

# Relatório Analítico dos Investimentos em junho, 2º Trimestre e 1º semestre de 2016



Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 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	9.842.229,72	12,18%	602	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	7.158.914,74	8,86%	738	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	4.519,17	0,01%	111	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.102.563,11	1,36%	1.175	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.779.900,15	3,44%	701	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	13.936.712,72	17,24%	60	6,56%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	945.671,18	1,17%	37	0,23%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
TOWER BRIDGE II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	277.514,83	0,34%	36	0,23%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.900,40	0,00%	77	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.128.310,61	1,40%	91	0,10%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	205.053,30	0,25%	288	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	7.268.899,29	8,99%	824	0,13%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	10.967.633,42	13,57%	3.283	0,20%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	7.792.641,62	9,64%	381	0,13%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	10.261,60	0,01%	1	1,10%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	2.531.310,78	3,13%	98	2,14%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	1.474.921,95	1,82%	22.018	0,34%	Artigo 8º, Inciso I
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.552.775,06	3,16%	3.282	1,07%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	23/08/2017	1.147.585,66	1,42%	116	0,35%	Artigo 8º, Inciso III
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	D+4382	Não há	1.515.627,14	1,88%		0,75%	Artigo 8º, Inciso IV
CONQUEST FIP - FCCQ11	Não se aplica	Não se aplica	3.837.095,29	4,75%			Artigo 8º, Inciso V
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se aplica	Não se aplica	3.469.009,97	4,29%		5,50%	Artigo 8º, Inciso VI

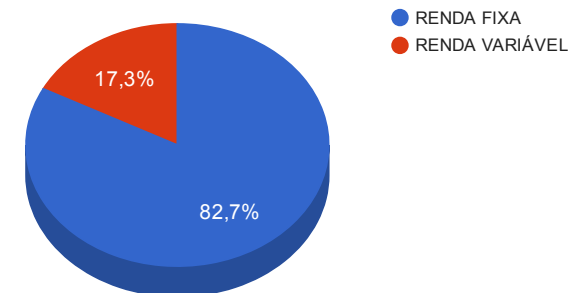
Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
SECURITY RENDA FIXA FI REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	D+90 ou D+150 a D+450	18 meses	865.270,80	1,07%	14	8,35%	Em Enquadramento - RF
<b>TOTAL -</b>			<b>80.818.322,51</b>				

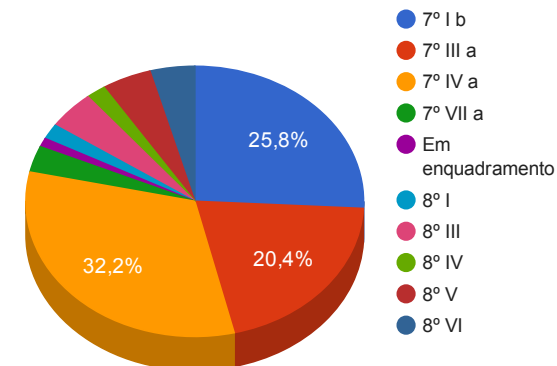
Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (junho / 2016)

Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	80,00%	20.888.126,89	25,85%	43.766.531,12
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	50,00%	16.497.163,04	20,41%	23.911.998,22
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	80,00%	10,00%	0,00	0,00%	8.081.832,25
<b>Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "</b>	<b>30,00%</b>	<b>30,00%</b>	<b>26.029.174,33</b>	<b>32,21%</b>	<b>-1.783.677,58</b>
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	30,00%	10,00%	0,00	0,00%	8.081.832,25
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	4.040.916,13
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	2.541.572,38	3,14%	1.499.343,75
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	4.040.916,13
<b>Em Enquadramento - RF</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>865.270,80</b>	<b>1,07%</b>	<b>-865.270,80</b>
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>195,00</b>	<b>66.821.307,44</b>	<b>82,68%</b>	

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	10,00%	1.474.921,95	1,82%	6.606.910,30
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	3.700.360,72	4,58%	8.422.387,66
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	1.515.627,14	1,88%	2.525.288,99
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	3.837.095,29	4,75%	203.820,84
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	3.469.009,97	4,29%	571.906,16
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>40,00</b>	<b>13.997.015,07</b>	<b>17,32%</b>	

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	1,93%	16,15%	5,83%	16,15%	16,73%	32,26%	-	-	-
BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	1,94%	15,75%	5,94%	15,75%	15,97%	31,68%	0,20%	2,407%	9,79%
BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1,85%	15,93%	5,68%	15,93%	15,92%	30,93%	0,20%	2,350%	9,81%
CDI + 3,50% ao ano	1,46%	8,54%	4,25%	8,54%	18,08%	36,68%	-	-	-
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-68,98%	-81,27%	-82,38%	-81,27%	-83,29%	-54,79%	0,20%	103,280%	87,20%
Selic	1,16%	6,73%	3,36%	6,73%	14,11%	27,66%	-	-	-
BRASESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,18%	6,72%	3,38%	6,72%	14,11%	27,85%	0,20%	0,013%	0,02%
CDI	1,16%	6,72%	3,36%	6,72%	14,09%	27,57%	-	-	-
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,16%	6,75%	3,39%	6,75%	14,22%	27,90%	0,25%	0,017%	0,08%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,07%	6,49%	3,22%	6,49%	13,92%	27,68%	0,20%	0,271%	0,17%
SECURITY RENDA FIXA FI REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	0,58%	-27,41%	-9,90%	-27,41%	-25,51%	-27,73%	1,00%	0,057%	24,01%
IRF-M 1	1,08%	7,42%	3,25%	7,42%	14,96%	27,79%	-	-	-
BRASESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1,06%	7,38%	3,22%	7,38%	14,78%	27,34%	0,20%	0,114%	0,77%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,03%	7,34%	3,22%	7,34%	14,66%	27,00%	0,10%	0,117%	0,51%
IMA-B 5	0,94%	8,84%	3,31%	8,84%	16,94%	31,07%	-	-	-
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1,45%	2,52%	4,12%	2,52%	-1,62%	8,34%	0,70%	1,015%	13,01%
TOWER BRIDGE II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1,34%	-	-	-	-	-	0,70%	1,178%	-

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

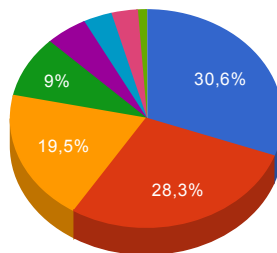
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,92%	8,66%	3,26%	8,66%	16,43%	30,14%	0,20%	1,106%	3,51%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,91%	8,75%	3,28%	8,75%	16,54%	30,11%	0,20%	1,106%	3,52%
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	0,88%	8,79%	3,32%	8,79%	16,23%	-	0,20%	1,203%	3,69%
IDKA IPCA 2 Anos	0,93%	8,58%	3,25%	8,58%	17,00%	31,47%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,88%	8,41%	3,32%	8,41%	16,74%	30,55%	0,20%	1,115%	3,11%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,82%	8,36%	3,26%	8,36%	16,56%	30,05%	0,20%	1,178%	3,23%
101,50% do IPCA + 5,75% ao ano	0,79%	7,06%	3,04%	7,06%	14,50%	31,16%	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,10%	-3,90%	-2,30%	-3,90%	-4,34%	-15,24%	0,25%	0,240%	3,65%

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

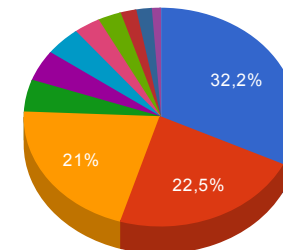
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDIV	7,69%	25,88%	6,70%	25,88%	-4,03%	-25,77%	-	-	-
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	3,91%	-12,48%	-3,08%	-12,48%	-15,14%	-20,58%	3,00%	10,830%	21,83%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	2,50%	6,47%	2,50%	6,47%	2,99%	2,50%	1,72%	5,552%	16,16%
Ibovespa	6,30%	18,86%	2,94%	18,86%	-2,93%	-3,09%	-	-	-
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	4,61%	-12,26%	-1,39%	-12,26%	-13,09%	-21,74%	4,00%	11,372%	21,18%
IFIX	1,61%	16,25%	10,30%	16,25%	12,19%	18,10%	-	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	0,00%	-	0,00%	-	48,51%	-56,80%	1,50%	-	48,50%
IPCA + 8,00% ao ano	1,03%	8,45%	3,73%	8,45%	17,55%	38,29%	-	-	-
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	0,60%	-2,13%	4,93%	-2,13%	5,57%	22,80%	0,12%	2,216%	14,02%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CONQUEST FIP - FCCQ11	-	-	-	-	-	-	0,30%	-	-

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	24.737.348,95	30,61%
BANCO BRADESCO	22.866.084,52	28,29%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	15.735.430,44	19,47%
Foco DTVM	7.306.105,26	9,04%
GERAÇÃO FUTURO	4.027.697,01	4,98%
Bridge Trust	2.738.813,15	3,39%
PETRA Corretora	2.531.310,78	3,13%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	865.270,80	1,07%
CITIBANK DTVM	10.261,60	0,01%



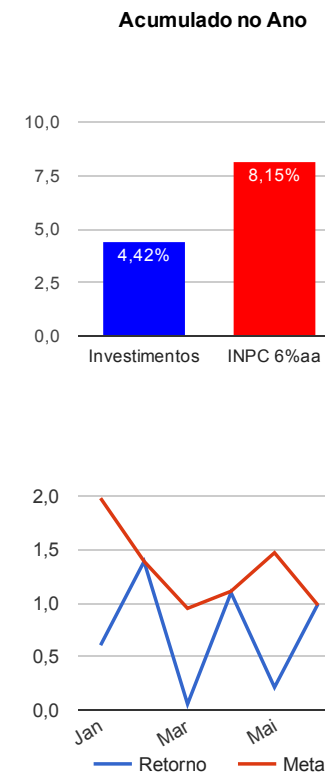
Sub-segmento	Valor	%
CDI	26.029.174,33	32,21%
IMA-B 5	18.144.852,18	22,45%
IDKA IPCA 2A	17.001.144,46	21,04%
FIP	3.837.095,29	4,75%
AÇÕES - SETORIAIS	3.700.360,72	4,58%
FUNDO IMOBILIÁRIO	3.469.009,97	4,29%
FIDC - FECHADO	2.541.572,38	3,14%
IRF-M 1	2.230.873,72	2,76%
MULTIMERCADO	1.515.627,14	1,88%
AÇÕES - INDEXADO	1.474.921,95	1,82%
CRÉDITO PRIVADO	865.270,80	1,07%
IMA-B	8.419,57	0,01%





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%
Acumulado no ano					3.448.386,14	4,42%	8,15%	54,28%	
Acumulado no 2º Trimestre					1.862.524,60	2,32%	3,60%	64,29%	



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	3.826,02	0,00	0,00	3.900,40	74,38	1,94%	2,41%	1,94%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	4.436,87	0,00	0,00	4.519,17	82,30	1,85%	2,35%	1,85%
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	932.176,33	0,00	0,00	945.671,18	13.494,85	1,45%	1,02%	1,45%
TOWER BRIDGE II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	273.856,78	0,00	0,00	277.514,83	3.658,05	1,34%	1,18%	1,34%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	8.093.313,83	140.000,00	536.510,92	7.792.641,62	95.838,71	1,16%	0,01%	1,18%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	11.372.028,17	0,00	536.510,92	10.967.633,42	132.116,17	1,16%	0,02%	1,16%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.192.291,01	0,00	0,00	7.268.899,29	76.608,28	1,07%	0,27%	1,07%
BRDESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1.116.506,10	0,00	0,00	1.128.310,61	11.804,51	1,06%	0,11%	1,06%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.091.277,02	0,00	0,00	1.102.563,11	11.286,09	1,03%	0,12%	1,03%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.754.610,72	0,00	0,00	2.779.900,15	25.289,43	0,92%	1,11%	0,92%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	203.205,77	0,00	0,00	205.053,30	1.847,53	0,91%	1,11%	0,91%
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	13.847.877,01	0,00	32.977,32	13.936.712,72	121.813,03	0,88%	1,20%	0,88%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.650.934,92	140.000,00	32.977,32	9.842.229,72	84.272,12	0,86%	1,11%	0,88%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.100.654,48	0,00	0,00	7.158.914,74	58.260,26	0,82%	1,18%	0,82%
SECURITY RENDA FIXA FI REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	860.281,92	0,00	0,00	865.270,80	4.988,88	0,58%	0,06%	0,58%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	2.533.833,24	0,00	0,00	2.531.310,78	-2.522,46	-0,10%	0,24%	-0,10%
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	33.081,68	0,00	0,00	10.261,60	-22.820,08	-68,98%	103,28%	-66,91%
Total Renda Fixa					616.092,05	0,92%	0,67%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	1.409.890,73	0,00	0,00	1.474.921,95	65.031,22	4,61%	11,37%	4,61%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.456.812,38	0,00	0,00	2.552.775,06	95.962,68	3,91%	10,83%	3,91%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.119.611,63	0,00	0,00	1.147.585,66	27.974,03	2,50%	5,55%	2,50%
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	1.506.555,67	0,00	0,00	1.515.627,14	9.071,47	0,60%	2,22%	0,60%
CONQUEST FIP - FCCQ11	3.841.348,88	0,00	0,00	3.837.095,29	-4.253,59	-0,11%	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	3.477.193,18	0,00	0,00	3.469.009,97	-8.183,21	-0,24%	-	0,00%
Total Renda Variável					185.602,60	1,34%	8,09%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º 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	13.577.861,61	0,00	91.149,75	13.936.712,72	450.000,86	3,32%	3,32%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	8.209.320,10	3.997.488,00	1.566.705,04	10.967.633,42	327.530,36	3,07%	3,39%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.451.436,43	140.000,00	62.389,87	9.842.229,72	313.183,16	3,31%	3,32%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	7.907.611,79	1.175.000,00	1.566.705,04	7.792.641,62	276.734,87	3,27%	3,38%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.042.035,26	0,00	0,00	7.268.899,29	226.864,03	3,22%	3,22%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.932.604,90	0,00	0,00	7.158.914,74	226.309,84	3,26%	3,26%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.692.257,76	0,00	0,00	2.779.900,15	87.642,39	3,26%	3,26%
CAIXA BRASIL IPCA IX FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	2.912.305,50	0,00	2.962.488,00	0,00	50.182,50	1,72%	-
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	908.261,88	0,00	0,00	945.671,18	37.409,30	4,12%	4,12%
BRDESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1.093.063,54	0,00	0,00	1.128.310,61	35.247,07	3,22%	3,22%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.068.141,01	0,00	0,00	1.102.563,11	34.422,10	3,22%	3,22%
TOWER BRIDGE II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	264.407,95	0,00	0,00	277.514,83	13.106,88	4,96%	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	198.539,05	0,00	0,00	205.053,30	6.514,25	3,28%	3,28%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	4.276,20	0,00	0,00	4.519,17	242,97	5,68%	5,68%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	3.681,86	0,00	0,00	3.900,40	218,54	5,94%	5,94%
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	58.237,94	0,00	0,00	10.261,60	-47.976,34	-82,38%	-82,38%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	2.590.786,46	0,00	2.725,64	2.531.310,78	-56.750,04	-2,19%	-2,30%
SECURITY RENDA FIXA FI REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	960.340,49	0,00	0,00	865.270,80	-95.069,69	-9,90%	-9,90%
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>1.885.813,05</b>	<b>2,84%</b>	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre / 2016

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	1.444.430,68	0,00	0,00	1.515.627,14	71.196,46	4,93%	4,93%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.119.611,63	0,00	0,00	1.147.585,66	27.974,03	2,50%	2,50%
ÁQUILLA FII - AQLL11	3.477.547,20	0,00	0,00	3.469.009,97	-8.537,23	-0,25%	0,00%
CONQUEST FIP - FCCQ11	3.849.054,69	0,00	0,00	3.837.095,29	-11.959,40	-0,31%	-
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	1.495.718,93	0,00	0,00	1.474.921,95	-20.796,98	-1,39%	-1,39%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.633.940,39	0,00	0,00	2.552.775,06	-81.165,33	-3,08%	-3,08%
<b>Total Renda Variável</b>					<b>-23.288,45</b>	<b>-0,17%</b>	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre / 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	633.134,65	13.936.712,72	695.074,47	7,60%	8,79%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	5.905.870,86	6.085.321,33	1.566.705,04	10.967.633,42	543.146,27	6,22%	6,75%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	5.615.711,44	3.262.833,33	1.566.705,04	7.792.641,62	480.801,89	6,40%	6,72%
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%	15,44%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.513.975,91	1.333.333,33	0,00	7.268.899,29	421.590,05	6,37%	6,49%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	10.062.011,76	604.374,77	9.842.229,72	384.592,73	4,05%	8,41%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	9.820.437,05	912.953,03	11.103.659,94	3.900,40	374.170,26	15,19%	15,75%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	6.892.905,32	0,00	7.158.914,74	266.009,42	3,86%	8,36%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	6.892.998,57	0,00	7.144.334,04	4.519,17	255.854,64	15,46%	15,93%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.558.313,66	0,00	0,00	2.779.900,15	221.586,49	8,66%	8,66%
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%	-
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	73.077,53	1.000.000,00	0,00	1.128.310,61	55.233,08	6,76%	7,38%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	49.718,96	1.000.000,00	0,00	1.102.563,11	52.844,15	6,66%	7,34%
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.190.958,38	0,00	264.407,95	945.671,18	19.120,75	2,52%	2,52%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	188.561,19	0,00	0,00	205.053,30	16.492,11	8,75%	8,75%
TOWER BRIDGE II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,00	264.407,95	0,00	277.514,83	13.106,88	4,96%	-
DIFERENCIAL FI RENDA FIXA LP	0,00	2.413,12	2.413,12	0,00	0,00	0,00%	12,85%
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	54.782,90	0,00	0,00	10.261,60	-44.521,30	-81,27%	-81,27%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	2.634.019,81	0,00	16.581,30	2.531.310,78	-86.127,73	-3,29%	-3,90%
SECURITY RENDA FIXA FI REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	1.192.074,97	0,00	0,00	865.270,80	-326.804,17	-27,41%	-27,41%
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>3.947.268,53</b>	<b>6,22%</b>	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre / 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	1.147.585,66	69.718,03	6,47%	6,47%
ÁQUILLA FII - AQLL11	3.409.802,51	0,00	0,00	3.469.009,97	59.207,46	1,74%	-
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	10.111,47	0,00	9.797,21	0,00	-314,26	-3,11%	14,59%
CONQUEST FIP - FCCQ11	3.861.436,88	0,00	0,00	3.837.095,29	-24.341,59	-0,63%	-
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	1.548.561,58	0,00	0,00	1.515.627,14	-32.934,44	-2,13%	-2,13%
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	1.680.965,47	0,00	0,00	1.474.921,95	-206.043,52	-12,26%	-12,26%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.916.949,13	0,00	0,00	2.552.775,06	-364.174,07	-12,48%	-12,48%
				<b>Total Renda Variável</b>	<b>-498.882,39</b>	<b>-3,44%</b>	