

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 / 4.392 / 4.604
BRDESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	D+1	16/05/2019	16.680.592,97	3,38%	11	22,61%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	8.082.487,18	1,64%		2,33%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	14.178.658,11	2,87%	72	1,73%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	19.251.505,51	3,90%	223	0,62%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	20.029.431,14	4,06%	731	0,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	18/08/2018	43.401.438,02	8,79%	100	3,78%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2018	8.085.434,00	1,64%	54	2,96%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	10.228.774,85	2,07%	48	2,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.238.564,19	0,25%	1.340	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	10.692.395,10	2,17%	6	24,52%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	547.506,00	0,11%	1.188	0,82%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	9.077.548,73	1,84%	620	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	16.760.885,78	3,40%	38	2,91%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	40.029.612,29	8,11%	110	6,92%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	36.533.020,51	7,40%	167	3,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	D+1	Não há	22.243.308,88	4,51%	12	6,95%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	13.566.750,49	2,75%	244	1,22%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	65.409.416,10	13,25%	758	1,09%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	50.799.817,36	10,29%	411	0,69%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.754.688,80	0,36%	787	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	9.591.870,13	1,94%	62	0,78%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	15.005.234,29	3,04%	1.321	0,28%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "

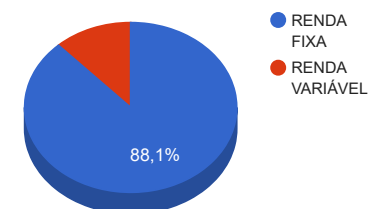
Carteira consolidada de investimentos - base (dezembro / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	1.632.751,62	0,33%	98	1,53%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	6.194.419,44	1,25%	41	1,29%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ FOF RPI 30 IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+25	Não há	2.009.789,51	0,41%	16	2,27%	Artigo 8º, Inciso I
BRDESCO H REGIMES DE PREVIDÊNCIA IBOVESPA FIC AÇÕES	D+5	Não há	5.532.686,02	1,12%	11	7,12%	Artigo 8º, Inciso I
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	5.204.209,10	1,05%	154	2,06%	Artigo 8º, Inciso III
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou D+33	Não há	4.353.189,63	0,88%	319	2,45%	Artigo 8º, Inciso III
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	5.016.639,12	1,02%	493	3,50%	Artigo 8º, Inciso III
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	6.217.587,16	1,26%	83	5,76%	Artigo 8º, Inciso III
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	13.175.682,62	2,67%	645	2,31%	Artigo 8º, Inciso IV
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	D+5	Não há	8.543.722,48	1,73%	33	3,35%	Artigo 8º, Inciso IV
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	2.571.488,86	0,52%	19	3,21%	Artigo 8º, Inciso V
		TOTAL -	493.641.105,99				

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

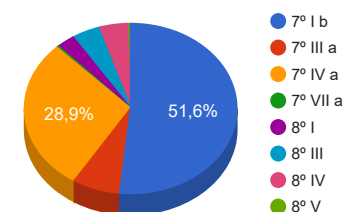
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	7,00%	0,00	0,00%	34.554.877,42
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	60,00%	254.817.854,38	51,62%	41.366.809,21
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	20,00%	35.810.059,37	7,25%	62.918.161,83
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	142.561.026,68	28,88%	5.531.305,12
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	3,00%	1.632.751,62	0,33%	13.176.481,56
Total Renda Fixa	100,00%	120,00	434.821.692,05	88,08%	

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	8,00%	13.736.894,97	2,78%	25.754.393,51
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	10,00%	20.791.625,01	4,21%	28.572.485,59
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	21.719.405,10	4,40%	2.962.650,20
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	3,00%	2.571.488,86	0,52%	12.237.744,32
Total Renda Variável	30,00%	26,00	58.819.413,94	11,92%	

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	2,91%	24,81%	2,30%	7,46%	24,81%	35,90%	-	-	-
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP	2,89%	24,69%	2,25%	7,36%	24,69%	35,56%	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%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,88%	24,46%	2,30%	7,59%	24,46%	35,19%	0,30%	3,580%	7,27%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA	2,87%	24,19%	2,18%	7,18%	24,19%	34,62%	0,40%	3,573%	7,32%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	2,83%	23,98%	2,39%	7,58%	23,98%	35,93%	0,15%	3,648%	7,72%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	2,75%	22,47%	2,10%	7,10%	22,47%	35,21%	0,45%	3,772%	7,04%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,74%	15,84%	1,81%	3,69%	15,84%	-	0,20%	3,199%	8,64%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,42%	15,11%	2,18%	5,84%	15,11%	-	0,20%	1,491%	2,60%
BRASESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	1,24%	7,40%	-3,69%	0,07%	7,40%	-	0,20%	1,403%	7,06%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,13%	8,58%	2,16%	2,88%	8,58%	-	0,20%	0,783%	4,98%
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%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,12%	-	2,21%	-	-	-	0,20%	0,779%	-
IRF-M 1	1,20%	14,72%	3,22%	6,79%	14,72%	29,64%	-	-	-
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	1,32%	14,39%	3,30%	6,95%	14,39%	29,73%	0,50%	0,395%	0,54%

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

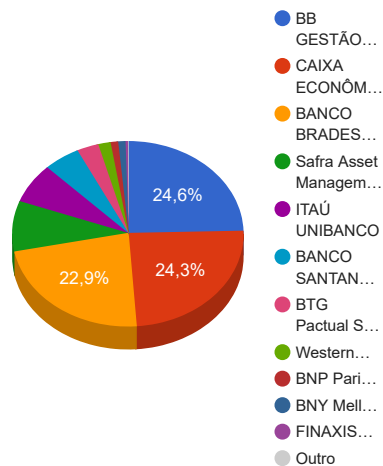
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,18%	14,58%	3,18%	6,71%	14,58%	29,20%	0,20%	0,098%	0,35%
Selic	1,12%	14,02%	3,24%	6,83%	14,02%	29,15%	-	-	-
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,12%	14,25%	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%
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,13%	14,04%	3,27%	6,87%	14,04%	29,29%	0,20%	0,005%	0,02%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,11%	14,00%	3,24%	6,81%	14,00%	29,18%	0,20%	0,016%	0,04%
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%
IPCA	0,30%	6,29%	0,74%	1,79%	6,29%	17,63%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2,12%	21,48%	2,91%	7,50%	21,48%	-	0,40%	2,341%	4,41%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,84%	-	2,15%	3,70%	-	-	0,15%	2,568%	7,28%
CAIXA BRASIL 2018 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,12%	8,93%	2,22%	3,04%	8,93%	-	0,20%	0,782%	4,84%

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

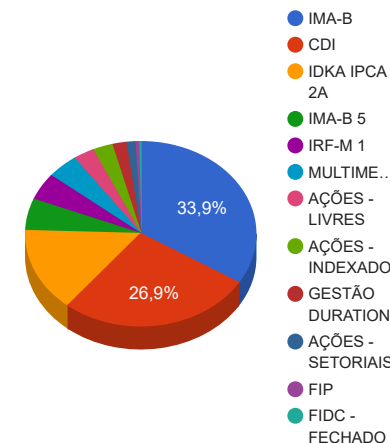
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	1,12%	14,00%	3,24%	6,82%	14,00%	29,09%	-	-	-
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	1,41%	14,72%	3,01%	6,73%	14,72%	31,46%	0,50%	0,651%	1,36%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	1,39%	17,48%	4,94%	9,52%	17,48%	-	2,00%	0,617%	1,88%
Ibovespa	-2,71%	38,94%	3,19%	16,89%	38,94%	20,44%	-	-	-
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	3,84%	23,62%	7,30%	15,15%	23,62%	36,03%	2,00%	4,665%	10,35%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-1,23%	18,32%	-4,72%	-1,27%	18,32%	16,92%	3,00%	9,167%	18,69%
ITAÚ FOF RPI 30 IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	-1,47%	30,93%	0,42%	10,95%	30,93%	20,44%	1,50%	8,646%	19,14%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	-1,50%	29,55%	1,13%	10,86%	29,55%	17,63%	1,50%	9,071%	19,83%
BRDESCO H REGIMES DE PREVIDÊNCIA IBOVESPA FIC AÇÕES	-1,54%	24,67%	2,18%	12,53%	24,67%	13,83%	1,00%	8,930%	19,80%
IGC	-1,39%	28,91%	0,94%	11,74%	28,91%	13,48%	-	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	-1,43%	28,38%	0,86%	11,51%	28,38%	13,09%	1,00%	10,115%	22,57%
SMLL	-0,54%	31,75%	-2,54%	11,98%	31,75%	2,30%	-	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	2,26%	20,08%	2,38%	9,05%	20,08%	12,32%	2,00%	5,531%	18,85%
Não Possui	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTIELSTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,50%	0,018%	26,62%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	121.502.916,12	24,61%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	119.812.615,50	24,27%
BANCO BRADESCO	113.042.708,64	22,90%
Safra Asset Management	43.501.478,68	8,81%
ITAÚ UNIBANCO	34.556.964,86	7,00%
BANCO SANTANDER	25.234.009,14	5,11%
BTG Pactual Serviços Financeiros	15.045.584,73	3,05%
Western Asset	8.543.722,48	1,73%
BNP Paribas	5.204.209,10	1,05%
BNY Mellon Serviços Financeiros	5.016.639,12	1,02%
FINAXIS Corretora	1.632.751,62	0,33%
Geração Futuro	547.506,00	0,11%



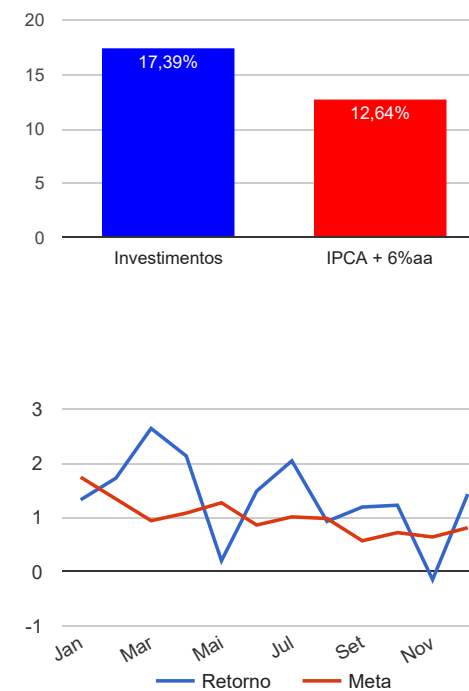
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	167.300.683,28	33,89%
CDI	132.969.156,55	26,94%
IDKA IPCA 2A	72.508.417,89	14,69%
IMA-B 5	27.336.939,51	5,54%
IRF-M 1	23.481.873,07	4,76%
MULTIMERCADO	21.719.405,10	4,40%
AÇÕES - LIVRES	14.574.037,85	2,95%
AÇÕES - INDEXADO	13.736.894,97	2,78%
GESTÃO DURATION	9.591.870,13	1,94%
AÇÕES - SETORIAIS	6.217.587,16	1,26%
FIP	2.571.488,86	0,52%
FIDC - FECHADO	1.632.751,62	0,33%



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%
Outubro	486.072.669,27	24.932.414,09	21.880.452,26	495.115.645,03	5.991.013,93	1,22%	0,72%	169,01%	1,17%
Novembro	495.115.645,03	101.301.218,02	103.096.218,87	492.604.117,63	-716.526,55	-0,14%	0,64%	-22,46%	2,68%
Dezembro	492.604.117,63	10.657.683,36	16.665.881,91	493.641.105,99	7.045.186,91	1,43%	0,81%	176,24%	1,79%
Acumulado no ano					74.345.403,07	17,39%	12,64%	137,57%	

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(%)
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIX...	9.941.031,07	0,00	0,00	10.228.774,85	287.743,78	2,89%	3,58%	2,89%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	38.906.992,82	0,00	0,00	40.029.612,29	1.122.619,47	2,89%	3,59%	2,89%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.172.629,28	13.902,62	0,00	13.566.750,49	380.218,59	2,88%	3,58%	2,88%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA	16.293.728,99	0,00	0,00	16.760.885,78	467.156,79	2,87%	3,57%	2,87%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	532.439,81	0,00	0,00	547.506,00	15.066,19	2,83%	3,65%	2,83%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	7.866.449,57	0,00	0,00	8.082.487,18	216.037,61	2,75%	3,77%	2,75%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	9.392.600,66	0,00	0,00	9.591.870,13	199.269,47	2,12%	2,34%	2,12%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.499.408,10	0,00	0,00	10.692.395,10	192.987,00	1,84%	2,57%	1,84%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	13.936.181,60	0,00	0,00	14.178.658,11	242.476,51	1,74%	3,20%	1,74%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	36.022.083,59	0,00	0,00	36.533.020,51	510.936,92	1,42%	1,49%	1,42%
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	21.954.256,74	0,00	0,00	22.243.308,88	289.052,14	1,32%	0,39%	1,32%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	19.782.283,07	0,00	0,00	20.029.431,14	247.148,07	1,25%	1,06%	1,25%
BRADERCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	16.476.053,61	0,00	0,00	16.680.592,97	204.539,36	1,24%	1,40%	1,24%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.735.021,68	0,00	0,00	1.754.688,80	19.667,12	1,13%	0,01%	1,13%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	19.037.140,49	0,00	0,00	19.251.505,51	214.365,02	1,13%	0,78%	1,13%
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	14.838.262,72	0,00	0,00	15.005.234,29	166.971,57	1,13%	0,01%	1,13%
CAIXA BRASIL 2018 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.995.519,00	0,00	0,00	8.085.434,00	89.915,00	1,12%	0,78%	1,12%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	42.918.928,28	0,00	0,00	43.401.438,02	482.509,74	1,12%	0,78%	1,12%
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	50.238.524,61	0,00	0,00	50.799.817,36	561.292,75	1,12%	0,01%	1,12%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.641.853,95	0,00	420.000,00	1.238.564,19	16.710,24	1,02%	0,10%	1,18%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	54.121.079,44	10.643.780,74	0,00	65.409.416,10	644.555,92	1,00%	0,02%	1,11%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	25.091.475,13	0,00	16.244.459,93	9.077.548,73	230.533,53	0,92%	1,02%	1,23%

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(%)
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.636.240,65	0,00	1.421,98	1.632.751,62	-2.067,05	-0,13%	0,14%	-0,21%
				Total Renda Fixa	6.799.705,74	1,57%	1,36%	

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(%)
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	5.011.786,34	0,00	0,00	5.204.209,10	192.422,76	3,84%	4,66%	3,84%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	4.905.628,76	0,00	0,00	5.016.639,12	111.010,36	2,26%	5,53%	2,26%
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	12.992.598,62	0,00	0,00	13.175.682,62	183.084,00	1,41%	0,65%	1,41%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	8.426.249,41	0,00	0,00	8.543.722,48	117.473,07	1,39%	0,62%	1,39%
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTISTRATÉGIA FIP	2.575.223,27	0,00	0,00	2.571.488,86	-3.734,41	-0,15%	0,02%	-0,15%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4.407.381,73	0,00	0,00	4.353.189,63	-54.192,10	-1,23%	9,17%	-1,23%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	6.307.514,16	0,00	0,00	6.217.587,16	-89.927,00	-1,43%	10,12%	-1,43%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	2.039.738,33	0,00	0,00	2.009.789,51	-29.948,82	-1,47%	8,65%	-1,47%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	6.288.564,76	0,00	0,00	6.194.419,44	-94.145,32	-1,50%	9,07%	-1,50%
BRDESCO H REGIMES DE PREVIDÊNCIA IBOVESPA FIC AÇÕES	5.619.247,39	0,00	0,00	5.532.686,02	-86.561,37	-1,54%	8,93%	-1,54%
Total Renda Variável					245.481,17	0,42%	4,96%	

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 (%)
BRABESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	49.124.804,87	20.000.000,00	20.000.000,00	50.799.817,36	1.675.012,49	3,09%	3,45%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	17.527.810,07	46.855.555,55	0,00	65.409.416,10	1.026.050,48	2,43%	3,24%
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	34.291.107,93	0,00	13.000.000,00	22.243.308,88	952.200,95	3,28%	3,30%
BRABESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	39.058.985,97	976.998,88	940.000,00	40.029.612,29	933.627,44	2,39%	2,31%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	22.599.396,08	20.000.000,00	0,00	43.401.438,02	802.041,94	2,07%	2,21%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	35.753.715,82	0,00	0,00	36.533.020,51	779.304,69	2,18%	2,18%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	40.366.363,81	0,00	20.895.000,00	20.029.431,14	558.067,33	2,04%	2,22%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	25.527.085,00	21.810.296,96	38.807.959,93	9.077.548,73	548.126,70	1,78%	2,24%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	24.612.444,83	0,00	23.862.143,54	1.238.564,19	488.262,90	2,96%	3,18%
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	14.529.799,82	0,00	0,00	15.005.234,29	475.434,47	3,27%	3,27%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA	23.191.147,28	540.000,00	7.440.000,00	16.760.885,78	469.738,50	2,47%	2,18%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	18.844.483,53	0,00	0,00	19.251.505,51	407.021,98	2,16%	2,16%
BRABESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	17.319.315,57	0,00	976.998,88	16.680.592,97	338.276,28	2,02%	-3,69%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.248.102,52	13.902,62	0,00	13.566.750,49	304.745,35	2,30%	2,30%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	13.926.739,98	0,00	0,00	14.178.658,11	251.918,13	1,81%	1,81%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIX...	10.719.898,31	0,00	725.000,00	10.228.774,85	233.876,54	2,29%	2,25%
BGT PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.467.783,00	0,00	0,00	10.692.395,10	224.612,10	2,15%	2,15%
CAIXA BRASIL 2018 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.910.168,00	0,00	0,00	8.085.434,00	175.266,00	2,22%	2,22%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	8.448.646,23	0,00	540.000,00	8.082.487,18	173.840,95	2,15%	2,10%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00	9.460.000,00	0,00	9.591.870,13	131.870,13	1,39%	2,91%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.422.303,51	278.775,10	0,00	1.754.688,80	53.610,19	3,24%	3,28%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	0,00	540.000,00	0,00	547.506,00	7.506,00	1,39%	2,39%

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 (%)
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.674.416,96	0,00	32.789,36	1.632.751,62	-8.875,98	-0,53%	-2,49%
				Total Renda Fixa	11.001.535,56	2,55%	

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 (%)
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	8.141.772,11	0,00	0,00	8.543.722,48	401.950,37	4,94%	4,94%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	4.850.249,61	0,00	0,00	5.204.209,10	353.959,49	7,30%	7,30%
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	0,00	12.966.651,60	0,00	13.175.682,62	209.031,02	1,61%	3,01%
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	3.297.851,62	0,00	3.450.917,33	0,00	153.065,71	4,64%	2,34%
CAIXA BRASIL IPCA VII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	10.825.427,40	0,00	10.971.744,00	0,00	146.316,60	1,35%	-
BRDESCO H REGIMES DE PREVIDÊNCIA IBOVESPA FIC AÇÕES	5.414.401,68	0,00	0,00	5.532.686,02	118.284,34	2,18%	2,18%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	4.900.023,40	0,00	0,00	5.016.639,12	116.615,72	2,38%	2,38%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	6.164.645,28	0,00	0,00	6.217.587,16	52.941,88	0,86%	0,86%
ITAÚ FOF RPI 30 IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	2.001.381,23	0,00	0,00	2.009.789,51	8.408,28	0,42%	0,42%
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTIESTRATÉGIA FIP	2.581.998,87	0,00	0,00	2.571.488,86	-10.510,01	-0,41%	-
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	2.761.542,66	3.449.134,76	0,00	6.194.419,44	-16.257,98	4,69%	1,13%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4.568.856,32	0,00	0,00	4.353.189,63	-215.666,69	-4,72%	-4,72%
Total Renda Variável					1.318.138,73	2,48%	

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 (%)
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	65.733.919,21	0,00	37.700.543,80	36.533.020,51	8.499.645,10	15,21%	15,11%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	34.923.797,84	1.414.309,51	4.475.964,98	40.029.612,29	8.167.469,92	24,60%	24,55%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	46.948.753,93	20.000.000,00	22.505.922,67	50.799.817,36	6.356.986,10	13,83%	14,25%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO FIC RENDA FIXA	22.782.284,47	540.000,00	11.593.917,14	16.760.885,78	5.032.518,45	24,49%	24,19%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	43.804.969,56	77.394.557,58	60.155.179,44	65.409.416,10	4.365.068,40	11,85%	14,00%
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	9.247.172,77	22.095.285,48	13.000.000,00	22.243.308,88	3.900.850,63	13,90%	14,39%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	15.365.337,43	59.880.187,75	77.138.635,57	1.238.564,19	3.131.674,58	12,73%	14,58%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.675.607,34	1.961.402,28	1.903.230,50	13.566.750,49	2.832.971,37	24,19%	24,46%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.240.130,84	0,00	818.732,64	14.178.658,11	2.757.259,91	23,20%	15,84%
BRADESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	15.530.878,80	0,00	1.414.309,51	16.680.592,97	2.564.023,68	16,78%	7,40%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIX...	10.304.047,84	0,00	2.443.860,02	10.228.774,85	2.368.587,03	24,70%	24,69%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.370.680,30	0,00	578.391,03	10.692.395,10	1.900.105,83	20,84%	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	19.468.038,23	3.424.123,35	23.011.967,33	1.754.688,80	1.874.494,55	13,49%	13,88%
SANTANDER CORPORATE FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	13.894.704,68	0,00	748.186,55	15.005.234,29	1.858.716,16	14,01%	14,04%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.512.805,85	39.773.148,95	36.023.857,42	20.029.431,14	1.767.333,76	8,38%	14,89%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	8.297.515,16	0,00	1.930.467,41	8.082.487,18	1.715.439,43	22,47%	22,47%
CAIXA BRASIL 2016 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	16.195.260,00	0,00	17.640.309,73	0,00	1.445.049,73	9,10%	-
CAIXA BRASIL 2018 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.422.723,00	0,00	436.674,85	8.085.434,00	1.099.385,85	15,21%	8,93%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	42.309.433,92	0,00	43.401.438,02	1.092.004,10	3,40%	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	86.842.900,49	78.781.061,93	9.077.548,73	1.015.710,17	3,02%	14,94%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	19.000.000,00	546.076,78	19.251.505,51	797.582,29	4,30%	8,58%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00	9.460.000,00	0,00	9.591.870,13	131.870,13	1,39%	21,48%

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 (%)
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	0,00	540.000,00	0,00	547.506,00	7.506,00	1,39%	23,98%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.887.294,79	0,00	172.100,85	1.632.751,62	-82.442,32	-4,45%	-13,49%
				Total Renda Fixa	64.599.810,85	17,01%	

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 (%)
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	9.229.940,42	0,00	5.500.000,00	6.217.587,16	2.487.646,74	27,42%	28,38%
CAIXA BRASIL IPCA VII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	9.748.083,20	0,00	10.971.744,00	0,00	1.223.660,80	12,55%	-
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	5.315.609,86	0,00	6.450.917,33	0,00	1.135.307,47	24,27%	22,39%
BRADESCO H REGIMES DE PREVIDÊNCIA IBOVESPA FIC AÇÕES	4.437.900,84	0,00	0,00	5.532.686,02	1.094.785,18	24,67%	24,67%
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	3.095.712,33	0,00	3.945.571,03	0,00	849.858,70	27,45%	33,41%
SAFRA CARTEIRA INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	7.335.002,48	0,00	8.030.779,86	0,00	695.777,38	9,49%	14,37%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	2.155.800,55	3.449.134,76	0,00	6.194.419,44	589.484,13	34,11%	29,55%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	0,00	8.030.779,86	0,00	8.543.722,48	512.942,62	6,39%	17,48%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	0,00	4.722.785,51	0,00	5.204.209,10	481.423,59	10,19%	23,62%
ITAÚ FOF RPI 30 IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	1.534.984,02	0,00	0,00	2.009.789,51	474.805,49	30,93%	30,93%
BRADESCO GOVERNANÇA CORPORATIVA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	1.626.134,11	0,00	1.936.546,45	0,00	310.412,34	19,09%	23,23%
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	0,00	12.966.651,60	0,00	13.175.682,62	209.031,02	1,61%	14,72%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	0,00	4.936.546,45	0,00	5.016.639,12	80.092,67	1,62%	20,08%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	0,00	4.936.546,45	4.936.546,45	0,00	0,00	0,00%	25,97%
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTISTRATÉGIA FIP	3.920.018,15	0,00	1.318.489,27	2.571.488,86	-30.040,02	-1,08%	-
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,00	4.722.785,52	0,00	4.353.189,63	-369.595,89	-7,83%	18,32%
Total Renda Variável					9.745.592,22	20,71%	