



**TRINUS**

C A P I T A L

**FUNDO DE PREVIDÊNCIA DOS  
SERVIDORES DO MUNICÍPIO DE  
APARECIDA DE GOIÂNIA**

Fevereiro - 2017

## Dados do Ente Federativo

Ente Federativo	<b>Prefeitura Municipal de Aparecida de Goiânia</b>
CNPJ	01.005.727/0001-24
Endereço	RUA GERVASIO PINHEIRO APM
E-mail	contato@aparecidaprev.com.br
Telefone	3238-6900
Prefeito	GUSTAVO MENDANHA MELO
Início da Gestão	-
E-mail	contato@aparecidaprev.com.br

## Dados da Unidade Gestora do RPPS do Município de Aparecida de Goiânia

Unidade Gestora	<b>FUNDO DE PREVIDENCIA DOS SERVIDORES DE APARECIDA DE GOIÂNIA</b>
Nome Fantasia	<b>Aparecida Prev</b>
CNPJ	07.481.455/0001-15
Endereço	Avenida Santana Qd 01 Lt 04/05
CEP	74987-828
Telefone	3545-5934
E-mail	khayoapprev@hotmail.com

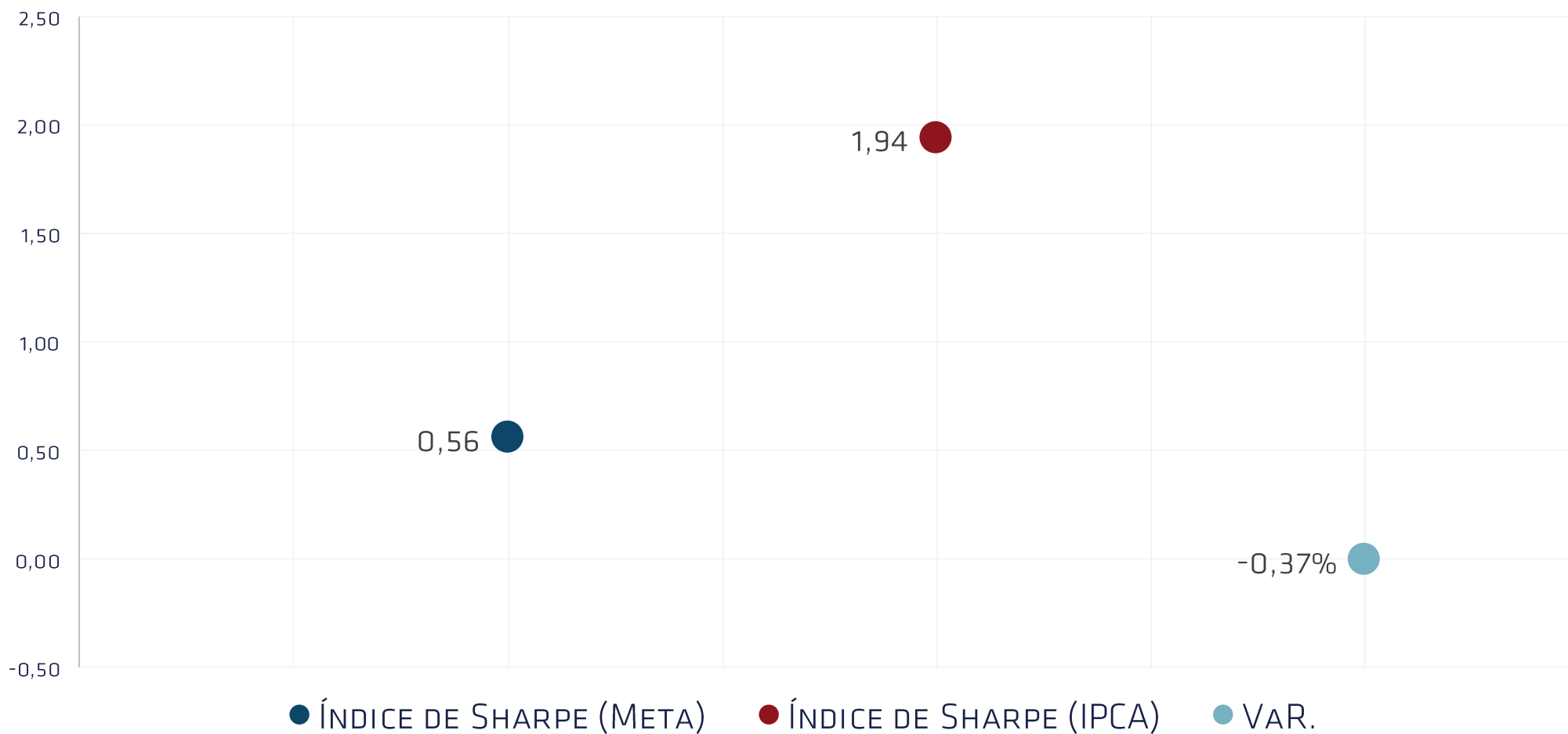
Representante Legal	<b>TARCISIO FRANCISCO DOS SANTOS</b>	Gestor de Recursos	<b>TARCISIO FRANCISCO DOS SANTOS</b>
Cargo	Presidente	Cargo	Presidente
Início da Gestão	01/01/17	Início da Gestão	01/01/2017
E-mail	tarcisiofr.adv@bol.com.br	E-mail	tarcisiofr.adv@bol.com.br
Telefone	(62)3545-5934	Telefone	(62)3545-5934
Certificação	ANBIMA CPA 10	Certificação	ANBIMA CPA 10
Validade		Validade	

## Membros da Unidade Gestora do RPPS do Município de Aparecida de Goiânia

Comitê de Investimentos	Cargo	Conselho	Cargo
Khayo Eduardo Pires de Oliveira	Membro Comitê Efetivo	Roosevelt Santos Paiva	Membro Conselho Efet
Cleiton Correa dos Santos	Membro Comitê Efetivo	Alzeni Cardoso de Cirqueira	Membro Conselho Efet
Julio Cesar Chagas	Membro Comitê Efetivo	João Gonsalves Pereira Neto	Membro Conselho Efet
		Ademir Vagetti	Membro Conselho Efet
		Cristiany Lopes Ferreira	Membro Conselho Efet
		Jose Marcos do Vale Freire	Membro Conselho Efet
		Osmar Ramos	Membro Conselho Efet
		Delson Vieira dos Santos	Membro Conselho Efet
		Maria de Souza Ataidés de Almeida	Membro Conselho Sup
		Claudineide Batista	Membro Conselho Efet
		Khayo Eduardo Pires de Oliveira	Membro Conselho Efet
		Cleiton Correa dos Santos	Membro Conselho Efet
		Julio Cesar Chagas	Membro Conselho Efet



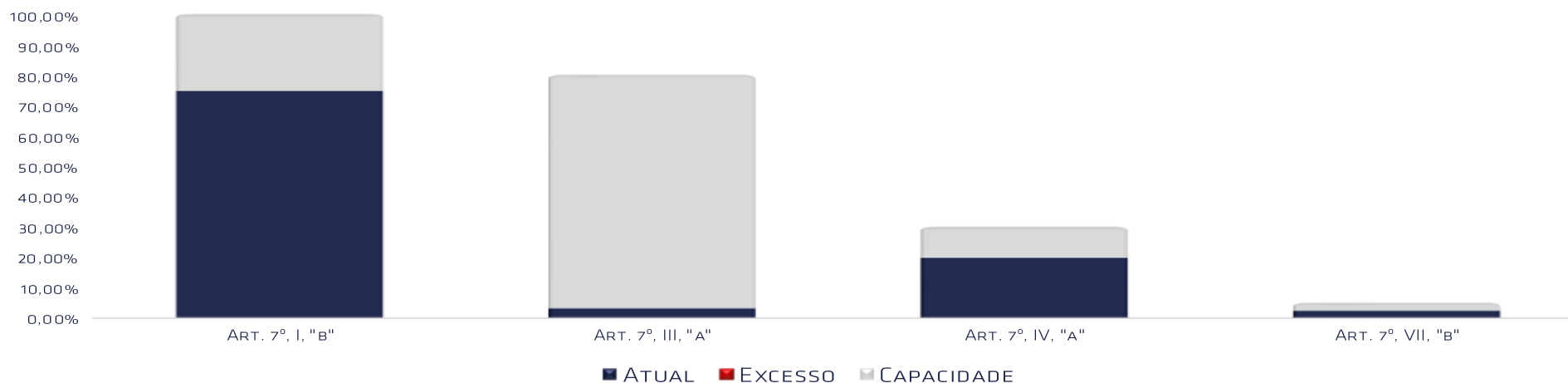
# ÍNDICE DE SHARPE E VAR DA CARTEIRA



Fundos	Saldo no Mês	% do RPPS	Lt. do RPPS	Lt. por fundo	Status
<b>Renda Fixa</b>	<b>219.190.947,16</b>	<b>100,00%</b>	<b>100%</b>		
<b>Art. 7º, I, "a" - Títulos Públicos Federais - SELIC</b>	0,00	0,00%	100%		OK
<b>Art. 7º, I, "b" - FI (100% TPF) - IMA ou IDKA</b>	163.765.285,25	74,71%	100%		OK
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	20.845.759,98	9,51%			
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.482.266,15	1,13%			
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	33.242.491,31	15,17%			
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.394.157,44	2,00%			
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.486.778,00	2,50%			
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	81.819.416,38	37,33%			
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.187.313,58	1,91%			
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.444.615,67	2,48%			
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.862.486,74	2,67%			
<b>Art. 7º, II - Compromissadas</b>	0,00	0,00%	15%		OK
<b>Art. 7º, III, "a" - FI Referenciado RF ou RF - IMA ou IDK,</b>	6.896.180,36	3,15%	80%	20% POR FUNDO	OK
TOP FI RENDA FIXA	6.896.180,36	3,15%			
<b>Art. 7º, III, "b" - FI de Índices RF - IMA ou IDKA</b>	0,00	0,00%	80%	20% POR FUNDO	OK
<b>Art. 7º, IV, "a" - FI Referenciado RF ou RF</b>	43.357.513,55	19,78%	30%	20% POR FUNDO	OK
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	68.061,33	0,03%			
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	11.908.002,16	5,43%			
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	5.358.493,54	2,44%			
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	707.023,53	0,32%			
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.961.308,31	3,63%			
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	51.456,79	0,02%			
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.028,59	0,00%			
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.507.352,43	0,69%			
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.169.510,54	6,92%			
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	624.043,88	0,28%			
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	232,45	0,00%			
<b>Art. 7º, IV, "b" - FI de Índices RF</b>	0,00	0,00%	30%	20% POR FUNDO	OK

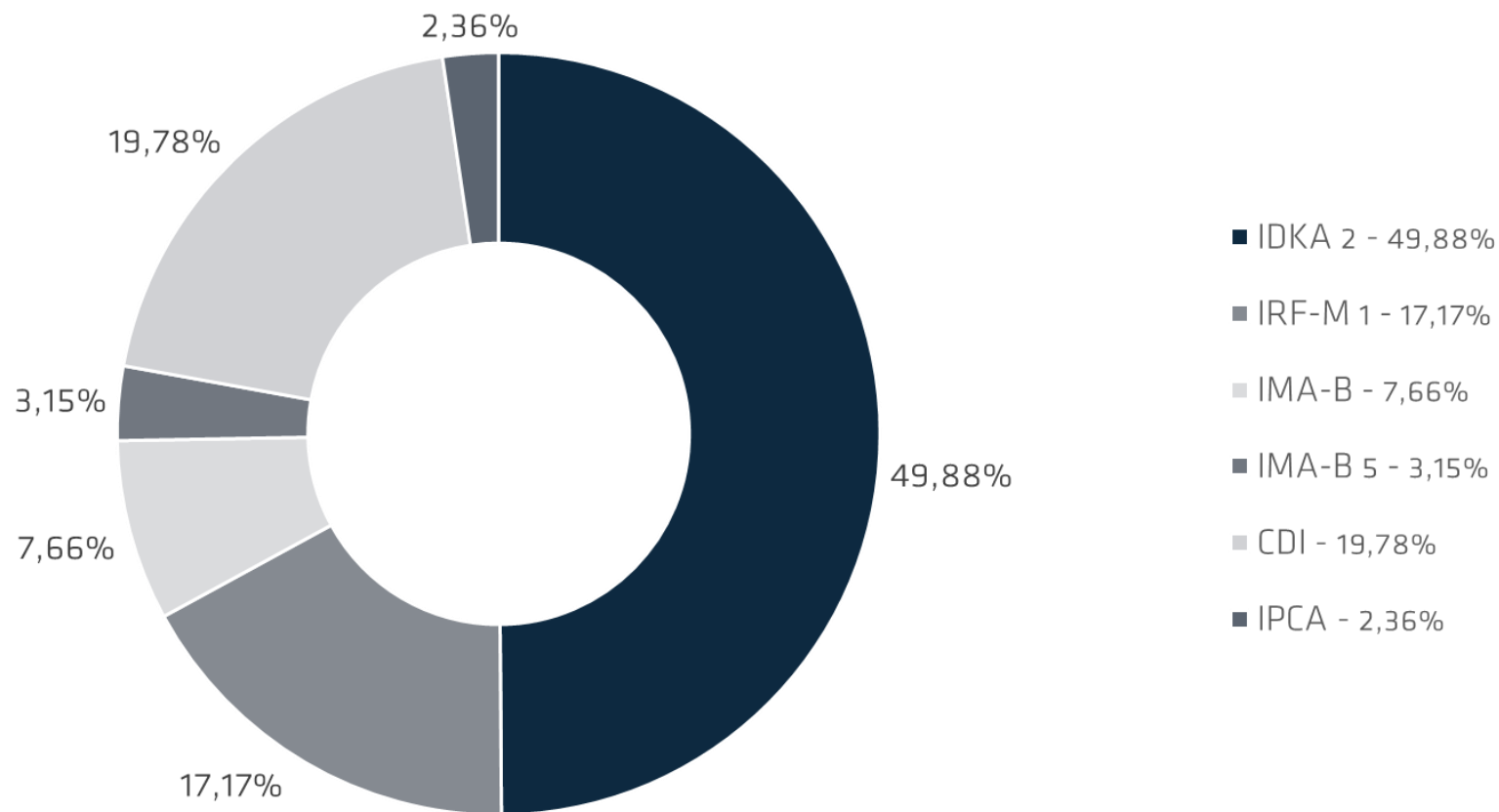
Art. 7º, V, "a" - Poupança	0,00	0,00%	20%	OK
Art. 7º, V, "b" - LIG - Letras Imobiliárias Garantidas	0,00	0,00%	20%	OK
Art. 7º, VI - FIDC Aberto	0,00	0,00%	15%	OK
Art. 7º, VII, "a" - FIDC Fechado	0,00	0,00%	5%	OK
Art. 7º, VII, "b" - FI Crédito Privado	5.171.968,00	2,36%	5%	OK
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	5.171.968,00	2,36%		
<b>Renda Variável</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>30%</b>	
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	0,00	0,00%	5%	OK
Art. 8º, VI - FI Imobiliário - FII	0,00	0,00%	5%	OK
Não Enquadra	0,00	0,00%		OK
<b>Aplicações</b>	<b>219.190.947,16</b>	<b>100,00%</b>		
<b>Imóveis</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>		
Art. 3º - Integralização em Imóveis	0,00	0,00%		OK
<b>Conta Corrente</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>		
<b>CARTEIRA</b>	<b>219.190.947,16</b>	<b>100,00%</b>		

## DISPONIBILIDADE 3.922



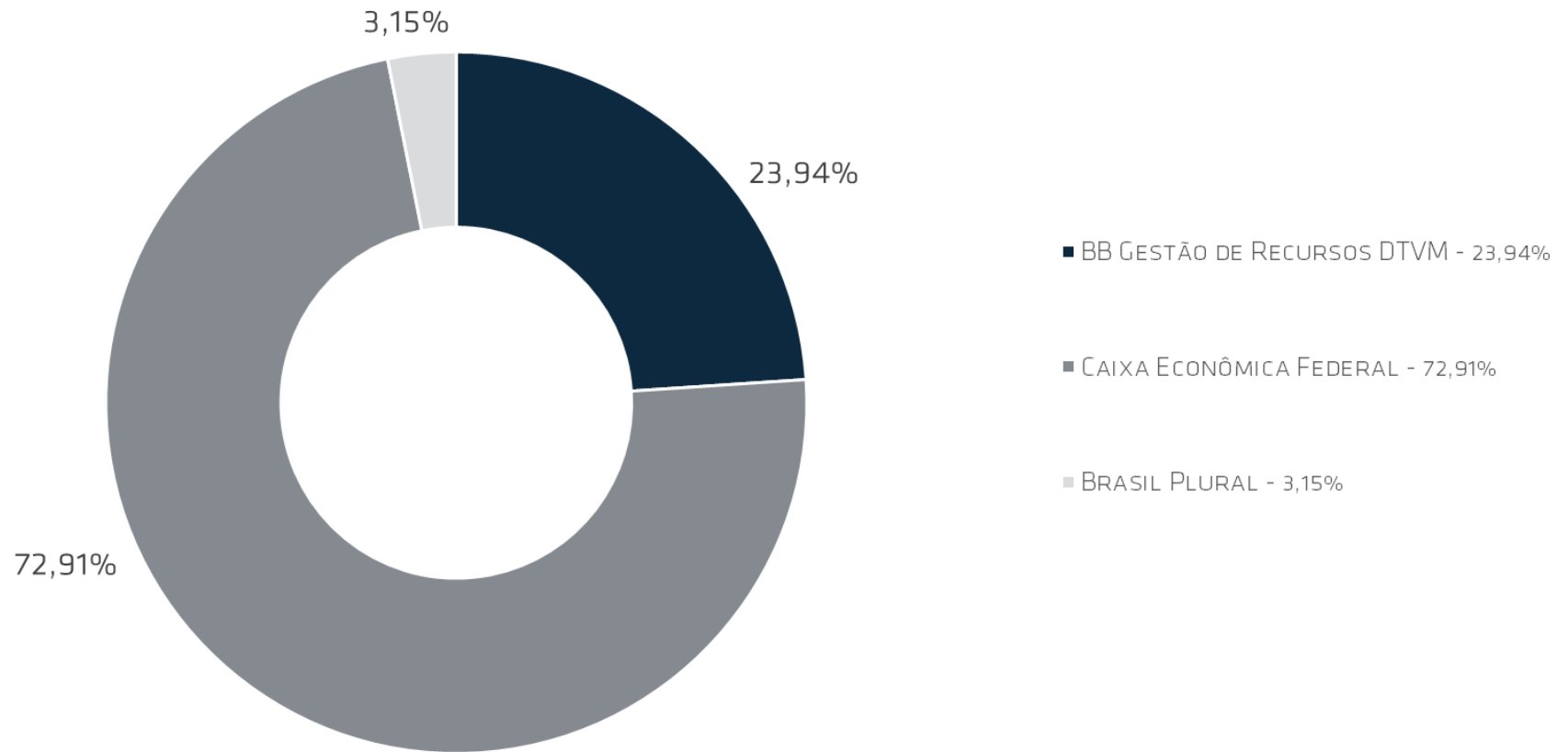
FUNDOS	CNPJ	GESTÃO	TAXA DE ADMINISTRAÇÃO	BENCHMARK	RESGATE
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.322.205/0001-35	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	0,20%	IDKA 2	D+1
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.740.670/0001-06	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	0,20%	IRF-M 1	D+0
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.328.882/0001-35	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	0,10%	IRF-M 1	D+0
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	19.768.682/0001-05	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	0,20%	IMA-B	D+0
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	14.386.926/0001-71	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	0,20%	IDKA 2	D+0
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	21.919.953/0001-28	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	0,20%	IMA-B	D+0
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	20.139.595/0001-78	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	0,20%	IMA-B	D+0
TOP FI RENDA FIXA	10.355.516/0001-02	BRASIL PLURAL	0,90%	IMA-B 5	D+1473
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.077.415/0001-05	BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	1,00%	CDI	D+0
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	33.737.206/0001-97	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
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	14.508.643/0001-55	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	0,80%	CDI	D+0
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	21.918.896/0001-62	CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	0,20%	IPCA	D+0

## DISTRIBUIÇÃO POR INDICADOR - FEVEREIRO - 2017





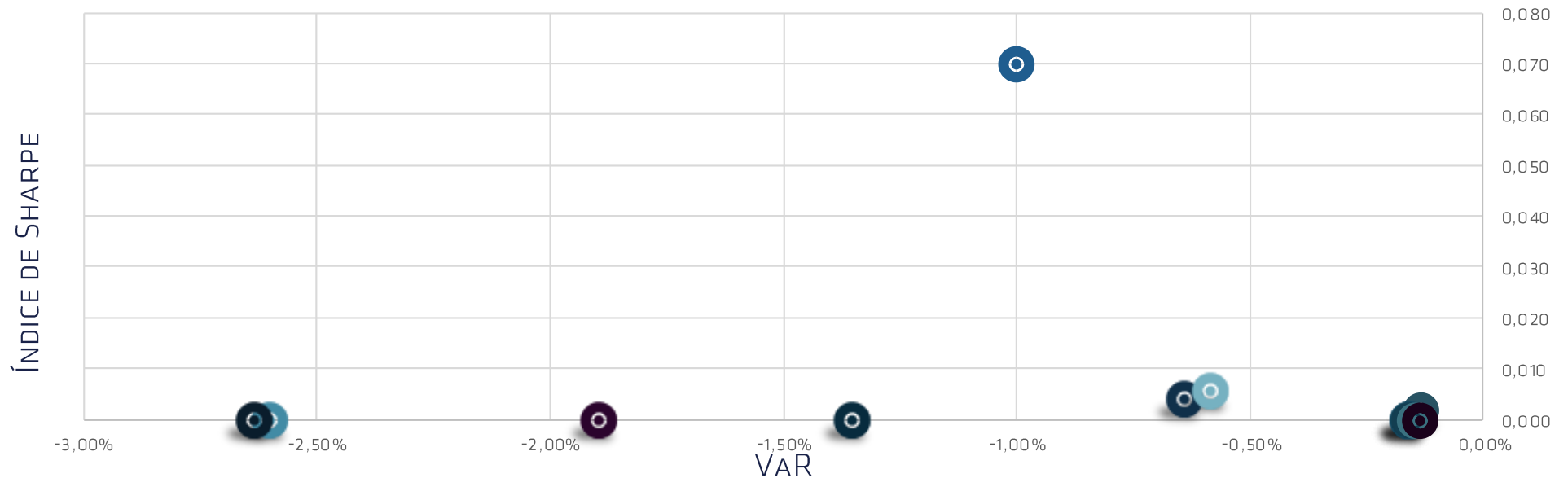
## DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO - FEVEREIRO - 2017



# APLICAÇÕES DO FUNDO DE PREVIDENCIA DOS SERVIDORES DE APARECIDA DE GOIÂNIA

ATIVOS	CC VINCULADA	DATA DA APLICAÇÃO	APLICAÇÃO INICIAL	VALOR ATUAL
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI	AG. 1452-4 CC 32049-8	ANTERIOR A 2015	R\$ 15.352.950,84	R\$ 20.845.759,98
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI	AG. 1452-4 CC 32050-1	ABR/16	R\$ 2.240.000,00	R\$ 2.482.266,15
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS	AG. 2510 CC 142-0	MAR/15	R\$ 21.478.371,02	R\$ 33.242.491,31
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA	AG. 1452-4 CC 32049-8	ANTERIOR A 2015	R\$ 3.333.942,84	R\$ 4.394.157,44
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS I		MAR/15	R\$ 4.500.000,00	R\$ 5.486.778,00
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚB	AG. 2510 CC 142-0	FEV/16	R\$ 1.978.944,38	R\$ 81.819.416,38
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚB	AG. 2510 CC 143-8	FEV/16	R\$ 106.797,24	R\$ 4.187.313,58
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS		FEV/16	R\$ 5.000.000,00	R\$ 5.444.615,67
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS		FEV/16	R\$ 5.000.000,00	R\$ 5.862.486,74
TOP FI RENDA FIXA		ANTERIOR A 2015	R\$ 6.983.283,51	R\$ 6.896.180,36
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁF	AG. 1452-4 CC 32049-8	ANTERIOR A 2015	R\$ 552.259,90	R\$ 68.061,33
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCI	AG. 2510 CC 142-0	OUT/15	R\$ 17.047.933,54	R\$ 11.908.002,16
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCI	AG. 2510 CC 143-8	OUT/15	R\$ 1.385.945,53	R\$ 5.358.493,54
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCI	AG. 2510 CC 466-6	OUT/15	R\$ 588.826,67	R\$ 707.023,53
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁF	AG. 1452-4 CC 32050-1	OUT/15	R\$ 6.632.626,86	R\$ 7.961.308,31
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁF	AG. 1452-4 CC 32051-X	ANTERIOR A 2015	R\$ 287.104,06	R\$ 51.456,79
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁF	AG. 1452-4 CC 32050-1	ABR/16	R\$ 1.828,95	R\$ 2.028,59
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁF	AG. 1452-4 CC 32051-X	ANTERIOR A 2015	R\$ 2.078.039,65	R\$ 1.507.352,43
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁF	AG. 1452-4 CC 32049-8	ANTERIOR A 2015	R\$ 329.835,89	R\$ 15.169.510,54
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENC	AG. 2510 CC 142-0	NOV/16	R\$ 9.513.372,65	R\$ 624.043,88
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENC	AG. 2510 CC 143-8	NOV/16	R\$ 44.770,05	R\$ 232,45
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CR	AG. 2510 CC 142-0	ABR/15	R\$ 4.000.000,00	R\$ 5.171.968,00

# ÍNDICE DE SHARPE E VAR



- BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO
- CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA
- BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO
- CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA
- CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP
- CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA
- CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA
- TOP FI RENDA FIXA
- BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO
- CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP
- BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO
- CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA
- CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO

Fundos	2016	12 meses	dez/16	jan/17	fev/17	2017
<b>Renda Fixa</b>						
<b>Art. 7º, I, "a" - Títulos Públicos Federais - SELIC</b>						
<b>Art. 7º, I, "b" - FI (100% TPF) - IMA ou IDKA</b>						
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14,89%	12,74%	1,25%	1,08%	1,33%	2,42%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14,89%	12,74%	1,25%	1,08%	1,33%	2,42%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	14,58%	14,05%	1,18%	1,26%	0,99%	2,27%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14,48%	13,95%	1,17%	1,26%	0,99%	2,26%
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	16,45%	16,38%	1,77%	1,77%	0,49%	2,27%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	14,94%	12,84%	1,23%	1,06%	1,29%	2,37%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	14,94%	12,84%	1,23%	1,06%	1,29%	2,37%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	11,38%	8,25%	1,55%	1,23%	-0,98%	0,23%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	15,84%	16,16%	1,74%	1,77%	0,44%	2,22%
<b>Art. 7º, II - Compromissadas</b>						
<b>Art. 7º, III, "a" - FI Referenciado RF ou RF - IMA ou IDKA</b>						
TOP FI RENDA FIXA	7,83%	9,94%	1,36%	0,97%	0,88%	1,86%
<b>Art. 7º, III, "b" - FI de Índices RF - IMA ou IDKA</b>						
<b>Art. 7º, IV, "a" - FI Referenciado RF ou RF</b>						
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13,11%	13,03%	1,05%	1,01%	0,80%	1,83%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	14,00%	13,90%	1,11%	1,07%	0,88%	1,96%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	14,00%	13,90%	1,11%	1,07%	0,88%	1,96%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	14,00%	13,90%	1,11%	1,07%	0,88%	1,96%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13,88%	13,85%	1,13%	1,10%	0,89%	2,00%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13,11%	13,03%	1,05%	1,01%	0,80%	1,83%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13,11%	13,03%	1,05%	1,01%	0,80%	1,83%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13,88%	13,85%	1,13%	1,10%	0,89%	2,00%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13,88%	13,85%	1,13%	1,10%	0,89%	2,00%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	13,05%	12,94%	1,05%	1,01%	0,81%	1,83%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	13,05%	12,94%	1,05%	1,01%	0,81%	1,83%
<b>Art. 7º, IV, "b" - FI de Índices RF</b>						

Art. 7º, V, "a" - Poupança

Art. 7º, V, "b" - LIG - Letras Imobiliárias Garantidas

Art. 7º, VI - FIDC Aberto

Art. 7º, VII, "a" - FIDC Fechado

Art. 7º, VII, "b" - FI Crédito Privado

CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	16,84%	13,46%	1,21%	0,93%	0,94%	1,88%
---	--------	--------	-------	-------	-------	-------

## 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

Art. 8º, VI - FI Imobiliário - FII

## Imóveis

Art. 3º - Integralização em Imóveis

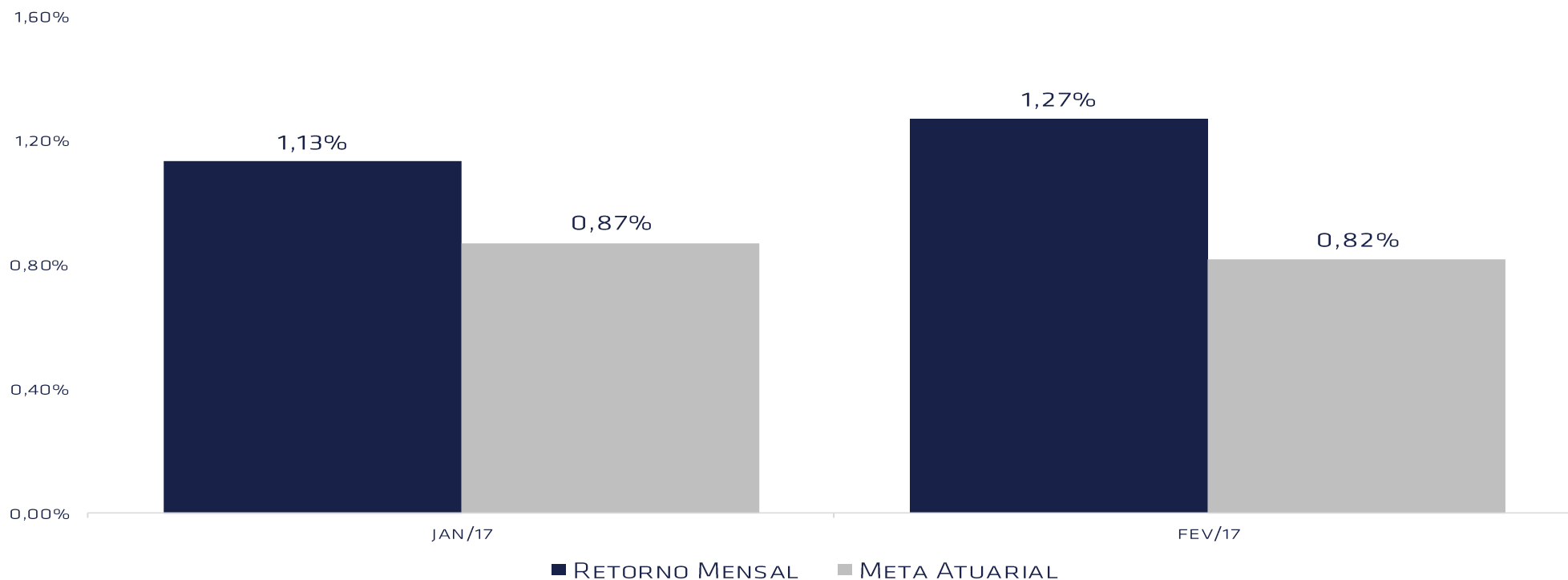
## Não Enquadra

## Performance Absoluta

	jan-17	fev-17	mar-17	abr-17	mai-17	jun-17
Carteira	1,13%	1,27%				
Retorno Financeiro	2.393.065,92	2.754.838,81				
Meta Atuarial	0,87%	0,82%				

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

## RETORNO MENSAL X META ATUARIAL MENSAL

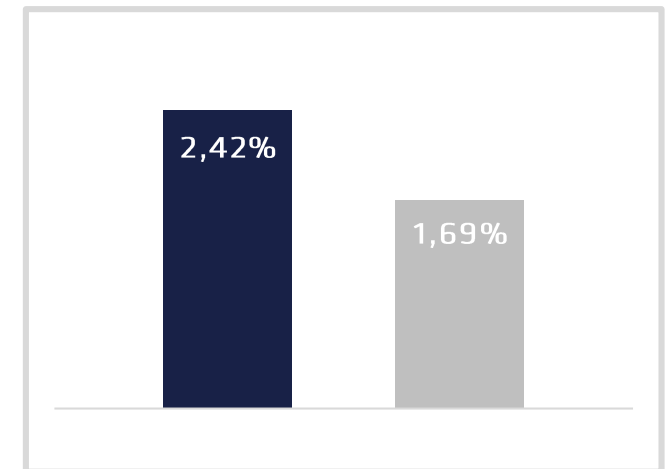


## Estatística

Meses positivos:	2	
Meses negativos:	0	
Meses acima da Meta Atuarial:	2	
Meses abaixo da Meta Atuarial:	0	
Retorno Mensal Máximo	1,27%	fev-17
Retorno Mensal Médio	1,20%	
Retorno Mensal Mínimo	1,13%	jan-17
Sharpe	0,56	
Volatilidade	4,55%	
VaR	-0,37%	
Meta Atuarial	IPCA + 6%	

## Consolidado - 2017

Carteira	2,42%
Retorno	R\$ 5.147.904,73
Meta	1,69%



FEV/17

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	AG. 1452-4 CC 32049-8	20.572.955,49				272.804,49	1,33%	20.845.759,98
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	AG. 1452-4 CC 32050-1	2.449.781,21				32.484,94	1,33%	2.482.266,15
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	AG. 2510 CC 142-0	32.915.196,02				327.295,29	0,99%	33.242.491,31
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	AG. 1452-4 CC 32049-8	4.351.213,42				42.944,02	0,99%	4.394.157,44
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA		5.460.066,00			149.009,46	175.721,46	3,22%	5.486.778,00
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	AG. 2510 CC 142-0	80.775.667,39				1.043.748,99	1,29%	81.819.416,38
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	AG. 2510 CC 143-8	4.133.897,11				53.416,47	1,29%	4.187.313,58
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA		5.498.413,83			157.421,55	103.623,39	1,88%	5.444.615,67
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA		5.836.910,96			162.289,13	187.864,91	3,22%	5.862.486,74
TOP FI RENDA FIXA		6.798.006,21				98.174,15	1,44%	6.896.180,36
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	AG. 1452-4 CC 32049-8	58.631,44	31.298,34	-22.362,99		494,54	0,73%	68.061,33
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	AG. 2510 CC 142-0	10.999.547,54	1.207.244,53	-405.500,00		106.710,09	0,90%	11.908.002,16
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	AG. 2510 CC 143-8	5.356.257,09		-44.900,00		47.136,45	0,89%	5.358.493,54
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	AG. 2510 CC 466-6	700.853,17				6.170,36	0,88%	707.023,53
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	AG. 1452-4 CC 32050-1	7.890.952,52				70.355,79	0,89%	7.961.308,31
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	AG. 1452-4 CC 32051-X	2.520,68	80.304,33	-31.677,71		309,49	0,61%	51.456,79
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	AG. 1452-4 CC 32050-1	2.012,41				16,18	0,80%	2.028,59
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	AG. 1452-4 CC 32051-X	1.593.683,73		-100.000,00		13.668,70	0,92%	1.507.352,43
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	AG. 1452-4 CC 32049-8	13.251.182,30	1.796.577,67			121.750,57	0,81%	15.169.510,54
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	AG. 2510 CC 142-0	515,68	1.088.318,50	-466.682,71		1.892,41	0,30%	624.043,88
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	AG. 2510 CC 143-8	144,84	44.900,00	-44.832,51		20,12	9,48%	232,45
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	AG. 2510 CC 142-0	5.123.732,00				48.236,00	0,94%	5.171.968,00
<b>APLICAÇÕES</b>		<b>213.772.141,04</b>						<b>219.190.947,16</b>
<b>IMÓVEIS</b>		<b>0,00</b>						<b>0,00</b>
<b>CONTA CORRENTE</b>		<b>0,00</b>						<b>0,00</b>
CAIXA 142-0		0,00						0,00
CAIXA 143-8		0,00						0,00
CAIXA 466-6		0,00						0,00
BB 32049-8		0,00						0,00
BB 32051-X		0,00						0,00
BB 32050-1		0,00						0,00
BRADESCO 17550-1		0,00						0,00
<b>FINAL</b>		<b>213.772.141,04</b>	<b>4.248.643,37</b>	<b>-1.115.955,92</b>	<b>468.720,14</b>	<b>2.754.838,81</b>	<b>1,27%</b>	<b>219.190.947,16</b>

+ 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

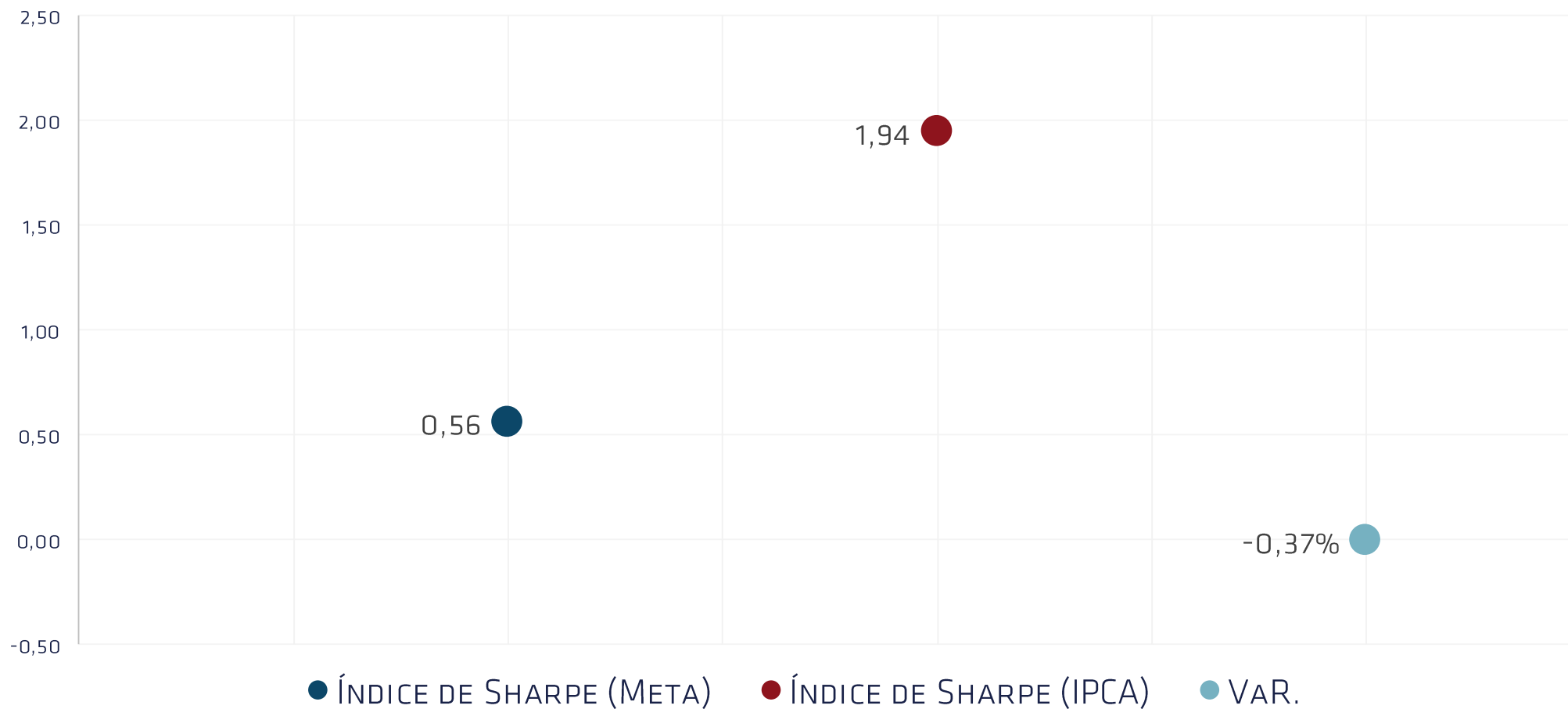
WWW.TRINUSCAPITAL.COM | CONTATO@TRINUSCAPITAL.COM







## ÍNDICE DE SHARPE E VAR DA CARTEIRA

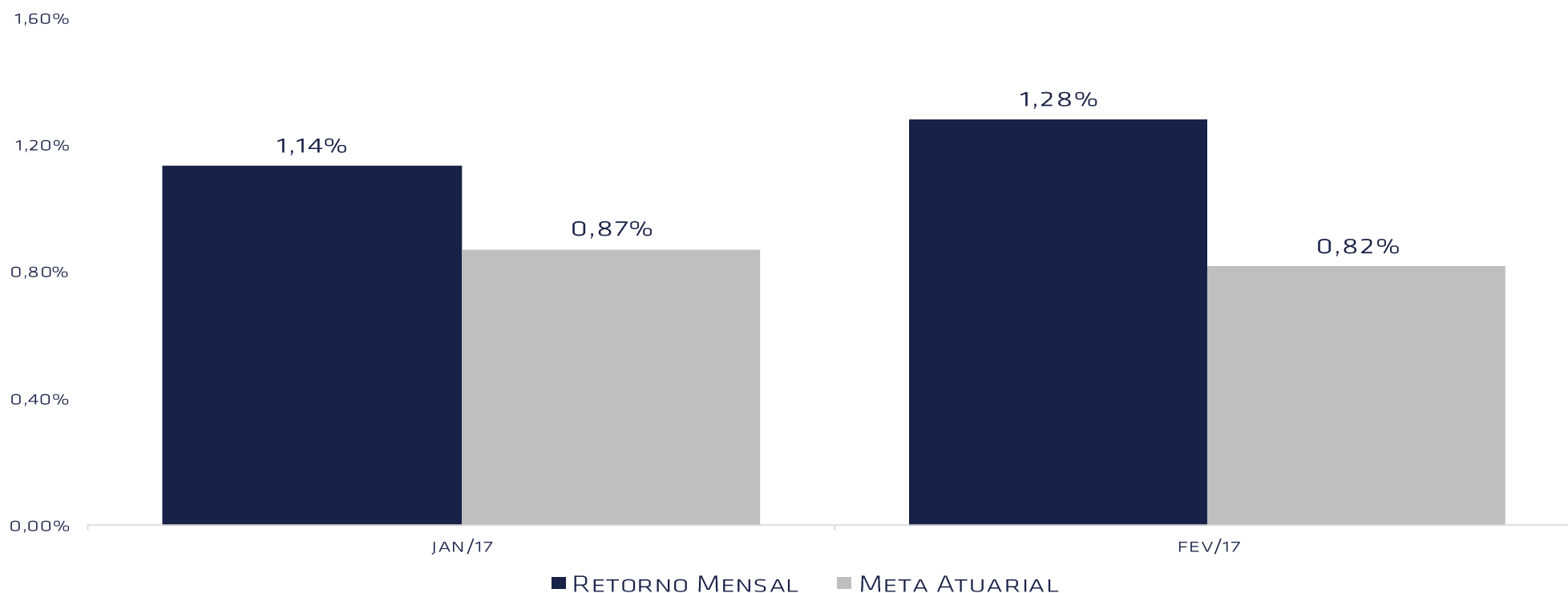


Performance Absoluta

	jan-17	fev-17	mar-17	abr-17	mai-17	jun-17
Carteira	1,14%	1,28%				
Retorno Financeiro	2.274.746,03	2.640.287,58				
Meta Atuarial	0,87%	0,82%				

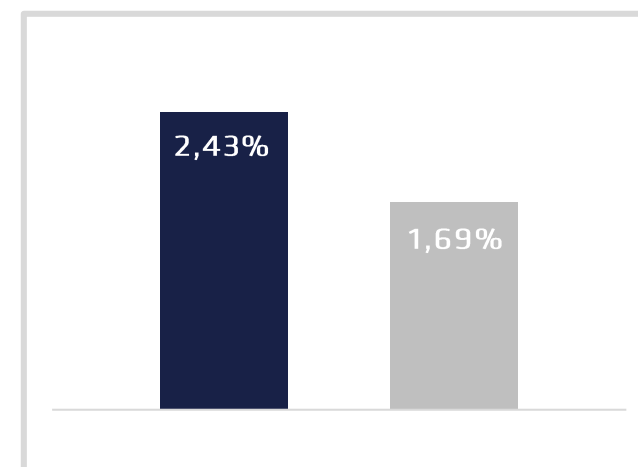
	jul-17	ago-17	set-17	out-17	nov-17	dez-17
Carteira						
Retorno Financeiro						
Meta Atuarial						

## RETORNO MENSAL X META ATUARIAL MENSAL



Estatística		
Meses positivos:	2	
Meses negativos:	0	
Meses acima da Meta Atuarial:	2	
Meses abaixo da Meta Atuarial:	0	
Retorno Mensal Máximo	1,28%	fev-17
Retorno Mensal Médio	1,21%	
Retorno Mensal Mínimo	1,14%	jan-17
Sharpe	0,56	
Volatilidade	4,56%	
VaR	-0,37%	
Meta Atuarial	IPCA + 6%	

Consolidado - 2017	
Carteira	2,43%
Retorno	R\$ 4.915.033,61
Meta	1,69%



FEV/17

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 1452-4 CC 32049-8	20.572.955,49				272.804,49	1,33%	20.845.759,98
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 1452-4 CC 32050-1	2.449.781,21				32.484,94	1,33%	2.482.266,15
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	Ag. 2510 CC 142-0	32.915.196,02				327.295,29	0,99%	33.242.491,31
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 1452-4 CC 32049-8	4.351.213,42				42.944,02	0,99%	4.394.157,44
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA		5.460.066,00			149.009,46	175.721,46	3,22%	5.486.778,00
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	Ag. 2510 CC 142-0	80.775.667,39				1.043.748,99	1,29%	81.819.416,38
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA		5.498.413,83			157.421,55	103.623,39	1,88%	5.444.615,67
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA		5.836.910,96			162.289,13	187.864,91	3,22%	5.862.486,74
TOP FI RENDA FIXA		6.798.006,21				98.174,15	1,44%	6.896.180,36
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 CC 466-6	700.853,17				6.170,36	0,88%	707.023,53
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	Ag. 2510 CC 142-0	10.999.547,54	1.207.244,53	-405.500,00		106.710,09	0,90%	11.908.002,16
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 1452-4 CC 32050-1	7.890.952,52				70.355,79	0,89%	7.961.308,31
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 1452-4 CC 32049-8	58.631,44	31.298,34	-22.362,99		494,54	0,73%	68.061,33
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 1452-4 CC 32050-1	2.012,41				16,18	0,80%	2.028,59
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	Ag. 1452-4 CC 32049-8	13.251.182,30	1.796.577,67			121.750,57	0,81%	15.169.510,54
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	Ag. 2510 CC 142-0	515,68	1.088.318,50	-466.682,71		1.892,41	0,30%	624.043,88
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	Ag. 2510 CC 142-0	5.123.732,00				48.236,00	0,94%	5.171.968,00
<b>APLICAÇÕES</b>		<b>202.685.637,59</b>						<b>208.086.098,37</b>
<b>IMÓVEIS</b>		<b>0,00</b>						<b>0,00</b>
<b>CONTA CORRENTE</b>		<b>0,00</b>						<b>0,00</b>
CAIXA 142-0		0,00						0,00
BB 32049-8		0,00						0,00
BB 32050-1		0,00						0,00
BRANCO 17550-1		0,00						0,00
<b>FINAL</b>		<b>202.685.637,59</b>	<b>4.123.439,04</b>	<b>-894.545,70</b>	<b>468.720,14</b>	<b>2.640.287,58</b>	<b>1,28%</b>	<b>208.086.098,37</b>

+ 55 62 3924-6211

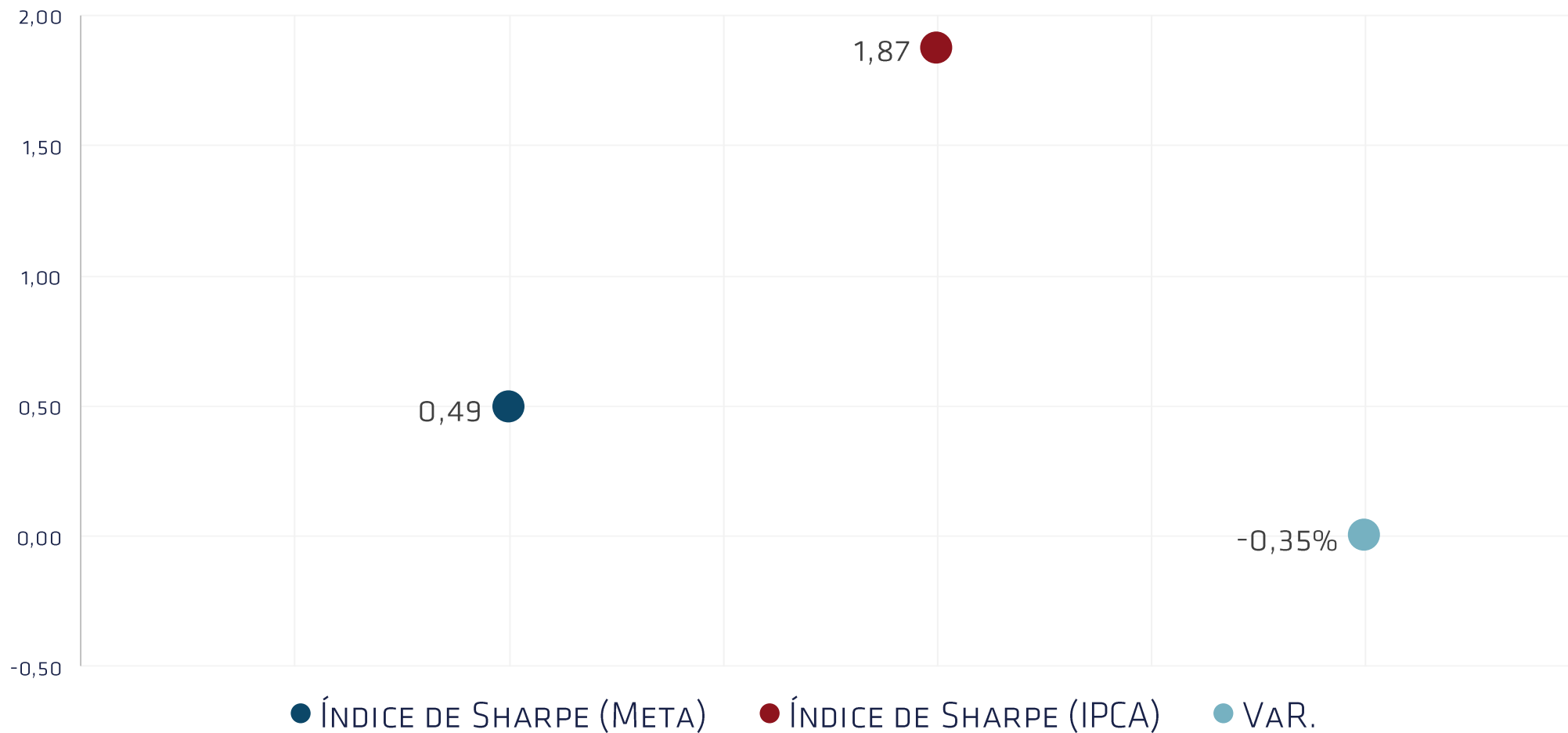
AV. OLINDA, Nº 960, QD. H4, LT. 01/03 – Ed. LOZANDES CORPORATE DESIGN, TORRE 01 – SALA 806 GOIÂNIA – GO CEP: 74.884-120

WWW.TRINUSCAPITAL.COM CONTATO@TRINUSCAPITAL.COM





# ÍNDICE DE SHARPE E VAR DA CARTEIRA

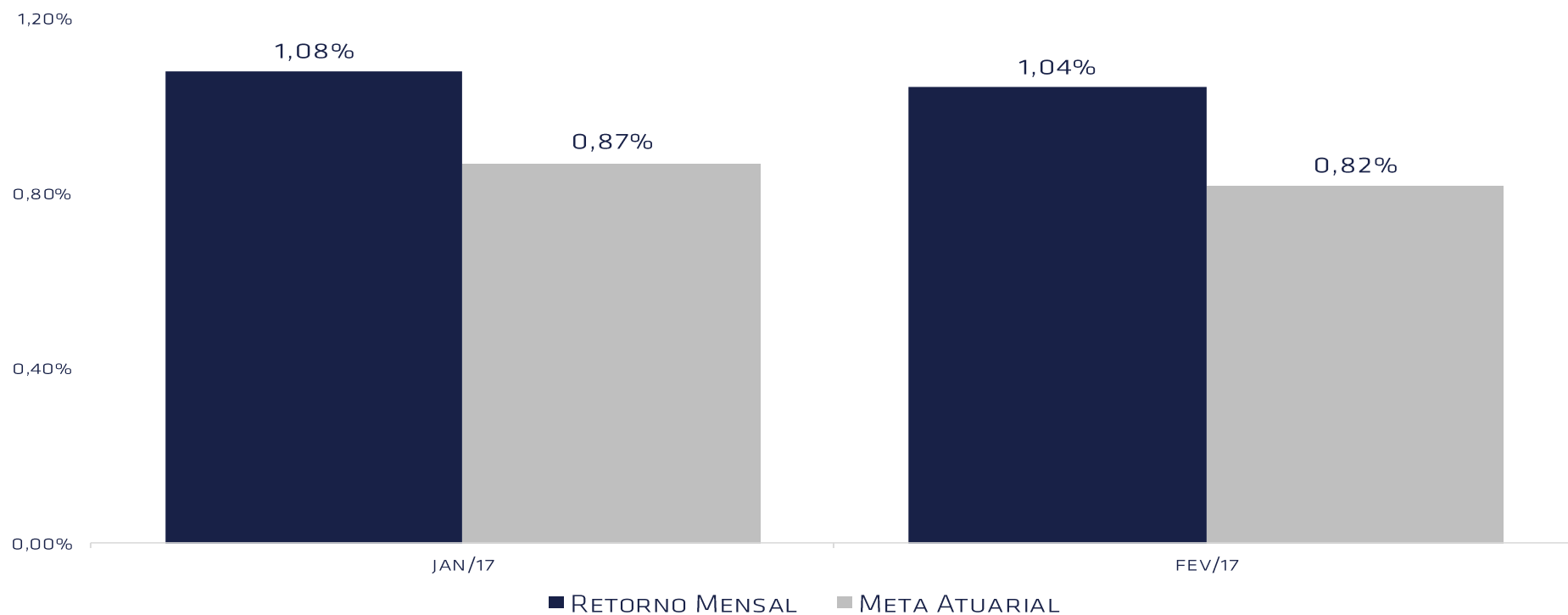


Performance Absoluta

	jan-17	fev-17	mar-17	abr-17	mai-17	jun-17
Carteira	1,08%	1,04%				
Retorno Financeiro	118.319,89	114.551,23				
Meta Atuarial	0,87%	0,82%				

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

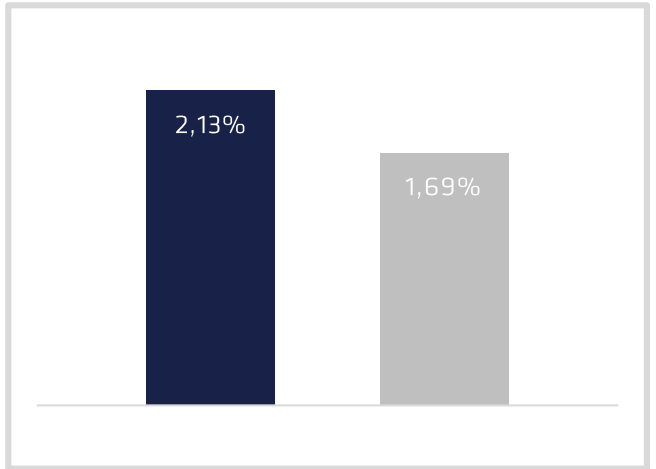
## RETORNO MENSAL X META ATUARIAL MENSAL





Estatística		
Meses positivos:	2	
Meses negativos:	0	
Meses acima da Meta Atuarial:	2	
Meses abaixo da Meta Atuarial:	0	
Retorno Mensal Máximo	1,08%	jan-17
Retorno Mensal Médio	1,06%	
Retorno Mensal Mínimo	1,04%	fev-17
Sharpe	0,49	
Volatilidade	4,55%	
VaR	-0,35%	
Meta Atuarial	IPCA + 6%	

Consolidado - 2017	
Carteira	2,13%
Retorno	R\$ 232.871,12
Meta	1,69%



**FEV/17**

Aplicações	Cc vinculada	Financeiro Inicial	Aplicação	Resgate	Amortização	Rendimento	Rent. %	Total
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	AG. 2510 CC 143-8	4.133.897,11				53.416,47	1,29%	4.187.313,58
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	AG. 1452-4 CC 32051-X	2.520,68	80.304,33	-31.677,71		309,49	0,61%	51.456,79
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	AG. 1452-4 CC 32051-X	1.593.683,73		-100.000,00		13.668,70	0,92%	1.507.352,43
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	AG. 2510 CC 143-8	144,84	44.900,00	-44.832,51		20,12	9,48%	232,45
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	AG. 2510 CC 143-8	5.356.257,09		-44.900,00		47.136,45	0,89%	5.358.493,54
<b>APLICAÇÕES</b>		<b>11.086.503,45</b>						<b>11.104.848,79</b>
<b>IMÓVEIS</b>		<b>0,00</b>						<b>0,00</b>
<b>CONTA CORRENTE</b>		<b>0,00</b>						<b>0,00</b>
CAIXA 143-8		0,00						0,00
BB 32051-X		0,00						0,00
<b>FINAL</b>		<b>11.086.503,45</b>	<b>125.204,33</b>	<b>-221.410,22</b>	<b>0,00</b>	<b>114.551,23</b>	<b>1,04%</b>	<b>11.104.848,79</b>

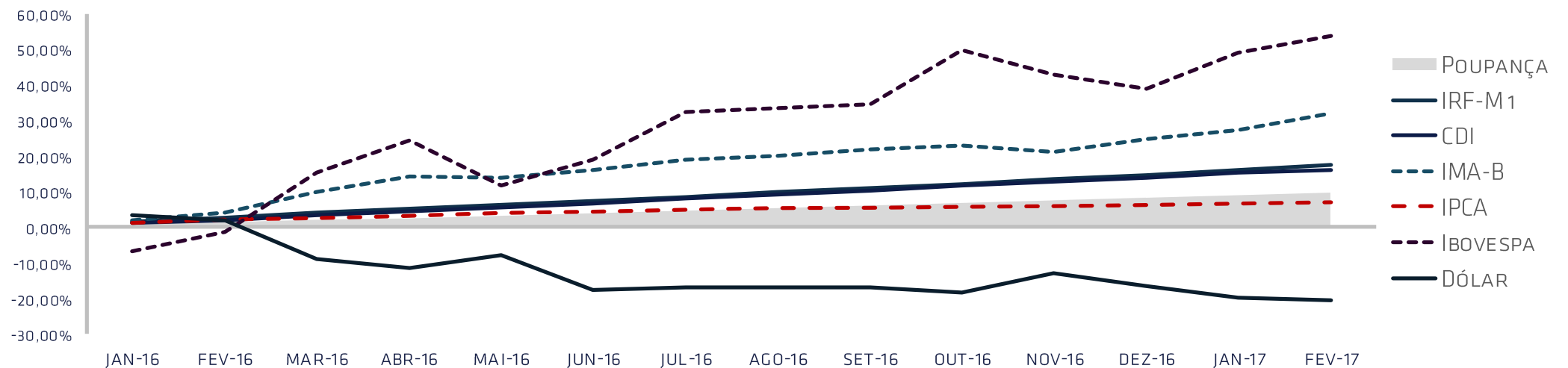
+ 55 62 3924-6211

AV. OLINDA, Nº 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



	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%
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%
fev-17	1,01%	0,86%	3,85%	1,35%	0,53%	0,33%	3,08%	-0,89%	0,82%
<b>2017</b>	<b>2,31%</b>	<b>1,95%</b>	<b>5,79%</b>	<b>2,45%</b>	<b>1,20%</b>	<b>0,71%</b>	<b>10,69%</b>	<b>-4,90%</b>	<b>1,69%</b>



# Cenário Econômico Fevereiro 2017

## Europa

Na Europa não se fala em outra coisa a não ser as eleições francesas. Com primeiro turno agendado para 23 de abril, a campanha está marcada por grandes reviravoltas. O ex-primeiro-ministro François Fillon, até então favorito ao cargo de Presidente, será formalmente acusado em uma investigação de mau uso do dinheiro público (improbidade administrativa). Familiares de François são acusados de serem funcionários fantasmas, tendo embolsado milhares de euros sem nunca terem trabalhado. Neste cenário a candidata do partido de extrema-direita, Marine Le Pen, saiu fortalecida. Como apontado nas pesquisas eleitorais, fica claro que os eleitores franceses estão fartos dos políticos tradicionais e suas práticas, devendo mostrar essa insatisfação nas urnas.

## China

O governo Chinês espera para esse ano o pior crescimento em 27 anos – em torno de 6,5% a 7%. O governo trabalha agora para implementar algumas reformas que possam permitir a retomada do crescimento aos níveis da década passada, além de controlar o crescimento da dívida, em decorrência do aumento das despesas públicas.

Val e ressaltar que o Brasil é um grande parceiro comercial. A China é hoje a maior importadora de recursos minerais e soja do Brasil. Por isso, o crescimento de sua economia é fundamental para a balança comercial brasileira, muito beneficiada pelo comércio de commodities.

## EUA

A economia americana teve seu pior crescimento desde 2011, apenas 1,6% em 2016. Apesar do resultado, a política expansionista que o presidente americano Donald Trump pretende adotar, busca alavancar o crescimento do PIB, através do corte de impostos e aumento dos gastos do governo.

Em entrevista, a presidente do Federal Reserve (Fed, Banco Central Americano) Janet Yellen, afirmou que seria apropriado subir as taxas de juros no mês de março caso o emprego e a inflação continuarem a apresentar tendência de alta. Yellen também defendeu o desempenho do Fed em termos de política monetária, ao indicar que a entidade não foi descuidada em subir as taxas, observando que a recuperação da economia foi lenta e a inflação foi baixa.

## Brasil

As eleições presidenciais só acontecem em 2018, porém, alguns partidos já começam a sondar possíveis nomes para o pleito. O PSDB por exemplo, com os desgastes envolvendo nomes como Aécio Neves, José Serra e Geraldo Alckmin, já estuda



lançar o Prefeito de São Paulo, João Doria ao Palácio do Planalto.

No entanto, talvez a grande preocupação de alguns partidos e políticos não esteja nas eleições de 2018, mas sim no inquérito que o STF está preparando para indiciar ao menos 30 pessoas, entre Ministros, Senadores, Deputados e Governadores. O Procurador Geral da República, Rodrigo Janot, deve liberar já no início de março os pedidos, com base nas delações de 78 executivos da maior empreiteira do país (grupo Odebrecht). Segundo informações, os executivos da empreiteira teriam citados ao menos 130 políticos.

## Mercado

Na última reunião do Copom, os diretores do Banco Central decidiram por reduzir em 0,75 pontos percentuais a taxa de juros, fechada em 12,75%. Na ata divulgada uma semana depois, os diretores deixaram claro que na próxima reunião a redução pode ser ainda maior, na casa de 1 ponto percentual.

Logo após o anúncio do BC, bancos como Itaú, Bradesco, Banco do Brasil e Caixa Econômica Federal, anunciaram a redução dos juros à empréstimos bancários para pessoas físicas e jurídicas. Apesar do Banco Central vir reduzindo desde o ano passado os juros, os bancos não haviam repassado aos clientes essa redução, alegando os riscos envolvidos nas operações.

Os saques às contas inativas do FGTS iniciam na próxima sexta-feira, dia dez de março. O governo espera que esta medida contribua para o aquecimento do mercado nacional, com a injeção de até 40 bilhões de reais.

Boa semana e ótimos negócios!



# TRINUS

C A P I T A L

[CONTATO@TRINUSCAPITAL.COM](mailto:CONTATO@TRINUSCAPITAL.COM)  
[WWW.TRINUSCAPITAL.COM](http://WWW.TRINUSCAPITAL.COM)