

# 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
TÍTULOS PÚBLICOS			224.969.023,85	46,68%			Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	55.775,31	0,01%	713	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	113.402,44	0,02%	1.183	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.943.699,46	1,03%	200	0,67%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	6.326.342,03	1,31%	731	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	1.313.816,56	0,27%	193	0,38%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	174.286,17	0,04%	721	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADERCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	D+1	16/05/2019	111.089,16	0,02%	11	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	390.185,47	0,08%	1.340	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	23.252.860,00	4,82%	223	0,75%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	32.018.748,04	6,64%	603	0,64%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	20.179.861,39	4,19%	242	1,92%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADERCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	68.580.613,02	14,23%	192	10,87%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	9.547.125,00	1,98%	38	5,58%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	18/08/2020	6.285.190,00	1,30%	19	5,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2022	9.547.080,00	1,98%	17	12,91%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADERCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.341,66	0,00%	122	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	88.469,36	0,02%	787	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	13.532.038,47	2,81%	95	3,67%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	176.810,80	0,04%	42	3,01%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	5.076.404,00	1,05%	100	2,44%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	3.767.648,99	0,78%	16	13,61%	Artigo 8º, Inciso I

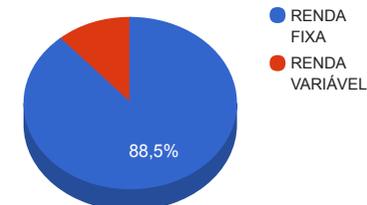
Carteira consolidada de investimentos - base (dezembro / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	4.138.402,81	0,86%	41	0,86%	Artigo 8º, Inciso I
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	D+33	Não há	4.431.113,66	0,92%	119	4,81%	Artigo 8º, Inciso III
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	4.253.573,71	0,88%	493	2,97%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	D+43	5 anos	3.672.448,64	0,76%	60	2,87%	Artigo 8º, Inciso III
KINEA PIPE FI AÇÕES	D+363 a D+723 ou D+30 a D+1830	Não há	2.355.766,95	0,49%	23	1,26%	Artigo 8º, Inciso III
BB CONSUMO FIC AÇÕES	D+4	Não há	4.683.637,60	0,97%	2.264	6,55%	Artigo 8º, Inciso III
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	2.568.022,95	0,53%	83	2,38%	Artigo 8º, Inciso III
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	D+13	Não há	10.072.945,71	2,09%	203	19,03%	Artigo 8º, Inciso III
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	Não se aplica	Não se aplica	5.303.958,33	1,10%		0,22%	Artigo 8º, Inciso VI
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS12	S/Info	Não se aplica	10.050.536,43	2,09%		23,14%	Artigo 8º, Inciso VI
		<b>TOTAL -</b>	<b>481.983.217,97</b>				

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

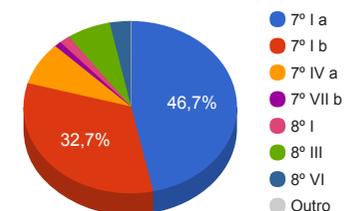
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	0,00%	224.969.023,85	46,68%	-224.969.023,85
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	85,00%	157.460.679,05	32,67%	252.225.056,22
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	50,00%	0,00	0,00%	240.991.608,99
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	39.002.244,49	8,09%	105.592.720,90
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	8,00%	0,00	0,00%	38.558.657,44
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	2,00%	176.810,80	0,04%	9.462.853,56
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	5.076.404,00	1,05%	19.022.756,90
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>180,00</b>	<b>426.685.162,19</b>	<b>88,53%</b>	

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	10,00%	7.906.051,80	1,64%	40.292.270,00
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	32.037.509,22	6,65%	40.259.973,48
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	24.099.160,90
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	24.099.160,90
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	15.354.494,76	3,19%	8.744.666,14
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>40,00</b>	<b>55.298.055,78</b>	<b>11,47%</b>	

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%
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%
BRANCO 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%
CDI + 3,50% ao ano	1,43%	17,97%	4,12%	8,69%	17,97%	38,23%	-	-	-
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	96,66%	34,21%	74,89%	57,07%	34,21%	-31,07%	0,20%	192,108%	119,93%
IMA-B 5	1,39%	15,48%	2,27%	6,11%	15,48%	33,33%	-	-	-
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%
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%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,12%	13,26%	2,23%	5,49%	13,26%	-	0,20%	0,771%	1,21%
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%

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
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,17%	14,53%	3,18%	6,67%	14,53%	29,17%	0,20%	0,101%	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%
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%
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	1,08%	13,65%	3,15%	6,64%	13,65%	28,43%	0,20%	0,008%	0,44%
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%
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,70%	6,84%	2,07%	1,96%	6,84%	18,41%	0,20%	0,175%	3,99%
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,70%	6,86%	2,06%	1,96%	6,86%	18,47%	0,20%	0,175%	3,97%
CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,69%	6,76%	2,04%	1,94%	6,76%	18,31%	0,20%	0,175%	3,98%
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%

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

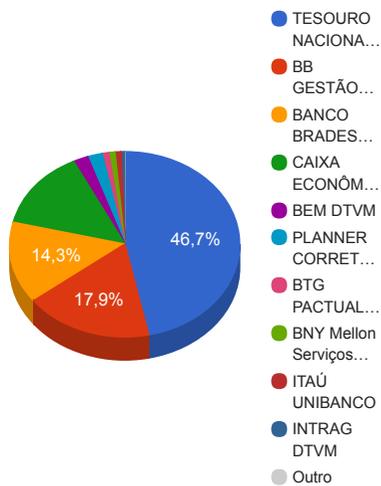
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IFIX	1,47%	32,29%	2,64%	13,80%	32,29%	39,52%	-	-	-
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	0,00%	-	-	-	-	-	0,30%	-	-
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS12	0,00%	-	0,00%	0,00%	-	-	0,14%	-	-
Ibovespa	-2,71%	38,94%	3,19%	16,89%	38,94%	20,44%	-	-	-
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%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	-2,69%	38,16%	3,20%	16,65%	38,16%	18,59%	0,50%	11,521%	28,24%
IBX	-2,55%	36,70%	2,53%	16,10%	36,70%	19,74%	-	-	-
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	-0,51%	18,87%	-2,29%	4,93%	18,87%	9,66%	2,00%	7,217%	15,54%
ICON	-1,64%	13,23%	-9,34%	2,39%	13,23%	5,65%	-	-	-
BB CONSUMO FIC AÇÕES	-1,75%	11,84%	-9,51%	1,72%	11,84%	3,25%	1,00%	11,620%	20,58%
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%	-	-	-
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	-1,02%	18,27%	-3,69%	-1,36%	18,27%	15,67%	2,50%	8,714%	17,00%
IVBX-2	-0,73%	21,05%	-1,45%	8,65%	21,05%	20,29%	-	-	-
KINEA PIPE FI AÇÕES	-0,29%	37,84%	-4,75%	2,44%	37,84%	-13,04%	1,50%	7,280%	20,73%
SMLL	-0,54%	31,75%	-2,54%	11,98%	31,75%	2,30%	-	-	-

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

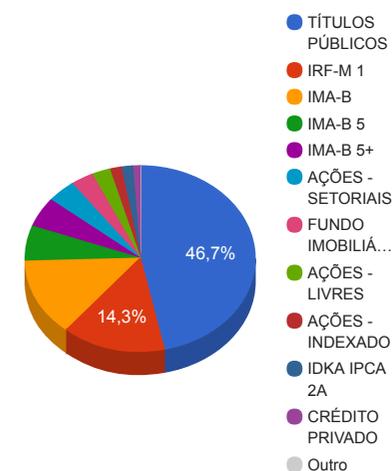
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	2,26%	20,08%	2,38%	9,05%	20,08%	12,32%	2,00%	5,531%	18,85%
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	1,28%	-20,85%	-10,89%	-5,16%	-20,85%	-30,94%	1,72%	3,541%	30,18%

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

Administrador	Valor	%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	224.969.023,85	46,68%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	86.128.297,17	17,87%
BANCO BRADESCO	68.694.043,84	14,25%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	66.712.703,04	13,84%
BEM DTVM	10.072.945,71	2,09%
PLANNER CORRETORA	10.050.536,43	2,09%
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS	4.431.113,66	0,92%
BNY Mellon Serviços Financeiros	4.253.573,71	0,88%
ITAÚ UNIBANCO	4.138.402,81	0,86%
INTRAG DTVM	2.355.766,95	0,49%
Geração Futuro	176.810,80	0,04%



Sub-segmento	Valor	%
TÍTULOS PÚBLICOS	224.969.023,85	46,68%
IRF-M 1	69.084.200,93	14,33%
IMA-B	64.930.366,84	13,47%
IMA-B 5	29.593.825,31	6,14%
IMA-B 5+	25.123.560,85	5,21%
AÇÕES - SETORIAIS	19.608.796,56	4,07%
FUNDO IMOBILIÁRIO	15.354.494,76	3,19%
AÇÕES - LIVRES	12.428.712,66	2,58%
AÇÕES - INDEXADO	7.906.051,80	1,64%
IDKA IPCA 2A	7.640.158,59	1,59%
CRÉDITO PRIVADO	5.076.404,00	1,05%
FIDC - FECHADO	176.810,80	0,04%
CDI	90.811,02	0,02%



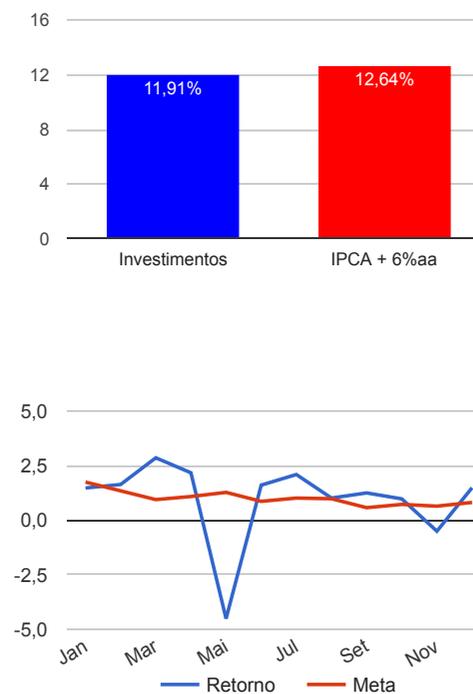
Carteira de Títulos Públicos - base (dezembro / 2016)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde.	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	GAP (Atual - Pago)
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2021	10/11/2016	7000	3.029,485123	2.986,351886	21.206.395,86	20.904.463,20	-301.932,66
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2021	29/08/2016	10000	2.967,972738	2.986,351886	29.679.727,38	29.863.518,86	183.791,48
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2021	12/09/2016	10000	2.980,886631	2.986,351886	29.808.866,31	29.863.518,86	54.652,55
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2021	14/09/2016	10000	2.971,010111	2.986,351886	29.710.101,11	29.863.518,86	153.417,75
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2022	27/07/2016	15000	2.963,303079	3.028,412806	44.449.546,19	45.426.192,09	976.645,91
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2022	04/08/2016	13000	2.979,58205	3.028,412806	38.734.566,65	39.369.366,48	634.799,83
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2022	30/06/2016	9800	2.911,042410	3.028,412806	28.528.215,62	29.678.445,50	1.150.229,88

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	471.564.087,44	4.042.042,41	1.645.000,49	480.933.235,20	6.972.105,84	1,47%	1,74%	84,57%	1,65%
Fevereiro	480.933.235,20	43.066.586,10	40.465.066,88	491.420.839,60	7.886.085,18	1,63%	1,34%	121,33%	2,75%
Março	491.420.839,60	54.921.199,03	54.297.509,91	506.078.159,50	14.033.630,78	2,85%	0,94%	302,71%	3,40%
Abril	506.078.159,50	44.154.944,66	43.765.997,78	517.439.455,56	10.972.349,18	2,17%	1,08%	201,28%	1,98%
Mai	517.439.455,56	76.910.317,10	51.304.798,77	518.575.038,91	-24.469.934,98	-4,51%	1,27%	-354,65%	2,07%
Junho	518.575.038,91	158.807.115,26	156.695.398,04	529.027.647,55	8.340.891,42	1,60%	0,86%	185,88%	1,63%
Julho	529.027.647,55	47.170.455,84	46.422.130,25	540.831.753,27	11.055.780,13	2,09%	1,01%	206,77%	1,19%
Agosto	540.831.753,27	181.329.286,83	181.029.947,86	546.599.315,27	5.468.223,03	1,01%	0,98%	103,58%	1,68%
Setembro	546.599.315,27	60.999.661,75	60.807.614,95	553.598.670,37	6.807.308,30	1,24%	0,57%	219,51%	1,66%
Outubro	553.598.670,37	2.342.324,51	3.411.869,83	557.918.464,74	5.389.339,69	0,97%	0,72%	134,33%	1,39%
Novembro	557.918.464,74	36.406.064,13	36.078.406,99	555.429.131,90	-2.816.989,98	-0,50%	0,64%	-78,31%	3,48%
Dezembro	555.429.131,90	17.426.007,84	99.092.198,73	481.983.217,97	8.220.276,96	1,48%	0,81%	182,37%	2,79%
Acumulado no ano					57.859.065,55	11,91%	12,64%	94,23%	

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(%)
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	89.904,67	0,00	5.245,16	176.810,80	92.151,29	102,50%	192,11%	102,04%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	19.457.602,03	0,00	0,00	20.179.861,39	722.259,36	3,71%	4,87%	3,71%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	45.516.510,96	0,00	14.593.633,96	32.018.748,04	1.095.871,04	2,41%	3,58%	2,89%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	16.213.122,19	0,00	11.567.128,91	4.943.699,46	297.706,18	1,84%	4,85%	3,70%
TÍTULOS PÚBLICOS	220.959.650,58	0,00	0,00	224.969.023,85	4.009.373,27	1,81%	-	-
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%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.248.279,74	0,00	0,00	6.326.342,03	78.062,29	1,25%	1,06%	1,25%
BRDESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	109.726,97	0,00	0,00	111.089,16	1.362,19	1,24%	1,40%	1,24%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	5.015.620,00	0,00	0,00	5.076.404,00	60.784,00	1,21%	0,60%	1,21%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	22.993.940,00	0,00	0,00	23.252.860,00	258.920,00	1,13%	0,78%	1,13%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.299.232,97	0,00	0,00	1.313.816,56	14.583,59	1,12%	0,77%	1,12%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	74.401.941,75	6.564.848,25	13.265.020,20	68.580.613,02	878.843,22	1,09%	0,10%	1,17%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	17.703.546,02	0,00	17.703.546,02	174.286,17	174.286,17	0,98%	3,58%	2,88%
GRADUAL FI RENDA FIXA	4.737.234,12	0,00	4.779.672,38	0,00	42.438,26	0,90%	0,06%	1,00%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.656.354,00	0,00	6.656.354,00	55.775,31	55.775,31	0,84%	1,32%	1,38%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.533.185,67	40.000,00	9.533.185,67	113.402,44	73.402,44	0,77%	0,10%	1,17%
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.480.982,50	0,00	0,00	9.547.125,00	66.142,50	0,70%	0,18%	0,70%
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.241.730,00	0,00	0,00	6.285.190,00	43.460,00	0,70%	0,18%	0,70%
CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.481.747,50	0,00	0,00	9.547.080,00	65.332,50	0,69%	0,18%	0,69%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.099.831,51	0,00	13.099.831,51	88.469,36	88.469,36	0,68%	0,01%	1,13%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.635.507,42	821.159,59	6.105.587,49	390.185,47	39.105,95	0,61%	0,10%	1,18%
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	1.778.762,79	0,00	1.780.000,00	2.341,66	3.578,87	0,20%	0,01%	1,08%
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>8.399.545,27</b>	<b>1,65%</b>	<b>1,72%</b>	

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(%)	
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	4.159.448,80	0,00	0,00	4.253.573,71	94.124,91	2,26%	5,53%	2,26%	
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	3.626.030,37	0,00	0,00	3.672.448,64	46.418,27	1,28%	3,54%	1,28%	
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS12	0,00	10.000.000,00	0,00	10.050.536,43	50.536,43	0,51%	-	0,00%	
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	5.282.493,71	0,00	0,00	5.303.958,33	21.464,62	0,41%	-	0,00%	
CAIXA LOGÍSTICA FICFIP	2.993,43	0,00	2.993,43	0,00	0,00	0,00%	-	-	
KINEA PIPE FI AÇÕES	2.362.509,23	0,00	0,00	2.355.766,95	-6.742,28	-0,29%	7,28%	-0,29%	
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	10.124.210,57	0,00	0,00	10.072.945,71	-51.264,86	-0,51%	7,22%	-0,51%	
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	4.476.951,14	0,00	0,00	4.431.113,66	-45.837,48	-1,02%	8,71%	-1,02%	
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	2.605.165,10	0,00	0,00	2.568.022,95	-37.142,15	-1,43%	10,12%	-1,43%	
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	4.201.299,95	0,00	0,00	4.138.402,81	-62.897,14	-1,50%	9,07%	-1,50%	
BB CONSUMO FIC AÇÕES	4.767.267,94	0,00	0,00	4.683.637,60	-83.630,34	-1,75%	11,62%	-1,75%	
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	3.871.947,28	0,00	0,00	3.767.648,99	-104.298,29	-2,69%	11,52%	-2,69%	
<b>Total Renda Variável</b>						<b>-179.268,31</b>	<b>-0,32%</b>	<b>8,17%</b>	

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 (%)
TÍTULOS PÚBLICOS	202.151.672,14	21.206.395,86	3.219.845,74	224.969.023,85	4.830.801,59	2,25%	-
BRASESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	70.917.086,28	8.623.981,30	13.265.020,20	68.580.613,02	2.304.565,64	3,07%	3,18%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	45.810.366,68	0,00	14.593.633,96	32.018.748,04	802.015,32	1,75%	2,23%
GRADUAL FI RENDA FIXA	32.248.440,74	3.219.845,74	35.986.068,24	0,00	517.781,76	2,34%	3,03%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	22.761.240,00	0,00	0,00	23.252.860,00	491.620,00	2,16%	2,16%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	19.641.136,24	97.500,00	0,00	20.179.861,39	441.225,15	2,24%	2,24%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12.826.976,73	0,00	13.099.831,51	88.469,36	361.324,14	2,82%	3,28%
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%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.348.883,17	40.000,00	9.533.185,67	113.402,44	257.704,94	2,75%	3,16%
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.353.715,00	0,00	0,00	9.547.125,00	193.410,00	2,07%	2,07%
CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.355.950,00	0,00	0,00	9.547.080,00	191.130,00	2,04%	2,04%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.157.457,37	2.697.185,57	10.640.773,04	390.185,47	176.315,57	2,34%	3,18%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.189.218,33	0,00	0,00	6.326.342,03	137.123,70	2,22%	2,22%
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.158.105,00	0,00	0,00	6.285.190,00	127.085,00	2,06%	2,06%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.601.216,70	0,00	6.656.354,00	55.775,31	110.912,61	1,68%	2,23%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	4.970.992,00	0,00	0,00	5.076.404,00	105.412,00	2,12%	2,12%
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	101.095,83	0,00	16.229,53	176.810,80	91.944,50	102,13%	74,89%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	17.797.110,95	0,00	17.703.546,02	174.286,17	80.721,24	0,45%	2,33%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	16.437.560,69	0,00	11.567.128,91	4.943.699,46	73.267,68	0,45%	2,29%
BRASESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	1.464.968,42	289.488,01	1.786.506,60	2.341,66	34.391,83	2,08%	3,15%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.285.196,74	0,00	0,00	1.313.816,56	28.619,82	2,23%	2,23%
BRASESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	115.342,91	0,00	6.506,60	111.089,16	2.252,85	2,02%	-3,69%



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 BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	3.650.995,95	0,00	0,00	3.767.648,99	116.653,04	3,20%	3,20%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	4.154.696,06	0,00	0,00	4.253.573,71	98.877,65	2,38%	2,38%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	0,00	10.000.000,00	0,00	10.072.945,71	72.945,71	0,73%	-2,29%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS12	0,00	10.000.000,00	0,00	10.050.536,43	50.536,43	0,51%	0,00%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	4.092.034,03	0,00	0,00	4.138.402,81	46.368,78	1,13%	1,13%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	2.546.156,59	0,00	0,00	2.568.022,95	21.866,36	0,86%	0,86%
CAIXA LOGÍSTICA FICFIP	2.076,86	0,00	2.993,43	0,00	916,57	44,13%	-
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	5.337.597,26	0,00	0,00	5.303.958,33	-33.638,93	-0,63%	-
KINEA PIPE FI AÇÕES	2.473.162,22	0,00	0,00	2.355.766,95	-117.395,27	-4,75%	-4,75%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	4.601.080,92	0,00	0,00	4.431.113,66	-169.967,26	-3,69%	-3,69%
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	4.121.347,16	0,00	0,00	3.672.448,64	-448.898,52	-10,89%	-10,89%
BB CONSUMO FIC AÇÕES	5.176.112,37	0,00	0,00	4.683.637,60	-492.474,77	-9,51%	-9,51%
Total Renda Variável					-854.210,21	-0,75%	

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 (%)
TÍTULOS PÚBLICOS	0,00	302.064.061,72	91.374.606,98	224.969.023,85	14.279.569,11	15,52%	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	62.125.489,16	0,00	41.593.633,96	32.018.748,04	11.486.892,84	22,30%	24,52%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	60.989.363,23	0,00	67.556.354,00	55.775,31	6.622.766,08	14,06%	15,19%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	76.960.687,51	13.265.020,20	68.580.613,02	4.884.945,71	6,99%	14,53%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.319.682,31	147.500,00	0,00	20.179.861,39	4.712.679,08	30,74%	30,74%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	28.373.188,94	0,00	32.703.546,02	174.286,17	4.504.643,25	19,75%	24,56%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	12.878.554,60	0,00	11.567.128,91	4.943.699,46	3.632.273,77	28,20%	30,56%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	21.415.340,00	0,00	1.312.970,78	23.252.860,00	3.150.490,78	15,13%	8,58%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	25.480.931,97	37.143.827,47	65.763.515,19	0,00	3.138.755,75	5,74%	14,25%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	22.225.175,85	116.758.481,57	141.308.260,16	390.185,47	2.714.788,21	10,69%	14,58%
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%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	37.807.941,44	220.500,00	40.099.831,51	88.469,36	2.159.859,43	12,72%	13,88%
CAIXA BRASIL 2016 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	21.593.680,00	0,00	23.520.412,98	0,00	1.926.732,98	9,10%	-
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	20.874.480,00	0,00	22.736.113,57	0,00	1.861.633,57	9,10%	-
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.935.875,00	0,00	525.295,46	9.547.125,00	1.136.545,46	13,08%	6,84%
CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.942.205,00	0,00	523.773,77	9.547.080,00	1.128.648,77	12,98%	6,76%
CAIXA BRASIL 2016 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.488.864,00	0,00	10.334.946,24	0,00	846.082,24	9,10%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.494.875,79	0,00	8.008.991,76	1.313.816,56	827.932,53	13,32%	13,26%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	0,00	15.000.000,00	15.792.654,23	0,00	792.654,23	5,28%	15,02%
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.881.685,00	0,00	343.779,80	6.285.190,00	747.284,80	13,07%	6,86%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	4.344.592,00	0,00	0,00	5.076.404,00	731.812,00	16,84%	16,84%
CAIXA BRASIL 2016 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.410.504,30	0,00	6.981.969,72	0,00	571.465,42	9,10%	-

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 IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	222.373,25	8.941.429,40	9.533.185,67	113.402,44	482.785,46	12,79%	14,48%
CAIXA BRASIL IPCA XIV FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	5.455.920,00	0,00	5.933.094,00	0,00	477.174,00	8,75%	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	21.731.205,44	0,00	22.108.743,93	0,00	377.538,49	1,74%	14,00%
CAIXA BRASIL IPCA XII FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	5.629.077,00	0,00	5.997.630,00	0,00	368.553,00	6,55%	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	5.998.000,00	0,00	6.326.342,03	328.342,03	5,47%	14,89%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	12.638.753,11	0,00	12.858.962,98	0,00	220.209,87	1,74%	14,07%
CAIXA BRASIL IPCA XV FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.768.925,00	0,00	1.942.270,00	0,00	173.345,00	9,80%	-
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	131.743,51	0,00	35.234,30	176.810,80	80.301,59	83,23%	34,21%
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	0,00	2.009.127,67	2.061.706,74	2.341,66	54.920,73	4,09%	13,65%
BRDESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	103.432,31	0,00	6.506,60	111.089,16	14.163,45	13,77%	7,40%
BRDESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,00	502.879,96	504.852,10	0,00	1.972,14	0,39%	14,57%
GRADUAL FI RENDA FIXA	0,00	141.217.900,90	117.975.517,85	0,00	-23.242.383,05	-45,21%	12,50%
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>53.597.274,42</b>	<b>11,81%</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 (%)
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	2.726.984,13	0,00	0,00	3.767.648,99	1.040.664,86	38,16%	38,16%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	3.194.449,73	0,00	0,00	4.138.402,81	943.953,08	29,55%	29,55%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	3.542.190,05	0,00	0,00	4.253.573,71	711.383,66	20,08%	20,08%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	3.746.498,18	0,00	0,00	4.431.113,66	684.615,48	18,27%	18,27%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	2.000.252,48	0,00	0,00	2.568.022,95	567.770,47	28,38%	28,38%
KINEA PIPE FI AÇÕES	1.244.931,60	590.000,00	0,00	2.355.766,95	520.835,35	38,36%	37,84%
BB CONSUMO FIC AÇÕES	4.187.867,19	0,00	0,00	4.683.637,60	495.770,41	11,84%	11,84%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	5.115.544,72	0,00	0,00	5.303.958,33	188.413,61	3,68%	-
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	0,00	10.000.000,00	0,00	10.072.945,71	72.945,71	0,73%	18,87%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS12	0,00	10.000.000,00	0,00	10.050.536,43	50.536,43	0,51%	-
CAIXA LOGÍSTICA FICFIP	28.936,78	21.609,26	2.993,43	0,00	-47.552,61	-99,80%	-
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	4.639.993,96	0,00	0,00	3.672.448,64	-967.545,32	-20,85%	-20,85%
Total Renda Variável					4.261.791,13	15,70%	