

Relatório Analítico dos Investimentos em dezembro, 4º Trimestre e ano de 2016



Carteira consolidada de investimentos - base (dezembro / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	7.441.319,63	9,27%	603	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	11.356.092,97	14,15%	110	1,96%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	427.015,87	0,53%	200	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	5.811.377,86	7,24%	731	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	11.923.964,94	14,86%	721	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.713.963,52	9,61%	620	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.945.757,57	2,42%	713	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.175.949,42	1,47%	1.183	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	43.483,36	0,05%	242	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	9.476.365,65	11,81%	69	3,37%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
TOWER BRIDGE II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	274.150,40	0,34%	33	0,24%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	427.076,48	0,53%	39	0,14%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	1.005.737,06	1,25%	38	0,18%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	4.200,29	0,01%	88	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	546.605,54	0,68%	86	0,06%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	142.560,41	0,18%	320	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	326.773,14	0,41%	411	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	593.347,76	0,74%	4.376	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.212.737,42	2,76%	787	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	117.794,02	0,15%	1	1,10%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	2.278.764,35	2,84%	98	2,14%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	D+90 ou D+150 a D+450	18 meses	894.138,56	1,11%	14	8,35%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "

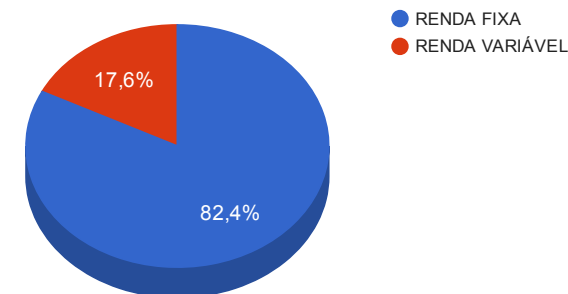
Carteira consolidada de investimentos - base (dezembro / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	1.765.101,99	2,20%	21.866	0,34%	Artigo 8º, Inciso I
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.869.194,37	3,58%	2.948	1,09%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	23/08/2017	1.211.230,03	1,51%	116	0,35%	Artigo 8º, Inciso III
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	D+4382	Não há	980.970,87	1,22%	5	0,46%	Artigo 8º, Inciso IV
CONQUEST FIP - FCCQ11	Não se aplica	Não se aplica	3.818.274,32	4,76%			Artigo 8º, Inciso V
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se aplica	Não se aplica	3.459.142,22	4,31%		8,15%	Artigo 8º, Inciso VI
		TOTAL -	80.243.090,02				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (dezembro / 2016)

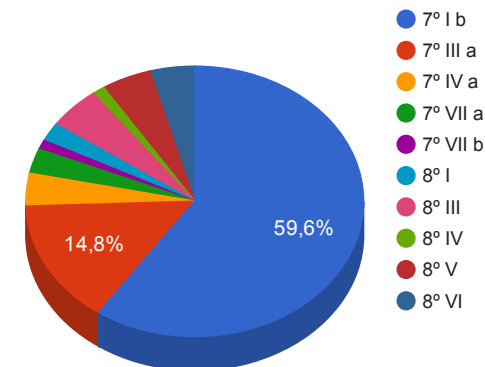
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	80,00%	47.838.925,14	59,62%	16.355.546,88
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	50,00%	11.876.695,83	14,80%	28.244.849,18
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	80,00%	10,00%	0,00	0,00%	8.024.309,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	3.132.858,32	3,90%	20.940.068,69
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	30,00%	10,00%	0,00	0,00%	8.024.309,00
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	4.012.154,50
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	2.396.558,37	2,99%	1.615.596,13
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	894.138,56	1,11%	3.118.015,94
Total Renda Fixa	100,00%	195,00	66.139.176,22	82,42%	

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	10,00%	1.765.101,99	2,20%	6.259.207,01
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	4.080.424,40	5,09%	7.956.039,10
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	980.970,87	1,22%	3.031.183,63
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	3.818.274,32	4,76%	193.880,18
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	3.459.142,22	4,31%	553.012,28
Total Renda Variável	30,00%	40,00	14.103.913,80	17,58%	

Distribuição por Artigo / Resolução



Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (dezembro / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5+	3,71%	31,04%	2,33%	8,46%	31,04%	38,52%	-	-	-
BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	3,75%	30,44%	2,27%	8,37%	30,44%	37,21%	0,20%	4,953%	10,56%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,71%	30,74%	2,24%	8,34%	30,74%	37,82%	0,20%	4,872%	10,46%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,70%	30,56%	2,29%	8,35%	30,56%	37,15%	0,20%	4,847%	10,44%

IMA-B	2,91%	24,81%	2,30%	7,46%	24,81%	35,90%	-	-	-
BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	3,00%	24,64%	2,42%	7,69%	24,64%	35,41%	0,20%	3,678%	7,48%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,89%	24,52%	2,23%	7,37%	24,52%	35,13%	0,20%	3,579%	7,34%
BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	2,89%	24,55%	2,31%	7,44%	24,55%	34,83%	0,20%	3,586%	7,35%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,88%	24,56%	2,33%	7,42%	24,56%	33,62%	0,20%	3,583%	7,33%

CDI + 3,50% ao ano	1,43%	17,97%	4,12%	8,69%	17,97%	38,23%	-	-	-
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1.116,38%	115,02%	147,23%	1.047,91%	115,02%	81,31%	0,20%	1.489,121%	1.010,69%

IMA-B 5	1,39%	15,48%	2,27%	6,11%	15,48%	33,33%	-	-	-
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1,53%	9,03%	2,28%	6,35%	9,03%	10,79%	0,70%	1,349%	10,74%
BRASESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	1,42%	15,33%	2,25%	6,01%	15,33%	31,99%	0,20%	1,495%	2,78%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,38%	15,19%	2,23%	6,01%	15,19%	32,31%	0,20%	1,325%	2,60%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,36%	15,28%	2,20%	6,01%	15,28%	32,42%	0,20%	1,318%	2,61%
TOWER BRIDGE II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1,09%	-	2,15%	-1,21%	-	-	0,70%	5,579%	-

Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (dezembro / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDKA IPCA 2 Anos	1,28%	15,21%	2,28%	6,11%	15,21%	34,09%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,25%	14,89%	2,22%	6,03%	14,89%	32,56%	0,20%	1,061%	2,50%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,23%	14,94%	2,24%	6,02%	14,94%	32,76%	0,20%	1,023%	2,42%
IRF-M 1	1,20%	14,72%	3,22%	6,79%	14,72%	29,64%	-	-	-
BRDESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1,17%	14,57%	3,19%	6,70%	14,57%	29,27%	0,20%	0,101%	0,35%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,17%	14,48%	3,16%	6,66%	14,48%	28,89%	0,10%	0,100%	0,35%
Selic	1,12%	14,02%	3,24%	6,83%	14,02%	29,15%	-	-	-
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,12%	14,25%	3,45%	7,06%	14,25%	29,51%	0,20%	0,006%	0,05%
CDI	1,12%	14,00%	3,24%	6,82%	14,00%	29,09%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,13%	13,88%	3,28%	6,94%	13,88%	29,21%	0,20%	0,009%	0,17%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,11%	14,06%	3,26%	6,84%	14,06%	29,36%	0,25%	0,016%	0,05%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	0,55%	-24,99%	1,55%	3,34%	-24,99%	-26,22%	1,00%	0,063%	24,05%
101,50% do IPCA + 5,75% ao ano	0,78%	12,29%	2,11%	4,65%	12,29%	31,31%	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,21%	-13,49%	-2,49%	-9,98%	-13,49%	-16,56%	0,25%	0,143%	2,96%

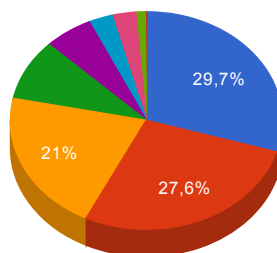
Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (dezembro / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	1,47%	32,29%	2,64%	13,80%	32,29%	39,52%	-	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	0,00%	-	-32,65%	-32,65%	-	-70,90%	1,50%	-	32,72%
IPCA + 8,00% ao ano	0,98%	14,76%	2,67%	5,82%	14,76%	37,08%	-	-	-
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	1,71%	5,87%	2,94%	8,17%	5,87%	25,14%	0,12%	64,758%	42,75%
Ibovespa	-2,71%	38,94%	3,19%	16,89%	38,94%	20,44%	-	-	-
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	1,42%	5,01%	6,30%	19,67%	5,01%	5,73%	4,00%	10,472%	23,28%
IDIV	-0,88%	60,49%	11,34%	27,50%	60,49%	16,45%	-	-	-
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	2,22%	-1,64%	0,52%	12,40%	-1,64%	-2,85%	3,00%	9,609%	23,20%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	-0,53%	12,37%	-0,47%	5,55%	12,37%	8,75%	1,72%	7,338%	16,38%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CONQUEST FIP - FCCQ11	-	-	-	-	-	-	0,30%	-	-

Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (dezembro / 2016)

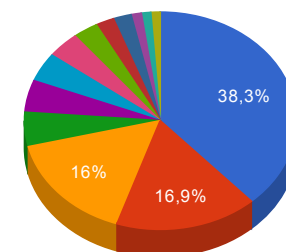
Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	23.815.279,69	29,68%
BANCO BRADESCO	22.137.114,07	27,59%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	16.827.428,10	20,97%
Foco DTVM	7.277.416,54	9,07%
GERAÇÃO FUTURO	4.634.296,36	5,78%
PETRA Corretora	2.278.764,35	2,84%
BRIDGE TRUST	2.260.858,33	2,82%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	894.138,56	1,11%
Socopa	117.794,02	0,15%

- CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
- BANCO BRADESCO
- BB GESTÃO DE RECURSOS...
- Foco DTVM
- GERAÇÃO FUTURO
- PETRA Corretora
- BRIDGE TRUST
- BNY MELLON SERVIÇOS...
- Socopa



Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	30.725.577,83	38,29%
IDKA IPCA 2A	13.525.341,38	16,86%
IMA-B 5	12.844.571,09	16,01%
AÇÕES - SETORIAIS	4.080.424,40	5,09%
FIP	3.818.274,32	4,76%
FUNDO IMOBILIÁRIO	3.459.142,22	4,31%
CDI	3.132.858,32	3,90%
FIDC - FECHADO	2.396.558,37	2,99%
AÇÕES - INDEXADO	1.765.101,99	2,20%
IRF-M 1	1.722.554,96	2,15%
MULTIMERCADO	980.970,87	1,22%
IMA-B 5+	897.575,71	1,12%
CRÉDITO PRIVADO	894.138,56	1,11%

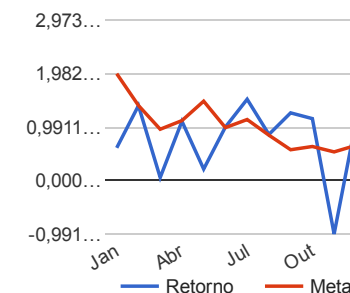
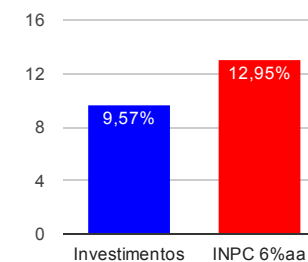
- IMA-B
- IDKA IPCA 2A
- IMA-B 5
- AÇÕES - SETORIAIS
- FIP
- FUNDO IMOBILIÁRIO
- CDI
- FIDC - FECHADO
- AÇÕES - INDEXADO
- IRF-M 1
- MULTIMER...
- IMA-B 5+
- CRÉDITO PRIVADO



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	74.423.756,56	2.732.531,68	151.945,88	77.470.633,08	466.290,72	0,61%	1,98%	30,57%	2,78%
Fevereiro	77.470.633,08	32.530.266,04	32.756.349,85	78.319.834,24	1.075.284,97	1,39%	1,39%	99,53%	1,76%
Março	78.319.834,24	2.886.624,24	1.355.271,08	79.895.473,25	44.285,85	0,06%	0,95%	5,82%	2,43%
Abril	79.895.473,25	2.070.000,00	1.085.034,30	81.767.714,89	887.275,94	1,10%	1,11%	99,14%	1,70%
Mai	81.767.714,89	2.962.488,00	4.028.152,56	80.875.604,34	173.554,01	0,21%	1,47%	14,42%	1,28%
Junho	80.875.604,34	280.000,00	1.138.976,48	80.818.322,51	801.694,65	0,99%	0,98%	100,90%	1,35%
Julho	80.818.322,51	29.330.000,00	30.392.671,18	80.972.704,06	1.217.052,73	1,51%	1,13%	133,28%	1,57%
Agosto	80.972.704,06	503.000,00	1.489.905,63	80.676.832,42	691.033,99	0,85%	0,84%	101,01%	1,90%
Setembro	80.676.832,42	850.000,00	1.194.864,43	81.343.069,23	1.011.101,24	1,25%	0,57%	220,98%	2,18%
Outubro	81.343.069,23	1.151.632,00	1.278.442,75	82.149.050,26	932.791,78	1,15%	0,63%	180,78%	1,80%
Novembro	82.149.050,26	863.860,00	1.197.174,62	81.001.494,64	-814.241,00	-0,99%	0,53%	-185,67%	3,96%
Dezembro	81.001.494,64	0,00	1.635.198,36	80.243.090,02	876.793,74	1,08%	0,65%	166,35%	6,07%
Acumulado no ano					7.362.918,62	9,57%	12,95%	73,89%	

Acumulado no Ano



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de dezembro / 2016

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)	
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	9.684,02	0,00	0,00	117.794,02	108.110,00	1.116,38%	1.489,12%	1.116,38%	
BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	411.646,60	0,00	0,00	427.076,48	15.429,88	3,75%	4,95%	3,75%	
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	41.927,04	0,00	0,00	43.483,36	1.556,32	3,71%	4,87%	3,71%	
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	411.761,75	0,00	0,00	427.015,87	15.254,12	3,70%	4,85%	3,70%	
BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	4.077,82	0,00	0,00	4.200,29	122,47	3,00%	3,68%	3,00%	
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.232.285,28	0,00	0,00	7.441.319,63	209.034,35	2,89%	3,58%	2,89%	
BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	11.628.384,28	0,00	600.699,80	11.356.092,97	328.408,49	2,82%	3,59%	2,89%	
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	12.523.763,42	0,00	938.935,80	11.923.964,94	339.137,32	2,71%	3,58%	2,88%	
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	990.629,78	0,00	0,00	1.005.737,06	15.107,28	1,53%	1,35%	1,53%	
BRASESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	9.360.569,26	0,00	17.403,88	9.476.365,65	133.200,27	1,42%	1,49%	1,42%	
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.919.304,52	0,00	0,00	1.945.757,57	26.453,05	1,38%	1,32%	1,38%	
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	140.646,64	0,00	0,00	142.560,41	1.913,77	1,36%	1,32%	1,36%	
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.739.669,85	0,00	0,00	5.811.377,86	71.708,01	1,25%	1,06%	1,25%	
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.637.616,01	0,00	17.403,88	7.713.963,52	93.751,39	1,23%	1,02%	1,23%	
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.162.376,04	0,00	0,00	1.175.949,42	13.573,38	1,17%	0,10%	1,17%	
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.187.936,33	0,00	0,00	2.212.737,42	24.801,09	1,13%	0,01%	1,13%	
BRASESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	323.162,59	0,00	0,00	326.773,14	3.610,55	1,12%	0,01%	1,12%	
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	586.830,63	0,00	0,00	593.347,76	6.517,13	1,11%	0,02%	1,11%	
TOWER BRIDGE II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	271.202,10	0,00	0,00	274.150,40	2.948,30	1,09%	5,58%	1,09%	
BRASESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	600.893,28	0,00	60.755,00	546.605,54	6.467,26	1,08%	0,10%	1,17%	
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	889.281,36	0,00	0,00	894.138,56	4.857,20	0,55%	0,06%	0,55%	
PREMIUM FIDC SÊNIOR	2.283.633,85	0,00	0,00	2.278.764,35	-4.869,50	-0,21%	0,14%	-0,21%	
Total Renda Fixa						1.417.092,13	2,14%	4,90%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de dezembro / 2016

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.806.918,36	0,00	0,00	2.869.194,37	62.276,01	2,22%	9,61%	2,22%
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	1.740.425,80	0,00	0,00	1.765.101,99	24.676,19	1,42%	10,47%	1,42%
ÁQUILLA FII - AQLL11	3.444.910,65	0,00	0,00	3.459.142,22	14.231,57	0,41%	-	0,00%
CONQUEST FIP - FCCQ11	3.822.263,41	0,00	0,00	3.818.274,32	-3.989,09	-0,10%	-	-
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.217.699,18	0,00	0,00	1.211.230,03	-6.469,15	-0,53%	7,34%	-0,53%
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	1.611.994,79	0,00	0,00	980.970,87	-631.023,92	-39,15%	64,76%	-39,15%
Total Renda Variável					-540.298,39	-3,69%	17,35%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre / 2016

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	12.608.357,61	577.529,00	1.520.972,34	11.923.964,94	259.050,67	2,08%	2,33%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	11.715.594,39	574.103,00	1.182.736,34	11.356.092,97	249.131,92	2,16%	2,31%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	9.340.224,25	0,00	73.157,86	9.476.365,65	209.299,26	2,25%	2,25%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.617.427,99	0,00	73.157,86	7.713.963,52	169.693,39	2,24%	2,24%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.278.977,09	0,00	0,00	7.441.319,63	162.342,54	2,23%	2,23%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.685.416,03	0,00	0,00	5.811.377,86	125.961,83	2,22%	2,22%
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	47.645,07	0,00	34.669,91	117.794,02	104.818,86	830,37%	147,23%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.142.364,08	0,00	0,00	2.212.737,42	70.373,34	3,28%	3,28%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.903.406,13	0,00	0,00	1.945.757,57	42.351,44	2,23%	2,23%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.139.904,14	0,00	0,00	1.175.949,42	36.045,28	3,16%	3,16%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.151.503,66	0,00	582.683,21	593.347,76	24.527,31	3,23%	3,26%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1.166.650,68	0,00	643.438,21	546.605,54	23.393,07	3,06%	3,19%
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	983.280,90	0,00	0,00	1.005.737,06	22.456,16	2,28%	2,28%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	0,00	411.000,00	0,00	427.076,48	16.076,48	3,91%	2,27%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	411.000,00	0,00	427.015,87	16.015,87	3,90%	2,29%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	880.486,50	0,00	0,00	894.138,56	13.652,06	1,55%	1,55%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	315.869,06	0,00	0,00	326.773,14	10.904,08	3,45%	3,45%
TOWER BRIDGE II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	268.386,66	0,00	0,00	274.150,40	5.763,74	2,15%	2,15%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	139.491,55	0,00	0,00	142.560,41	3.068,86	2,20%	2,20%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	41.860,00	0,00	43.483,36	1.623,36	3,88%	2,24%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	4.101,21	0,00	0,00	4.200,29	99,08	2,42%	2,42%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	2.336.914,95	0,00	0,00	2.278.764,35	-58.150,60	-2,49%	-2,49%
Total Renda Fixa					1.508.498,00	2,27%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre / 2016

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	1.660.448,53	0,00	0,00	1.765.101,99	104.653,46	6,30%	6,30%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.854.231,30	0,00	0,00	2.869.194,37	14.963,07	0,52%	0,52%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.217.007,89	0,00	0,00	1.211.230,03	-5.777,86	-0,47%	-0,47%
ÁQUILLA FII - AQLL11	3.465.699,90	0,00	0,00	3.459.142,22	-6.557,68	-0,19%	-32,65%
CONQUEST FIP - FCCQ11	3.827.001,10	0,00	0,00	3.818.274,32	-8.726,78	-0,23%	-
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	1.592.678,56	0,00	0,00	980.970,87	-611.707,69	-38,41%	2,94%
				Total Renda Variável	-513.153,48	-3,51%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no Ano de 2016

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	3.048.620,76	10.826.152,14	5.688.297,99	9.476.365,65	1.289.890,74	14,03%	15,33%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	6.892.998,57	11.950.603,00	8.327.070,38	11.356.092,97	839.561,78	21,50%	24,55%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	10.062.011,76	3.170.551,48	7.713.963,52	822.503,24	9,84%	14,94%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	5.905.870,86	6.085.321,33	12.082.166,70	593.347,76	684.322,27	12,85%	14,06%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	12.824.029,00	1.520.972,34	11.923.964,94	620.908,28	5,16%	24,56%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	6.892.905,32	1.695.517,79	5.811.377,86	613.990,33	10,12%	14,89%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.513.975,91	1.333.333,33	5.230.845,01	2.212.737,42	596.273,19	13,33%	13,88%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	5.615.711,44	3.262.833,33	9.118.252,15	326.773,14	566.480,52	13,15%	14,25%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	12.378.930,40	1.819.578,65	14.641.129,09	0,00	442.620,04	3,13%	24,14%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	7.060.000,00	0,00	7.441.319,63	381.319,63	5,40%	24,52%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	9.820.437,05	912.953,03	11.103.659,94	4.200,29	374.470,15	24,05%	24,64%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.558.313,66	0,00	953.399,96	1.945.757,57	340.843,87	15,10%	15,19%
CAIXA BRASIL IPCA IX FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	2.800.009,50	0,00	2.962.488,00	0,00	162.478,50	5,80%	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	49.718,96	1.000.000,00	0,00	1.175.949,42	126.230,46	13,76%	14,48%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	73.077,53	1.000.000,00	643.438,21	546.605,54	116.966,22	13,77%	14,57%
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	54.782,90	0,00	35.151,66	117.794,02	98.162,78	717,33%	115,02%
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.190.958,38	0,00	264.407,95	1.005.737,06	79.186,63	9,03%	9,03%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	188.561,19	0,00	71.329,45	142.560,41	25.328,67	15,24%	15,28%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	0,00	411.000,00	0,00	427.076,48	16.076,48	3,91%	30,44%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	411.000,00	0,00	427.015,87	16.015,87	3,90%	30,56%
TOWER BRIDGE II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,00	264.407,95	0,00	274.150,40	9.742,45	3,68%	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	41.860,00	0,00	43.483,36	1.623,36	3,88%	30,74%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no Ano de 2016

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
DIFERENCIAL FI RENDA FIXA LP	0,00	2.413,12	2.413,12	0,00	0,00	0,00%	19,71%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	2.634.019,81	0,00	183.098,69	2.278.764,35	-172.156,77	-6,75%	-13,49%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	1.192.074,97	0,00	0,00	894.138,56	-297.936,41	-24,99%	-24,99%
				Total Renda Fixa	7.754.902,28	12,44%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no Ano de 2016

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.077.867,63	0,00	0,00	1.211.230,03	133.362,40	12,37%	12,37%
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	1.680.965,47	0,00	0,00	1.765.101,99	84.136,52	5,01%	5,01%
ÁQUILLA FII - AQLL11	3.409.802,51	0,00	0,00	3.459.142,22	49.339,71	1,45%	-
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	10.111,47	0,00	9.797,21	0,00	-314,26	-3,11%	20,28%
CONQUEST FIP - FCCQ11	3.861.436,88	0,00	0,00	3.818.274,32	-43.162,56	-1,12%	-
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.916.949,13	0,00	0,00	2.869.194,37	-47.754,76	-1,64%	-1,64%
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	1.548.561,58	0,00	0,00	980.970,87	-567.590,71	-36,65%	5,87%
Total Renda Variável					-391.983,66	-2,70%	