

# Relatório Analítico dos Investimentos em abril de 2017

riskoffice

Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

## Carteira consolidada de investimentos - base (abril / 2017)

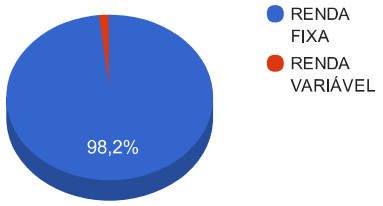
| Produto / Fundo | Disponibilidade Resgate | Carência | Saldo | Particip. S/ Total | Qtde. Cotistas | % S/ PL Fundo | RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014 |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+1 | Não há | 9.070.648,78 | 4,67% | 717 | 0,17% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | D+0 | Não há | 7.647.615,13 | 3,94% | 1.339 | 0,06% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | D+0 | Não há | 7.900.234,44 | 4,07% | 609 | 0,21% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+1 | Não há | 28.601.484,66 | 14,72% | 668 | 0,59% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | D+0 | Não há | 52.230.009,75 | 26,89% | 720 | 0,87% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA | D+0 | Não há | 237.169,95 | 0,12% | 57 | 0,10% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+0 | Não há | 2.092.075,95 | 1,08% | 1.168 | 0,02% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA | D+1 | Não há | 888.187,16 | 0,46% | 77 | 0,04% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+0 | 15/08/2018 | 829.458,05 | 0,43% | 193 | 0,24% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | D+0 | Não há | 30.910.039,08 | 15,91% | 769 | 0,52% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| TMJ IMA-B FI RENDA FIXA | D+31 ou D+1461 | Não há | 590.130,73 | 0,30% | 14 | 0,45% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a " |
| CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP | D+0 | Não há | 15.485.515,40 | 7,97% | 343 | 0,61% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a " |
| BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA | D+0 | Não há | 3.250.748,54 | 1,67% | 83 | 0,35% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a " |
| MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA | D+1800 | Não há | 3.133.342,77 | 1,61% | 15 | 3,22% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a " |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | D+0 | Não há | 25.631.063,95 | 13,20% | 748 | 0,42% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+0 | Não há | 741.849,64 | 0,38% | 754 | 0,02% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| PRASS II FIDC SÊNIOR | D+540 | Não há | 1.473.015,14 | 0,76% | 22 | 1,15% | Artigo 7º, Inciso VI |
| MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR | Não se aplica | Não se aplica | 7.089,37 | 0,00% | 42 | 0,31% | Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a " |
| ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR | Não se aplica | Não se aplica | 90.901,19 | 0,05% | 46 | 0,42% | Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a " |
| WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO | D+5 | Não há | 1.163.313,00 | 0,60% | 33 | 0,45% | Artigo 8º, Inciso IV |
| ÁTICO FLORESTAL - FIP | Não se aplica | Não se aplica | 1.256.241,68 | 0,65% | 21 | 0,71% | Artigo 8º, Inciso V |
| CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11 | Não se aplica | Não se aplica | 1.015.000,00 | 0,52% | | 0,63% | Artigo 8º, Inciso VI |
| | | **TOTAL -** | **194.245.134,36** | | | | |


Risk Office S.A.
Av. Tambore, 267 - 2 - Tamboré - Barueri - SP - Telefone: (11) 3707-9000

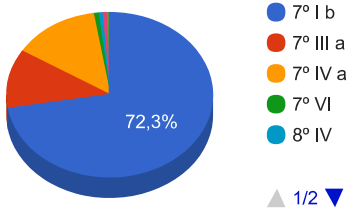
## Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (abril / 2017)

| 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% | 0,00% | 10,00% | 10,00% | 19.424.513,44 |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " | 100,00% | 140.406.922,95 | 72,28% | 0,00% | 90,00% | 90,00% | 34.413.697,97 |
| Artigo 7º, Inciso II | 15,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 5,00% | 9.712.256,72 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a " | 80,00% | 22.459.737,44 | 11,56% | 0,00% | 20,00% | 20,00% | 16.389.289,43 |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " | 30,00% | 26.372.913,59 | 13,58% | 0,00% | 30,00% | 30,00% | 31.900.626,72 |
| Artigo 7º, Inciso VI | 15,00% | 1.473.015,14 | 0,76% | 0,00% | 5,00% | 5,00% | 8.239.241,58 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a " | 5,00% | 97.990,56 | 0,05% | 0,00% | 3,00% | 3,00% | 5.729.363,47 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b " | 5,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 2,00% | 2,00% | 3.884.902,69 |
| Total Renda Fixa | 100,00% | 190.810.579,68 | 98,23% | 0,00 | 165,00 | 165,00 | - |

**Distribuição por Segmento**




**Distribuição por Artigo / Resolução**




| Artigos - Renda Variável | Resolução % | Carteira $ | Carteira % | Estratégia de Alocação | | | GAP Superior |
|---|---|---|---|---|---|---|---|
| | | | | Inferior % | Alvo % | Superior % | |
| Artigo 8º, Inciso I | 30,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 10,00% | 10,00% | 19.424.513,44 |
| Artigo 8º, Inciso II | 20,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 5,00% | 5,00% | 9.712.256,72 |
| Artigo 8º, Inciso III | 15,00% | 0,00 | 0,00% | 0,00% | 15,00% | 15,00% | 29.136.770,15 |
| Artigo 8º, Inciso IV | 5,00% | 1.163.313,00 | 0,60% | 0,00% | 5,00% | 5,00% | 8.548.943,72 |
| Artigo 8º, Inciso V | 5,00% | 1.256.241,68 | 0,65% | 0,00% | 5,00% | 5,00% | 8.456.015,04 |
| Artigo 8º, Inciso VI | 5,00% | 1.015.000,00 | 0,52% | 0,00% | 5,00% | 5,00% | 8.697.256,72 |
| Total Renda Variável | 30,00% | 3.434.554,68 | 1,77% | 0,00 | 45,00 | 45,00 | - |


Risk Office S.A.
Av. Tambore, 267 - 2 - Tamboré - Barueri - SP - Telefone: (11) 3707-9000

## Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

| Artigos - Renda Fixa | Base: abril / 2017 | | Limite Inferior (%) | Limite Superior (%) |
|---|---|---|---|---|
| | Carteira ($) | Carteira (%) | | |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " | 140.406.922,95 | 72,28% | 0,00% | 0,00% |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a " | 22.459.737,44 | 11,56% | 0,00% | 0,00% |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " | 26.372.913,59 | 13,58% | 0,00% | 0,00% |
| Artigo 7º, Inciso VI | 1.473.015,14 | 0,76% | 0,00% | 0,00% |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a " | 97.990,56 | 0,05% | 0,00% | 0,00% |
| Total Renda Fixa | 190.810.579,68 | 98,23% | 0,00 | 0,00 |

| Artigos - Renda Variável | Base: abril / 2017 | | Limite Inferior (%) | Limite Superior (%) |
|---|---|---|---|---|
| | Carteira ($) | Carteira (%) | | |
| Artigo 8º, Inciso IV | 1.163.313,00 | 0,60% | 0,00% | 0,00% |
| Artigo 8º, Inciso V | 1.256.241,68 | 0,65% | 0,00% | 0,00% |
| Artigo 8º, Inciso VI | 1.015.000,00 | 0,52% | 0,00% | 0,00% |
| Total Renda Variável | 3.434.554,68 | 1,77% | 0,00 | 0,00 |


Risk Office S.A.
Av. Tambore, 267 - 2 - Tamboré - Barueri - SP - Telefone: (11) 3707-9000

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

| | Mês | Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | Taxa adm | VaR - Mês | Volatilidade - 12 meses |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| CDI + 3,50% ao ano | 1,03% | 4,99% | 3,55% | 7,89% | 17,40% | 38,30% | - | - | - |
| MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR | -0,24% | -61,53% | -12,49% | -28,87% | -41,50% | -62,63% | 0,20% | 6,003% | 120,17% |
| ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR | -3,52% | -8,56% | -7,92% | -15,73% | -74,53% | -67,19% | 0,39% | 0,595% | 69,48% |
| IDKA IPCA 2 Anos | 0,92% | 5,08% | 3,95% | 7,03% | 13,24% | 34,55% | - | - | - |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,79% | 4,15% | 3,11% | 6,03% | 12,75% | - | 0,20% | 0,309% | 1,20% |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0,79% | 4,64% | 3,54% | 6,53% | 12,81% | 33,04% | 0,20% | 0,465% | 1,76% |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,76% | 4,66% | 3,54% | 6,53% | 12,72% | 32,84% | 0,20% | 0,481% | 1,83% |
| IRF-M 1 | 0,87% | 4,36% | 3,04% | 6,72% | 13,86% | 30,56% | - | - | - |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 0,86% | 4,30% | 3,00% | 6,61% | 13,65% | 30,13% | 0,20% | 0,157% | 0,29% |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,86% | 4,27% | 2,97% | 6,56% | 13,53% | 29,85% | 0,10% | 0,162% | 0,29% |
| ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA | 0,85% | 4,25% | 2,96% | 6,55% | 13,54% | 29,71% | 0,20% | 0,158% | 0,29% |
| BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA | 0,85% | 4,28% | 2,99% | 6,59% | 13,64% | 29,96% | 0,20% | 0,162% | 0,29% |
| CDI | 0,79% | 3,84% | 2,72% | 6,09% | 13,45% | 29,16% | - | - | - |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 0,79% | 3,87% | 2,77% | 6,12% | 13,47% | 29,25% | 0,20% | 0,018% | 0,06% |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,78% | 3,89% | 2,77% | 6,17% | 13,57% | 29,27% | 0,20% | 0,015% | 0,18% |
| IMA-B 5 | 0,71% | 4,83% | 3,63% | 6,72% | 13,17% | 33,32% | - | - | - |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0,70% | 4,77% | 3,59% | 6,62% | 12,96% | 32,50% | 0,20% | 0,516% | 2,06% |


Risk Office S.A.
Av. Tambore, 267 - 2 - Tamboré - Barueri - SP - Telefone: (11) 3707-9000

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

| | Mês | Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | Taxa adm | VaR - Mês | Volatilidade - 12 meses |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA | 0,68% | 4,70% | 3,54% | 6,52% | 12,74% | 32,23% | 0,40% | 0,517% | 2,05% |
| MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA | 0,19% | 1,39% | 0,49% | 4,97% | 13,30% | 24,21% | 1,30% | - | - |
| IPCA + 7,00% ao ano | 0,63% | 3,33% | 2,33% | 5,00% | 11,34% | 30,12% | - | - | - |
| PRASS II FIDC SÊNIOR | 1,06% | 5,18% | 3,67% | 7,15% | 14,00% | 33,18% | 1,70% | 0,018% | - |
| IRF-M | 0,53% | 6,48% | 4,10% | 8,79% | 17,62% | 36,41% | - | - | - |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,50% | 6,42% | 4,03% | 8,65% | 17,43% | 35,83% | 0,20% | 1,156% | 3,09% |
| IMA-B | -0,32% | 6,55% | 4,60% | 8,31% | 16,59% | 36,72% | - | - | - |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | -0,34% | 6,47% | 4,54% | 8,25% | 16,41% | 34,52% | 0,20% | 1,894% | 5,83% |
| TMJ IMA-B FI RENDA FIXA | -0,52% | 4,68% | 3,32% | 6,60% | 13,84% | 30,56% | 1,30% | 1,344% | 5,02% |
| CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP | -0,53% | 6,18% | 4,21% | 7,90% | 16,38% | 34,80% | 0,20% | 1,855% | 5,57% |


Risk Office S.A.
Av. Tambore, 267 - 2 - Tamboré - Barueri - SP - Telefone: (11) 3707-9000

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

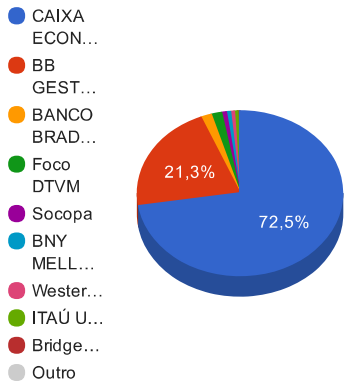
| | Mês | Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | Taxa adm | VaR - Mês | Volatilidade - 12 meses |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| CDI | 0,79% | 3,84% | 2,72% | 6,09% | 13,45% | 29,16% | - | - | - |
| WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO | 0,55% | 4,09% | 2,16% | 6,64% | 16,15% | 37,00% | 2,00% | 0,793% | 1,81% |
| IFIX | 0,15% | 9,17% | 5,22% | 7,96% | 30,95% | 45,67% | - | - | - |
| CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11 | -3,33% | -0,49% | -1,46% | -3,30% | 21,27% | 35,33% | 1,20% | 8,214% | 23,37% |
| Não Informado | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| ÁTICO FLORESTAL - FIP | - | - | - | - | - | - | 1,50% | 0,000% | 0,01% |



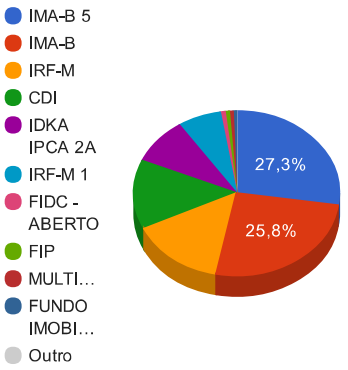
Risk Office S.A.
Av. Tambore, 267 - 2 - Tamboré - Barueri - SP - Telefone: (11) 3707-9000

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

| Administrador | Valor | % |
|---|---|---|
| CAIXA ECONÔMICA FEDERAL | 140.819.477,75 | 72,50% |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM | 41.335.517,08 | 21,28% |
| BANCO BRADESCO | 3.250.748,54 | 1,67% |
| Foco DTVM | 3.133.342,77 | 1,61% |
| Socopa | 1.473.015,14 | 0,76% |
| BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS | 1.256.241,68 | 0,65% |
| Western Asset | 1.163.313,00 | 0,60% |
| ITAÚ UNIBANCO | 1.125.357,11 | 0,58% |
| Bridge Trust | 590.130,73 | 0,30% |
| BRL Trust Investimentos | 90.901,19 | 0,05% |
| CITIBANK DTVM | 7.089,37 | 0,00% |




| Sub-segmento | Valor | % |
|---|---|---|
| IMA-B 5 | 53.118.196,91 | 27,35% |
| IMA-B | 50.119.027,98 | 25,80% |
| IRF-M | 28.601.484,66 | 14,72% |
| CDI | 26.372.913,59 | 13,58% |
| IDKA IPCA 2A | 17.800.341,27 | 9,16% |
| IRF-M 1 | 13.227.609,57 | 6,81% |
| FIDC - ABERTO | 1.473.015,14 | 0,76% |
| FIP | 1.256.241,68 | 0,65% |
| MULTIMERCADO | 1.163.313,00 | 0,60% |
| FUNDO IMOBILIÁRIO | 1.015.000,00 | 0,52% |
| FIDC - FECHADO | 97.990,56 | 0,05% |

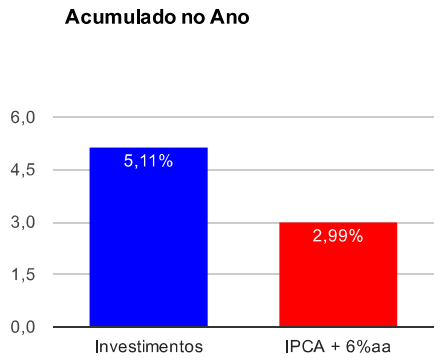


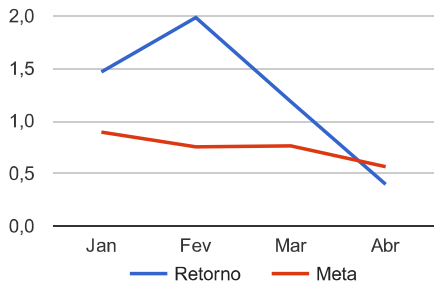


Risk Office S.A.
Av. Tamboré, 267 - 2 - Tamboré - Barueri - SP - Telefone: (11) 3707-9000

## Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2017

| Mês | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno ($) | Retorno (%) | Meta (%) | Gap (%) | VaR (%) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| Janeiro | 176.426.263,36 | 3.845.430,28 | 329.839,39 | 182.576.997,07 | 2.635.142,82 | 1,46% | 0,89% | 164,54% | 1,60% |
| Fevereiro | 182.576.997,07 | 2.039.022,46 | 518.458,91 | 187.752.127,21 | 3.654.566,59 | 1,99% | 0,75% | 264,68% | 0,94% |
| Março | 187.752.127,21 | 2.156.479,69 | 376.820,07 | 191.768.083,95 | 2.236.297,12 | 1,18% | 0,76% | 154,34% | 1,08% |
| Abril | 191.768.083,95 | 2.082.428,77 | 372.191,96 | 194.245.134,36 | 766.813,60 | 0,40% | 0,56% | 71,07% | 0,88% |
| Acumulado no ano | | | | | 9.292.820,13 | 5,11% | 2,99% | 170,78% | |






Risk Office S.A.
Av. Tamboré, 267 - 2 - Tamboré - Barueri - SP - Telefone: (11) 3707-9000

## Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de abril / 2017

| Ativos de Renda Fixa | Sado Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R$) | Retorno (%) | VaR - Mês (%) | Instituição(%) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| PRASS II FIDC SÊNIOR | 1.457.621,83 | 0,00 | 0,00 | 1.473.015,14 | 15.393,31 | 1,06% | 0,02% | 1,06% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 7.582.225,83 | 0,00 | 0,00 | 7.647.615,13 | 65.389,30 | 0,86% | 0,16% | 0,86% |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 2.074.316,73 | 0,00 | 0,00 | 2.092.075,95 | 17.759,22 | 0,86% | 0,16% | 0,86% |
| ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA | 235.162,95 | 0,00 | 0,00 | 237.169,95 | 2.007,00 | 0,85% | 0,16% | 0,85% |
| BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA | 3.223.362,13 | 0,00 | 0,00 | 3.250.748,54 | 27.386,41 | 0,85% | 0,16% | 0,85% |
| ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR | 94.219,61 | 0,00 | 4.105,99 | 90.901,19 | 787,57 | 0,84% | 0,59% | 0,87% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 822.969,77 | 0,00 | 0,00 | 829.458,05 | 6.488,28 | 0,79% | 0,31% | 0,79% |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 7.838.556,76 | 0,00 | 0,00 | 7.900.234,44 | 61.677,68 | 0,79% | 0,46% | 0,79% |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 736.087,95 | 0,00 | 0,00 | 741.849,64 | 5.761,69 | 0,78% | 0,01% | 0,78% |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 9.002.013,97 | 0,00 | 0,00 | 9.070.648,78 | 68.634,81 | 0,76% | 0,48% | 0,76% |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 23.716.202,81 | 2.082.428,77 | 360.485,97 | 25.631.063,95 | 192.918,34 | 0,75% | 0,02% | 0,79% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 51.868.794,39 | 0,00 | 0,00 | 52.230.009,75 | 361.215,36 | 0,70% | 0,52% | 0,70% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA | 882.173,29 | 0,00 | 0,00 | 888.187,16 | 6.013,87 | 0,68% | 0,52% | 0,68% |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 28.458.792,26 | 0,00 | 0,00 | 28.601.484,66 | 142.692,40 | 0,50% | 1,16% | 0,50% |
| MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA | 3.127.264,77 | 0,00 | 0,00 | 3.133.342,77 | 6.078,00 | 0,19% | - | - |
| MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR | 7.106,19 | 0,00 | 0,00 | 7.089,37 | -16,82 | -0,24% | 6,00% | -0,24% |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 31.015.829,44 | 0,00 | 0,00 | 30.910.039,08 | -105.790,36 | -0,34% | 1,89% | -0,34% |
| TMJ IMA-B FI RENDA FIXA | 593.189,25 | 0,00 | 0,00 | 590.130,73 | -3.058,52 | -0,52% | 1,34% | -0,52% |
| CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP | 15.567.575,88 | 0,00 | 0,00 | 15.485.515,40 | -82.060,48 | -0,53% | 1,85% | -0,53% |
| | | | Total Renda Fixa | | 789.277,06 | 0,42% | 0,85% | |


Risk Office S.A.
Av. Tambore, 267 - 2 - Tamboré - Barueri - SP - Telefone: (11) 3707-9000

## Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de abril / 2017

| Ativos de Renda Variável | Sado Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (R$) | Retorno (%) | VaR - Mês (%) | Instituição(%) |
|---|---|---|---|---|---|---|---|---|
| WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO | 1.156.953,37 | 0,00 | 0,00 | 1.163.313,00 | 6.359,63 | 0,55% | 0,79% | 0,55% |
| ÁTICO FLORESTAL - FIP | 1.257.664,77 | 0,00 | 0,00 | 1.256.241,68 | -1.423,09 | -0,11% | 0,00% | -0,11% |
| CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11 | 1.050.000,00 | 0,00 | 7.600,00 | 1.015.000,00 | -27.400,00 | -2,61% | 8,21% | -3,33% |
| | | | Total Renda Variável | | -22.463,46 | -0,65% | 2,70% | |


Risk Office S.A.
Av. Tambore, 267 - 2 - Tamboré - Barueri - SP - Telefone: (11) 3707-9000