

Relatório Analítico dos Investimentos em agosto de 2016



Carteira consolidada de investimentos - base (agosto / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	13.385.322,18	4,85%	176	1,88%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2024	696.748,34	0,25%	17	0,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	765.397,32	0,28%	983	1,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.920.337,92	3,23%	207	0,74%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	27.632.316,55	10,01%	598	0,84%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	13.015.828,70	4,71%	116	2,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	16.228.078,08	5,88%	110	4,33%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	3.744.286,44	1,36%	20	1,52%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.481.945,68	2,71%	731	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	2.476.739,86	0,90%	38	3,41%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	27.554.439,45	9,98%	631	0,61%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.911.432,15	0,69%	753	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	6.602.113,70	2,39%	298	0,40%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	789.589,65	0,29%	1.176	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	3.964.135,27	1,44%	193	1,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	9.134.954,40	3,31%	30	3,50%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	D+1	Não há	2.467.727,98	0,89%	13	0,75%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADERCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	737.263,60	0,27%	88	0,08%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	53.584.825,92	19,41%	340	2,29%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	2.499.128,21	0,91%	143	0,25%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VIII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	01/01/2017	2.659.193,91	0,96%	49	0,41%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.503.118,17	1,27%	467	0,16%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "

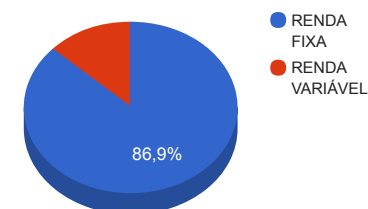
Carteira consolidada de investimentos - base (agosto / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	16/05/2023	3.915.845,72	1,42%	52	1,49%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRASESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	19.811.209,60	7,17%	384	0,29%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	686.739,83	0,25%	179	0,25%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.072.578,80	1,11%	808	0,06%	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	1.466.618,64	0,53%	51	0,46%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	1.231.106,00	0,45%	100	0,61%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	2.785.137,55	1,01%	193	13,24%	Artigo 8º, Inciso III
BB CIELO FI AÇÕES	D+4	Não há	1.998.916,93	0,72%	6.669	1,08%	Artigo 8º, Inciso III
BB PIPE FIC AÇÕES	D+4	03/06/2018	1.048.014,07	0,38%	48	1,13%	Artigo 8º, Inciso III
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	D+4	Não há	3.136.501,74	1,14%	9.082	1,82%	Artigo 8º, Inciso III
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	1.348.151,00	0,49%	1.302	3,94%	Artigo 8º, Inciso III
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	2.423.446,35	0,88%	30	4,55%	Artigo 8º, Inciso III
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	D+4	Não há	3.730.177,94	1,35%	3.534	7,37%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	1.477.481,10	0,54%	148	1,01%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	D+12	Não há	1.619.110,79	0,59%	403	2,25%	Artigo 8º, Inciso III
XP INVESTOR FI AÇÕES	D+4	Não há	1.976.374,71	0,72%	3.025	1,13%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.243.569,62	0,81%	3.192	0,80%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	8.533.052,42	3,09%	242	6,24%	Artigo 8º, Inciso IV
CAIXA BRASIL IPCA VIII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+0	06/12/2016	1.845.897,00	0,67%	21	2,00%	Artigo 8º, Inciso IV
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	D+5	Não há	2.011.376,88	0,73%	28	1,21%	Artigo 8º, Inciso IV
		TOTAL -	276.116.230,17				

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

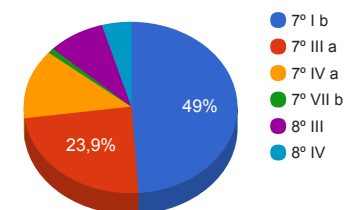
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	10,00%	0,00	0,00%	27.611.623,02
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	75,00%	135.168.711,29	48,95%	71.918.461,34
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	50,00%	65.924.771,90	23,88%	72.133.343,19
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	36.147.814,24	13,09%	46.687.054,81
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	13.805.811,51
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	13.805.811,51
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	2.697.724,64	0,98%	11.108.086,87
Total Renda Fixa	100,00%	180,00	239.939.022,07	86,90%	

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	5,00%	0,00	0,00%	13.805.811,51
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	23.786.881,80	8,61%	17.630.552,73
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	12.390.326,30	4,49%	1.415.485,21
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	13.805.811,51
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	13.805.811,51
Total Renda Variável	30,00%	35,00	36.177.208,10	13,10%	

Distribuição por Artigo / Resolução



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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDKA IPCA 2 Anos	1,29%	10,97%	3,16%	5,69%	17,70%	31,48%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,28%	10,91%	3,19%	6,25%	17,70%	30,36%	0,20%	0,755%	3,06%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,22%	10,94%	3,23%	6,39%	17,78%	30,85%	0,20%	0,732%	2,94%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,69%	9,33%	3,13%	6,31%	16,22%	-	0,20%	0,552%	1,24%

Selic	1,22%	9,22%	3,53%	7,01%	14,15%	28,31%	-	-	-
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,22%	9,24%	3,57%	7,04%	14,18%	28,51%	0,20%	0,007%	0,02%

CDI	1,21%	9,21%	3,52%	7,00%	14,13%	28,23%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,25%	9,04%	3,49%	6,87%	14,01%	28,38%	0,20%	0,021%	0,17%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,19%	9,30%	3,48%	6,97%	13,97%	27,77%	0,20%	0,011%	0,21%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VIII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,17%	10,64%	3,24%	6,91%	14,05%	22,56%	0,20%	0,038%	2,09%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	1,14%	8,60%	3,30%	6,54%	13,18%	26,11%	0,80%	0,001%	0,00%

IRF-M 1	1,19%	9,83%	3,35%	6,89%	14,87%	28,36%	-	-	-
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	1,19%	9,44%	3,50%	7,06%	14,42%	28,64%	0,50%	0,156%	0,48%
BRADERCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1,18%	9,75%	3,28%	6,84%	14,59%	27,89%	0,20%	0,055%	0,75%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,16%	9,70%	3,26%	6,78%	14,60%	27,58%	0,10%	0,051%	0,47%

IMA-B 5	1,09%	11,35%	3,27%	6,50%	18,11%	31,19%	-	-	-
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	1,10%	11,21%	3,22%	6,40%	17,90%	30,75%	0,10%	0,786%	3,32%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,07%	11,13%	3,21%	6,38%	17,61%	30,24%	0,20%	0,801%	3,29%
IMA Geral	1,03%	15,92%	4,57%	11,75%	19,78%	27,84%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,02%	15,64%	4,49%	11,57%	19,16%	26,88%	0,20%	0,925%	4,52%
IRF-M	0,98%	17,01%	4,49%	12,10%	18,72%	27,21%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,98%	16,92%	4,42%	12,05%	18,50%	26,64%	0,20%	0,968%	4,21%
IPCA + 6,00% ao ano	0,98%	9,60%	2,87%	6,29%	15,51%	34,14%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,36%	18,08%	4,20%	12,53%	23,58%	28,81%	0,15%	1,574%	8,78%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,13%	10,15%	3,20%	6,73%	15,90%	34,89%	0,20%	0,130%	0,34%
IDKA IPCA 20 Anos	0,96%	46,60%	12,00%	44,19%	46,78%	27,81%	-	-	-
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,11%	32,44%	9,22%	29,62%	36,42%	27,52%	0,20%	3,926%	17,99%
IMA-B	0,89%	20,11%	5,41%	15,26%	25,51%	29,04%	-	-	-
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	0,97%	19,34%	5,35%	14,94%	24,37%	28,43%	0,20%	1,795%	8,44%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	0,83%	19,85%	5,30%	15,08%	24,87%	27,69%	0,20%	1,905%	9,30%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	0,80%	18,12%	5,14%	13,68%	23,74%	31,65%	0,45%	1,937%	8,00%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	0,67%	19,00%	5,00%	14,29%	24,94%	29,48%	0,15%	2,015%	9,51%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,35%	13,01%	1,58%	10,51%	18,10%	-	0,20%	4,850%	10,60%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5+	0,87%	25,95%	6,93%	21,12%	30,33%	28,94%	-	-	-
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	0,86%	25,45%	6,97%	20,88%	29,56%	27,41%	0,20%	2,567%	13,46%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,82%	25,55%	6,88%	20,93%	29,43%	27,40%	0,20%	2,523%	13,15%
IRF-M 1+	0,87%	22,39%	5,07%	15,69%	21,58%	26,96%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,90%	22,33%	4,97%	15,82%	21,80%	26,83%	0,20%	1,428%	6,64%
IPCA	0,44%	5,42%	1,32%	3,17%	8,97%	19,36%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,78%	13,35%	3,27%	8,03%	18,95%	-	0,20%	0,705%	3,35%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1,45%	15,03%	3,98%	8,99%	20,86%	30,99%	0,20%	1,245%	6,37%

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

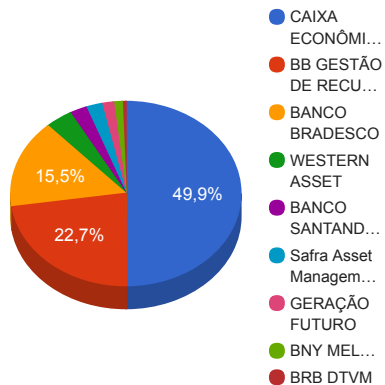
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDIV	1,88%	44,54%	23,66%	47,75%	28,38%	-25,39%	-	-	-
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	1,63%	-3,05%	15,11%	0,61%	-2,32%	-14,55%	3,00%	8,906%	21,82%
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	-0,56%	39,14%	12,09%	32,07%	42,12%	20,20%	3,00%	6,215%	20,17%
IFNC	1,70%	43,82%	20,31%	42,37%	35,45%	8,31%	-	-	-
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	1,77%	43,16%	20,17%	41,80%	34,85%	7,60%	1,00%	8,596%	32,55%
CDI	1,21%	9,21%	3,52%	7,00%	14,13%	28,23%	-	-	-
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	1,56%	11,06%	4,50%	7,88%	16,98%	38,67%	2,00%	0,833%	1,96%
Ibovespa	1,03%	33,57%	19,45%	35,30%	24,18%	-5,53%	-	-	-
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	2,95%	3,97%	21,39%	9,41%	9,72%	-6,64%	2,00%	8,531%	20,51%
XP INVESTOR FI AÇÕES	1,54%	46,85%	21,55%	42,85%	50,03%	20,11%	2,00%	7,498%	21,38%
GERAÇÃO FI AÇÕES	0,85%	-2,11%	16,47%	4,14%	1,46%	-16,47%	3,00%	9,087%	21,24%
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	0,58%	23,20%	17,45%	25,84%	17,49%	3,95%	1,00%	7,120%	21,57%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	-1,19%	40,66%	22,17%	42,71%	28,69%	-10,82%	2,00%	7,193%	22,91%
BB PIPE FIC AÇÕES	-4,09%	26,89%	11,45%	22,19%	19,15%	14,82%	1,20%	5,126%	15,19%
IPCA + 6,00% ao ano	0,98%	9,60%	2,87%	6,29%	15,51%	34,14%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA VIII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1,11%	10,45%	3,23%	6,95%	15,80%	34,00%	0,15%	0,071%	0,43%
CIELO ON NM - CIEL3	-8,60%	21,03%	5,80%	31,10%	6,81%	20,50%	-	-	-

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

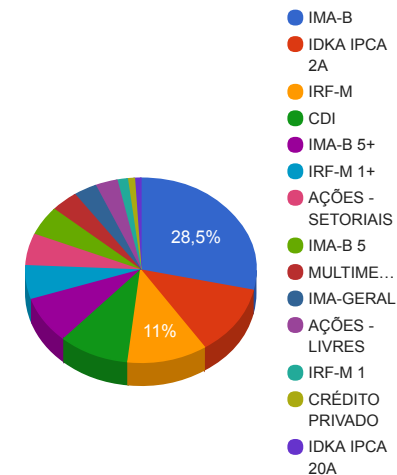
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB CIELO FI AÇÕES	-8,64%	19,25%	5,22%	29,48%	4,74%	16,30%	1,50%	12,378%	33,85%
BBSEGURIDADE ON NM - BBSE3	-0,58%	27,40%	9,92%	24,23%	8,00%	-8,31%	-	-	-
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	-0,62%	25,76%	9,56%	22,97%	6,14%	-11,35%	1,5%	7,975%	43,97%
S&P 500	-0,12%	6,21%	3,53%	12,35%	10,08%	8,36%	-	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	1,12%	13,91%	6,96%	19,58%	24,53%	37,40%	1,00%	2,372%	15,09%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	137.903.696,12	49,94%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	62.724.635,79	22,72%
BANCO BRADESCO	42.699.256,30	15,46%
WESTERN ASSET	10.544.429,30	3,82%
BANCO SANTANDER	6.602.113,70	2,39%
Safra Asset Management	6.212.014,42	2,25%
GERAÇÃO FUTURO	4.628.077,73	1,68%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	3.324.525,71	1,20%
BRB DTVM	1.477.481,10	0,54%



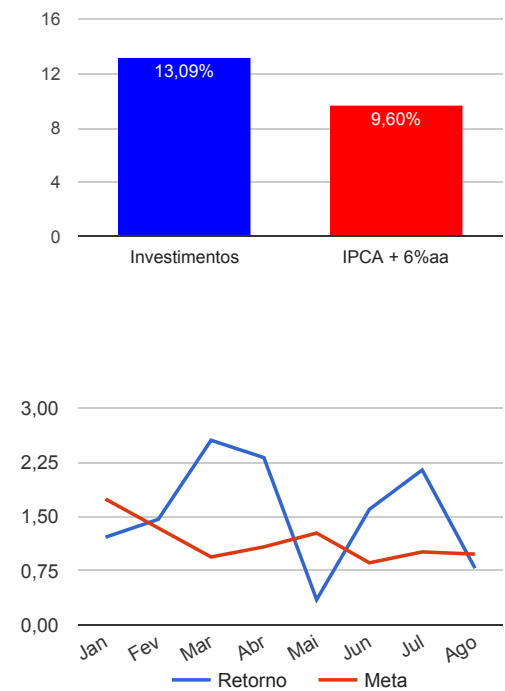
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	78.222.060,65	28,33%
IDKA IPCA 2A	33.430.006,87	12,11%
IRF-M	30.291.510,46	10,97%
CDI	27.073.646,40	9,81%
IMA-B 5+	22.520.276,58	8,16%
IRF-M 1+	16.228.078,08	5,88%
AÇÕES - SETORIAIS	15.242.454,78	5,52%
IMA-B 5	14.084.059,38	5,10%
MULTIMERCADO	10.544.429,30	3,82%
IMA-GERAL	8.920.337,92	3,23%
AÇÕES - LIVRES	8.544.427,02	3,09%
IRF-M 1	3.994.581,23	1,45%
CRÉDITO PRIVADO	2.697.724,64	0,98%
IDKA IPCA 20A	2.476.739,86	0,90%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	241.212.832,49	35.867.183,30	35.272.132,63	244.741.399,82	2.933.516,66	1,21%	1,74%	69,75%	2,33%
Fevereiro	244.741.399,82	9.607.549,88	9.179.947,33	248.747.930,53	3.578.928,16	1,46%	1,34%	108,59%	2,84%
Março	248.747.930,53	182.053.778,36	181.728.508,26	255.427.795,69	6.354.595,06	2,55%	0,94%	270,78%	4,25%
Abril	255.427.795,69	32.599.986,76	32.762.345,97	261.171.295,48	5.905.859,00	2,31%	1,08%	214,81%	2,40%
Mai	261.171.295,48	6.516.425,80	6.252.173,84	262.352.914,80	917.367,36	0,35%	1,27%	27,62%	2,12%
Junho	262.352.914,80	20.257.583,29	18.505.041,69	268.325.723,04	4.220.266,64	1,60%	0,86%	185,42%	1,91%
Julho	268.325.723,04	34.720.002,88	35.354.949,28	273.436.298,45	5.745.521,81	2,14%	1,01%	212,15%	1,51%
Agosto	273.436.298,45	116.699.411,99	116.173.159,89	276.116.230,17	2.153.679,62	0,79%	0,98%	80,58%	1,88%
Acumulado no ano					31.809.734,31	13,09%	9,60%	136,35%	

Acumulado no Ano



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de agosto / 2016

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.209.592,00	0,00	0,00	1.231.106,00	21.514,00	1,78%	0,71%	1,78%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1.445.640,34	0,00	0,00	1.466.618,64	20.978,30	1,45%	1,24%	1,45%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	706.316,88	0,00	19.342,89	696.748,34	9.774,35	1,38%	4,85%	-1,35%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.863.363,94	0,00	0,00	3.915.845,72	52.481,78	1,36%	1,57%	1,36%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.887.230,36	0,00	0,00	1.911.432,15	24.201,79	1,28%	0,75%	1,28%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.034.525,36	0,00	0,00	3.072.578,80	38.053,44	1,25%	0,02%	1,25%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	27.223.408,25	0,00	0,00	27.554.439,45	331.031,20	1,22%	0,73%	1,22%
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	2.438.625,79	0,00	0,00	2.467.727,98	29.102,19	1,19%	0,16%	1,19%
BRDESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	728.673,79	0,00	0,00	737.263,60	8.589,81	1,18%	0,05%	1,18%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VIII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.628.441,02	0,00	0,00	2.659.193,91	30.752,89	1,17%	0,04%	1,17%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	780.513,97	0,00	0,00	789.589,65	9.075,68	1,16%	0,05%	1,16%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.543.394,22	0,00	72.536,64	2.499.128,21	28.270,63	1,11%	0,13%	1,13%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	6.530.545,92	0,00	0,00	6.602.113,70	71.567,78	1,10%	0,79%	1,10%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.402.894,44	0,00	0,00	7.481.945,68	79.051,24	1,07%	0,80%	1,07%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.829.990,79	0,00	0,00	8.920.337,92	90.347,13	1,02%	0,93%	1,02%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	19.572.810,49	7.000.000,00	7.003.684,31	19.811.209,60	242.083,42	0,91%	0,01%	1,22%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	16.084.043,47	0,00	0,00	16.228.078,08	144.034,61	0,90%	1,43%	0,90%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	9.057.261,82	0,00	0,00	9.134.954,40	77.692,58	0,86%	2,57%	0,86%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.474.190,86	2.000.000,00	0,00	3.503.118,17	28.927,31	0,83%	0,01%	1,19%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	3.714.694,83	0,00	0,00	3.744.286,44	29.591,61	0,80%	1,94%	0,80%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	28.012.311,99	0,00	24.262.470,10	3.964.135,27	214.293,38	0,76%	0,55%	0,69%
CAIXA BRASIL 2016 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	22.217.720,00	0,00	22.368.020,00	0,00	150.300,00	0,68%	-	-

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de agosto / 2016

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL 2016 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	16.568.160,00	0,00	16.680.105,00	0,00	111.945,00	0,68%	-	-
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	760.277,16	0,00	0,00	765.397,32	5.120,16	0,67%	2,01%	0,67%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	38.199.284,66	15.116.736,56	0,00	53.584.825,92	268.804,70	0,50%	1,79%	0,97%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.224.487,23	24.335.006,74	0,00	27.632.316,55	72.822,58	0,26%	0,97%	0,98%
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.473.961,61	0,00	0,00	2.476.739,86	2.778,25	0,11%	3,93%	0,11%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	981.375,16	45.443.984,38	45.767.000,95	686.739,83	28.381,24	0,06%	0,00%	1,14%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	6.027.000,99	7.003.684,31	0,00	13.015.828,70	-14.856,60	-0,11%	1,91%	0,83%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.491.922,72	11.000.000,00	0,00	13.385.322,18	-106.600,54	-0,79%	2,52%	0,82%
Total Renda Fixa					2.100.109,91	0,87%	1,26%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de agosto / 2016

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	1.572.743,21	0,00	0,00	1.619.110,79	46.367,58	2,95%	8,53%	2,95%
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	3.665.401,79	0,00	0,00	3.730.177,94	64.776,15	1,77%	8,60%	1,77%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.207.649,17	0,00	0,00	2.243.569,62	35.920,45	1,63%	8,91%	1,63%
XP INVESTOR FI AÇÕES	1.946.422,47	0,00	0,00	1.976.374,71	29.952,24	1,54%	7,50%	1,54%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	8.438.894,51	0,00	0,00	8.533.052,42	94.157,91	1,12%	2,37%	1,12%
CAIXA BRASIL IPCA VIII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.825.679,00	0,00	0,00	1.845.897,00	20.218,00	1,11%	0,07%	1,11%
GERAÇÃO FI AÇÕES	1.464.996,45	0,00	0,00	1.477.481,10	12.484,65	0,85%	9,09%	0,85%
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	2.409.589,40	0,00	0,00	2.423.446,35	13.856,95	0,58%	7,12%	0,58%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	0,00	2.000.000,00	0,00	2.011.376,88	11.376,88	0,57%	0,83%	1,56%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	0,00	2.800.000,00	0,00	2.785.137,55	-14.862,45	-0,53%	7,19%	-1,19%
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.355.691,94	0,00	0,00	1.348.151,00	-7.540,94	-0,56%	6,21%	-0,56%
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	3.155.913,61	0,00	0,00	3.136.501,74	-19.411,87	-0,62%	7,97%	-0,62%
BB PIPE FIC AÇÕES	1.092.656,91	0,00	0,00	1.048.014,07	-44.642,84	-4,09%	5,13%	-4,09%
BB CIELO FI AÇÕES	2.187.999,93	0,00	0,00	1.998.916,93	-189.083,00	-8,64%	12,38%	-8,64%
Total Renda Variável					53.569,71	0,15%	6,00%	