

Relatório Analítico dos Investimentos em dezembro, 4º Trimestre e ano de 2015



Carteira consolidada de investimentos - base (dezembro / 2015)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	49.718,96	0,07%	1.165	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	2.558.313,66	3,44%	631	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	73.077,53	0,10%	87	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	188.561,19	0,25%	208	0,02%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	6.892.998,57	9,26%	112	1,44%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	9.820.437,05	13,20%	83	0,96%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	3.048.620,76	4,10%	45	2,30%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	12.378.930,40	16,63%	344	0,52%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	1.190.958,38	1,60%	43	0,21%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	5.905.870,86	7,94%	2.356	0,14%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO PREMIUM FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	5.615.711,44	7,55%	390	0,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	5.513.975,91	7,41%	831	0,09%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	54.782,90	0,07%	28	1,10%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	2.634.019,81	3,54%	98	2,14%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IPCA IX FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	18/05/2016	2.800.009,50	3,76%	54	2,94%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVSPA ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	1.680.965,47	2,26%	23.387	0,34%	Artigo 8º, Inciso I
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	10.111,47	0,01%	13	0,18%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.916.949,13	3,92%	3.711	1,10%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	23/08/2017	1.077.867,63	1,45%	116	0,35%	Artigo 8º, Inciso III
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	D+4382	Não há	1.548.561,58	2,08%	5	0,75%	Artigo 8º, Inciso IV
CONQUEST FIP - FCCQ11	Não se aplica	Não se aplica	3.861.436,88	5,19%			Artigo 8º, Inciso V
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se aplica	Não se aplica	3.409.802,51	4,58%		5,41%	Artigo 8º, Inciso VI

Carteira consolidada de investimentos - base (dezembro / 2015)

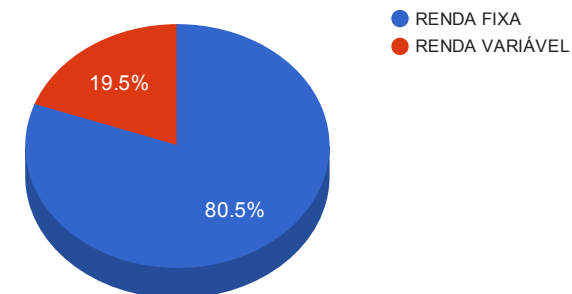
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
SECURITY FI REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	D+90 ou D+150 a D+450	18 meses	1.192.074,97	1,60%	14	8,35%	Em Enquadramento - RF
		TOTAL	74.423.756,56				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (dezembro / 2015)

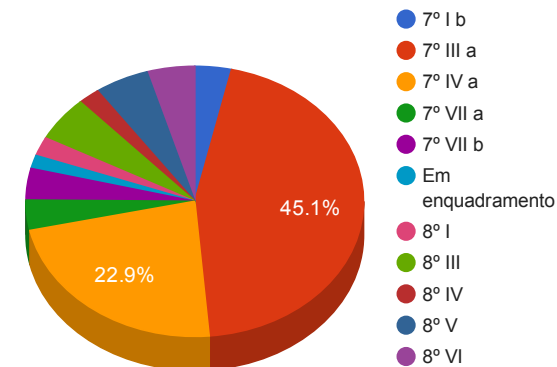
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	80,00%	2.608.032,62	3,50%	56.930.972,63
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	50,00%	33.593.583,88	45,14%	3.618.294,40
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	17.035.558,21	22,89%	5.291.568,76
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.721.187,83
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	2.688.802,71	3,61%	1.032.385,12
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	2.800.009,50	3,76%	921.178,33
Em Enquadramento - RF	0,00%	0,00%	1.192.074,97	1,60%	-1.192.074,97
Total Renda Fixa	100,00%	175,00	59.918.061,89	80,51%	

Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	10,00%	1.680.965,47	2,26%	5.761.410,19
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	4.004.928,23	5,38%	7.158.635,25
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	1.548.561,58	2,08%	2.172.626,25
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	3.861.436,88	5,19%	-140.249,05
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	3.409.802,51	4,58%	311.385,32
Total Renda Variável	30,00%	40,00	14.505.694,67	19,49%	

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Retorno dos investimentos de Renda Fixa - base (dezembro / 2015)

Ativos Renda Fixa	Benchmark	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	IMA-B 5	2,13%	14,45%	5,17%	6,83%	14,45%	0,20%	0,850%	3,37%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	IMA-B 5	2,07%	14,87%	5,10%	7,17%	14,87%	0,20%	0,827%	3,17%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	IMA-B 5	2,04%	14,86%	5,10%	7,14%	14,86%	0,20%	0,798%	3,20%
CAIXA BRASIL IPCA IX FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	IPCA + 6,00% ao ano	1,57%	16,52%	4,01%	7,05%	16,52%	0,20%	0,147%	0,34%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RE...	IMA-B	1,47%	8,25%	4,95%	-0,01%	8,25%	0,20%	1,450%	9,25%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	IMA-B	1,43%	8,64%	5,06%	0,19%	8,64%	0,20%	1,435%	9,22%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	IMA-B	1,21%	8,59%	5,04%	0,07%	8,59%	0,20%	1,277%	8,42%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	CDI	1,18%	13,46%	3,39%	6,98%	13,46%	0,20%	0,010%	0,07%
BRDESCO PREMIUM FI REFERENCIADO DI	Selic	1,16%	13,35%	3,36%	6,93%	13,35%	0,20%	0,013%	0,05%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	CDI	1,16%	13,42%	3,37%	6,99%	13,42%	0,25%	0,021%	0,09%
BRDESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	IRF-M 1	1,15%	12,83%	3,75%	6,90%	12,83%	0,20%	0,120%	0,78%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENC...	IRF-M 1	1,15%	12,58%	3,54%	6,82%	12,58%	0,10%	0,100%	0,52%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	101,50% do IPCA + 5,75% ao ano	1,10%	-3,55%	0,37%	-0,46%	-3,55%	0,25%	4,094%	3,17%
SECURITY FI REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	CDI	0,54%	-1,64%	1,59%	2,62%	-1,64%	1,00%	0,298%	6,80%
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	CDI + 3,50% ao ano	-2,20%	-15,68%	-4,89%	-10,77%	-15,68%	0,20%	1,259%	4,13%
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	IMA-B 5	-7,67%	1,66%	-4,85%	-4,00%	1,66%	0,70%	10,953%	7,85%

Indicadores e Benchmark's de Renda Fixa - base (dezembro / 2015)

Indicadores - Renda Fixa	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses
IMA-B 5	2,12%	15,46%	5,23%	7,45%	15,46%
IMA-B	1,52%	8,88%	5,21%	0,50%	8,88%
IPCA + 6,00% ao ano	1,47%	17,26%	4,32%	7,37%	17,26%
CDI + 3,50% ao ano	1,47%	17,17%	4,25%	8,79%	17,17%
INPC + 6% a.a. (Meta Atuarial)	1,41%	17,90%	4,31%	7,32%	17,90%
IRF-M 1	1,18%	13,01%	3,60%	7,02%	13,01%
Selic	1,16%	13,27%	3,36%	6,91%	13,27%
CDI	1,16%	13,24%	3,36%	6,91%	13,24%

Retorno dos investimentos de Renda Variável - base (dezembro / 2015)

Ativos Renda Variável	Benchmark	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	IPCA + 8,00% ao ano	1,73%	18,20%	4,39%	7,86%	18,20%	0,80%	0,159%	0,34%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	IDIV	0,11%	-3,22%	6,48%	-3,27%	-3,22%	1,72%	9,771%	15,03%
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	Ibovespa	-1,14%	0,69%	1,00%	-0,94%	0,69%	4,00%	6,164%	17,94%
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	IDIV	-2,14%	-22,60%	-2,36%	-20,00%	-22,60%	1,00%	10,018%	19,58%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	IDIV	-3,11%	-1,23%	-0,82%	-3,03%	-1,23%	3,00%	7,251%	18,65%
CONQUEST FIP - FCCQ11	Não definido	-	-	-	-	-	1,10%	-	1,35%
ÁQUILLA FII - AQLL11	IFIX	-	-	-	-	-	1,50%	-	68,59%

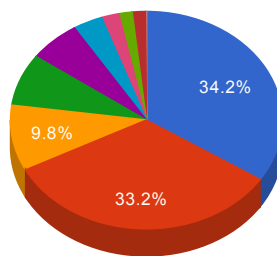
Indicadores e Benchmark's de Renda Variável - base (dezembro / 2015)

Indicadores - Renda Variável	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses
IPCA + 8,00% ao ano	1,64%	19,45%	4,81%	8,40%	19,45%
INPC + 6% a.a. (Meta Atuarial)	1,41%	17,90%	4,31%	7,32%	17,90%
Ibovespa	-3,93%	-13,31%	-3,80%	-18,33%	-13,31%
IDIV	-3,75%	-27,45%	-5,33%	-23,76%	-27,45%
IFIX	-2,96%	5,46%	0,64%	-3,49%	5,46%

Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (dezembro / 2015)

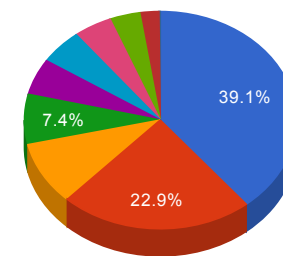
Administrador	Valor	%
BANCO BRADESCO	25.450.845,35	34,20%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	24.720.992,05	33,22%
FOCO INVESTIMENTOS	7.271.239,39	9,77%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	5.762.367,53	7,74%
GERAÇÃO FUTURO	4.597.914,60	6,18%
PETRA	2.634.019,81	3,54%
SANTANDER SECURITIES SERVICES	1.548.561,58	2,08%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	1.192.074,97	1,60%
GRADUAL INVESTIMENTOS	1.190.958,38	1,60%
CITIBANK DTVM	54.782,90	0,07%

- BANCO BRADESCO
- CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
- FOCO INVESTIM...
- BB GESTÃO DE RECUR...
- GERAÇÃO FUTURO
- PETRA
- SANTANDER SECURITIE...
- BNY MELLON S...
- GRADUAL INVESTIM...
- Outro



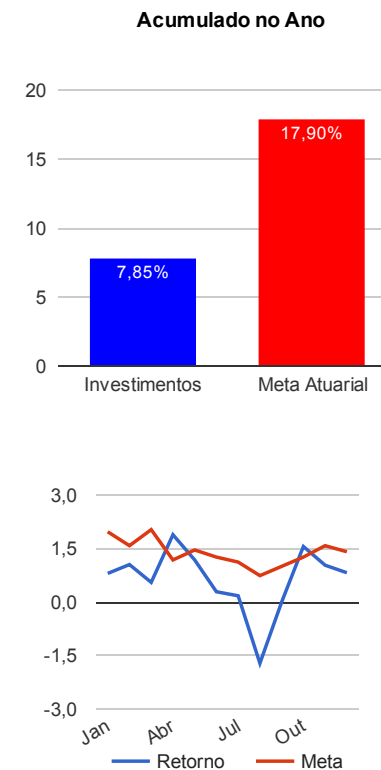
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	29.092.366,02	39,09%
CDI	17.035.558,21	22,89%
IMA-B 5	6.986.453,99	9,39%
CRÉDITO PRIVADO	5.540.646,05	7,44%
DIVIDENDOS	4.004.928,23	5,38%
FIP	3.861.436,88	5,19%
FUNDO IMOBILIÁRIO	3.409.802,51	4,58%
FIDC	2.688.802,71	3,61%
IBOVESPA	1.680.965,47	2,26%
IRF-M 1	122.796,49	0,16%

- IMA-B
- CDI
- IMA-B 5
- CRÉDITO PRIVADO
- DIVIDENDOS
- FIP
- FUNDO IMOBILIÁRIO
- FIDC
- IBOVESPA
- IRF-M 1



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2015

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	62.559.485,98	34.276,00	29.749,71	63.065.803,94	501.791,67	0,80%	1,97%	40,63%	2,83%
Fevereiro	63.065.803,94	0,00	27.441,44	63.701.163,81	662.801,31	1,05%	1,58%	66,44%	2,68%
Março	63.701.163,81	3.260.644,06	503.203,42	66.824.847,73	366.243,28	0,55%	2,03%	27,18%	2,78%
Abril	66.824.847,73	0,00	217.188,33	67.869.229,77	1.261.570,37	1,89%	1,18%	160,42%	2,76%
Mai	67.869.229,77	1.500.000,00	205.632,64	69.980.176,33	816.579,20	1,18%	1,46%	80,97%	2,64%
Junho	69.980.176,33	0,00	238.602,75	69.943.248,81	201.675,23	0,29%	1,26%	22,86%	1,83%
Julho	69.943.248,81	3.192.416,88	1.964.129,06	71.295.955,14	124.418,51	0,17%	1,12%	15,66%	2,60%
Agosto	71.295.955,14	1.522.023,64	916.918,09	70.665.887,83	-1.235.172,86	-1,72%	0,74%	-232,78%	3,05%
Setembro	70.665.887,83	1.344.000,00	948.448,27	71.060.852,39	-587,17	-0,00%	1,00%	-0,08%	6,13%
Outubro	71.060.852,39	21.538.018,55	21.009.509,62	72.703.930,58	1.114.569,26	1,56%	1,26%	123,51%	2,75%
Novembro	72.703.930,58	871.250,25	102.867,28	74.230.951,95	758.638,40	1,03%	1,58%	65,41%	2,45%
Dezembro	74.230.951,95	2.871.152,93	3.287.840,37	74.423.756,56	609.492,05	0,82%	1,41%	58,04%	1,67%
Acumulado no ano					5.182.019,25	7,85%	17,90%	43,86%	
Acumulado no 4º Trimestre					2.482.699,71	3,45%	4,31%	79,92%	



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de dezembro / 2015

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	2.928.837,14	56.785,73	0,00	3.048.620,76	62.997,89	2,11%	0,85%	2,13%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	184.733,97	0,00	0,00	188.561,19	3.827,22	2,07%	0,83%	2,07%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	2.605.236,89	0,00	19.997,41	2.634.019,81	48.780,33	1,87%	4,09%	1,10%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	434.922,99	2.082.592,06	0,00	2.558.313,66	40.798,61	1,62%	0,80%	2,04%
CAIXA BRASIL IPCA IX FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	2.756.671,50	0,00	0,00	2.800.009,50	43.338,00	1,57%	0,15%	1,57%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	6.792.828,02	0,00	0,00	6.892.998,57	100.170,55	1,47%	1,45%	1,47%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	10.052.817,69	125.961,99	500.347,74	9.820.437,05	142.005,11	1,40%	1,43%	1,43%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.449.638,16	0,00	0,00	5.513.975,91	64.337,75	1,18%	0,01%	1,18%
BRADESCO PREMIUM FI REFERENCIADO DI	5.551.130,92	0,00	0,00	5.615.711,44	64.580,52	1,16%	0,01%	1,16%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	5.838.028,01	0,00	0,00	5.905.870,86	67.842,85	1,16%	0,02%	1,16%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	72.243,47	0,00	0,00	73.077,53	834,06	1,15%	0,12%	1,15%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	49.151,90	0,00	0,00	49.718,96	567,06	1,15%	0,10%	1,15%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	12.253.226,18	605.813,15	626.209,72	12.378.930,40	146.100,79	1,14%	1,28%	1,21%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.012.886,55	0,00	2.030.695,68	0,00	17.809,13	0,88%	1,92%	0,96%
SECURITY FI REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	1.185.637,47	0,00	0,00	1.192.074,97	6.437,50	0,54%	0,30%	0,54%
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	56.017,92	0,00	1.288,14	54.782,90	53,12	0,09%	1,26%	0,09%
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.290.491,52	0,00	0,00	1.190.958,38	-99.533,14	-7,71%	10,95%	-7,67%
Total Renda Fixa					710.947,35	1,19%	1,16%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de dezembro / 2015

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	1.522.268,09	0,00	0,00	1.548.561,58	26.293,49	1,73%	0,16%	1,73%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.076.637,25	0,00	0,00	1.077.867,63	1.230,38	0,11%	9,77%	0,11%
CONQUEST FIP - FCCQ11	3.866.141,01	0,00	0,00	3.861.436,88	-4.704,13	-0,12%	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	3.420.401,35	0,00	0,00	3.409.802,51	-10.598,84	-0,31%	-	0,00%
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	109.825,63	0,00	109.301,68	0,00	-523,95	-0,48%	8,28%	-0,64%
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	1.700.399,50	0,00	0,00	1.680.965,47	-19.434,03	-1,14%	6,16%	-1,14%
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	10.333,09	0,00	0,00	10.111,47	-221,62	-2,14%	10,02%	-2,14%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	3.010.445,73	0,00	0,00	2.916.949,13	-93.496,60	-3,11%	7,25%	-3,11%
Total Renda Variável					-101.455,30	-0,69%	5,86%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre / 2015

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	13.529.223,03	735.813,15	2.517.240,95	12.378.930,40	631.135,17	4,90%	5,04%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	11.198.491,61	255.961,99	2.158.305,83	9.820.437,05	524.289,28	4,97%	5,06%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	7.282.435,67	0,00	728.243,56	6.892.998,57	338.806,46	4,90%	4,95%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	5.372.758,99	0,00	5.513.975,91	141.216,92	2,63%	3,39%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	5.770.983,77	0,00	5.905.870,86	134.887,09	2,34%	3,37%
BRADESCO PREMIUM FI REFERENCIADO DI	0,00	5.487.478,33	0,00	5.615.711,44	128.233,11	2,34%	3,36%
CAIXA BRASIL IPCA IX FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	2.692.152,00	0,00	0,00	2.800.009,50	107.857,50	4,01%	4,01%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	0,00	2.969.304,01	0,00	3.048.620,76	79.316,75	2,70%	5,17%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	5.487.478,33	0,00	5.487.478,33	73.077,53	73.077,53	3,52%	3,75%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.707.318,78	0,00	5.770.983,77	0,00	63.664,99	1,12%	3,55%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.372.758,99	0,00	5.372.758,99	49.718,96	49.718,96	3,14%	3,54%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	1.985.992,53	2.030.695,68	0,00	44.703,15	2,25%	4,86%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	2.624.368,54	0,00	34.207,56	2.634.019,81	43.858,83	1,68%	0,37%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	2.518.217,18	0,00	2.558.313,66	40.096,48	1,46%	5,10%
SECURITY FI REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	1.173.402,03	0,00	0,00	1.192.074,97	18.672,94	1,59%	1,59%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,00	183.911,78	0,00	188.561,19	4.649,41	2,53%	5,10%
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	57.599,32	0,00	2.819,35	54.782,90	2,93	0,00%	-4,89%
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.252.302,79	0,00	0,00	1.190.958,38	-61.344,41	-4,90%	-4,85%
Total Renda Fixa					2.362.843,09	4,11%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre / 2015

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.012.278,01	0,00	0,00	1.077.867,63	65.589,62	6,48%	6,48%
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	1.483.481,54	0,00	0,00	1.548.561,58	65.080,04	4,39%	4,39%
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	1.664.290,33	0,00	0,00	1.680.965,47	16.675,14	1,00%	1,00%
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	183.911,78	0,00	183.911,78	10.111,47	10.111,47	-1,12%	-2,36%
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	106.093,90	0,00	109.301,68	0,00	3.207,78	3,02%	2,86%
CONQUEST FIP - FCCQ11	3.860.667,62	0,00	0,00	3.861.436,88	769,26	0,02%	-
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	4.125,45	0,00	4.269,79	0,00	144,34	3,50%	-5,18%
ÁQUILLA FII - AQLL11	3.427.304,41	0,00	0,00	3.409.802,51	-17.501,90	-0,51%	-
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.941.168,26	0,00	0,00	2.916.949,13	-24.219,13	-0,82%	-0,82%
Total Renda Variável					119.856,62	0,82%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no Ano de 2015

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	10.132.410,32	5.355.677,05	4.022.713,28	12.378.930,40	913.556,31	8,59%	8,59%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	7.881.683,24	5.924.435,74	4.717.524,25	9.820.437,05	731.842,32	8,76%	8,64%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	7.060.103,20	0,00	728.243,56	6.892.998,57	561.138,93	8,20%	8,25%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.241.235,57	500.000,00	6.273.656,33	0,00	532.420,76	10,07%	12,76%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	5.045.985,54	0,00	5.487.478,33	73.077,53	514.570,32	12,57%	12,83%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.941.317,42	0,00	5.372.758,99	49.718,96	481.160,53	12,15%	12,58%
CAIXA BRASIL IPCA IX FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	2.403.103,50	0,00	0,00	2.800.009,50	396.906,00	16,52%	16,52%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	2.731.021,58	0,00	429.616,25	2.634.019,81	332.614,48	13,08%	-3,55%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	5.372.758,99	0,00	5.513.975,91	141.216,92	2,63%	13,46%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00	5.770.983,77	0,00	5.905.870,86	134.887,09	2,34%	13,42%
BRADESCO PREMIUM FI REFERENCIADO DI	0,00	5.487.478,33	0,00	5.615.711,44	128.233,11	2,34%	13,35%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	0,00	2.969.304,01	0,00	3.048.620,76	79.316,75	2,70%	14,45%
SECURITY FI REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	1.211.965,25	0,00	83.504,24	1.192.074,97	63.613,96	5,45%	-1,64%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	1.985.992,53	2.030.695,68	0,00	44.703,15	2,25%	5,05%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	2.518.217,18	0,00	2.558.313,66	40.096,48	1,46%	14,86%
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.172.091,63	0,00	0,00	1.190.958,38	18.866,75	1,61%	1,66%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,00	183.911,78	0,00	188.561,19	4.649,41	2,53%	14,87%
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	64.969,34	0,00	7.856,82	54.782,90	-2.329,62	-3,70%	-15,68%
Total Renda Fixa					5.117.463,65	9,98%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no Ano de 2015

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	1.310.098,19	0,00	0,00	1.548.561,58	238.463,39	18,20%	18,20%
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	1.669.519,61	0,00	0,00	1.680.965,47	11.445,86	0,69%	0,69%
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	4.628,49	0,00	4.269,79	0,00	-358,70	-7,75%	-15,49%
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	115.591,78	0,00	109.301,68	0,00	-6.290,10	-5,44%	-5,59%
CONQUEST FIP - FCCQ11	3.874.577,57	0,00	0,00	3.861.436,88	-13.140,69	-0,34%	-
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.884.918,92	65.022,93	0,00	2.916.949,13	-32.992,72	-1,10%	-1,23%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.113.741,60	0,00	0,00	1.077.867,63	-35.873,97	-3,22%	-3,22%
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	231.999,78	0,00	183.911,78	10.111,47	-37.976,53	-21,62%	-22,60%
ÁQUILLA FII - AQLL11	3.468.523,45	0,00	0,00	3.409.802,51	-58.720,94	-1,69%	-
Total Renda Variável					64.555,60	0,45%	

