente		2.106.296,84						36.405.577,62
Banco do Brasil 17160-3		0,00						37.314,95
Banco do Brasil 15854-2		158,73						3.645,23
Caixa 271-0		704.793,81						690.373,66
Caixa 266-3		1.401.344,30						35.674.243,78
Final		2.106.296,84	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	36.405.577,62

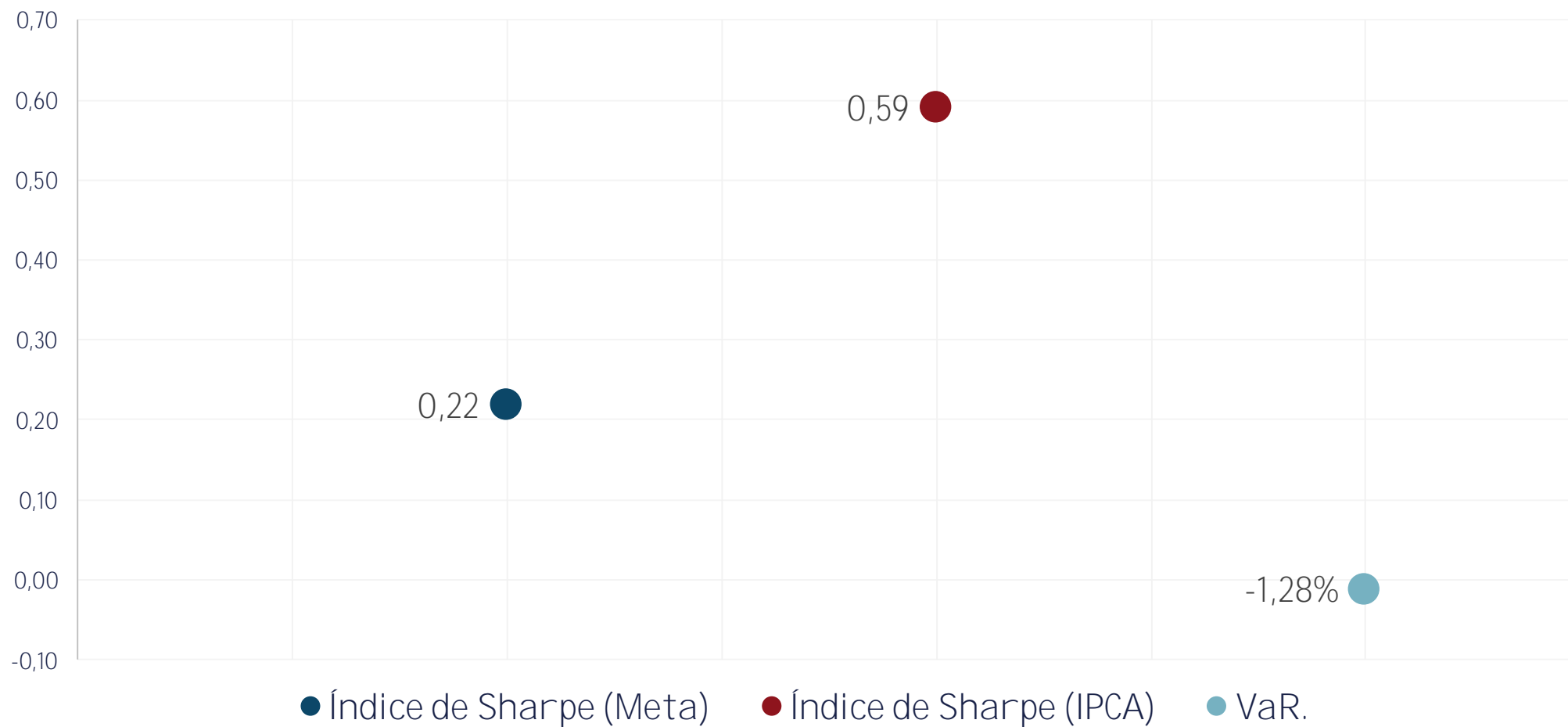
Evolução Patrimônio Líquido - Fundo II

Jan R\$ 598.297.079,63 Fev Mar Abr
Mai Jun Jul Ago
Set Out Nov Dez



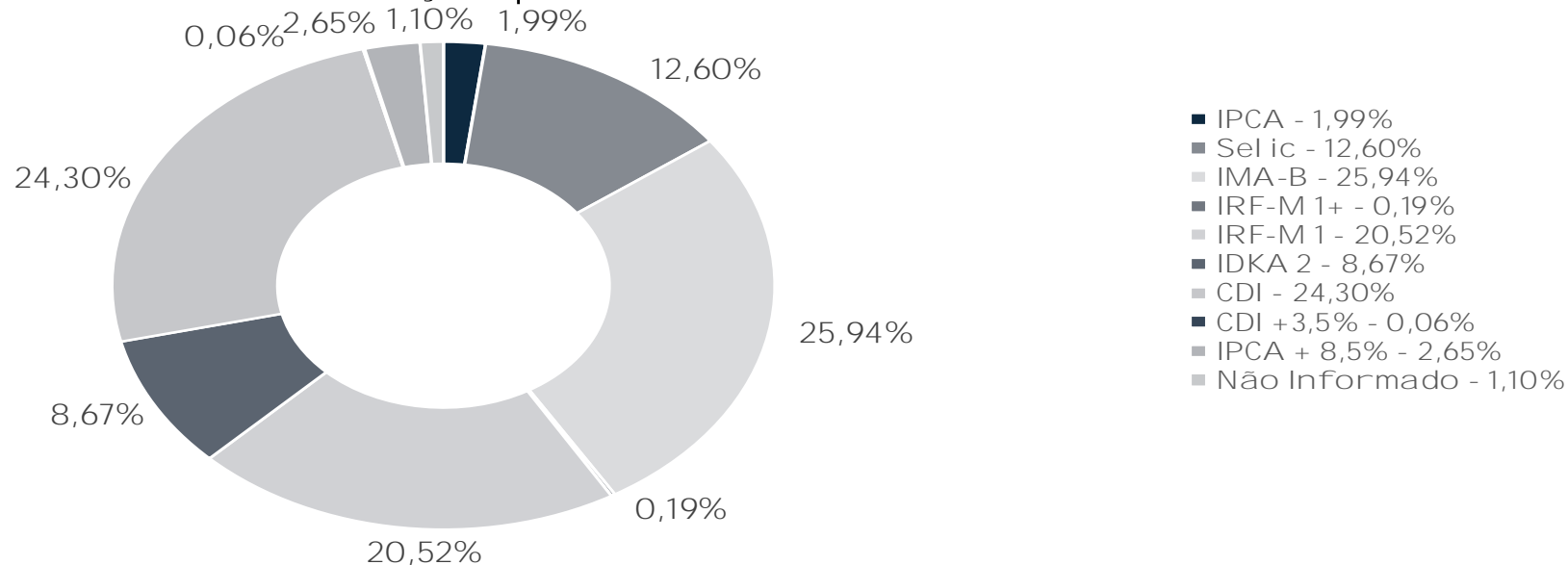
19,43%

Índice de Sharpe e Var da Carteira

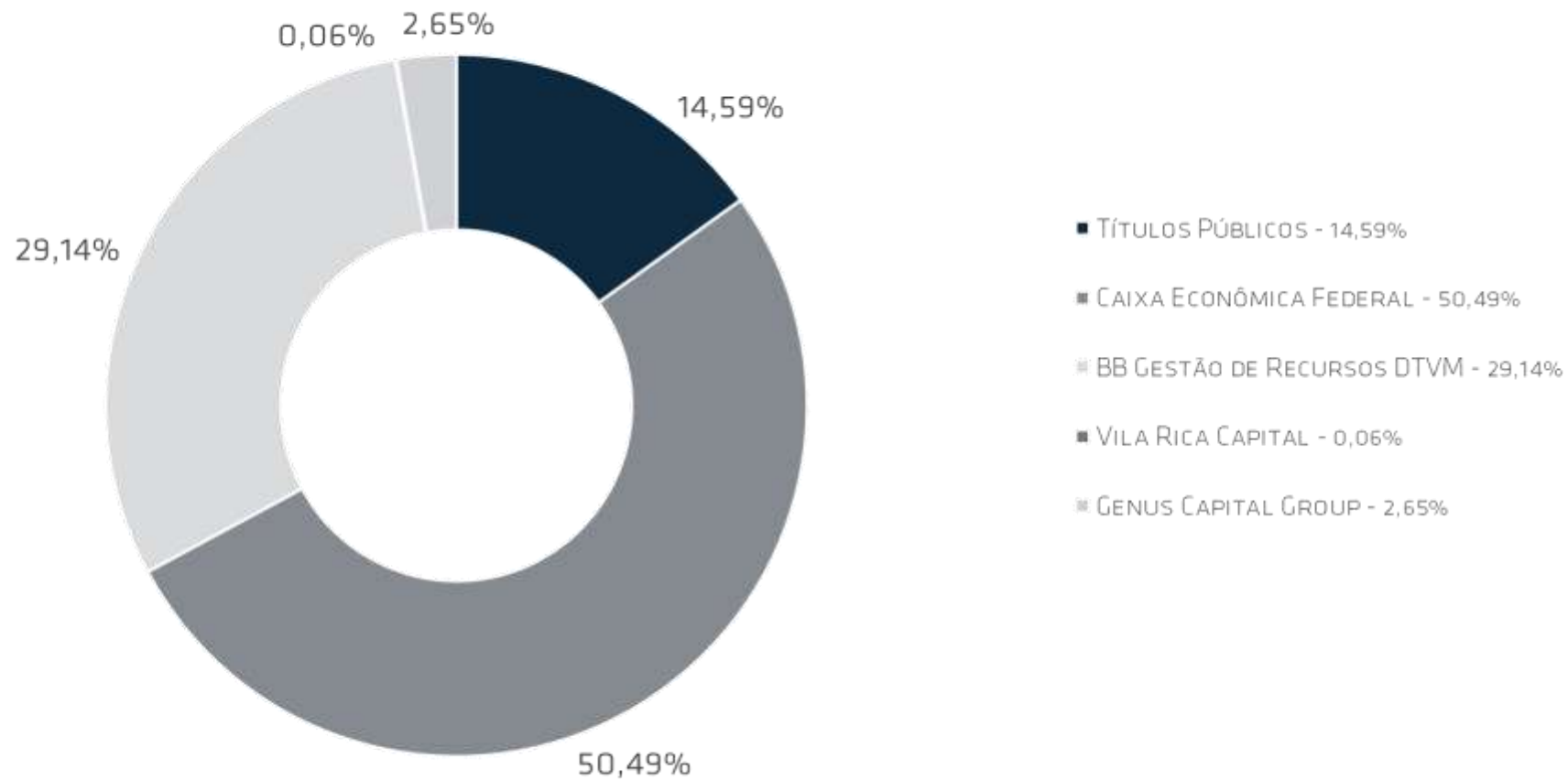


Fundos	CNPJ	Gestão	Taxa de Administração	Benchmark	Resgate
NTN-B IPSM	0.000.000/0000-C	Títulos Públicos	0,00%	IPCA	-
NTN-F IPSM	0.000.000/0000-0	Títulos Públicos	0,00%	Selic	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.740.658/0001-92	Caixa Econômica Federal	0,20%	IMA-B	D+0
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.577.519/0001-90	Caixa Econômica Federal	0,20%	IRF-M 1+	D+0
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.740.670/0001-06	Caixa Econômica Federal	0,20%	IRF-M 1	D+0
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	14.386.926/0001-71	Caixa Econômica Federal	0,20%	IDKA 2	D+0
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	07.442.078/0001-01	BB Gestão de Recursos DTVM	0,20%	IMA-B	D+1
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	03.543.447/0001-02	BB Gestão de Recursos DTVM	0,20%	IMA-B	D+1
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	07.861.554/0001-22	BB Gestão de Recursos DTVM	0,30%	IMA-B	D+1
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	10.646.895/0001-90	Caixa Econômica Federal	0,20%	IMA-B	D+0
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	03.737.206/0001-97	Caixa Econômica Federal	0,20%	CDI	D+0
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.077.418/0001-49	BB Gestão de Recursos DTVM	0,20%	CDI	D+0
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	3.990.000/0001-28	Vila Rica Capital	0,39%	CDI +3,5%	Não se aplica
CONQUEST FIP - FCCQ11	10.625.626/0001-47	Genus Capital Group	0,30%	IPCA + 8,5%	Não se aplica
ÁQUILLA FII - AQLL11	13.555.918/0001-49	AQ3 Asset Management	1,50%	Não Informado	Não se aplica
FIRENZE FII	14.074.721/0001-50	AQ3 Asset Management	1,50%	Não Informado	Não se aplica

Distribuição por Indicador - Janeiro - 2017



DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO - JANEIRO - 2017

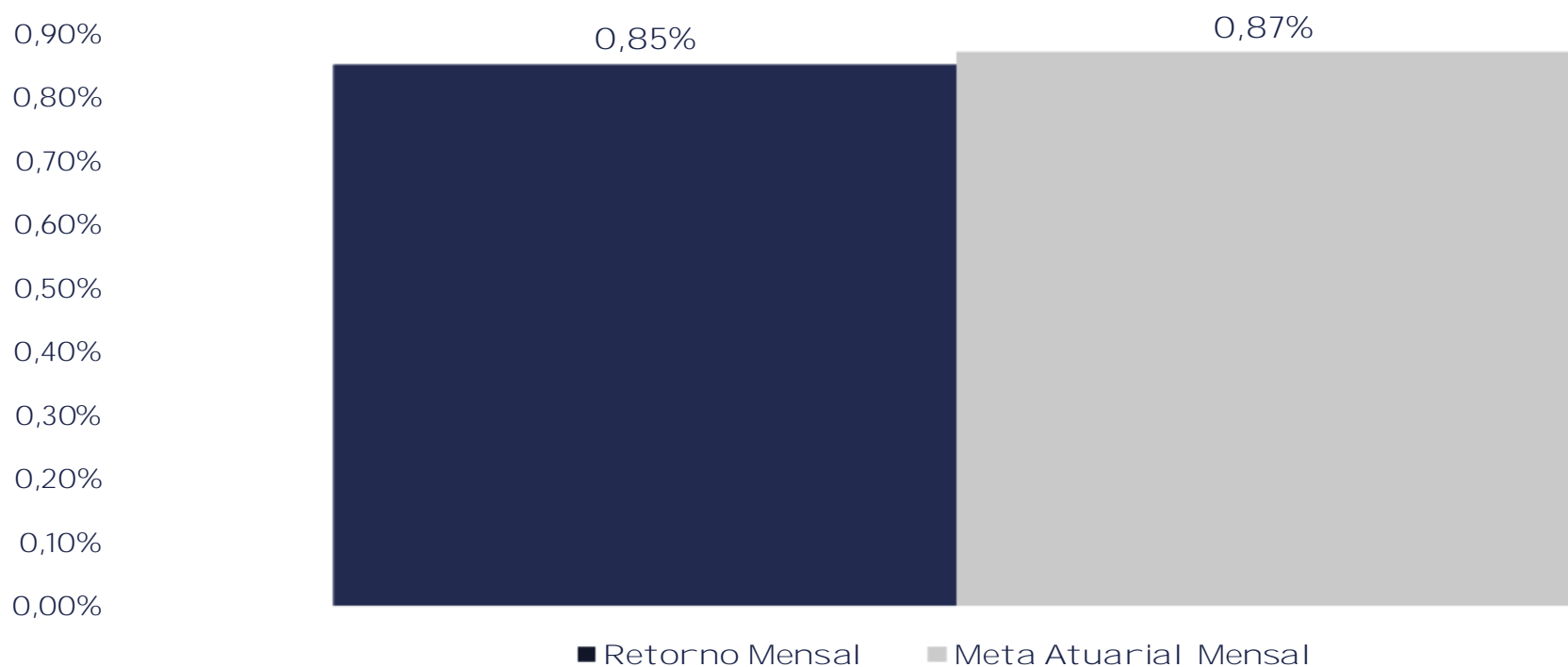


Performance Absoluta

	jan-17	fev-17	mar-17	abr-17	mai-17	jun-17
Carteira	0,85%					
Retorno Financeiro	4.984.050,27					
Meta Atuarial	0,87%					

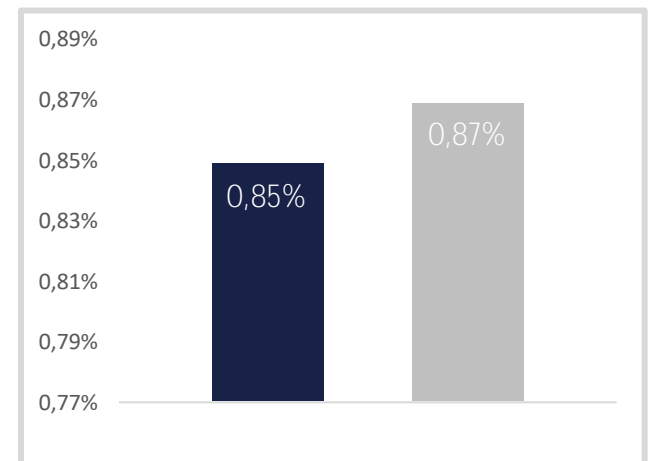
	jul-17	ago-17	set-17	out-17	nov-17	dez-17
Carteira						
Retorno Financeiro						
Meta Atuarial						

Retorno Mensal X Meta Atuarial Mensal



Estatística		
Meses positivos:	1	
Meses negativos:	0	
Meses acima da Meta Atuarial:	0	
Meses abaixo da Meta Atuarial:	1	
Retorno Mensal Máximo	0,85%	jan-17
Retorno Mensal Médio	0,85%	
Retorno Mensal Mínimo	0,85%	jan-17
Sharpe	0,27	
Volatilidade	16,13%	
VaR	-1,20%	
Meta Atuarial	IPCA + 6%	

Consolidado - 2017	
Carteira	0,85%
Retorno	R\$ 4.984.050,27
Meta	0,87%

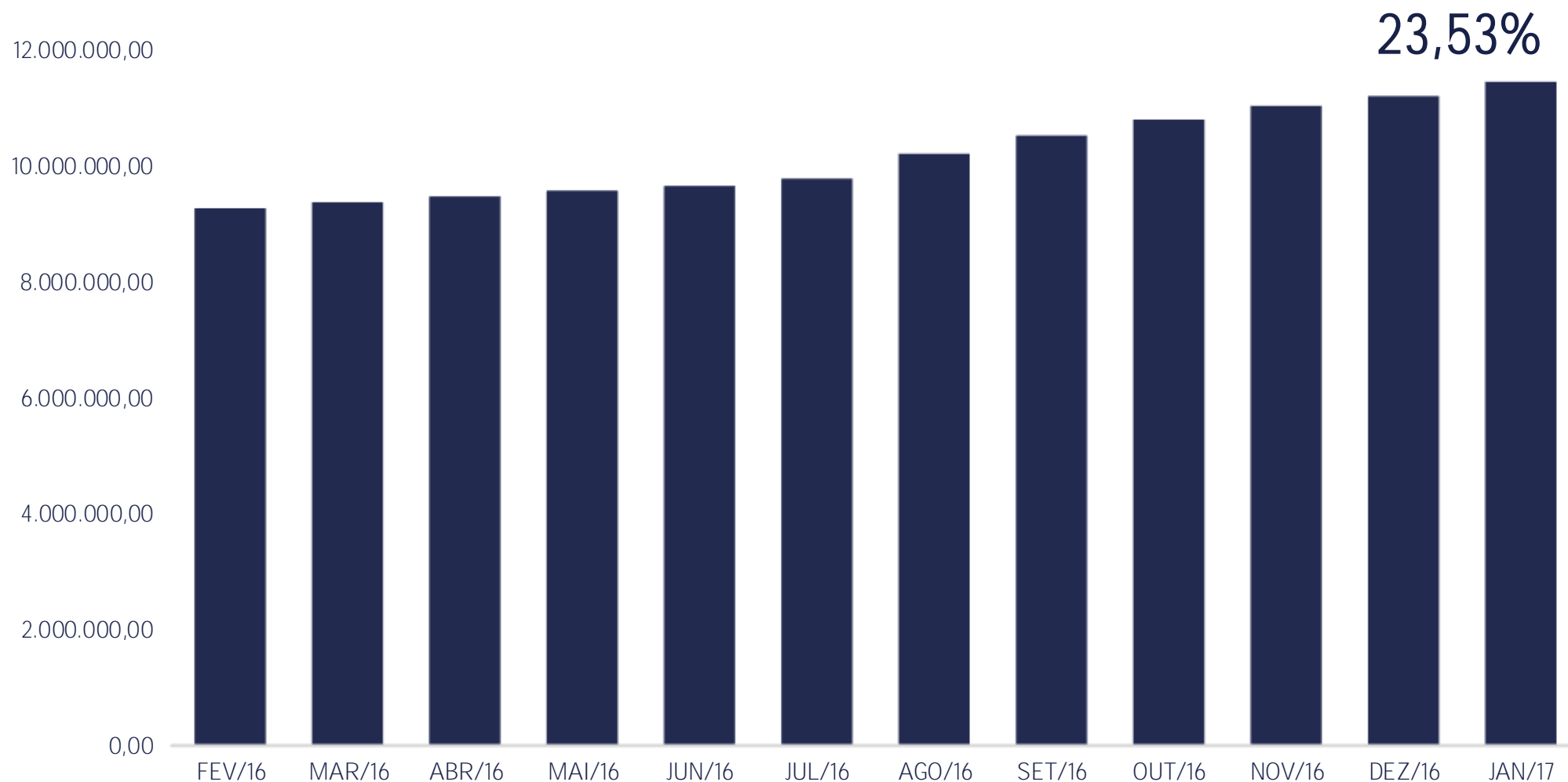


jan/17

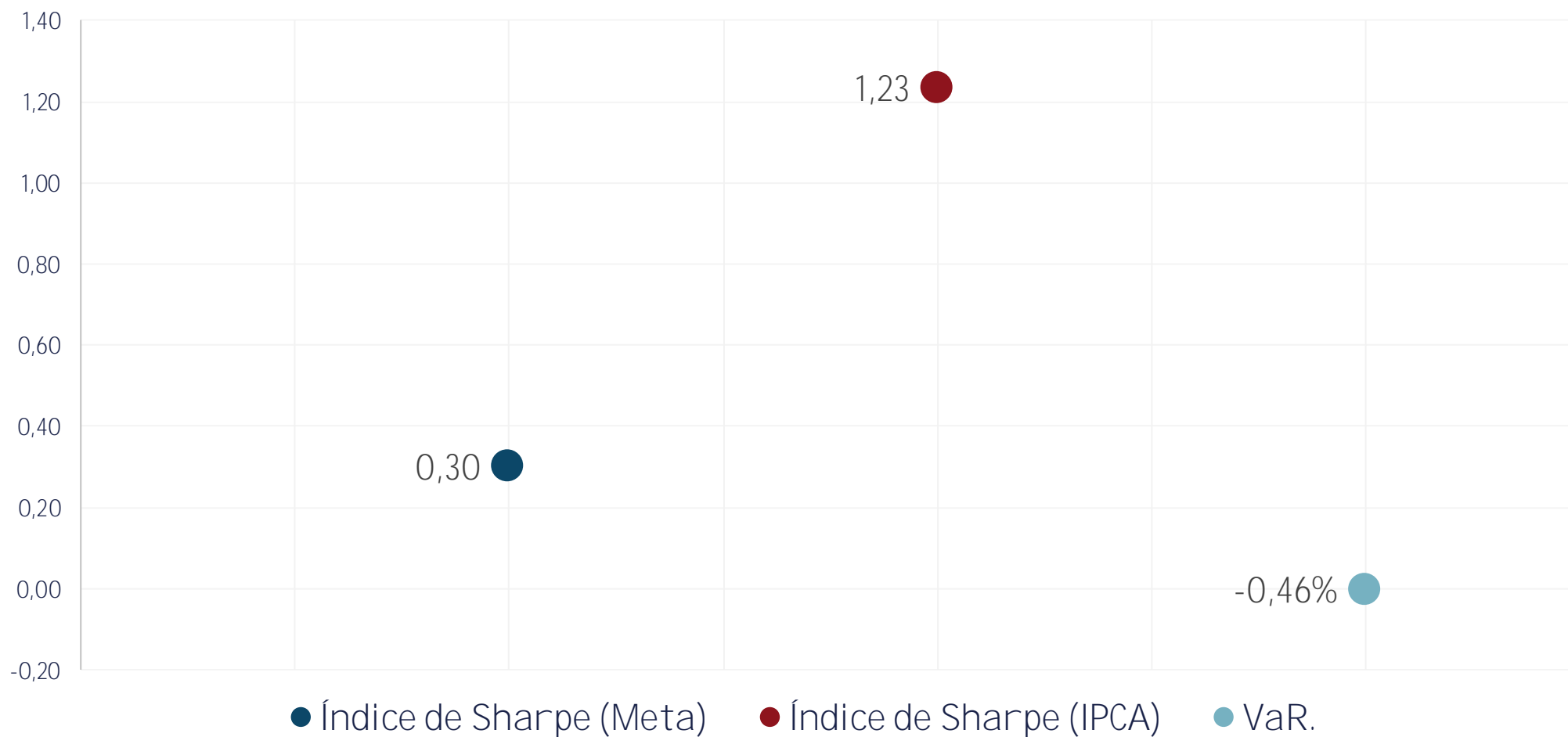
Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
NTN-B IPSM		11.477.445,00				325.536,69	2,84%	11.802.981,69
NTN-F IPSM		76.108.499,33			3.672.865,96	-1.536.427,41	-2,02%	74.572.071,92
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	8.108.475,23				149.404,80	1,84%	8.257.880,03
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	1.090.240,93				29.380,30	2,69%	1.119.621,23
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 267-1	119.956.819,09				1.509.919,77	1,26%	121.466.738,86
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	50.779.453,94				540.215,59	1,06%	51.319.669,53
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	42.783.020,59				789.045,54	1,84%	43.572.066,13
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 15852-6	43.799.217,81				498.388,72	1,14%	44.297.606,53
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	49.321.539,24				932.629,03	1,89%	50.254.168,27
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 267-1	7.055.348,18				133.216,65	1,89%	7.188.564,83
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 267-1	108.345.364,65				1.164.015,91	1,07%	109.509.380,56
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 15852-6	33.985.777,11				373.114,60	1,10%	34.358.891,71
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR		377.980,53			3.516,63	907,23	0,24%	375.371,13
CONQUEST FIP - FCCQ11		15.700.656,17				-17.720,42	-0,11%	15.682.935,75
ÁQUILLA FII - AQLL11		6.539.263,25				-821,59	-0,01%	6.538.441,66
FIRENZE FII		11.523.739,89				93.244,86	0,81%	11.616.984,75
Apl icações		586.952.840,94						591.933.374,58
Imóveis		0,00						0,00
Conta Corrente		221.827,66						6.363.705,05
Caixa 267-1		221.776,52						6.340.246,58
Banco do Brasil 15852-6		0,00						23.407,33
Caixa 538-7		51,14						51,14
Final		587.174.668,60	0,00	0,00	3.676.382,59	4.984.050,27	0,85%	598.297.079,63

Evolução Patrimônio Líquido - Fundo III

Jan R\$ 11.420.445,75 Fev Mar Abr
 Mai Jun Jul Ago
 Set Out Nov Dez

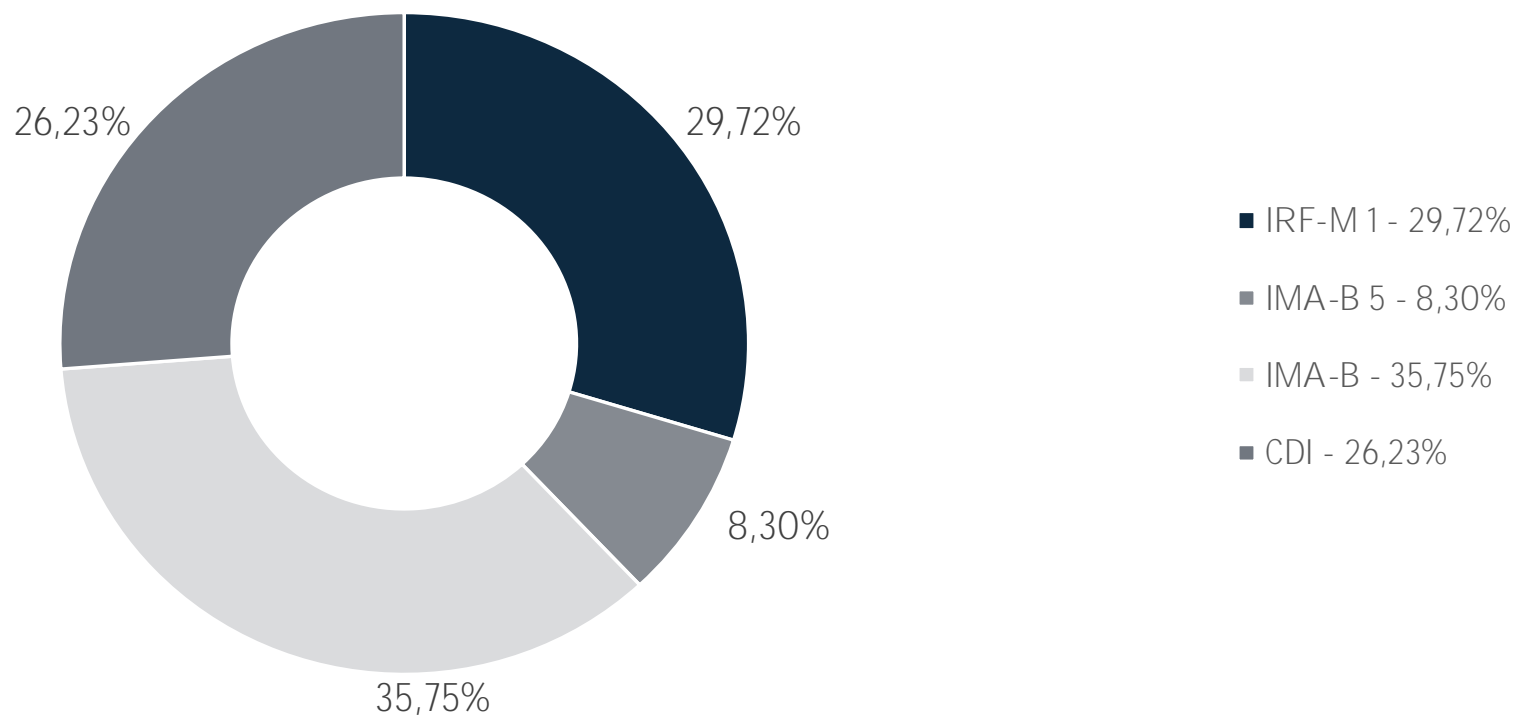


Índice de Sharpe e Var da Carteira

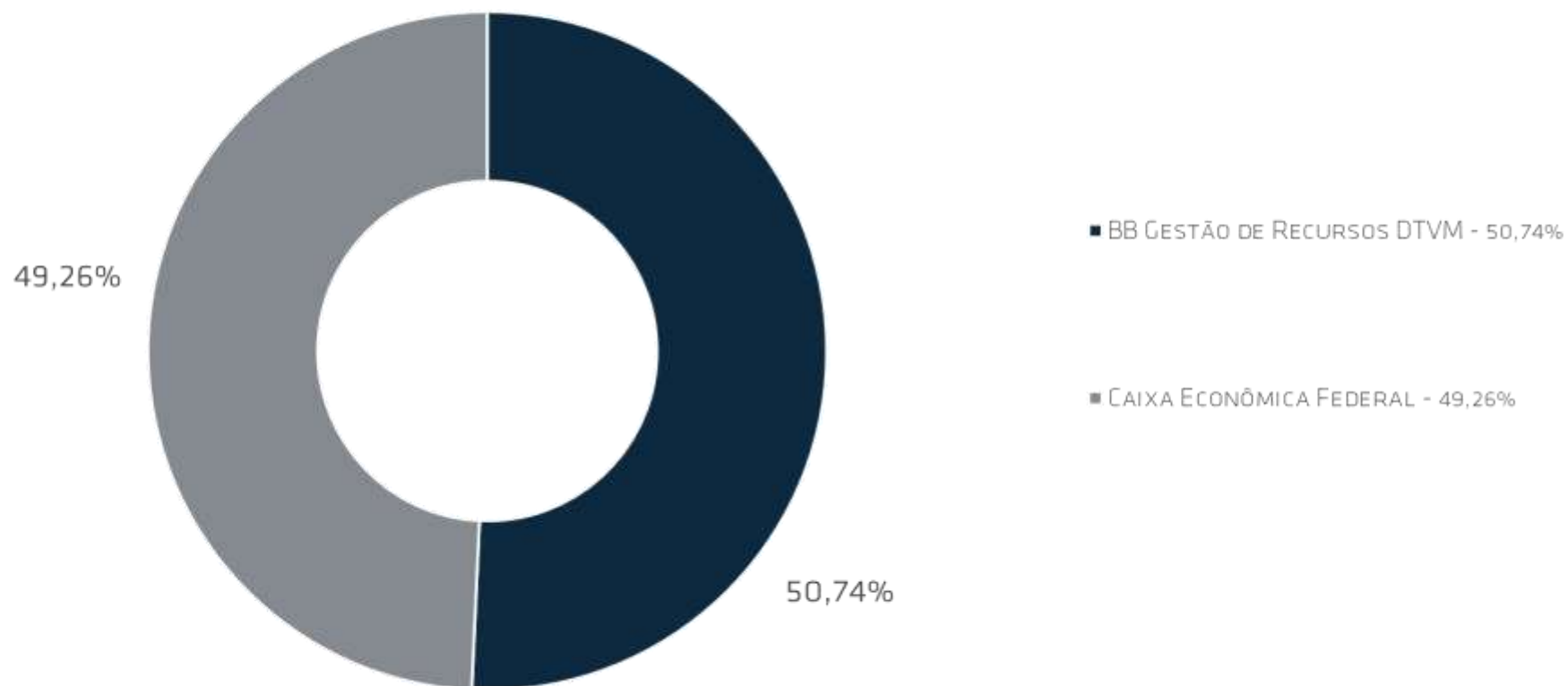


Fundos	CNPJ	Gestão	Taxa de Administração	Benchmark	Resgate
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.328.882/0001-35	BB Gestão de Recursos DTVM	0,10%	IRF-M 1	D+0
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.740.670/0001-06	Caixa Econômica Federal	0,20%	IRF-M 1	D+0
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.060.913/0001-10	Caixa Econômica Federal	0,20%	IMA-B 5	D+0
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	13.543.447/0001-03	BB Gestão de Recursos DTVM	0,20%	IMA-B	D+1
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	10.646.895/0001-90	Caixa Econômica Federal	0,20%	IMA-B	D+0
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	13.737.206/0001-97	Caixa Econômica Federal	0,20%	CDI	D+0
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.077.418/0001-49	BB Gestão de Recursos DTVM	0,20%	CDI	D+0

Distribuição por Indicador - Janeiro - 2017



DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO - JANEIRO - 2017

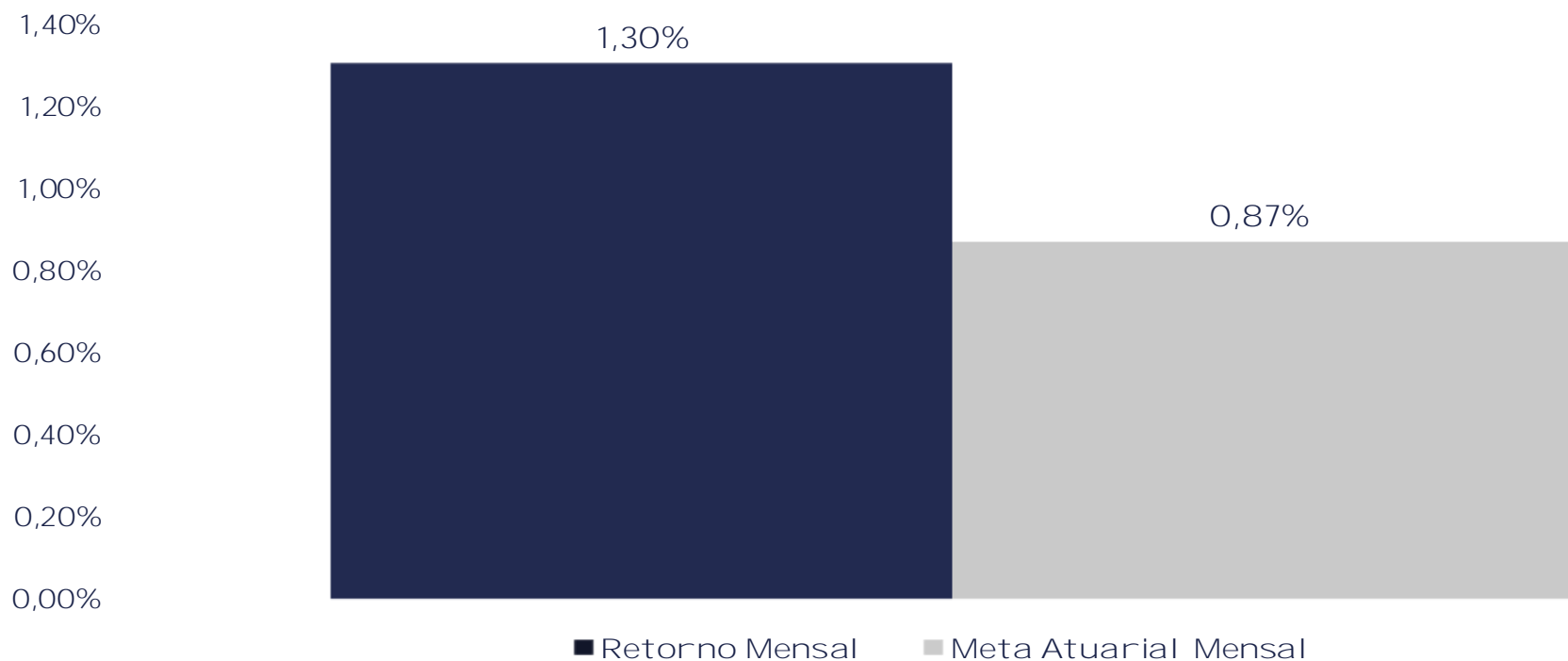


Performance Absoluta

	jan-17	fev-17	mar-17	abr-17	mai-17	jun-17
Carteira	1,30%					
Retorno Financeiro	145.641,38					
Meta Atuarial	0,87%					

	jul-17	ago-17	set-17	out-17	nov-17	dez-17
Carteira						
Retorno Financeiro						
Meta Atuarial						

Retorno Mensal X Meta Atuarial Mensal

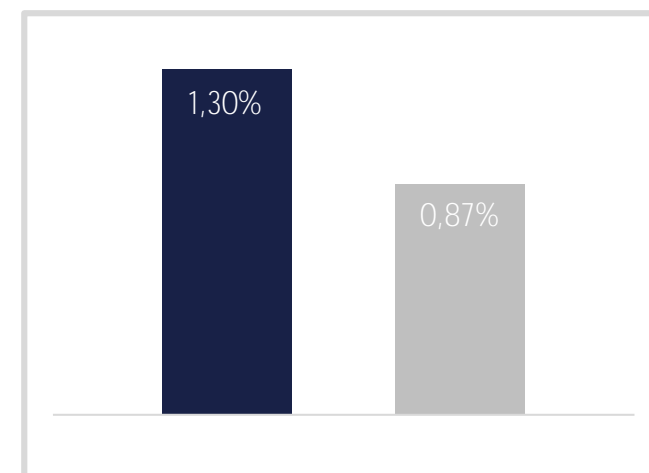


Estatística

Meses positivos:	1	
Meses negativos:	0	
Meses acima da Meta Atuarial:	1	
Meses abaixo da Meta Atuarial:	0	
Retorno Mensal Máximo	1,30%	jan-17
Retorno Mensal Médio	1,30%	
Retorno Mensal Mínimo	1,30%	jan-17
Sharpe	0,30	
Volatilidade	6,78%	
VaR	-0,46%	
Meta Atuarial	IPCA + 6%	

Consolidado - 2017

Carteira	1,30%
Retorno	R\$ 145.641,38
Meta	0,87%

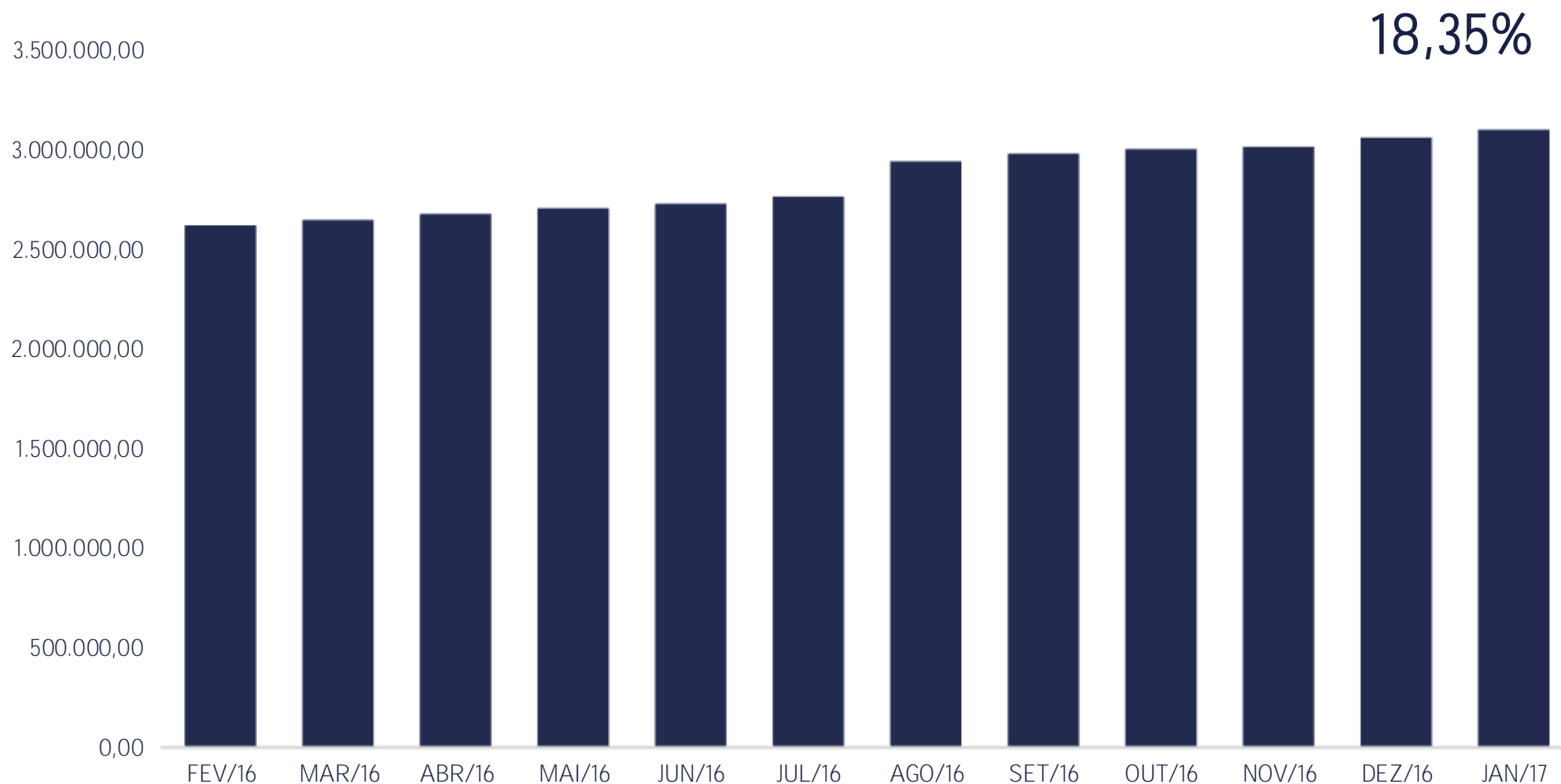


jan/17

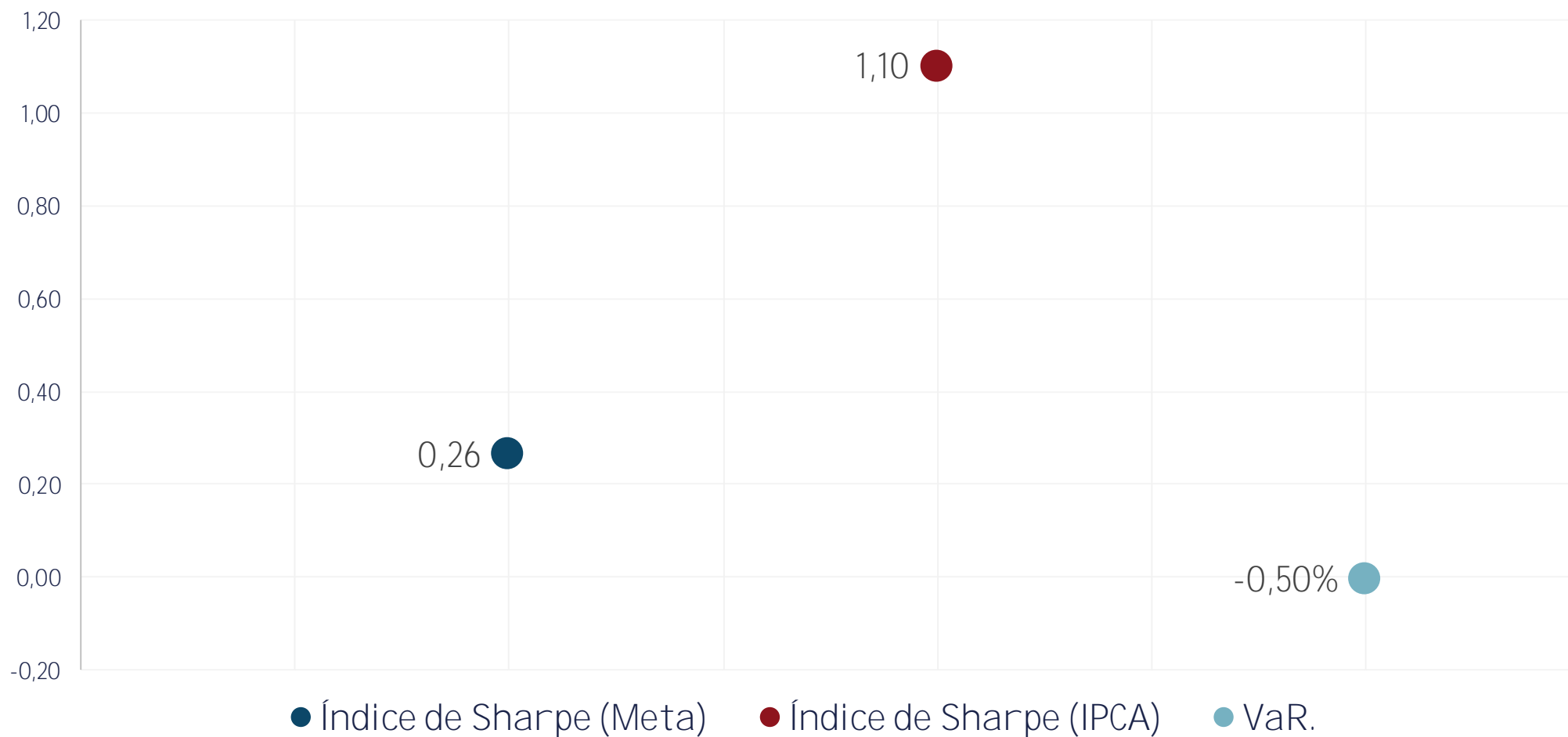
Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 17879-9	2.960.377,80				37.300,81	1,26%	2.997.678,61
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 cc 278-7	362.671,07				4.565,02	1,26%	367.236,09
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 278-7	928.991,84				10.567,94	1,14%	939.559,78
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 17879-9	1.844.334,30				20.986,57	1,14%	1.865.320,87
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 278-7	2.142.293,95				40.450,06	1,89%	2.182.744,01
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 278-7	2.066.203,71				22.198,40	1,07%	2.088.402,11
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 17879-9	871.935,28				9.572,58	1,10%	881.507,86
Aplicações		11.176.807,95						11.322.449,33
Imóveis		0,00						0,00
Conta Corrente		0,00						97.996,42
Caixa 278-7		0,00						97.996,42
Banco do Brasil 17879-9		0,00						0,00
Final		11.176.807,95	0,00	0,00	0,00	145.641,38	1,30%	11.420.445,75

Evolução Patrimônio Líquido - Fundo IV

Jan R\$ 3.092.720,28 Fev Mar Abr
Mai Jun Jul Ago
Set Out Nov Dez

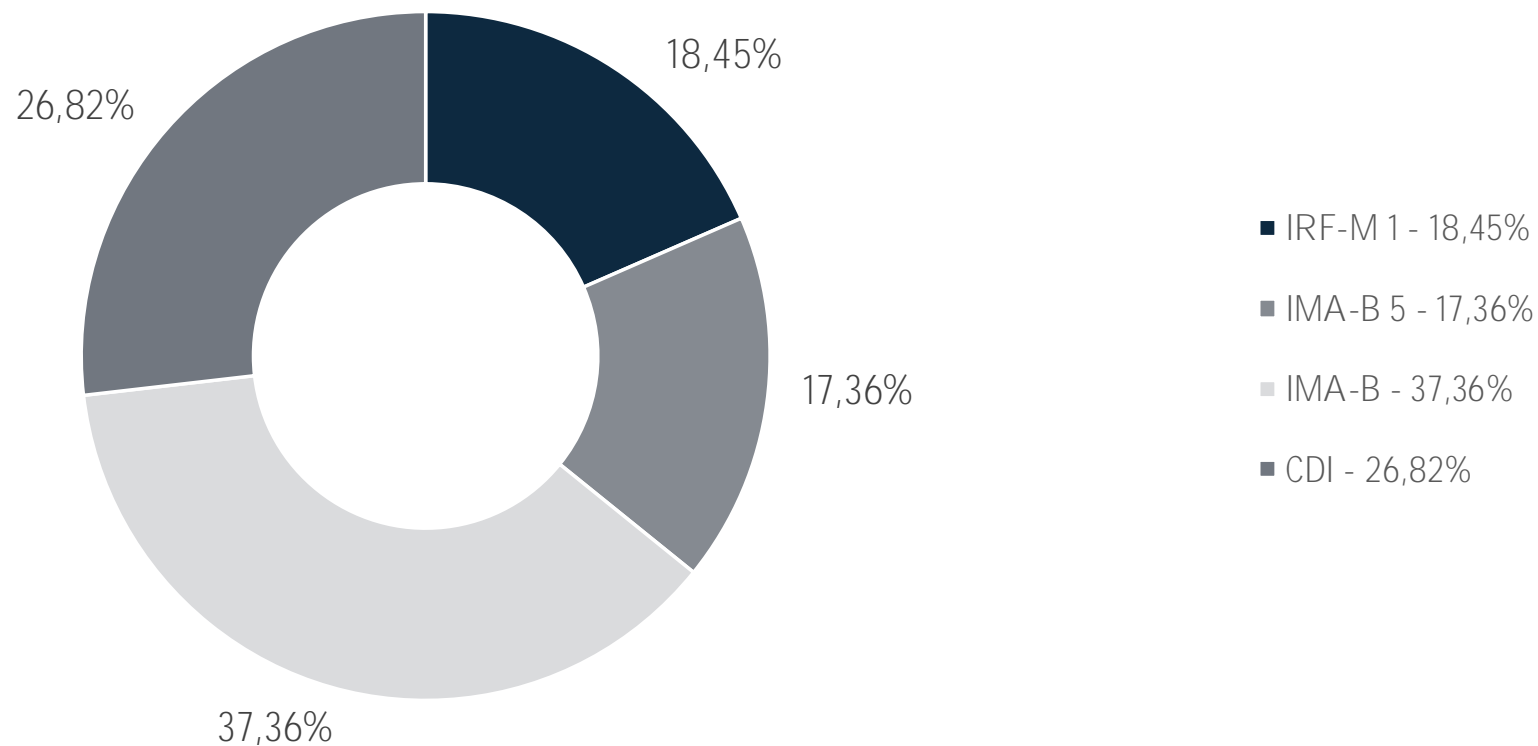


Índice de Sharpe e Var da Carteira

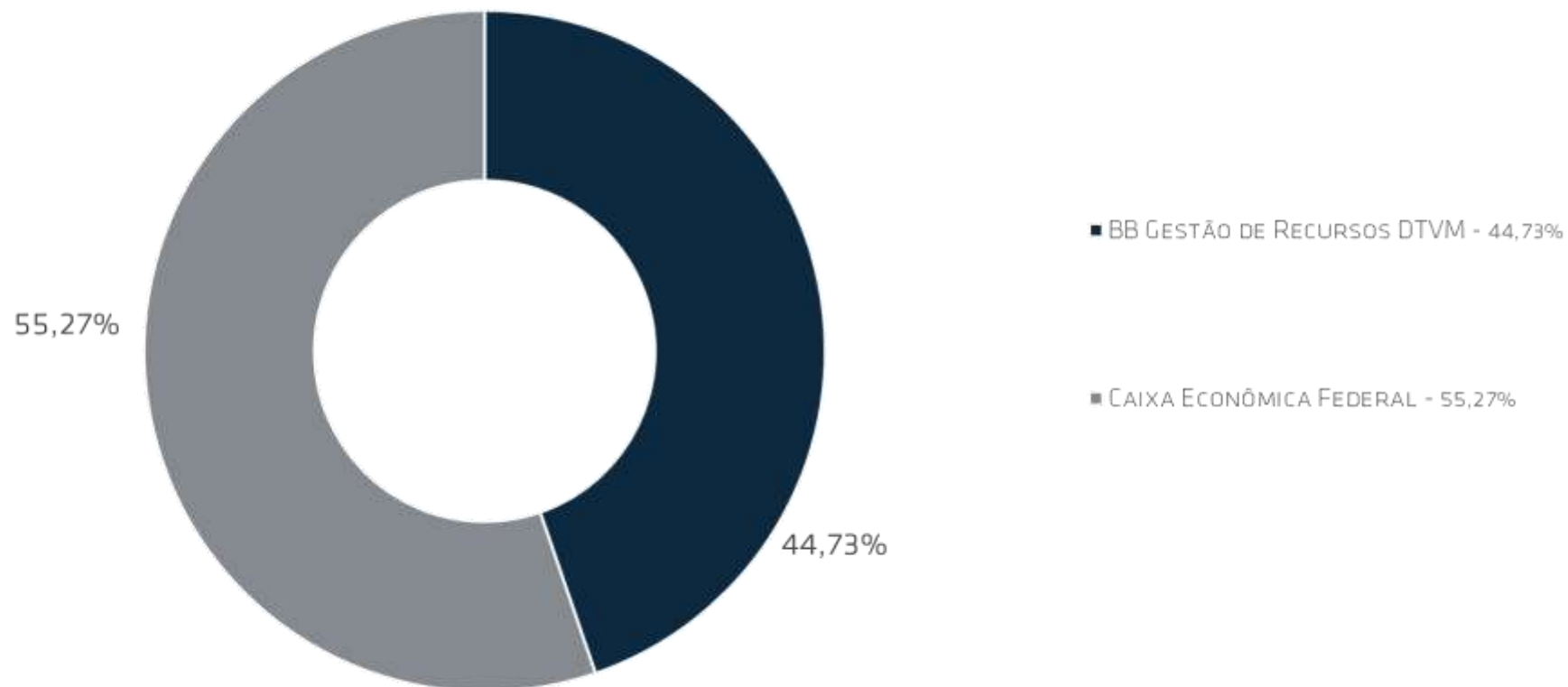


Fundos	CNPJ	Gestão	Taxa de Administração	Benchmark	Resgate
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	01.328.882/0001-35	BB Gestão de Recursos DTVM	0,10%	IRF-M 1	D+0
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.060.913/0001-10	Caixa Econômica Federal	0,20%	IMA-B 5	D+0
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	03.543.447/0001-03	BB Gestão de Recursos DTVM	0,20%	IMA-B	D+1
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	10.646.895/0001-90	Caixa Econômica Federal	0,20%	IMA-B	D+0
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	03.737.206/0001-97	Caixa Econômica Federal	0,20%	CDI	D+0
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.077.418/0001-49	BB Gestão de Recursos DTVM	0,20%	CDI	D+0

Distribuição por Indicador - Janeiro - 2017



DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO - JANEIRO - 2017

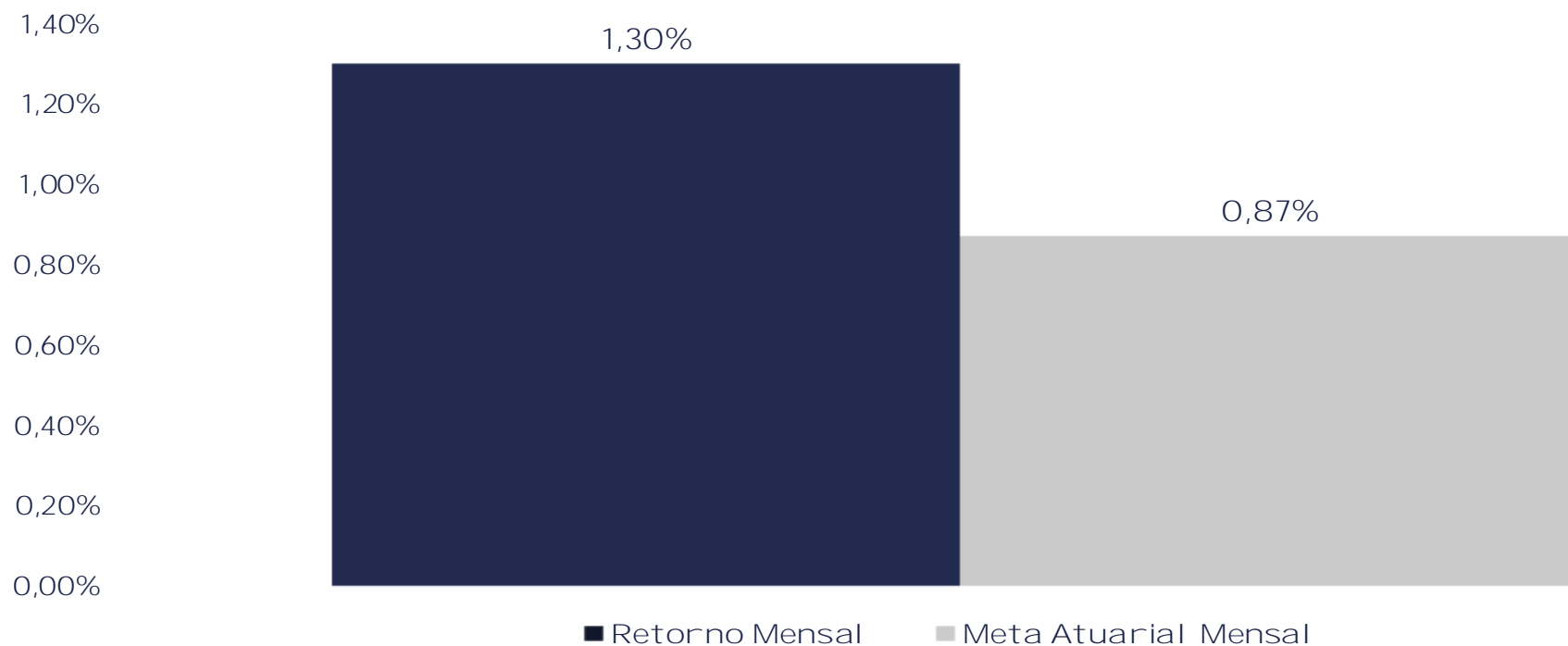


Performance Absoluta

	jan-17	fev-17	mar-17	abr-17	mai-17	jun-17
Carteira	1,30%					
Retorno Financeiro	39.595,39					
Meta Atuarial	0,87%					

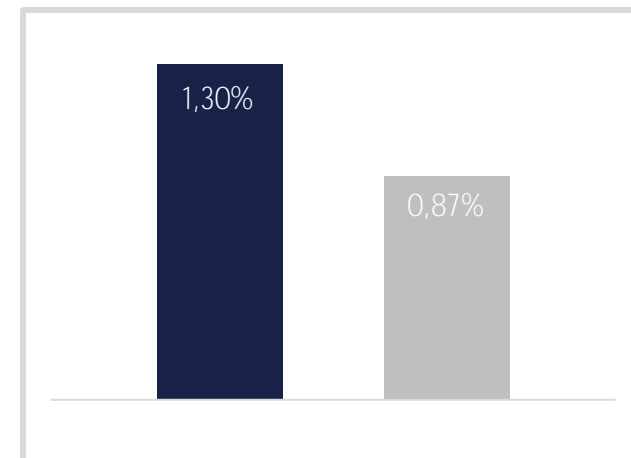
	jul-17	ago-17	set-17	out-17	nov-17	dez-17
Carteira						
Retorno Financeiro						
Meta Atuarial						

Retorno Mensal X Meta Atuarial Mensal



Estatística		
Meses positivos:	1	
Meses negativos:	0	
Meses acima da Meta Atuarial:	1	
Meses abaixo da Meta Atuarial:	0	
Retorno Mensal Máximo	1,30%	jan-17
Retorno Mensal Médio	1,30%	
Retorno Mensal Mínimo	1,30%	jan-17
Sharpe	0,26	
Volatilidade	7,55%	
VaR	-0,50%	
Meta Atuarial	IPCA + 6%	

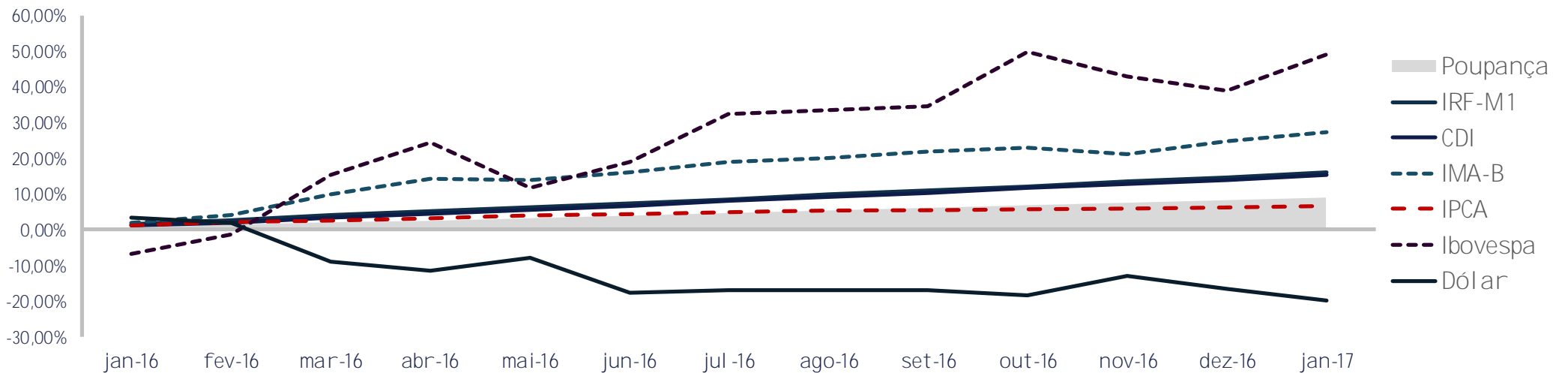
Consolidado - 2017	
Carteira	1,30%
Retorno	R\$ 39.595,39
Meta	0,87%



jan/17

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 18272-9	563.567,80				7.100,96	1,26%	570.668,76
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 281-7	530.852,48				6.038,82	1,14%	536.891,30
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	Ag. 86-8 cc 18272-9	521.839,95				5.937,99	1,14%	527.777,94
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	Ag. 2510 cc 281-7	616.159,82				11.634,12	1,89%	627.793,94
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 cc 281-7	538.991,14				5.790,69	1,07%	544.781,83
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 86-8 cc 18272-9	281.713,70				3.092,81	1,10%	284.806,51
Aplicações		3.053.124,89						3.092.720,28
Imóveis		0,00						0,00
Conta Corrente		0,00						0,00
Caixa 281-7		0,00						0,00
Banco do Brasil 18272-9		0,00						0,00
Final		3.053.124,89	0,00	0,00	0,00	39.595,39	1,30%	3.092.720,28

	IRF-M 1	CDI	IMA-B	IDKA 2	Poupança	IPCA	Ibovespa	Dólar	IPCA + 6%
2016	14,72%	13,99%	24,82%	13,75%	8,31%	6,29%	38,92%	-16,54%	12,67%
fev-16	1,09%	1,00%	2,26%	1,20%	0,60%	0,90%	5,91%	-1,56%	1,39%
mar-16	1,26%	1,16%	5,31%	0,15%	0,72%	0,43%	16,97%	-10,57%	0,92%
abr-16	1,07%	1,05%	3,93%	1,66%	0,63%	0,61%	7,70%	-3,04%	1,10%
mai-16	1,07%	1,11%	-0,10%	0,63%	0,65%	0,78%	-10,09%	4,18%	1,27%
jun-16	1,08%	1,16%	1,93%	0,93%	0,71%	0,35%	6,30%	-10,72%	0,84%
jul-16	1,04%	1,11%	2,51%	0,91%	0,66%	0,52%	11,22%	0,91%	1,01%
ago-16	1,19%	1,21%	0,89%	1,29%	0,76%	0,44%	1,03%	0,04%	0,93%
set-16	1,19%	1,11%	1,57%	1,50%	0,66%	0,08%	0,80%	0,18%	0,57%
out-16	0,94%	1,05%	0,64%	0,41%	0,66%	0,26%	11,23%	-2,01%	0,75%
nov-16	1,05%	1,04%	-1,22%	0,57%	0,64%	0,18%	-4,65%	6,78%	0,67%
dez-16	1,20%	1,12%	2,91%	1,28%	0,69%	0,30%	-2,71%	-4,05%	0,79%
jan-17	1,29%	1,08%	1,87%	1,09%	0,67%	0,38%	7,38%	-4,05%	0,87%
2017	1,29%	1,08%	1,87%	1,09%	0,67%	0,38%	7,38%	-4,05%	0,87%



CENÁRIO ECONÔMICO JANEIRO 2017

EUROPA

A PRIMEIRA-MINISTRA BRITÂNICA, THERESA MAY, ANUNCIOU QUE VAI ATIVAR O PROCEDIMENTO DE SAÍDA DO REINO UNIDO DA UNIÃO EUROPEIA ATÉ O MÊS DE ABRIL.

FRANÇA SE PREPARA PARA AS ELEIÇÕES PRESIDENCIAIS EM ABRIL. MARINE LE PEN, DO PARTIDO DE EXTREMA-DIREITA, LIDERA AS INTENÇÕES DE VOTO E SINALIZA A RETIRADA DA FRANÇA DA ZONA DO EURO. ALEMANHA TAMBÉM PASSARÁ POR ELEIÇÕES EM SETEMBRO E JÁ ESTÃO DEFINIDOS OS CANDIDATOS DE CADA PARTIDO.

O FÓRUM ECONÔMICO MUNDIAL DE DAVOS, UM DOS PRINCIPAIS EVENTOS PARA DISCUSSÃO DE ASSUNTOS INTERNACIONAIS, CONTOU COM A PARTICIPAÇÃO DE ILAN GOLDFAJN, QUE APONTOU A PERSPECTIVA DA RETOMADA DO RATING DE INVESTIMENTO DO BRASIL.

CHINA

RESULTADOS NA CHINA CHAMAM ATENÇÃO. A BOLSA LOCAL ENCERROU O DIA 13 EM QUEDA DE 6% DEVIDO À ESPERA DE QUE VÁRIOS IPOs (INGRESSO DE NOVAS EMPRESAS NA BOLSA DE VALORES) SEJAM LANÇADOS EM BREVE, CAUSANDO UM EXCESSO DE OFERTA DE AÇÕES E ILIQUIDEZ NO MERCADO. HOUE TAMBÉM UM BAIXO SALDO NA BALANÇA COMERCIAL, EM CONTRAPONTO AOS BONS RESULTADOS DOS INDICADORES DE ATIVIDADE ECONÔMICA. O GOVERNO PRETENDE DIMINUIR A ALAVANCAGEM FINANCEIRA NO PAÍS, IMPONDO RESTRIÇÕES AO CRÉDITO E SAÍDA DE DIVISAS. O ESTOQUE DE CRÉDITO SUBIU EM 2015 O EQUIVALENTE AO PIB DA ITÁLIA.

NESTE ANO TAMBÉM PODEM OCORRER MUDANÇAS NA CÚPULA DO PARTIDO COMUNISTA CHINÊS. NO ENTANTO, XI JINPING, O ATUAL PRESIDENTE, PRETENDE MANTER SUA POSIÇÃO.

ESTADOS UNIDOS

AS NOTÍCIAS DO MÊS FORAM VOLTADAS PARA A POSSE DE DONALD TRUMP COMO NOVO PRESIDENTE DOS EUA. EM MEIO À DIVERSOS DISCURSOS E SINALIZAÇÕES, TRUMP CAUSOU POLÊMICA AO DECIDIR SOBRE A CONSTRUÇÃO IMEDIATA DO MURO NA FRONTEIRA COM O MÉXICO, RETIRADA DOS EUA DA PARCERIA DO TRANSPACÍFICO E SUSPENSÃO TEMPORÁRIA DE ENTRADA DE NOVOS IMIGRANTES NO PAÍS.

MESMO COM AS CONTURBADAS NOTÍCIAS DO PRESIDENTE AMERICANO, O MERCADO SEGUIU APRESENTANDO BONS RESULTADOS, COM A BOLSA LOCAL BATENDO NÍVEIS RECORDES E MELHORA DOS NÍVEIS DE EMPREGO. CENÁRIO QUE FAVORECE A SUBIDA DOS JUROS PELO FED.



BRASIL

O GOVERNO BRASILEIRO APRESENTOU OS DADOS DAS CONTAS PÚBLICAS: (I) DÉFICIT EM CONTA

CORRENTE DE US\$ 23,5 BILHÕES (MENOR RESULTADO DESDE 2007); (II) DÍVIDA PÚBLICA DE R\$ 3,112 TRILHÕES (11,4% MAIOR QUE 2015); (III) DÉFICIT DA PREVIDÊNCIA DE R\$ 149,73 BILHÕES (74,5% MAIOR QUE 2015).

O MÊS TAMBÉM FOI MARCADO PELA MORTE DO MINISTRO DO STF E RELATOR DA LAVA JATO, TEORI ZAVASCKI. O INCIDENTE TROUXE QUESTIONAMENTOS QUANTO AO ANDAMENTO DA OPERAÇÃO LAVA-JATO, MAS SUA SUCESSÃO JÁ FOI ENCAMINHADA PARA CÁRMEM LÚCIA, PRESIDENTE DO STF.

HOUE AINDA A PRISÃO DO EMPRESÁRIO EIKE BATISTA, ACUSADO DE CORRUPÇÃO ATIVA E LAVAGEM DE DINHEIRO EM PAGAMENTO DE PROPINA AO EX-GOVERNADOR DO RIO DE JANEIRO, SÉRGIO CABRAL.

MERCADO

IBOVESPA ROMPEU OS 65 MIL PONTOS E FECHOU O MÊS EM ALTA DE 7,38%, PUXADO PELA ALTA VALORIZAÇÃO DAS AÇÕES DA VALE E INGRESSO DE CAPITAL ESTRANGEIRO.

A PRODUÇÃO DO PETRÓLEO COMEÇOU A SER REDUZIDA PELA OPEP, GERANDO LEVE AUMENTO DE PREÇOS AO LONGO DO MÊS.

NA ÚLTIMA REUNIÃO DO COPOM FOI DEFINIDA A REDUÇÃO DA TAXA SELIC PARA 13% A.A. ESTE MOVIMENTO FAVORECEU AOS INDICADORES DOS TÍTULOS PÚBLICOS DE PRAZO MAIS LONGO, QUE APRESENTARAM RETORNOS INTERESSANTES.

ATENTOS AOS MOVIMENTOS DA TAXA SELIC E A CONTÍNUA QUEDA DA INFLAÇÃO, ESPERA-SE QUE O ANO DE 2017 SEJA DE MENOR META ATUARIAL QUE O ANO ANTERIOR. DESEJAMOS EXCELENTE INVESTIMENTOS A TODOS.



TRINUS

C A P I T A L

CONTATO@TRINUSCAPITAL.COM
WWW.TRINUSCAPITAL.COM