

# 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 3.922/2010 - 4.392/2014
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.802.260,56	10,39%	620	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	640.275,48	0,85%	1.340	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.592.802,76	3,45%	1.183	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.713.532,30	2,28%	200	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	73.441,59	0,10%	603	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	17/08/2020	1.939.803,00	2,58%	20	3,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	1.192.267,00	1,59%	26	0,87%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	374.637,03	0,50%	55	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.889.138,45	2,52%	731	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	2.112.135,11	2,81%	242	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	13.214.590,24	17,60%	721	0,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.382.172,86	4,50%	69	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	3.400.019,63	4,53%	69	1,21%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	13.241.711,96	17,63%	326	0,58%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	50.602,93	0,07%	86	0,01%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
INFINITY IMA-B 5+ TIGER FI RENDA FIXA	D+1	Não há	631.271,68	0,84%	20	5,79%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	54.299,98	0,07%	64	0,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.630.863,33	4,83%	787	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	880.752,11	1,17%	124	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	3.544.953,01	4,72%	758	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	3.055.281,28	4,07%	411	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
OURINVEST SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	D+45 a D+75	Não há	74.725,70	0,10%	184	0,02%	Artigo 7º, Inciso VI

Carteira consolidada de investimentos - base (dezembro / 2016)

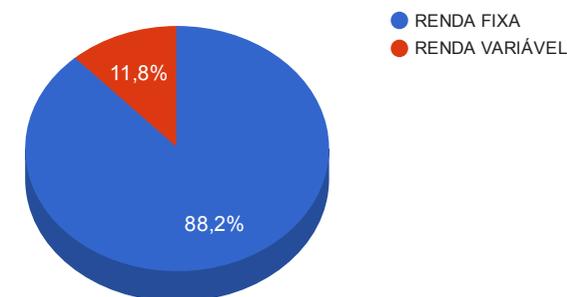
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	634.550,50	0,84%	100	0,31%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	975.975,46	1,30%	353	0,25%	Artigo 8º, Inciso III
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	746.646,84	0,99%	83	0,69%	Artigo 8º, Inciso III
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	996.377,72	1,33%	312	0,75%	Artigo 8º, Inciso III
BB SETOR FINANCEIRO FI AÇÕES	D+4	Não há	976.770,46	1,30%	3.734	1,31%	Artigo 8º, Inciso III
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	3.143.161,34	4,19%	57	1,53%	Artigo 8º, Inciso IV
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se aplica	Não se aplica	2.040.000,00	2,72%		1,27%	Artigo 8º, Inciso VI
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	Término do fundo	Não há	97.464,90	0,13%	752	0,63%	Desenquadrado - RF
		<b>TOTAL -</b>	<b>75.102.485,21</b>				

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

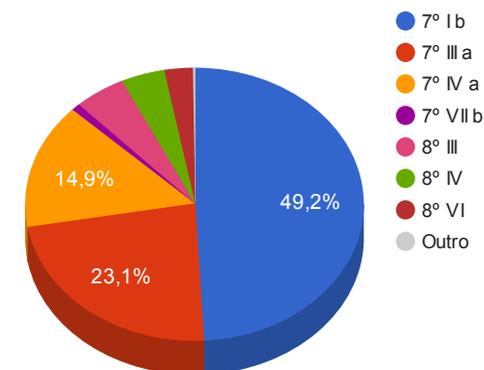
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	80,00%	36.927.056,38	49,17%	23.154.931,79
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	50,00%	17.323.606,20	23,07%	20.227.636,41
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	11.166.149,71	14,87%	11.364.595,85
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	74.725,70	0,10%	3.680.398,56
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	634.550,50	0,84%	3.120.573,76
<b>Desenquadrado - RF</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>97.464,90</b>	<b>0,13%</b>	<b>-97.464,90</b>
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	80,00%	10,00%	0,00	0,00%	7.510.248,52
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	30,00%	10,00%	0,00	0,00%	7.510.248,52
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.755.124,26
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>195,00</b>	<b>66.223.553,39</b>	<b>88,18%</b>	

Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	10,00%	3.695.770,48	4,92%	3.814.478,04
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	3.143.161,34	4,19%	611.962,92
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	2.040.000,00	2,72%	1.715.124,26
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.755.124,26
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.755.124,26
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>30,00</b>	<b>8.878.931,82</b>	<b>11,82%</b>	

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%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,70%	30,56%	2,29%	8,35%	30,56%	37,15%	0,20%	4,847%	10,44%
INFINITY IMA-B 5+ TIGER FI RENDA FIXA	2,13%	57,54%	6,39%	16,59%	57,54%	54,40%	0,50%	2,706%	14,31%

IMA-B	2,91%	24,81%	2,30%	7,46%	24,81%	35,90%	-	-	-
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%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,88%	24,56%	2,33%	7,42%	24,56%	33,62%	0,20%	3,583%	7,33%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	2,80%	24,14%	2,48%	7,53%	24,14%	34,80%	0,20%	3,446%	6,85%
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,77%	16,45%	1,83%	3,84%	16,45%	-	0,20%	3,194%	8,52%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,58%	11,90%	2,13%	3,62%	11,90%	18,84%	0,20%	1,961%	6,21%

IMA-B 5	1,39%	15,48%	2,27%	6,11%	15,48%	33,33%	-	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	1,42%	15,33%	2,25%	6,01%	15,33%	31,99%	0,20%	1,495%	2,78%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	1,36%	15,02%	2,17%	5,90%	15,02%	32,21%	0,40%	1,321%	2,60%

115% do CDI	1,29%	16,26%	3,74%	7,88%	16,26%	34,13%	-	-	-
OURINVEST SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	1,29%	16,27%	3,74%	7,89%	16,27%	34,12%	0,20%	0,002%	0,01%

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%

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 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%
IRF-M 1	1,20%	14,72%	3,22%	6,79%	14,72%	29,64%	-	-	-
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%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1,17%	14,57%	3,19%	6,70%	14,57%	29,27%	0,20%	0,101%	0,35%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1,17%	14,40%	3,15%	6,63%	14,40%	29,00%	0,20%	0,102%	0,35%
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%
Selic	1,12%	14,02%	3,24%	6,83%	14,02%	29,15%	-	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIA DO 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%	-	-	-
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	1,36%	15,52%	3,49%	7,88%	15,52%	35,39%	0,75%	1,402%	5,50%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,13%	13,88%	3,28%	6,94%	13,88%	29,21%	0,20%	0,009%	0,17%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIA DO DI	1,12%	14,07%	3,25%	6,86%	14,07%	29,34%	0,18%	0,005%	0,02%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIA DO DI LP	1,11%	14,00%	3,24%	6,81%	14,00%	29,18%	0,20%	0,016%	0,04%
IPCA	0,30%	6,29%	0,74%	1,79%	6,29%	17,63%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,21%	16,84%	2,12%	5,31%	16,84%	-	0,20%	0,602%	2,40%
Não definido	-	-	-	-	-	-	-	-	-

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
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	68,94%	102,72%	73,83%	79,39%	102,72%	181,60%	0,00%	105,330%	65,97%

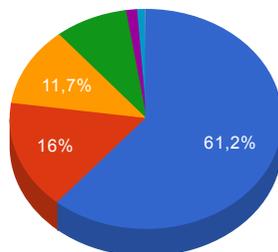
Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (dezembro / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	1,47%	32,29%	2,64%	13,80%	32,29%	39,52%	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	4,62%	27,50%	3,13%	9,67%	27,50%	22,89%	1,20%	-	23,63%
CDI	1,12%	14,00%	3,24%	6,82%	14,00%	29,09%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO	1,12%	14,31%	3,13%	6,84%	14,31%	29,18%	0,35%	0,166%	0,34%
IFNC	-1,52%	47,21%	3,65%	15,01%	47,21%	28,94%	-	-	-
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	-1,55%	45,61%	2,99%	14,32%	45,61%	26,31%	1,00%	12,906%	30,89%
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%
IDIV	-0,88%	60,49%	11,34%	27,50%	60,49%	16,45%	-	-	-
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	-0,77%	48,74%	13,81%	28,73%	48,74%	15,22%	1,50%	10,526%	26,48%
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	-1,15%	32,46%	4,28%	13,67%	32,46%	17,57%	1,50%	10,337%	22,88%

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

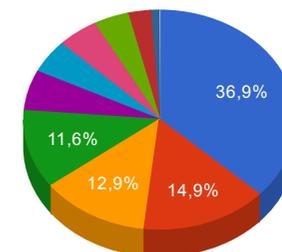
Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	45.963.944,05	61,20%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	12.021.798,54	16,01%
ITAÚ UNIBANCO	8.777.101,06	11,69%
BANCO BRADESCO	6.505.903,84	8,66%
BEM DTVM	975.975,46	1,30%
BRB DTVM	685.571,66	0,91%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	97.464,90	0,13%
Oliveira Trust	74.725,70	0,10%

- CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
- BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM
- ITAÚ UNIBANCO
- BANCO BRADESCO
- BEM DTVM
- BRB DTVM
- Outro



Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	27.722.010,79	36,91%
CDI	11.166.149,71	14,87%
IDKA IPCA 2A	9.691.399,01	12,90%
IMA-B 5	8.721.995,49	11,61%
IMA-B 5+	4.456.939,09	5,93%
AÇÕES - SETORIAIS	3.695.770,48	4,92%
IRF-M 1	3.658.318,20	4,87%
MULTIMERCADO	3.143.161,34	4,19%
FUNDO IMOBILIÁRIO	2.040.000,00	2,72%
CRÉDITO PRIVADO	732.015,40	0,97%
FIDC - ABERTO	74.725,70	0,10%

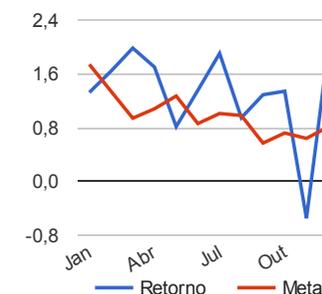
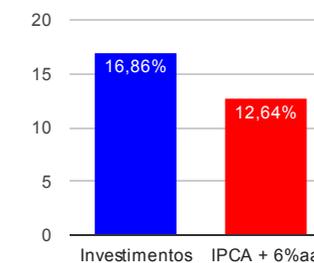
- IMA-B
- CDI
- IDKA IPCA 2A
- IMA-B 5
- IMA-B 5+
- AÇÕES - SETORIAIS
- IRF-M 1
- MULTIMER...
- FUNDO IMOBILIÁRIO
- CRÉDITO PRIVADO
- Outro



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	62.277.696,34	3.749.404,56	3.710.428,93	63.141.520,41	824.848,44	1,32%	1,74%	76,10%	1,67%
Fevereiro	63.141.520,41	8.298.722,63	7.841.510,77	64.642.122,27	1.043.390,00	1,64%	1,34%	122,04%	2,26%
Março	64.642.122,27	3.738.261,49	2.934.465,86	66.743.676,02	1.297.758,12	1,98%	0,94%	210,46%	2,09%
Abril	66.743.676,02	688.061,74	426.640,36	68.144.370,91	1.139.273,51	1,70%	1,08%	157,97%	1,55%
Mai	68.144.370,91	6.653.130,12	6.560.846,88	68.792.712,16	556.058,01	0,81%	1,27%	64,14%	1,65%
Junho	68.792.712,16	5.755.185,90	5.540.792,06	69.943.026,73	935.920,73	1,36%	0,86%	157,38%	1,36%
Julho	69.943.026,73	4.327.901,06	4.428.967,53	71.173.759,23	1.331.798,97	1,90%	1,01%	188,66%	0,99%
Agosto	71.173.759,23	12.499.550,72	12.494.481,40	71.852.598,95	673.770,40	0,95%	0,98%	97,03%	1,47%
Setembro	71.852.598,95	2.526.311,21	2.460.584,58	72.845.285,31	926.959,73	1,29%	0,57%	227,26%	1,64%
Outubro	72.845.285,31	549.205,25	532.756,84	73.838.914,11	977.180,39	1,34%	0,72%	185,05%	1,87%
Novembro	73.838.914,11	5.965.047,19	5.983.703,22	73.415.055,62	-405.202,46	-0,55%	0,64%	-85,16%	3,23%
Dezembro	73.415.055,62	1.058.631,70	813.755,34	75.102.485,21	1.442.553,23	1,96%	0,81%	241,32%	2,64%
Acumulado no ano					10.744.309,07	16,86%	12,64%	133,40%	

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(%)
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	57.692,74	0,00	0,00	97.464,90	39.772,16	68,94%	105,33%	68,94%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.036.539,48	0,00	0,00	2.112.135,11	75.595,63	3,71%	4,87%	3,71%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	71.378,54	0,00	0,00	73.441,59	2.063,05	2,89%	3,58%	2,89%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	12.845.207,37	0,00	0,00	13.214.590,24	369.382,87	2,88%	3,58%	2,88%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	12.880.673,23	0,00	0,00	13.241.711,96	361.038,73	2,80%	3,45%	2,80%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	610.349,05	1.058.631,70	0,00	1.713.532,30	44.551,55	2,67%	4,85%	3,70%
INFINITY IMA-B 5+ TIGER FI RENDA FIXA	618.093,67	0,00	0,00	631.271,68	13.178,01	2,13%	2,71%	2,13%
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.171.565,00	0,00	0,00	1.192.267,00	20.702,00	1,77%	3,19%	1,77%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.909.587,00	0,00	0,00	1.939.803,00	30.216,00	1,58%	1,96%	1,58%
BRANCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	3.352.287,98	0,00	0,00	3.400.019,63	47.731,65	1,42%	1,49%	1,42%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	3.336.694,39	0,00	0,00	3.382.172,86	45.478,47	1,36%	1,32%	1,36%
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	53.572,63	0,00	0,00	54.299,98	727,35	1,36%	1,40%	1,36%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.865.827,91	0,00	0,00	1.889.138,45	23.310,54	1,25%	1,06%	1,25%
OURINVEST SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	73.815,31	0,00	0,00	74.725,70	910,39	1,23%	0,00%	1,29%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.707.581,14	0,00	0,00	7.802.260,56	94.679,42	1,23%	1,02%	1,23%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	626.952,50	0,00	0,00	634.550,50	7.598,00	1,21%	0,60%	1,21%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	632.807,03	0,00	0,00	640.275,48	7.468,45	1,18%	0,10%	1,18%
BRANCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	50.015,54	0,00	0,00	50.602,93	587,39	1,17%	0,10%	1,17%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	370.304,20	0,00	0,00	374.637,03	4.332,83	1,17%	0,10%	1,17%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.562.875,38	0,00	0,00	2.592.802,76	29.927,38	1,17%	0,10%	1,17%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	870.977,99	0,00	0,00	880.752,11	9.774,12	1,12%	0,00%	1,12%
BRANCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	3.021.523,14	0,00	0,00	3.055.281,28	33.758,14	1,12%	0,01%	1,12%

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(%)
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	3.506.130,36	0,00	0,00	3.544.953,01	38.822,65	1,11%	0,02%	1,11%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.383.259,47	0,00	797.755,34	3.630.863,33	45.359,20	1,03%	0,01%	1,13%
Total Renda Fixa					1.346.965,98	2,08%	2,29%	

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(%)
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.950.000,00	0,00	16.000,00	2.040.000,00	106.000,00	5,44%	-	4,62%
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FI MULTIMERCADO	3.108.356,17	0,00	0,00	3.143.161,34	34.805,17	1,12%	0,17%	1,12%
ITAÚ DIVIDENDOS FIAÇÕES	1.004.062,45	0,00	0,00	996.377,72	-7.684,73	-0,77%	10,53%	-0,77%
BRADESCO DIVIDENDOS FIAÇÕES	987.330,74	0,00	0,00	975.975,46	-11.355,28	-1,15%	10,34%	-1,15%
BB GOVERNANÇA FIAÇÕES PREVIDENCIÁRIO	757.445,84	0,00	0,00	746.646,84	-10.799,00	-1,43%	10,12%	-1,43%
BB SETOR FINANCEIRO FIAÇÕES	992.149,37	0,00	0,00	976.770,46	-15.378,91	-1,55%	12,91%	-1,55%
Total Renda Variável					95.587,25	1,09%	6,03%	

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 (%)
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	12.683.668,86	240.163,44	0,00	13.241.711,96	317.879,66	2,46%	2,48%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	12.913.095,52	0,00	0,00	13.214.590,24	301.494,72	2,33%	2,33%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.617.712,79	13.438,31	0,00	7.802.260,56	171.109,46	2,24%	2,24%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.230.976,82	0,00	1.748.949,21	3.630.863,33	148.835,72	3,14%	3,28%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	3.433.698,24	0,00	0,00	3.544.953,01	111.254,77	3,24%	3,24%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.953.329,67	0,00	0,00	3.055.281,28	101.951,61	3,45%	3,45%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	2.022.902,85	0,00	2.112.135,11	89.232,26	4,41%	2,24%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.513.328,01	0,00	0,00	2.592.802,76	79.474,75	3,16%	3,16%
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	3.325.128,27	0,00	0,00	3.400.019,63	74.891,36	2,25%	2,25%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	3.310.294,15	0,00	0,00	3.382.172,86	71.878,71	2,17%	2,17%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	1.670.850,30	0,00	1.713.532,30	42.682,00	2,05%	2,29%
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	56.068,45	0,00	0,00	97.464,90	41.396,45	73,83%	73,83%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.848.191,30	0,00	0,00	1.889.138,45	40.947,15	2,22%	2,22%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.899.300,00	0,00	0,00	1.939.803,00	40.503,00	2,13%	2,13%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	853.019,77	0,00	0,00	880.752,11	27.732,34	3,25%	3,25%
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.170.822,00	0,00	0,00	1.192.267,00	21.445,00	1,83%	1,83%
INFINITY IMA-B 5+ TIGER FI RENDA FIXA	0,00	610.363,34	0,00	631.271,68	20.908,34	4,29%	6,39%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	620.532,17	0,00	0,00	640.275,48	19.743,31	3,18%	3,18%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	621.374,00	0,00	0,00	634.550,50	13.176,50	2,12%	2,12%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	363.197,19	0,00	0,00	374.637,03	11.439,84	3,15%	3,15%
OURINVEST SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	72.074,89	0,00	0,00	74.725,70	2.650,81	3,68%	3,74%
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	52.468,08	0,00	0,00	54.299,98	1.831,90	3,49%	3,49%

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 (%)
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	71.839,38	0,00	0,00	73.441,59	1.602,21	2,23%	2,23%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	47.892,26	1.165,90	0,00	50.602,93	1.544,77	3,17%	3,19%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2.007.639,66	14.000,00	2.022.902,85	0,00	1.263,19	0,06%	2,20%
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>1.756.869,83</b>	<b>2,73%</b>	

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 (%)
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.978.000,00	0,00	48.000,00	2.040.000,00	110.000,00	5,59%	3,13%
BB GOVERNANÇA FIAÇÕES PREVIDENCIÁRIO	4.153.861,36	0,00	3.510.363,34	746.646,84	103.148,82	1,28%	0,86%
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIMULTIMERCADO	3.047.772,47	0,00	0,00	3.143.161,34	95.388,87	3,13%	3,13%
ITAÚ DIVIDENDOS FIAÇÕES	0,00	1.000.000,00	0,00	996.377,72	-3.622,28	-0,36%	13,81%
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	0,00	1.000.000,00	0,00	976.770,46	-23.229,54	-2,32%	2,99%
BRADESCO DIVIDENDOS FIAÇÕES	0,00	1.000.000,00	0,00	975.975,46	-24.024,54	-2,40%	4,28%
Total Renda Variável					257.661,33	2,86%	

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 NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	4.770.500,52	10.504.687,99	3.500.000,00	13.241.711,96	1.466.523,45	22,18%	24,14%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.277.904,28	5.034.581,92	3.596.426,36	7.802.260,56	1.086.200,72	14,53%	14,94%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.660.294,09	5.499.492,53	6.345.969,58	3.630.863,33	817.046,29	13,08%	13,88%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	6.117.228,29	3.215.399,01	6.500.000,00	3.544.953,01	712.325,71	13,11%	14,00%
CAIXA BRASIL 2016 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.262.167,20	0,00	6.820.919,76	0,00	558.752,56	9,10%	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.384.167,42	1.964.871,31	2.917.614,50	1.889.138,45	457.714,22	14,24%	14,89%
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	2.948.157,73	0,00	0,00	3.400.019,63	451.861,90	15,33%	15,33%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	2.940.425,83	0,00	0,00	3.382.172,86	441.747,03	15,02%	15,02%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	12.814.177,15	0,00	13.214.590,24	400.413,09	3,10%	24,56%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	2.674.117,92	0,00	0,00	3.055.281,28	381.163,36	14,25%	14,25%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.733.470,50	0,00	104.101,01	1.939.803,00	310.433,51	18,35%	11,90%
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.131.172,00	0,00	3.410.417,03	0,00	279.245,03	9,10%	-
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.023.825,00	0,00	63.760,51	1.192.267,00	232.202,51	23,30%	16,45%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	508.545,13	2.114.643,10	255.274,30	2.592.802,76	224.888,83	13,53%	14,48%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.273.101,64	69.029,16	5.421.175,53	73.441,59	152.486,32	22,75%	24,52%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.219.467,13	2.014.000,00	5.379.433,58	0,00	145.966,45	8,33%	15,28%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	484.334,97	5.114.655,15	5.095.970,44	640.275,48	137.255,80	13,04%	14,58%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	772.109,82	0,00	0,00	880.752,11	108.642,29	14,07%	14,07%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	543.074,00	0,00	0,00	634.550,50	91.476,50	16,84%	16,84%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	2.022.902,85	0,00	2.112.135,11	89.232,26	4,41%	30,74%
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,00	97.253,90	49.130,26	97.464,90	49.341,26	102,53%	102,72%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	327.482,93	0,00	0,00	374.637,03	47.154,10	14,40%	14,40%

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	0,00	1.670.850,30	0,00	1.713.532,30	42.682,00	2,05%	30,56%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	430.005,88	0,00	464.290,98	0,00	34.285,10	7,97%	15,19%
INFINITY IMA-B 5+ TIGER FI RENDA FIXA	0,00	610.363,34	0,00	631.271,68	20.908,34	4,29%	57,54%
OURINVEST SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	64.308,86	0,00	0,00	74.725,70	10.416,84	16,20%	16,27%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	32.333,38	12.505,86	0,00	50.602,93	5.763,69	14,41%	14,57%
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	0,00	50.000,00	0,00	54.299,98	4.299,98	8,60%	15,52%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	86.468,46	0,00	89.799,23	0,00	3.330,77	15,55%	24,46%
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>8.763.759,91</b>	<b>15,59%</b>	

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 FIAÇÕES PREVIDENCIÁRIO	3.263.260,21	0,00	3.510.363,34	746.646,84	993.749,97	28,92%	28,38%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.600.000,00	0,00	204.287,36	2.040.000,00	644.287,36	42,68%	27,50%
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIMULTIMERCADO	2.749.773,15	0,00	0,00	3.143.161,34	393.388,19	14,31%	14,31%
ITAÚ DIVIDENDOS FIAÇÕES	0,00	1.000.000,00	0,00	996.377,72	-3.622,28	-0,36%	48,74%
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	0,00	1.000.000,00	0,00	976.770,46	-23.229,54	-2,32%	45,61%
BRADESCO DIVIDENDOS FIAÇÕES	0,00	1.000.000,00	0,00	975.975,46	-24.024,54	-2,40%	32,46%
Total Renda Variável					1.980.549,16	26,36%	

