

Relatório Analítico dos Investimentos em setembro e 3º Trimestre de 2016



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 (setembro / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.617.427,99	9,36%	639	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	11.715.594,39	14,40%	116	1,97%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.903.406,13	2,34%	733	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.139.904,14	1,40%	1.171	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	7.278.977,09	8,95%	612	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	5.685.416,03	6,99%	754	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	12.608.357,61	15,50%	728	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
TOWER BRIDGE II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	268.386,66	0,33%	34	0,24%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	983.280,90	1,21%	38	0,21%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	4.101,21	0,01%	86	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	139.491,55	0,17%	327	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	9.340.224,25	11,48%	65	2,97%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.166.650,68	1,43%	89	0,13%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	315.869,06	0,39%	385	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.151.503,66	1,42%	3.732	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.142.364,08	2,63%	801	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	47.645,07	0,06%		1,09%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	2.336.914,95	2,87%	98	2,14%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
SECURITY RENDA FIXA FI REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	D+90 ou D+150 a D+450	18 meses	880.486,50	1,08%	14	8,35%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVSPA ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	1.660.448,53	2,04%	21.424	0,34%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	23/08/2017	1.217.007,89	1,50%	116	0,35%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.854.231,30	3,51%	3.115	1,03%	Artigo 8º, Inciso III

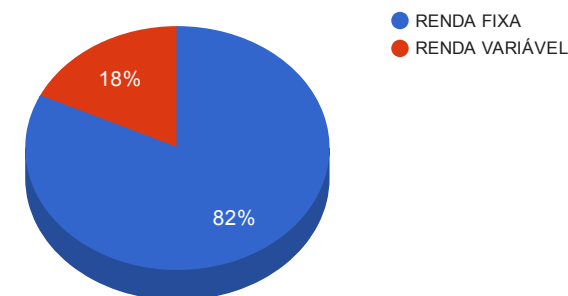
Carteira consolidada de investimentos - base (setembro / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	D+4382	Não há	1.592.678,56	1,96%	5	0,75%	Artigo 8º, Inciso IV
CONQUEST FIP - FCCQ11	Não se aplica	Não se aplica	3.827.001,10	4,70%			Artigo 8º, Inciso V
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se aplica	Não se aplica	3.465.699,90	4,26%		5,50%	Artigo 8º, Inciso VI
		TOTAL -	81.343.069,23				

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

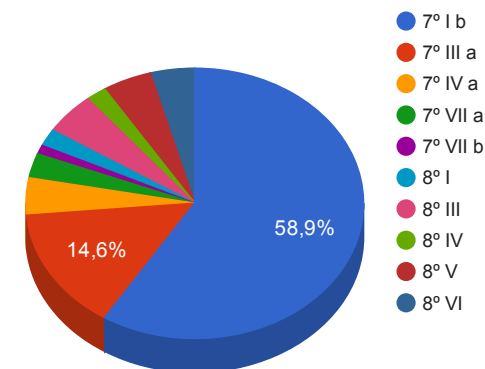
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	80,00%	47.949.083,38	58,95%	17.125.372,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	50,00%	11.902.135,25	14,63%	28.769.399,37
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	80,00%	10,00%	0,00	0,00%	8.134.306,92
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	3.609.736,80	4,44%	20.793.183,97
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	30,00%	10,00%	0,00	0,00%	8.134.306,92
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	4.067.153,46
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	2.384.560,02	2,93%	1.682.593,44
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	880.486,50	1,08%	3.186.666,96
Total Renda Fixa	100,00%	195,00	66.726.001,95	82,03%	

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	10,00%	1.660.448,53	2,04%	6.473.858,39
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	4.071.239,19	5,01%	8.130.221,19
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	1.592.678,56	1,96%	2.474.474,90
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	3.827.001,10	4,70%	240.152,36
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	3.465.699,90	4,26%	601.453,56
Total Renda Variável	30,00%	40,00	14.617.067,28	17,97%	

Distribuição por Artigo / Resolução



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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	1,57%	22,00%	5,04%	11,16%	28,36%	35,87%	-	-	-
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	1,67%	21,70%	5,15%	11,39%	27,86%	35,65%	0,20%	2,399%	7,14%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,58%	21,72%	4,97%	11,04%	27,66%	33,42%	0,20%	2,300%	7,11%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1,57%	21,73%	5,01%	10,97%	27,76%	34,50%	0,20%	2,339%	7,09%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,56%	21,80%	5,03%	11,08%	27,99%	35,08%	0,20%	2,302%	7,06%
IDKA IPCA 2 Anos	1,50%	12,64%	3,74%	7,11%	18,43%	33,53%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,35%	12,40%	3,73%	7,12%	18,25%	32,16%	0,20%	0,558%	2,63%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,33%	12,42%	3,70%	7,14%	18,28%	32,52%	0,20%	0,545%	2,55%
IMA-B 5	1,41%	12,92%	3,76%	7,19%	18,83%	33,03%	-	-	-
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	1,40%	12,79%	3,67%	7,11%	18,62%	31,79%	0,20%	0,834%	2,81%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,40%	12,68%	3,70%	7,08%	18,43%	32,08%	0,20%	0,778%	2,72%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,39%	12,80%	3,73%	7,13%	18,55%	32,13%	0,20%	0,771%	2,71%
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1,23%	6,60%	3,98%	8,26%	1,38%	10,35%	0,70%	0,819%	12,74%
TOWER BRIDGE II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1,06%	-	-3,29%	-	-	-	0,70%	0,846%	-
CDI + 3,50% ao ano	1,40%	13,31%	4,39%	8,83%	18,13%	37,65%	-	-	-
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	306,19%	-13,03%	364,30%	-18,19%	-17,28%	-25,23%	0,20%	-	-
IRF-M 1	1,19%	11,14%	3,46%	6,82%	15,14%	28,83%	-	-	-

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BRDESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1,17%	11,03%	3,40%	6,73%	15,20%	28,38%	0,20%	0,075%	0,52%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,16%	10,97%	3,39%	6,72%	14,91%	28,05%	0,10%	0,076%	0,39%
Selic	1,11%	10,44%	3,47%	6,95%	14,15%	28,56%	-	-	-
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,10%	10,44%	3,49%	6,99%	14,15%	28,71%	0,20%	0,005%	0,02%
CDI	1,11%	10,42%	3,47%	6,94%	14,13%	28,50%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,11%	10,26%	3,54%	6,88%	14,00%	28,66%	0,20%	0,027%	0,17%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,11%	10,45%	3,47%	6,97%	14,17%	28,80%	0,25%	0,023%	0,07%
SECURITY RENDA FIXA FI REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	0,56%	-26,14%	1,76%	-8,32%	-24,96%	-26,25%	1,00%	0,043%	24,01%
101,50% do IPCA + 5,75% ao ano	0,56%	10,17%	2,55%	5,86%	14,93%	33,32%	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-3,02%	-11,28%	-7,68%	-9,80%	-10,95%	-17,12%	0,25%	4,297%	4,82%

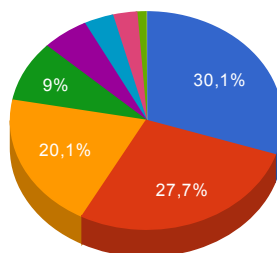
Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (setembro / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	2,77%	28,89%	10,87%	22,29%	29,71%	27,80%	-	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	0,00%	-	0,00%	0,00%	0,00%	-56,80%	1,50%	-	0,00%
Ibovespa	0,80%	34,64%	13,28%	16,61%	29,53%	7,86%	-	-	-
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	0,95%	-1,22%	12,58%	11,01%	-0,23%	-6,68%	4,00%	11,431%	21,63%
IPCA + 8,00% ao ano	0,72%	11,77%	3,07%	6,91%	17,15%	38,54%	-	-	-
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	1,51%	2,85%	5,08%	10,26%	7,36%	25,86%	0,12%	1,567%	14,10%
IDIV	-0,27%	44,15%	14,52%	22,19%	36,47%	-14,52%	-	-	-
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	0,93%	-2,15%	11,81%	8,36%	-2,96%	-5,91%	3,00%	10,489%	21,92%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	0,02%	12,91%	6,05%	8,70%	20,22%	12,08%	1,72%	7,256%	15,35%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CONQUEST FIP - FCCQ11	-	-	-	-	-	-	0,30%	-	-

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

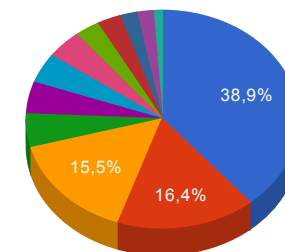
Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	24.497.703,28	30,12%
BANCO BRADESCO	22.542.439,59	27,71%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	16.386.152,89	20,14%
Foco DTVM	7.292.701,00	8,97%
GERAÇÃO FUTURO	4.514.679,83	5,55%
Bridge Trust	2.844.346,12	3,50%
PETRA Corretora	2.336.914,95	2,87%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	880.486,50	1,08%
CITIBANK DTVM	47.645,07	0,06%

- CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
- BANCO BRADESCO
- BB GESTÃO DE RECURSO...
- Foco DTVM
- GERAÇÃO FUTURO
- Bridge Trust
- PETRA Corretora
- BNY MELLON SERVIÇOS...
- Outro



Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	31.607.030,30	38,86%
IDKA IPCA 2A	13.302.844,02	16,35%
IMA-B 5	12.634.789,49	15,53%
AÇÕES - SETORIAIS	4.071.239,19	5,01%
FIP	3.827.001,10	4,70%
CDI	3.609.736,80	4,44%
FUNDO IMOBILIÁRIO	3.465.699,90	4,26%
FIDC - FECHADO	2.384.560,02	2,93%
IRF-M 1	2.306.554,82	2,84%
AÇÕES - INDEXADO	1.660.448,53	2,04%
MULTIMERCADO	1.592.678,56	1,96%
CRÉDITO PRIVADO	880.486,50	1,08%

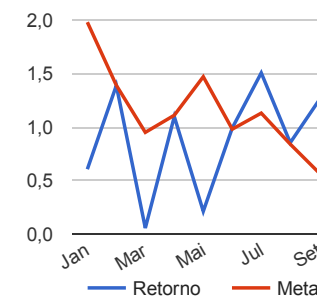
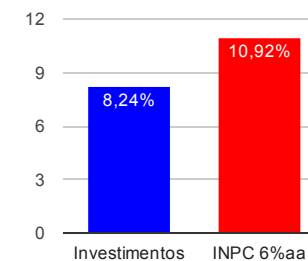
- IMA-B
- IDKA IPCA 2A
- IMA-B 5
- AÇÕES - SETORIAIS
- FIP
- CDI
- FUNDO IMOBILIÁRIO
- FIDC - FECHADO
- IRF-M 1
- AÇÕES - INDEXADO
- MULTIMER...
- CRÉDITO PRIVADO



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%
Acumulado no ano					6.367.574,10	8,24%	10,92%	75,45%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	11.729,83	0,00	481,75	47.645,07	36.396,99	310,29%	-	-
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	4.033,94	0,00	0,00	4.101,21	67,27	1,67%	2,40%	1,67%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	11.988.624,71	425.000,00	0,00	12.608.357,61	194.732,90	1,57%	2,30%	1,58%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.166.901,94	0,00	0,00	7.278.977,09	112.075,15	1,56%	2,30%	1,56%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	11.111.040,09	425.000,00	0,00	11.715.594,39	179.554,30	1,56%	2,34%	1,57%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.877.152,67	0,00	0,00	1.903.406,13	26.253,46	1,40%	0,78%	1,40%
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	9.246.799,74	0,00	35.834,72	9.340.224,25	129.259,23	1,40%	0,83%	1,40%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	137.575,60	0,00	0,00	139.491,55	1.915,95	1,39%	0,77%	1,39%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.609.774,51	0,00	0,00	5.685.416,03	75.641,52	1,35%	0,56%	1,35%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.552.870,28	0,00	35.834,72	7.617.427,99	100.392,43	1,33%	0,55%	1,33%
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	971.293,70	0,00	0,00	983.280,90	11.987,20	1,23%	0,82%	1,23%
BRDESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1.153.174,49	0,00	0,00	1.166.650,68	13.476,19	1,17%	0,07%	1,17%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.126.848,70	0,00	0,00	1.139.904,14	13.055,44	1,16%	0,08%	1,16%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.118.747,92	0,00	0,00	2.142.364,08	23.616,16	1,11%	0,03%	1,11%
TOWER BRIDGE II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	265.573,17	0,00	0,00	268.386,66	2.813,49	1,06%	0,85%	1,06%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.664.074,07	0,00	530.073,30	1.151.503,66	17.502,89	1,05%	0,02%	1,11%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	837.634,76	0,00	530.073,30	315.869,06	8.307,60	0,99%	0,01%	1,10%
SECURITY RENDA FIXA FI REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	875.621,84	0,00	0,00	880.486,50	4.864,66	0,56%	0,04%	0,56%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	2.409.685,51	0,00	62.566,64	2.336.914,95	-10.203,92	-0,42%	4,30%	-3,02%
Total Renda Fixa					941.708,91	1,42%	1,52%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	1.569.084,73	0,00	0,00	1.592.678,56	23.593,83	1,50%	1,57%	1,51%
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	1.644.861,99	0,00	0,00	1.660.448,53	15.586,54	0,95%	11,43%	0,95%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.827.914,17	0,00	0,00	2.854.231,30	26.317,13	0,93%	10,49%	0,93%
CONQUEST FIP - FCCQ11	3.821.433,56	0,00	0,00	3.827.001,10	5.567,54	0,15%	-	-
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.216.805,33	0,00	0,00	1.217.007,89	202,56	0,02%	7,26%	0,02%
ÁQUILLA FII - AQLL11	3.467.575,17	0,00	0,00	3.465.699,90	-1.875,27	-0,05%	-	0,00%
Total Renda Variável					69.392,33	0,48%	8,23%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre / 2016

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	13.936.712,72	0,00	4.982.005,48	9.340.224,25	385.517,01	3,64%	3,67%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	12.246.500,00	0,00	12.608.357,61	361.857,61	3,02%	4,97%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	4.519,17	11.376.500,00	0,00	11.715.594,39	334.575,22	3,01%	5,01%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.842.229,72	0,00	2.493.018,85	7.617.427,99	268.217,12	3,26%	3,70%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.158.914,74	0,00	1.695.517,79	5.685.416,03	222.019,08	3,73%	3,73%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	7.060.000,00	0,00	7.278.977,09	218.977,09	3,10%	5,03%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	10.967.633,42	0,00	9.932.778,45	1.151.503,66	116.648,69	2,91%	3,47%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.268.899,29	0,00	5.230.845,01	2.142.364,08	104.309,80	3,15%	3,54%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.779.900,15	0,00	953.399,96	1.903.406,13	76.905,94	3,62%	3,70%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	7.792.641,62	0,00	7.551.547,11	315.869,06	74.774,55	2,80%	3,49%
BRDESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1.128.310,61	0,00	0,00	1.166.650,68	38.340,07	3,40%	3,40%
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	10.261,60	0,00	481,75	47.645,07	37.865,22	369,00%	364,30%
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	945.671,18	0,00	0,00	983.280,90	37.609,72	3,98%	3,98%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.102.563,11	0,00	0,00	1.139.904,14	37.341,03	3,39%	3,39%
SECURITY RENDA FIXA FI REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	865.270,80	0,00	0,00	880.486,50	15.215,70	1,76%	1,76%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	205.053,30	0,00	71.329,45	139.491,55	5.767,70	3,69%	3,73%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	3.900,40	0,00	0,00	4.101,21	200,81	5,15%	5,15%
TOWER BRIDGE II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	277.514,83	0,00	0,00	268.386,66	-9.128,17	-3,29%	-3,29%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	2.531.310,78	0,00	166.517,39	2.336.914,95	-27.878,44	-1,12%	-7,68%
Total Renda Fixa					2.299.135,75	3,50%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre / 2016

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.552.775,06	0,00	0,00	2.854.231,30	301.456,24	11,81%	11,81%
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	1.474.921,95	0,00	0,00	1.660.448,53	185.526,58	12,58%	12,58%
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	1.515.627,14	0,00	0,00	1.592.678,56	77.051,42	5,08%	5,08%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.147.585,66	0,00	0,00	1.217.007,89	69.422,23	6,05%	6,05%
ÁQUILLA FII - AQLL11	3.469.009,97	0,00	0,00	3.465.699,90	-3.310,07	-0,10%	0,00%
CONQUEST FIP - FCCQ11	3.837.095,29	0,00	0,00	3.827.001,10	-10.094,19	-0,26%	-
Total Renda Variável					620.052,21	4,43%	