

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



Carteira consolidada de investimentos - base (setembro / 2016)

| Produto / Fundo | Disponibilidade Resgate | Carência | Saldo | Particip. S/ Total | Qtde. Cotistas | % S/ PL Fundo | RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604 |
|--|-------------------------|---------------|---------------|--------------------|----------------|---------------|-------------------------------------|
| BRADESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA | D+1 | 16/05/2019 | 17.319.315,57 | 3,56% | 11 | 22,61% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| SAFRA IMA FIC RENDA FIXA | D+4 | Não há | 8.448.646,23 | 1,74% | 21 | 3,04% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | D+0 | Não há | 25.527.085,00 | 5,25% | 639 | 0,56% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | D+0 | 15/08/2024 | 13.926.739,98 | 2,87% | 70 | 1,80% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+0 | 18/08/2018 | 22.599.396,08 | 4,65% | 75 | 2,62% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP | D+1 | Não há | 10.719.898,31 | 2,21% | 118 | 1,86% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | D+0 | 15/08/2018 | 18.844.483,53 | 3,88% | 200 | 0,87% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+0 | 15/08/2022 | 35.753.715,82 | 7,36% | 167 | 3,34% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | D+0 | Não há | 24.612.444,83 | 5,06% | 1.331 | 0,24% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| CAIXA BRASIL 2018 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | D+0 | 16/08/2018 | 7.910.168,00 | 1,63% | 54 | 2,96% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA | D+1 | Não há | 23.191.147,28 | 4,77% | 37 | 4,08% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | D+0 | 15/08/2024 | 10.467.783,00 | 2,15% | 6 | 24,52% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+1 | Não há | 40.366.363,81 | 8,30% | 754 | 0,61% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA | D+1 | Não há | 39.058.985,97 | 8,04% | 116 | 6,56% | Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " |
| BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+1 | Não há | 13.248.102,52 | 2,73% | 248 | 1,13% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a " |
| SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA | D+1 | Não há | 34.291.107,93 | 7,05% | 12 | 10,49% | Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a " |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | D+0 | Não há | 1.422.303,51 | 0,29% | 801 | 0,03% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | D+0 | Não há | 49.124.804,87 | 10,11% | 385 | 0,73% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | D+0 | Não há | 17.527.810,07 | 3,61% | 760 | 0,37% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI | D+0 | Não há | 14.529.799,82 | 2,99% | 1.325 | 0,26% | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " |
| PREMIUM FIDC SÊNIOR | Não se aplica | Não se aplica | 1.674.416,96 | 0,34% | 98 | 1,53% | Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a " |
| CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES | D+4 | Não há | 3.297.851,62 | 0,68% | 86 | 4,19% | Artigo 8º, Inciso I |

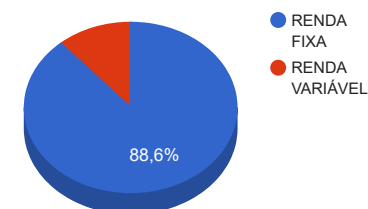
Carteira consolidada de investimentos - base (setembro / 2016)

| Produto / Fundo | Disponibilidade Resgate | Carência | Saldo | Particip. S/ Total | Qtde. Cotistas | % S/ PL Fundo | RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604 |
|---|-------------------------|----------------|-----------------------|--------------------|----------------|---------------|------------------------------------|
| ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES | D+5 | Não há | 2.761.542,66 | 0,57% | 42 | 0,59% | Artigo 8º, Inciso I |
| BRADESCO H REGIMES DE PREVIDÊNCIA IBOVESPA FIC AÇÕES | D+5 | Não há | 5.414.401,68 | 1,11% | 15 | 4,94% | Artigo 8º, Inciso I |
| ITAÚ FOF RPI 30 IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES | D+25 | Não há | 2.001.381,23 | 0,41% | 18 | 2,22% | Artigo 8º, Inciso I |
| BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES | D+30 | Não há | 4.850.249,61 | 1,00% | 155 | 2,46% | Artigo 8º, Inciso III |
| AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES | D+30 | Não há | 4.900.023,40 | 1,01% | 475 | 3,64% | Artigo 8º, Inciso III |
| BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES | D+4 ou D+33 | Não há | 4.568.856,32 | 0,94% | 282 | 3,00% | Artigo 8º, Inciso III |
| BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO | D+4 | Não há | 6.164.645,28 | 1,27% | 84 | 5,52% | Artigo 8º, Inciso III |
| WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO | D+5 | Não há | 8.141.772,11 | 1,68% | 29 | 4,52% | Artigo 8º, Inciso IV |
| CAIXA BRASIL IPCA VII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO | D+0 | 22/11/2016 | 10.825.427,40 | 2,23% | 20 | 10,83% | Artigo 8º, Inciso IV |
| CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTISTRATÉGIA FIP | Não se aplica | Não se aplica | 2.581.998,87 | 0,53% | 19 | 3,21% | Artigo 8º, Inciso V |
| | | TOTAL - | 486.072.669,27 | | | | |

Enquadramentos na Resolução 3.922 / 4.392 / 4.604 e Política de Investimentos - base (setembro / 2016)

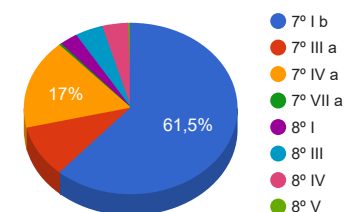
| Artigos - Renda Fixa | Limite Resolução | Limite Política | Total Artigo | % Carteira | GAP Política |
|-------------------------------------|------------------|-----------------|-----------------------|---------------|---------------|
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a " | 100,00% | 7,00% | 0,00 | 0,00% | 34.025.086,85 |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " | 100,00% | 60,00% | 298.746.173,41 | 61,46% | -7.102.571,85 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a " | 80,00% | 20,00% | 47.539.210,45 | 9,78% | 49.675.323,40 |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a " | 30,00% | 30,00% | 82.604.718,27 | 16,99% | 63.217.082,51 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a " | 5,00% | 3,00% | 1.674.416,96 | 0,34% | 12.907.763,12 |
| Total Renda Fixa | 100,00% | 120,00 | 430.564.519,09 | 88,58% | |

Distribuição por Segmento



| Artigos - Renda Variável | Limite Resolução | Limite Política | Total Artigo | % Carteira | GAP Política |
|-----------------------------|------------------|-----------------|----------------------|---------------|---------------|
| Artigo 8º, Inciso I | 30,00% | 8,00% | 13.475.177,19 | 2,77% | 25.410.636,35 |
| Artigo 8º, Inciso III | 15,00% | 10,00% | 20.483.774,61 | 4,21% | 28.123.492,32 |
| Artigo 8º, Inciso IV | 5,00% | 5,00% | 18.967.199,51 | 3,90% | 5.336.433,95 |
| Artigo 8º, Inciso V | 5,00% | 3,00% | 2.581.998,87 | 0,53% | 12.000.181,21 |
| Total Renda Variável | 30,00% | 26,00 | 55.508.150,18 | 11,42% | |

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% | - | - | - |
| BRASESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA | 1,74% | 11,52% | 3,90% | 4,73% | 13,97% | - | 0,20% | 0,826% | 5,62% |
| BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,64% | 21,66% | 5,17% | 11,11% | 27,79% | 35,14% | 0,30% | 2,270% | 6,99% |
| SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP | 1,58% | 21,94% | 5,00% | 11,13% | 28,22% | 35,09% | 0,20% | 2,286% | 7,06% |
| BRASESCO 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% |
| SAFRA IMA FIC RENDA FIXA | 1,55% | 19,96% | 4,90% | 10,37% | 25,86% | 35,07% | 0,45% | 2,426% | 6,40% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA | 1,52% | 21,54% | 4,90% | 10,88% | 27,72% | 34,61% | 0,40% | 2,285% | 7,04% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,40% | 12,66% | 3,59% | 7,28% | 18,44% | - | 0,20% | 0,970% | 2,50% |
| CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 1,34% | 6,28% | 0,70% | 4,21% | 12,34% | - | 0,20% | 0,462% | 5,24% |
| CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 1,13% | 13,78% | 1,85% | 7,28% | 19,52% | - | 0,20% | 2,215% | 8,78% |
| | | | | | | | | | |
| 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% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,34% | - | - | - | - | - | 0,20% | 0,462% | - |
| 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% |
| | | | | | | | | | |
| IRF-M 1 | 1,19% | 11,14% | 3,46% | 6,82% | 15,14% | 28,83% | - | - | - |
| SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA | 1,18% | 10,73% | 3,53% | 7,00% | 14,60% | 28,98% | 0,50% | 0,228% | 0,39% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 1,17% | 11,05% | 3,42% | 6,78% | 14,99% | 28,37% | 0,20% | 0,075% | 0,40% |

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 |
|---|--------|---------|---------|---------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| 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% |
| SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 1,11% | 10,43% | 3,48% | 7,00% | 14,15% | 28,69% | 0,20% | 0,003% | 0,02% |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 1,10% | 10,42% | 3,46% | 6,94% | 14,12% | 28,60% | 0,20% | 0,017% | 0,06% |
| 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% |
| Não Informado | - | - | - | - | - | - | - | - | - |
| BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 1,39% | - | 1,52% | 5,31% | - | - | 0,15% | 1,763% | - |
| CAIXA BRASIL 2018 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 1,34% | 6,57% | 0,81% | 4,31% | 12,65% | - | 0,20% | 0,463% | 5,12% |

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

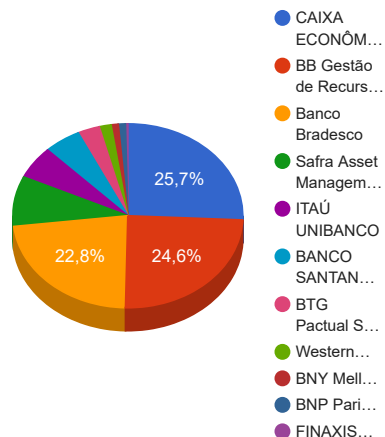
| | Mês | Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | Taxa adm | VaR - Mês | Volatilidade - 12 meses |
|---|--------|--------|---------|---------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| CDI | 1,11% | 10,42% | 3,47% | 6,94% | 14,13% | 28,50% | - | - | - |
| WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO | 0,81% | 11,96% | 4,37% | 7,72% | 15,37% | 39,49% | 2,00% | 0,701% | 1,87% |
| IBX-50 | 0,86% | 32,99% | 12,94% | 15,61% | 26,41% | 6,94% | - | - | - |
| CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES | 0,66% | 19,60% | 10,98% | 11,26% | 13,40% | -3,63% | 0,70% | 11,411% | 24,65% |
| Ibovespa | 0,80% | 34,64% | 13,28% | 16,61% | 29,53% | 7,86% | - | - | - |
| BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES | 0,52% | 15,21% | 7,32% | 14,56% | 22,90% | 26,72% | 2,00% | 2,667% | 10,97% |
| BRADESCO H REGIMES DE PREVIDÊNCIA IBOVESPA FIC AÇÕES | -0,14% | 22,00% | 10,13% | 13,10% | 18,40% | 7,16% | 1,00% | 10,130% | 19,26% |
| ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES | -0,22% | 28,10% | 9,62% | 16,08% | 25,10% | 12,42% | 1,50% | 9,932% | 19,37% |
| ITAÚ FOF RPI 30 IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES | -0,64% | 30,38% | 10,49% | 17,77% | 29,52% | 14,62% | 1,50% | 8,965% | 18,97% |
| BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES | -1,19% | 24,18% | 3,62% | 12,54% | 17,01% | 24,58% | 3,00% | 8,000% | 18,31% |
| IPCA + 6,00% ao ano | 0,57% | 10,22% | 2,57% | 5,90% | 14,98% | 33,45% | - | - | - |
| CAIXA BRASIL IPCA VII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO | 0,81% | 11,05% | 2,80% | 6,15% | 15,73% | 33,98% | 0,20% | 0,070% | 0,41% |
| SMLL | 0,09% | 35,19% | 14,90% | 26,78% | 32,37% | -4,76% | - | - | - |
| AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES | -1,43% | 17,29% | 6,52% | 15,18% | 18,00% | 5,80% | 2,00% | 9,273% | 17,30% |
| IGC | -0,06% | 27,72% | 10,70% | 14,42% | 23,02% | 9,74% | - | - | - |
| BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO | -0,09% | 27,29% | 10,57% | 14,16% | 22,78% | 9,26% | 1,00% | 9,612% | 22,62% |
| Não Possui | - | - | - | - | - | - | - | - | - |

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

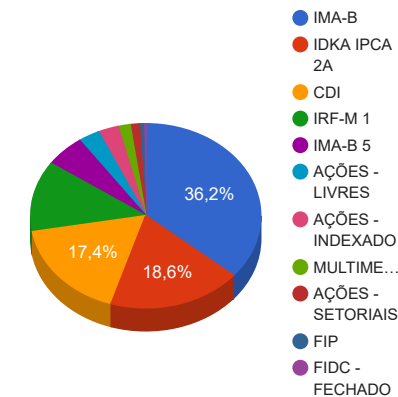
| | Mês | Ano | 3 meses | 6 meses | 12 meses | 24 meses | Taxa adm | VaR - Mês | Volatilidade - 12 meses |
|---|-----|-----|---------|---------|----------|----------|----------|-----------|-------------------------|
| CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTISTRATÉGIA FIP | - | - | - | - | - | - | 1,50% | 0,004% | 41,47% |

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

| Administrador | Valor | % |
|----------------------------------|----------------|--------|
| CAIXA ECONÔMICA FEDERAL | 125.054.009,30 | 25,73% |
| BB Gestão de Recursos DTVM | 119.554.527,02 | 24,60% |
| Banco Bradesco | 110.917.508,09 | 22,82% |
| Safra Asset Management | 42.739.754,16 | 8,79% |
| ITAÚ UNIBANCO | 27.954.071,17 | 5,75% |
| BANCO SANTANDER | 25.249.698,13 | 5,19% |
| BTG Pactual Serviços Financeiros | 15.036.639,32 | 3,09% |
| Western Asset | 8.141.772,11 | 1,68% |
| BNY Mellon Serviços Financeiros | 4.900.023,40 | 1,01% |
| BNP Paribas | 4.850.249,61 | 1,00% |
| FINAXIS Corretora | 1.674.416,96 | 0,34% |



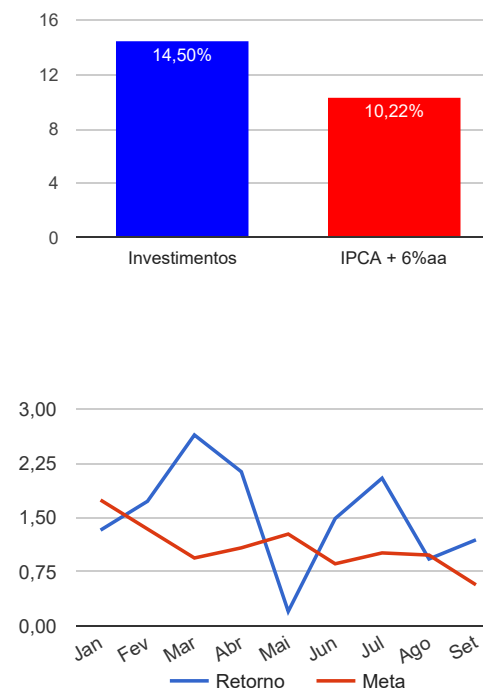
| Sub-segmento | Valor | % |
|-------------------|----------------|--------|
| IMA-B | 172.134.334,68 | 35,41% |
| IDKA IPCA 2A | 88.492.844,89 | 18,21% |
| CDI | 82.604.718,27 | 16,99% |
| IRF-M 1 | 58.903.552,76 | 12,12% |
| IMA-B 5 | 26.754.651,53 | 5,50% |
| AÇÕES - LIVRES | 14.319.129,33 | 2,95% |
| AÇÕES - INDEXADO | 13.475.177,19 | 2,77% |
| MULTIMERCADO | 8.141.772,11 | 1,68% |
| AÇÕES - SETORIAIS | 6.164.645,28 | 1,27% |
| FIP | 2.581.998,87 | 0,53% |
| FIDC - FECHADO | 1.674.416,96 | 0,34% |



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

| Mês | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual | Retorno (\$) | Retorno (%) | Meta (%) | Gap (%) | VaR (%) |
|------------------|----------------|----------------|----------------|----------------|---------------|-------------|----------|---------|---------|
| Janeiro | 427.005.108,00 | 11.927.148,13 | 11.222.950,69 | 433.375.135,20 | 5.665.829,76 | 1,32% | 1,74% | 76,16% | 2,00% |
| Fevereiro | 433.375.135,20 | 46.641.906,95 | 46.137.073,06 | 441.355.740,40 | 7.475.771,31 | 1,72% | 1,34% | 128,18% | 2,31% |
| Março | 441.355.740,40 | 9.096.704,14 | 10.247.469,52 | 451.848.557,18 | 11.643.582,16 | 2,64% | 0,94% | 280,00% | 3,13% |
| Abril | 451.848.557,18 | 11.924.050,74 | 10.852.012,11 | 462.571.507,76 | 9.650.911,95 | 2,13% | 1,08% | 197,97% | 2,20% |
| Mai | 462.571.507,76 | 11.016.057,32 | 11.055.604,93 | 463.470.726,32 | 938.766,17 | 0,20% | 1,27% | 15,97% | 1,73% |
| Junho | 463.470.726,32 | 21.977.168,48 | 20.878.789,76 | 471.465.587,19 | 6.896.482,15 | 1,48% | 0,86% | 172,26% | 1,60% |
| Julho | 471.465.587,19 | 30.911.151,87 | 35.636.085,95 | 476.364.178,66 | 9.623.525,55 | 2,04% | 1,01% | 202,24% | 1,14% |
| Agosto | 476.364.178,66 | 135.511.142,29 | 136.851.616,02 | 479.435.587,47 | 4.411.882,54 | 0,93% | 0,98% | 94,93% | 1,59% |
| Setembro | 479.435.587,47 | 12.503.934,07 | 11.585.829,46 | 486.072.669,27 | 5.718.977,19 | 1,19% | 0,57% | 209,92% | 1,43% |
| Acumulado no ano | | | | | 62.025.728,78 | 14,50% | 10,22% | 141,89% | |

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(%) |
|---|---------------|---------------|---------------|---------------|---------------------|--------------|---------------|----------------|
| BRADERCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA | 17.023.374,43 | 0,00 | 0,00 | 17.319.315,57 | 295.941,14 | 1,74% | 0,83% | 1,74% |
| BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 13.033.948,00 | 0,00 | 0,00 | 13.248.102,52 | 214.154,52 | 1,64% | 2,27% | 1,64% |
| SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIX... | 10.553.292,72 | 0,00 | 0,00 | 10.719.898,31 | 166.605,59 | 1,58% | 2,29% | 1,58% |
| BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA | 38.454.339,14 | 0,00 | 0,00 | 39.058.985,97 | 604.646,83 | 1,57% | 2,34% | 1,57% |
| SAFRA IMA FIC RENDA FIXA | 8.319.555,51 | 0,00 | 0,00 | 8.448.646,23 | 129.090,72 | 1,55% | 2,43% | 1,55% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA | 22.844.187,95 | 0,00 | 0,00 | 23.191.147,28 | 346.959,33 | 1,52% | 2,28% | 1,52% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 35.260.921,98 | 0,00 | 0,00 | 35.753.715,82 | 492.793,84 | 1,40% | 0,97% | 1,40% |
| BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 10.324.651,50 | 0,00 | 0,00 | 10.467.783,00 | 143.131,50 | 1,39% | 1,76% | 1,39% |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 39.806.548,32 | 22.946,26 | 0,00 | 40.366.363,81 | 536.869,23 | 1,35% | 0,56% | 1,35% |
| CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 18.595.064,38 | 0,00 | 0,00 | 18.844.483,53 | 249.419,15 | 1,34% | 0,46% | 1,34% |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 22.300.560,80 | 0,00 | 0,00 | 22.599.396,08 | 298.835,28 | 1,34% | 0,46% | 1,34% |
| CAIXA BRASIL 2018 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 7.805.574,00 | 0,00 | 0,00 | 7.910.168,00 | 104.594,00 | 1,34% | 0,46% | 1,34% |
| SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA | 33.890.716,20 | 0,00 | 0,00 | 34.291.107,93 | 400.391,73 | 1,18% | 0,23% | 1,18% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 24.625.108,09 | 0,00 | 300.000,00 | 24.612.444,83 | 287.336,74 | 1,17% | 0,08% | 1,17% |
| CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 13.771.737,01 | 0,00 | 0,00 | 13.926.739,98 | 155.002,97 | 1,13% | 2,21% | 1,13% |
| SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 14.370.616,75 | 0,00 | 0,00 | 14.529.799,82 | 159.183,07 | 1,11% | 0,00% | 1,11% |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 17.336.401,81 | 0,00 | 0,00 | 17.527.810,07 | 191.408,26 | 1,10% | 0,02% | 1,10% |
| BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 48.591.370,25 | 0,00 | 0,00 | 49.124.804,87 | 533.434,62 | 1,10% | 0,01% | 1,10% |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 24.628.484,12 | 11.775.363,20 | 11.241.000,00 | 25.527.085,00 | 364.237,68 | 1,00% | 0,55% | 1,33% |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 702.909,17 | 705.624,61 | 0,00 | 1.422.303,51 | 13.769,73 | 0,98% | 0,03% | 1,11% |
| PREMIUM FIDC SÊNIOR | 1.726.557,59 | 0,00 | 44.829,46 | 1.674.416,96 | -7.311,17 | -0,42% | 4,30% | -3,02% |
| Total Renda Fixa | | | | | 5.680.494,76 | 1,34% | 0,92% | |

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(%) |
|---|---------------|------------|----------|---------------|---------------|-------------|---------------|----------------|
| CAIXA BRASIL IPCA VII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO | 10.737.992,40 | 0,00 | 0,00 | 10.825.427,40 | 87.435,00 | 0,81% | 0,07% | 0,81% |
| WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO | 8.076.246,76 | 0,00 | 0,00 | 8.141.772,11 | 65.525,35 | 0,81% | 0,70% | 0,81% |
| CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES | 3.276.245,49 | 0,00 | 0,00 | 3.297.851,62 | 21.606,13 | 0,66% | 11,41% | 0,66% |
| BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES | 4.825.163,83 | 0,00 | 0,00 | 4.850.249,61 | 25.085,78 | 0,52% | 2,67% | 0,52% |
| BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO | 6.169.891,25 | 0,00 | 0,00 | 6.164.645,28 | -5.245,97 | -0,09% | 9,61% | -0,09% |
| CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTISTRATÉGIA FIP | 2.585.252,76 | 0,00 | 0,00 | 2.581.998,87 | -3.253,89 | -0,13% | 0,00% | -0,13% |
| BRDESCO H REGIMES DE PREVIDÊNCIA IBOVESPA FIC AÇÕES | 5.422.126,56 | 0,00 | 0,00 | 5.414.401,68 | -7.724,88 | -0,14% | 10,13% | -0,14% |
| ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES | 2.767.559,15 | 0,00 | 0,00 | 2.761.542,66 | -6.016,49 | -0,22% | 9,93% | -0,22% |
| ITAÚ FOF RPI 30 IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES | 2.014.284,59 | 0,00 | 0,00 | 2.001.381,23 | -12.903,36 | -0,64% | 8,97% | -0,64% |
| BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES | 4.623.861,29 | 0,00 | 0,00 | 4.568.856,32 | -55.004,97 | -1,19% | 8,00% | -1,19% |
| AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES | 4.971.043,67 | 0,00 | 0,00 | 4.900.023,40 | -71.020,27 | -1,43% | 9,27% | -1,43% |
| Total Renda Variável | | | | | 38.482,43 | 0,07% | 5,38% | |

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 (%) |
|---|---------------|---------------|---------------|---------------|----------------------|--------------|-----------------|
| BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 69.442.555,66 | 0,00 | 35.753.044,14 | 35.753.715,82 | 2.064.204,30 | 3,69% | 3,59% |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA | 37.197.144,33 | 0,00 | 0,00 | 39.058.985,97 | 1.861.841,64 | 5,01% | 5,01% |
| BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 47.468.164,62 | 0,00 | 0,00 | 49.124.804,87 | 1.656.640,25 | 3,49% | 3,49% |
| SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA | 33.122.761,76 | 0,00 | 0,00 | 34.291.107,93 | 1.168.346,17 | 3,53% | 3,53% |
| ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA | 22.108.814,90 | 0,00 | 0,00 | 23.191.147,28 | 1.082.332,38 | 4,90% | 4,90% |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP | 37.073.832,33 | 17.179.245,00 | 37.563.634,55 | 17.527.810,07 | 838.367,29 | 2,67% | 3,46% |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 25.577.020,73 | 0,00 | 1.793.322,09 | 24.612.444,83 | 828.746,19 | 3,37% | 3,42% |
| CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 13.674.373,92 | 0,00 | 400.511,68 | 13.926.739,98 | 652.877,74 | 4,81% | 1,85% |
| BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 12.596.741,77 | 0,00 | 0,00 | 13.248.102,52 | 651.360,75 | 5,17% | 5,17% |
| BRADESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA | 16.668.696,62 | 0,00 | 0,00 | 17.319.315,57 | 650.618,95 | 3,90% | 3,90% |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 3.972.854,08 | 35.775.990,40 | 0,00 | 40.366.363,81 | 617.519,33 | 2,52% | 3,73% |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 21.969.108,51 | 1.939.219,77 | 23.011.967,33 | 1.422.303,51 | 525.942,56 | 3,25% | 3,54% |
| SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIX... | 10.209.177,40 | 0,00 | 0,00 | 10.719.898,31 | 510.720,91 | 5,00% | 5,00% |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 9.044.318,01 | 55.372.895,35 | 39.389.779,23 | 25.527.085,00 | 499.650,87 | 1,56% | 3,70% |
| SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI | 14.040.512,59 | 0,00 | 0,00 | 14.529.799,82 | 489.287,23 | 3,48% | 3,48% |
| BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 10.311.078,60 | 0,00 | 291.978,86 | 10.467.783,00 | 448.683,26 | 4,39% | 1,52% |
| SAFRA IMA FIC RENDA FIXA | 8.054.005,94 | 0,00 | 0,00 | 8.448.646,23 | 394.640,29 | 4,90% | 4,90% |
| CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 0,00 | 19.000.000,00 | 546.076,78 | 18.844.483,53 | 390.560,31 | 2,09% | 0,70% |
| CAIXA BRASIL 2016 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 16.868.760,00 | 0,00 | 17.179.245,00 | 0,00 | 310.485,00 | 1,84% | - |
| BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,00 | 22.309.433,92 | 0,00 | 22.599.396,08 | 289.962,16 | 1,30% | - |
| CAIXA BRASIL 2018 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 7.846.769,00 | 0,00 | 220.612,40 | 7.910.168,00 | 284.011,40 | 3,66% | 0,81% |
| PREMIUM FIDC SÊNIOR | 1.813.703,02 | 0,00 | 122.642,15 | 1.674.416,96 | -16.643,91 | -0,94% | -7,68% |
| Total Renda Fixa | | | | | 16.200.155,07 | 3,89% | |

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 (%) |
|---|---------------|--------------|--------------|---------------|---------------|-------------|-----------------|
| BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO | 10.626.281,60 | 0,00 | 5.500.000,00 | 6.164.645,28 | 1.038.363,68 | 9,73% | 10,57% |
| CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES | 5.728.465,51 | 0,00 | 3.000.000,00 | 3.297.851,62 | 569.386,11 | 10,20% | 10,98% |
| BRADESCO H REGIMES DE PREVIDÊNCIA IBOVESPA FIC AÇÕES | 4.916.569,95 | 0,00 | 0,00 | 5.414.401,68 | 497.831,73 | 10,13% | 10,13% |
| SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES | 3.570.451,72 | 0,00 | 3.945.571,03 | 0,00 | 375.119,31 | 10,51% | 13,11% |
| CAIXA BRASIL IPCA VII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO | 10.530.926,60 | 0,00 | 0,00 | 10.825.427,40 | 294.500,80 | 2,80% | 2,80% |
| ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES | 2.519.172,94 | 0,00 | 0,00 | 2.761.542,66 | 242.369,72 | 9,62% | 9,62% |
| ITAÚ FOF RPI 30 IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES | 1.811.401,78 | 0,00 | 0,00 | 2.001.381,23 | 189.979,45 | 10,49% | 10,49% |
| SAFRA CARTEIRA INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO | 7.873.127,44 | 0,00 | 8.030.779,86 | 0,00 | 157.652,42 | 2,00% | 3,55% |
| BRADESCO GOVERNANÇA CORPORATIVA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO | 1.787.786,12 | 0,00 | 1.936.546,45 | 0,00 | 148.760,33 | 8,32% | 9,64% |
| BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES | 0,00 | 4.722.785,51 | 0,00 | 4.850.249,61 | 127.464,10 | 2,70% | 7,32% |
| WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO | 0,00 | 8.030.779,86 | 0,00 | 8.141.772,11 | 110.992,25 | 1,38% | 4,37% |
| AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES | 0,00 | 4.936.546,45 | 4.936.546,45 | 0,00 | 0,00 | 0,00% | 15,48% |
| CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTISTRATÉGIA FIP | 3.041.009,74 | 0,00 | 451.273,43 | 2.581.998,87 | -7.737,44 | -0,29% | - |
| AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES | 0,00 | 4.936.546,45 | 0,00 | 4.900.023,40 | -36.523,05 | -0,74% | 6,52% |
| BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES | 0,00 | 4.722.785,52 | 0,00 | 4.568.856,32 | -153.929,20 | -3,26% | 3,62% |
| Total Renda Variável | | | | | 3.554.230,21 | 6,78% | |