

Relatório Analítico dos Investimentos em dezembro, 4º Trimestre e ano de 2016



Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

Carteira consolidada de investimentos - base (dezembro / 2016)

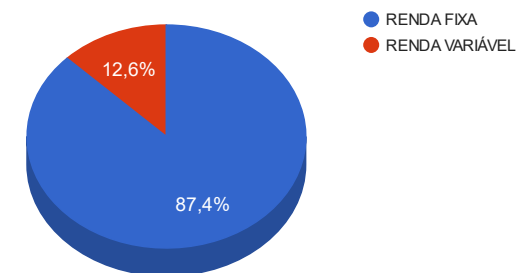
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	29.284.648,47	8,76%	1.183	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	21.737.012,21	6,50%	48	4,54%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	41.739.196,48	12,48%	242	3,97%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	17.002.075,08	5,08%	14	12,75%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	6.185.609,13	1,85%	603	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADERCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	D+1	16/05/2019	11.108.915,74	3,32%	11	15,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.441.326,53	0,43%	365	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	61.362.029,65	18,35%	713	1,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	67.917.160,86	20,31%	88	5,34%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	13.532.038,47	4,05%	95	3,67%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BTG PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA	D+0 ou D+1	Não há	12.200.800,00	3,65%	12	8,43%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	2.146.692,96	0,64%	62	0,18%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+30 a D+2880	Não há	6.548.738,25	1,96%	50	1,97%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	7.037.805,08	2,10%	21.866	1,35%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	23/08/2017	1.130.131,00	0,34%	116	0,33%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	8.237.462,26	2,46%	2.948	3,12%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	D+5	Não há	8.486.552,71	2,54%	33	3,33%	Artigo 8º, Inciso IV
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	5.933.297,53	1,77%	355	4,28%	Artigo 8º, Inciso IV
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	816.825,88	0,24%	19	1,02%	Artigo 8º, Inciso V
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	Não se aplica	Não se aplica	3.986.338,05	1,19%	115	0,72%	Artigo 8º, Inciso V
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPPF11	Não se aplica	Não se aplica	1.291.809,23	0,39%		0,80%	Artigo 8º, Inciso VI
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	Não se aplica	Não se aplica	5.303.958,33	1,59%			Artigo 8º, Inciso VI
TOTAL -			334.430.423,90				

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

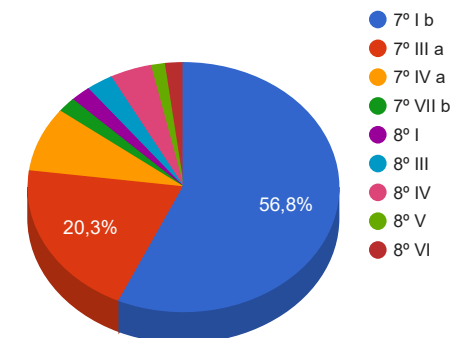
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	80,00%	189.860.813,29	56,77%	77.683.525,83
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	50,00%	67.917.160,86	20,31%	99.298.051,09
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	27.879.531,43	8,34%	72.449.595,74
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	16.721.521,20
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	16.721.521,20
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	6.548.738,25	1,96%	10.172.782,95
Total Renda Fixa	100,00%	175,00	292.206.243,83	87,37%	

Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	5,00%	7.037.805,08	2,10%	9.683.716,12
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	10,00%	9.367.593,26	2,80%	24.075.449,13
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	14.419.850,24	4,31%	2.301.670,96
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	4.803.163,93	1,44%	11.918.357,27
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	6.595.767,56	1,97%	10.125.753,64
Total Renda Variável	30,00%	30,00	42.224.180,07	12,63%	

Distribuição por Segmento



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 5+	3,71%	31,04%	2,33%	8,46%	31,04%	38,52%	-	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,71%	30,74%	2,24%	8,34%	30,74%	37,82%	0,20%	4,872%	10,46%
IMA-B	2,91%	24,81%	2,30%	7,46%	24,81%	35,90%	-	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	3,00%	24,64%	2,42%	7,69%	24,64%	35,41%	0,20%	3,678%	7,48%
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%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,89%	24,52%	2,23%	7,37%	24,52%	35,13%	0,20%	3,579%	7,34%
BRADESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	1,24%	7,40%	-3,69%	0,07%	7,40%	-	0,20%	1,403%	7,06%
IMA-B 5	1,39%	15,48%	2,27%	6,11%	15,48%	33,33%	-	-	-
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	1,73%	18,27%	1,97%	6,21%	18,27%	34,03%	0,40%	1,633%	3,81%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	1,38%	15,27%	2,22%	6,01%	15,27%	32,83%	0,10%	1,325%	2,61%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,38%	15,19%	2,23%	6,01%	15,19%	32,31%	0,20%	1,325%	2,60%
IRF-M 1	1,20%	14,72%	3,22%	6,79%	14,72%	29,64%	-	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,17%	14,48%	3,16%	6,66%	14,48%	28,89%	0,10%	0,100%	0,35%
IPCA + 6,00% ao ano	0,81%	12,64%	2,20%	4,83%	12,64%	32,08%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,79%	20,85%	2,15%	7,00%	20,85%	33,35%	0,15%	2,608%	6,41%
BTG PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA	0,71%	6,84%	-0,78%	2,00%	6,84%	18,23%	0,15%	0,193%	3,97%
IPCA	0,30%	6,29%	0,74%	1,79%	6,29%	17,63%	-	-	-

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
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2,12%	21,48%	2,91%	7,50%	21,48%	-	0,40%	2,341%	4,41%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1,64%	19,98%	2,51%	7,50%	19,98%	34,50%	0,20%	2,044%	4,70%

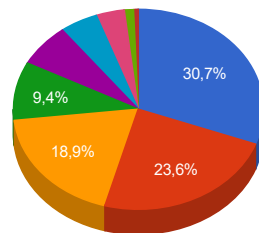
Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (dezembro / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
S&P 500	1,82%	9,54%	3,25%	6,67%	9,54%	8,74%	-	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	3,16%	22,78%	6,94%	14,05%	22,78%	37,62%	1,00%	3,311%	13,09%
IFIX	1,47%	32,29%	2,64%	13,80%	32,29%	39,52%	-	-	-
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	0,00%	-	-	-	-	-	0,30%	-	-
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPPF11	-5,72%	-	2,65%	2,01%	-	11,94%	0,40%	-	27,13%
CDI	1,12%	14,00%	3,24%	6,82%	14,00%	29,09%	-	-	-
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	1,39%	17,48%	4,94%	9,52%	17,48%	-	2,00%	0,617%	1,88%
IPCA	0,30%	6,29%	0,74%	1,79%	6,29%	17,63%	-	-	-
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	-	-	-	-	-	-	1,00%	0,137%	2,04%
Ibovespa	-2,71%	38,94%	3,19%	16,89%	38,94%	20,44%	-	-	-
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	1,42%	5,01%	6,30%	19,67%	5,01%	5,73%	4,00%	10,472%	23,28%
IDIV	-0,88%	60,49%	11,34%	27,50%	60,49%	16,45%	-	-	-
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	2,22%	-1,64%	0,52%	12,40%	-1,64%	-2,85%	3,00%	9,609%	23,20%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	-0,53%	12,37%	-0,47%	5,55%	12,37%	8,75%	1,72%	7,338%	16,38%
Não Possui	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,50%	0,018%	26,62%

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

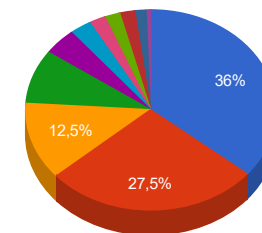
Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	102.594.189,13	30,68%
BANCO BRADESCO	79.026.076,60	23,63%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	63.308.986,53	18,93%
WESTERN ASSET	31.421.925,32	9,40%
BANCO SANTANDER	23.178.338,74	6,93%
GERAÇÃO FUTURO	16.567.076,57	4,95%
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS	12.200.800,00	3,65%
PÁTRIA INVESTIMENTOS	3.986.338,05	1,19%
Itaú Unibanco	2.146.692,96	0,64%

- BB GESTÃO DE RECUR...
- BANCO BRADESCO
- CAIXA ECONÔMIC...
- WESTERN ASSET
- BANCO SANTANDER
- GERAÇÃO FUTURO
- BTG PACTUAL...
- PÁTRIA INVESTIM...
- Itaú Unibanco



Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	120.480.736,41	36,03%
IMA-B 5	92.006.231,26	27,51%
IMA-B 5+	41.739.196,48	12,48%
IRF-M 1	29.284.648,47	8,76%
MULTIMERCADO	14.419.850,24	4,31%
AÇÕES - SETORIAIS	9.367.593,26	2,80%
AÇÕES - INDEXADO	7.037.805,08	2,10%
FUNDO IMOBILIÁRIO	6.595.767,56	1,97%
CRÉDITO PRIVADO	6.548.738,25	1,96%
FIP	4.803.163,93	1,44%
GESTÃO DURATION	2.146.692,96	0,64%

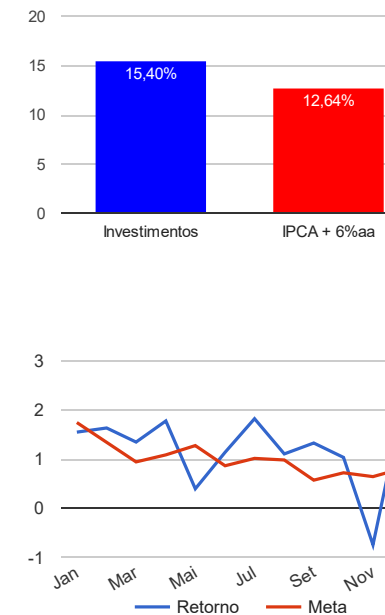
- IMA-B
- IMA-B 5
- IMA-B 5+
- IRF-M 1
- MULTIMER...
- AÇÕES - SETORIAIS
- AÇÕES - INDEXADO
- FUNDO IMOBILIÁRIO
- CRÉDITO PRIVADO
- FIP
- GESTÃO DURATION



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	308.051.335,34	6.737.337,95	5.182.608,69	314.380.496,84	4.774.432,24	1,54%	1,74%	88,66%	2,27%
Fevereiro	314.380.496,84	18.082.507,36	19.015.521,99	318.569.760,65	5.122.278,44	1,63%	1,34%	121,21%	2,16%
Março	318.569.760,65	74.303.565,24	75.371.269,37	321.768.125,22	4.266.068,70	1,34%	0,94%	142,13%	2,36%
Abril	321.768.125,22	7.534.703,96	8.379.525,53	326.622.539,80	5.699.236,15	1,77%	1,08%	164,56%	1,75%
Mai	326.622.539,80	5.461.192,96	6.763.556,47	326.600.595,78	1.280.419,49	0,39%	1,27%	30,85%	1,67%
Junho	326.600.595,78	12.976.057,50	17.141.219,13	326.134.537,68	3.699.103,53	1,13%	0,86%	131,43%	1,65%
Julho	326.134.537,68	27.311.591,63	28.839.384,43	330.529.053,26	5.922.308,38	1,82%	1,01%	179,92%	1,14%
Agosto	330.529.053,26	45.166.951,12	46.749.718,52	332.589.494,36	3.643.208,50	1,10%	0,98%	112,98%	1,20%
Setembro	332.589.494,36	21.627.089,97	23.408.740,09	335.213.274,83	4.405.430,59	1,32%	0,57%	233,55%	1,56%
Outubro	335.213.274,83	43.531.414,39	45.171.845,74	337.016.489,94	3.443.646,46	1,03%	0,72%	141,75%	1,45%
Novembro	337.016.489,94	55.125.680,65	56.672.976,91	332.956.071,63	-2.513.122,05	-0,75%	0,64%	-115,73%	4,21%
Dezembro	332.956.071,63	7.059.600,00	12.604.150,00	334.430.423,90	7.018.902,27	2,11%	0,81%	259,77%	2,82%
Acumulado no ano					46.761.912,70	15,40%	12,64%	121,82%	

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(%)
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	40.245.304,89	0,00	0,00	41.739.196,48	1.493.891,59	3,71%	4,87%	3,71%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	65.936.818,18	0,00	0,00	67.917.160,86	1.980.342,68	3,00%	3,68%	3,00%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIX...	21.125.532,33	0,00	0,00	21.737.012,21	611.479,88	2,89%	3,58%	2,89%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.011.848,98	0,00	0,00	6.185.609,13	173.760,15	2,89%	3,58%	2,89%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.102.095,78	0,00	0,00	2.146.692,96	44.597,18	2,12%	2,34%	2,12%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.294.400,99	0,00	0,00	13.532.038,47	237.637,48	1,79%	2,61%	1,79%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	16.712.685,86	0,00	0,00	17.002.075,08	289.389,22	1,73%	1,63%	1,73%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	6.442.876,74	0,00	0,00	6.548.738,25	105.861,51	1,64%	2,04%	1,64%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	1.421.674,70	0,00	0,00	1.441.326,53	19.651,83	1,38%	1,33%	1,38%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	58.641.516,05	1.891.600,00	0,00	61.362.029,65	828.913,60	1,37%	1,32%	1,38%
BRADESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	10.972.696,93	0,00	0,00	11.108.915,74	136.218,81	1,24%	1,40%	1,24%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	34.423.418,91	5.168.000,00	10.662.500,00	29.284.648,47	355.729,56	0,90%	0,10%	1,17%
BTG PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA	12.115.052,00	0,00	0,00	12.200.800,00	85.748,00	0,71%	0,19%	0,71%
Total Renda Fixa					6.363.221,49	2,20%	2,53%	

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(%)
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	5.751.544,77	0,00	0,00	5.933.297,53	181.752,76	3,16%	3,31%	3,16%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	8.058.667,74	0,00	0,00	8.237.462,26	178.794,52	2,22%	9,61%	2,22%
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPF11	1.276.279,94	0,00	10.050,00	1.291.809,23	25.579,29	2,00%	-	-5,72%
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	6.939.416,38	0,00	0,00	7.037.805,08	98.388,70	1,42%	10,47%	1,42%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	8.369.865,70	0,00	0,00	8.486.552,71	116.687,01	1,39%	0,62%	1,39%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	5.282.493,71	0,00	40.000,00	5.303.958,33	61.464,62	1,16%	-	0,00%
CAIXA BRASIL IPCA VIII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.887.901,00	0,00	1.891.600,00	0,00	3.699,00	0,20%	-	-
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	3.989.800,95	0,00	0,00	3.986.338,05	-3.462,90	-0,09%	0,14%	-0,09%
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA FIP	818.012,10	0,00	0,00	816.825,88	-1.186,22	-0,15%	0,02%	-0,15%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.136.167,00	0,00	0,00	1.130.131,00	-6.036,00	-0,53%	7,34%	-0,53%
Total Renda Variável					655.680,78	1,51%	5,24%	

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 (%)
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	35.604.960,06	30.926.981,00	0,00	67.917.160,86	1.385.219,80	2,09%	2,42%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	58.155.764,40	1.891.600,00	0,00	61.362.029,65	1.314.665,25	2,22%	2,23%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	36.545.369,67	17.568.000,00	25.871.100,00	29.284.648,47	1.042.378,80	2,55%	3,16%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	41.116.166,09	0,00	41.739.196,48	623.030,39	1,52%	2,24%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIX...	21.259.073,27	0,00	0,00	21.737.012,21	477.938,94	2,25%	2,25%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	14.685.062,51	2.000.000,00	0,00	17.002.075,08	317.012,57	1,90%	1,97%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.246.799,07	0,00	0,00	13.532.038,47	285.239,40	2,15%	2,15%
BTG PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA	12.296.902,00	0,00	345.924,62	12.200.800,00	249.822,62	2,05%	-0,78%
BRADESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	11.534.291,23	0,00	650.660,22	11.108.915,74	225.284,73	2,02%	-3,69%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	40.900.873,78	0,00	41.116.166,09	0,00	215.292,31	0,53%	2,22%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	6.388.527,82	0,00	0,00	6.548.738,25	160.210,43	2,51%	2,51%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.050.661,63	0,00	0,00	6.185.609,13	134.947,50	2,23%	2,23%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.086.067,30	0,00	0,00	2.146.692,96	60.625,66	2,91%	2,91%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	1.409.963,40	0,00	0,00	1.441.326,53	31.363,13	2,22%	2,22%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	30.261.825,35	0,00	30.276.320,78	0,00	14.495,43	0,05%	3,19%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	8.312.006,62	8.316.799,86	0,00	4.793,24	0,06%	3,28%
				Total Renda Fixa	6.542.320,20	2,26%	

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 (%)
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	6.620.531,40	0,00	0,00	7.037.805,08	417.273,68	6,30%	6,30%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	7.553.717,02	0,00	2.000.000,00	5.933.297,53	379.580,51	7,09%	6,94%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	4.364.783,14	3.812.766,00	0,00	8.486.552,71	309.003,57	4,93%	4,94%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	5.337.597,27	0,00	137.500,00	5.303.958,33	103.861,06	1,97%	-
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	3.822.834,96	89.175,33	0,00	3.986.338,05	74.327,76	1,90%	-
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	8.194.503,27	0,00	0,00	8.237.462,26	42.958,99	0,52%	0,52%
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	1.286.671,92	0,00	30.135,08	1.291.809,23	35.272,39	2,76%	2,65%
CAIXA BRASIL IPCA VIII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.862.626,00	0,00	1.891.600,00	0,00	28.974,00	1,56%	-
CAIXA BRASIL IPCA III FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	3.788.182,00	0,00	3.812.766,00	0,00	24.584,00	0,65%	-
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA FIP	820.164,36	0,00	0,00	816.825,88	-3.338,48	-0,41%	-
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.135.522,00	0,00	0,00	1.130.131,00	-5.391,00	-0,47%	-0,47%
Total Renda Variável					1.407.106,48	3,09%	

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 (%)
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	51.171.599,11	2.350.274,03	3.000,00	61.362.029,65	7.843.156,51	15,17%	15,19%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	20.949.936,17	40.926.981,00	0,00	67.917.160,86	6.040.243,69	24,04%	24,64%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	33.247.315,37	3.291.239,46	40.276.320,78	0,00	3.737.765,95	10,76%	14,57%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	44.729.769,43	59.413.301,44	107.737.203,93	0,00	3.594.133,06	6,79%	13,88%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	38.150.082,94	41.116.166,09	0,00	2.966.083,15	7,77%	14,89%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	44.384.508,24	5.923.089,97	46.565.860,48	6.185.609,13	2.443.871,40	9,56%	24,52%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.872.580,41	0,00	742.437,64	13.532.038,47	2.401.895,70	20,81%	20,85%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIX...	19.921.775,14	20.291.002,49	20.832.327,46	21.737.012,21	2.356.562,04	12,02%	24,69%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	12.660.231,27	2.000.000,00	0,00	17.002.075,08	2.341.843,81	18,20%	18,27%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	71.045.380,67	43.861.351,68	29.284.648,47	2.100.619,48	6,59%	14,48%
BRADESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	10.343.230,85	0,00	941.899,68	11.108.915,74	1.707.584,57	16,78%	7,40%
BTG PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA	11.419.780,00	0,00	686.698,28	12.200.800,00	1.467.718,28	13,06%	6,84%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	5.458.265,35	0,00	0,00	6.548.738,25	1.090.472,90	19,98%	19,98%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	0,00	20.834.317,83	20.291.002,49	1.441.326,53	898.011,19	8,97%	15,27%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	41.116.166,09	0,00	41.739.196,48	623.030,39	1,52%	30,74%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,00	2.000.000,00	0,00	2.146.692,96	146.692,96	7,33%	21,48%
				Total Renda Fixa	41.759.685,08	15,89%	

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 (%)
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	6.579.240,76	0,00	2.000.000,00	5.933.297,53	1.354.056,77	22,95%	22,78%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	5.115.544,72	0,00	558.000,00	5.303.958,33	746.413,61	15,14%	-
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	0,00	7.810.039,84	0,00	8.486.552,71	676.512,87	14,58%	17,48%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	0,00	7.730.945,03	0,00	8.237.462,26	506.517,23	5,41%	-1,64%
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	4.878.851,09	1.672.041,34	0,00	7.037.805,08	486.912,65	5,70%	5,01%
CAIXA BRASIL IPCA III FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	3.405.582,00	0,00	3.812.766,00	0,00	407.184,00	11,96%	-
ITAÚ FOF RPI VALOR FIC AÇÕES	2.324.229,41	0,00	2.661.985,35	0,00	337.755,94	14,53%	-
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	1.125.108,16	0,00	125.918,11	1.291.809,23	292.619,18	27,34%	-
CAIXA BRASIL IPCA VIII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.671.209,00	0,00	1.891.600,00	0,00	220.391,00	13,19%	-
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.005.698,00	0,00	38.889,80	1.130.131,00	163.322,80	16,55%	12,37%
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	3.556.133,88	362.830,60	0,00	3.986.338,05	67.373,57	1,71%	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	1.638.430,16	0,00	1.672.041,34	0,00	33.611,18	2,05%	20,08%
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA FIP	1.245.182,24	0,00	418.814,24	816.825,88	-9.542,12	-1,08%	-
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4.125.028,52	0,00	3.997.273,84	0,00	-127.754,68	-3,10%	18,32%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	5.222.106,06	0,00	5.068.959,68	0,00	-153.146,38	-2,93%	18,27%
				Total Renda Variável	5.002.227,62	12,03%	

