

# Relatório Analítico dos Investimentos em setembro e 3º Trimestre de 2016



Carteira consolidada de investimentos - base (setembro / 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	1.268.126,59	0,45%	179	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2024	704.580,25	0,25%	17	0,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	778.794,06	0,28%	1.027	1,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	9.061.305,64	3,24%	207	0,74%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	28.173.182,70	10,08%	596	0,85%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	13.220.486,48	4,73%	116	2,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	16.603.492,11	5,94%	108	4,36%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	3.802.384,82	1,36%	21	1,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	29.723.867,48	10,64%	733	0,49%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	2.530.495,52	0,91%	36	4,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	39.983.225,81	14,31%	639	0,88%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.937.205,67	0,69%	754	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	6.693.787,32	2,40%	299	0,40%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	798.737,67	0,29%	1.171	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	4.017.012,89	1,44%	193	1,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	544.699,34	0,19%	34	0,19%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	D+1	Não há	2.496.882,21	0,89%	12	0,76%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADERCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	9.285.614,58	3,32%	89	1,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	32.024.970,54	11,46%	341	1,37%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	2.520.265,99	0,90%	143	0,25%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VIII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	01/01/2017	2.689.478,33	0,96%	49	0,41%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.541.591,30	1,27%	463	0,16%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "

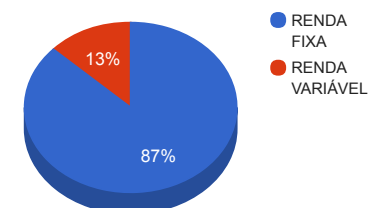
Carteira consolidada de investimentos - base (setembro / 2016)

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	3.966.374,67	1,42%	52	1,49%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	20.028.696,47	7,17%	385	0,30%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	934.973,32	0,33%	179	0,29%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.106.826,63	1,11%	801	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	1.492.312,42	0,53%	51	0,46%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	1.242.748,00	0,44%	100	0,61%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	2.751.053,66	0,98%	224	12,19%	Artigo 8º, Inciso III
BB CIELO FI AÇÕES	D+4	Não há	1.948.833,99	0,70%	6.498	1,09%	Artigo 8º, Inciso III
BB PIPE FIC AÇÕES	D+4	03/06/2018	1.043.119,99	0,37%	48	1,13%	Artigo 8º, Inciso III
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	D+4	Não há	3.210.800,34	1,15%	8.920	1,85%	Artigo 8º, Inciso III
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	1.362.525,87	0,49%	3.288	0,79%	Artigo 8º, Inciso III
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	2.430.957,09	0,87%	29	4,65%	Artigo 8º, Inciso III
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	D+4	Não há	3.684.100,25	1,32%	3.581	7,18%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	1.492.539,45	0,53%	145	1,00%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	D+12	Não há	1.633.366,06	0,58%	401	2,26%	Artigo 8º, Inciso III
XP INVESTOR FI AÇÕES	D+4	Não há	1.980.409,37	0,71%	3.346	1,06%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.264.448,73	0,81%	3.115	0,81%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	8.600.545,19	3,08%	247	6,35%	Artigo 8º, Inciso IV
CAIXA BRASIL IPCA VIII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+0	06/12/2016	1.862.626,00	0,67%	21	2,00%	Artigo 8º, Inciso IV
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	D+5	Não há	2.027.695,87	0,73%	29	1,13%	Artigo 8º, Inciso IV
		<b>TOTAL -</b>	<b>279.465.140,67</b>				

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

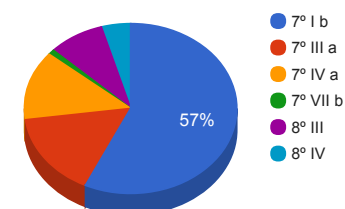
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	10,00%	0,00	0,00%	27.946.514,07
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	75,00%	159.296.685,01	57,00%	50.302.170,49
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	50,00%	44.352.166,67	15,87%	95.380.403,67
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	36.788.206,71	13,16%	47.051.335,49
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	13.973.257,03
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	13.973.257,03
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	2.735.060,42	0,98%	11.238.196,61
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>180,00</b>	<b>243.172.118,81</b>	<b>87,01%</b>	

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%	13.973.257,03
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	23.802.154,80	8,52%	18.117.616,30
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	12.490.867,06	4,47%	1.482.389,97
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	13.973.257,03
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	13.973.257,03
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>35,00</b>	<b>36.293.021,86</b>	<b>12,99%</b>	

Distribuição por Artigo / Resolução



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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M 1+	2,33%	25,23%	4,73%	12,51%	27,33%	32,01%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,31%	25,16%	4,76%	12,60%	27,19%	31,76%	0,20%	2,034%	5,59%
IRF-M	1,96%	19,30%	4,31%	10,51%	22,20%	30,67%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,96%	19,21%	4,32%	10,51%	22,07%	30,02%	0,20%	1,397%	3,48%
IMA-B 5+	1,67%	28,05%	5,98%	13,71%	34,70%	38,62%	-	-	-
BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	1,68%	27,55%	5,97%	13,54%	33,94%	37,07%	0,20%	3,166%	10,21%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,66%	27,64%	5,93%	13,48%	33,84%	36,94%	0,20%	3,135%	10,13%
IMA-B	1,57%	22,00%	5,04%	11,16%	28,36%	35,87%	-	-	-
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	1,75%	21,08%	5,07%	10,97%	27,56%	36,43%	0,15%	2,524%	7,44%
BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1,57%	21,73%	5,01%	10,97%	27,76%	34,50%	0,20%	2,339%	7,09%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	1,55%	19,96%	4,90%	10,37%	25,86%	35,07%	0,45%	2,426%	6,40%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	1,51%	21,14%	4,94%	10,88%	27,24%	34,68%	0,20%	2,172%	6,44%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,12%	14,28%	1,97%	7,40%	20,22%	-	0,20%	2,215%	8,70%
IMA Geral	1,53%	17,70%	4,28%	9,71%	22,07%	31,71%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,58%	17,46%	4,31%	9,67%	21,60%	30,66%	0,20%	1,247%	3,56%
IDKA IPCA 20 Anos	1,53%	48,84%	8,08%	21,72%	56,31%	46,52%	-	-	-
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,17%	35,31%	7,04%	17,35%	42,65%	42,15%	0,20%	4,415%	14,08%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDKA IPCA 2 Anos	1,50%	12,64%	3,74%	7,11%	18,43%	33,53%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,35%	12,40%	3,73%	7,12%	18,25%	32,16%	0,20%	0,558%	2,63%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,33%	10,79%	3,19%	6,83%	16,20%	-	0,20%	0,456%	1,06%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,33%	12,42%	3,70%	7,14%	18,28%	32,52%	0,20%	0,545%	2,55%
IMA-B 5	1,41%	12,92%	3,76%	7,19%	18,83%	33,03%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,40%	12,68%	3,70%	7,08%	18,43%	32,08%	0,20%	0,778%	2,72%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	1,39%	12,76%	3,70%	7,08%	18,58%	32,56%	0,10%	0,776%	2,70%
IRF-M 1	1,19%	11,14%	3,46%	6,82%	15,14%	28,83%	-	-	-
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	1,18%	10,73%	3,53%	7,00%	14,60%	28,98%	0,50%	0,228%	0,39%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1,17%	11,03%	3,40%	6,73%	15,20%	28,38%	0,20%	0,075%	0,52%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,16%	10,97%	3,39%	6,72%	14,91%	28,05%	0,10%	0,076%	0,39%
Selic	1,11%	10,44%	3,47%	6,95%	14,15%	28,56%	-	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,10%	10,44%	3,49%	6,99%	14,15%	28,71%	0,20%	0,005%	0,02%
CDI	1,11%	10,42%	3,47%	6,94%	14,13%	28,50%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VIII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,14%	11,90%	3,38%	6,66%	15,68%	25,29%	0,20%	0,049%	1,23%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,11%	10,26%	3,54%	6,88%	14,00%	28,66%	0,20%	0,027%	0,17%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,10%	10,50%	3,43%	6,90%	14,12%	27,99%	0,20%	0,016%	0,14%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	1,04%	9,73%	3,25%	6,49%	13,18%	26,36%	0,80%	0,000%	0,00%
IPCA + 6,00% ao ano	0,57%	10,22%	2,57%	5,90%	14,98%	33,45%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,29%	19,61%	5,01%	9,83%	25,57%	33,33%	0,15%	2,133%	6,97%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,85%	11,08%	2,90%	6,37%	15,86%	34,87%	0,20%	0,066%	0,34%
IPCA	0,08%	5,51%	1,04%	2,81%	8,48%	18,77%	-	-	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1,75%	17,04%	4,87%	8,98%	23,27%	34,09%	0,20%	1,408%	5,00%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,95%	14,42%	3,12%	6,49%	20,78%	-	0,20%	0,595%	3,16%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BBSEGURIDADE ON NM - BBSE3	2,50%	30,59%	9,26%	3,41%	28,06%	4,31%	-	-	-
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	2,37%	28,74%	8,91%	2,89%	25,80%	0,85%	1,5%	13,418%	42,65%
CDI	1,11%	10,42%	3,47%	6,94%	14,13%	28,50%	-	-	-
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	0,81%	11,96%	4,37%	7,72%	15,37%	39,49%	2,00%	0,701%	1,87%
Ibovespa	0,80%	34,64%	13,28%	16,61%	29,53%	7,86%	-	-	-
GERAÇÃO FI AÇÕES	1,02%	-1,12%	12,63%	10,67%	-0,01%	-7,74%	3,00%	11,421%	21,58%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	0,88%	4,89%	15,29%	16,52%	7,61%	0,54%	2,00%	10,518%	20,70%
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	0,31%	23,59%	11,89%	15,28%	20,36%	13,89%	1,00%	10,741%	21,75%
XP INVESTOR FI AÇÕES	0,20%	47,15%	13,75%	29,88%	57,37%	39,00%	2,00%	10,663%	20,81%
BB PIPE FIC AÇÕES	-0,47%	26,30%	3,57%	12,41%	21,87%	21,90%	1,20%	7,449%	15,26%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	-1,22%	38,94%	11,37%	22,71%	37,39%	-4,93%	2,00%	11,650%	22,72%
IPCA + 6,00% ao ano	0,57%	10,22%	2,57%	5,90%	14,98%	33,45%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA VIII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	0,91%	11,45%	2,86%	6,24%	16,02%	34,34%	0,15%	0,027%	0,40%
CIELO ON NM - CIEL3	-2,42%	18,11%	-3,19%	12,48%	8,22%	21,28%	-	-	-
BB CIELO FI AÇÕES	-2,51%	16,26%	-3,50%	11,30%	6,15%	17,22%	1,50%	9,502%	33,21%
IFNC	-1,24%	42,03%	10,96%	14,01%	40,00%	23,55%	-	-	-
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	-1,24%	41,39%	11,01%	13,95%	39,40%	22,58%	1,00%	11,439%	31,87%

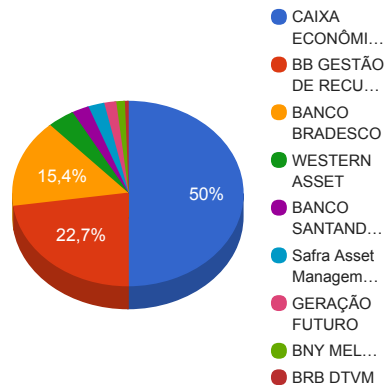


Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (setembro / 2016)

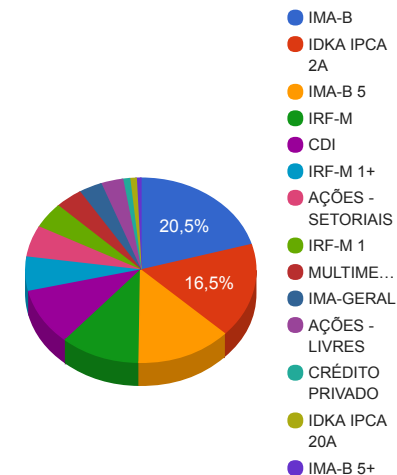
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDIV	-0,27%	44,15%	14,52%	22,19%	36,47%	-14,52%	-	-	-
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	1,07%	40,62%	7,53%	18,64%	49,28%	33,69%	3,00%	8,906%	19,69%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	0,93%	-2,15%	11,81%	8,36%	-2,96%	-5,91%	3,00%	10,489%	21,92%
S&P 500	-0,12%	6,08%	3,31%	5,27%	12,93%	9,94%	-	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	0,79%	14,81%	6,65%	12,17%	27,71%	39,43%	1,00%	6,808%	14,41%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	139.702.560,70	49,99%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	63.549.704,15	22,74%
BANCO BRADESCO	43.079.496,87	15,41%
WESTERN ASSET	10.628.241,06	3,80%
BANCO SANTANDER	6.693.787,32	2,40%
Safra Asset Management	6.299.267,03	2,25%
GERAÇÃO FUTURO	4.676.608,85	1,67%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	3.342.935,24	1,20%
BRB DTVM	1.492.539,45	0,53%



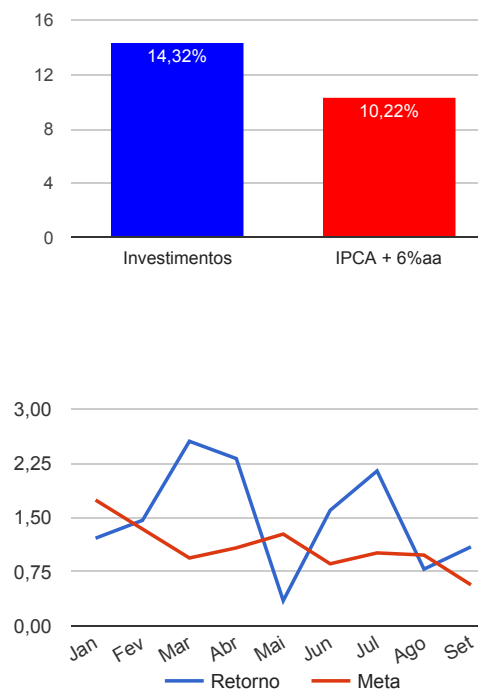
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	57.017.856,81	20,40%
IDKA IPCA 2A	45.937.444,37	16,44%
IMA-B 5	36.417.654,80	13,03%
IRF-M	30.862.661,03	11,04%
CDI	27.612.087,72	9,88%
IRF-M 1+	16.603.492,11	5,94%
AÇÕES - SETORIAIS	15.221.762,84	5,45%
IRF-M 1	12.581.234,46	4,50%
MULTIMERCADO	10.628.241,06	3,80%
IMA-GERAL	9.061.305,64	3,24%
AÇÕES - LIVRES	8.580.391,96	3,07%
CRÉDITO PRIVADO	2.735.060,42	0,98%
IDKA IPCA 20A	2.530.495,52	0,91%
IMA-B 5+	1.812.825,93	0,65%



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%
Setembro	276.116.230,17	48.964.439,65	48.638.608,75	279.465.140,67	3.023.079,60	1,09%	0,57%	192,82%	2,15%
Acumulado no ano					34.832.813,91	14,32%	10,22%	140,16%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	16.228.078,08	0,00	0,00	16.603.492,11	375.414,03	2,31%	2,03%	2,31%
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.476.739,86	0,00	0,00	2.530.495,52	53.755,66	2,17%	4,41%	2,17%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	27.632.316,55	0,00	0,00	28.173.182,70	540.866,15	1,96%	1,40%	1,96%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1.466.618,64	0,00	0,00	1.492.312,42	25.693,78	1,75%	1,41%	1,75%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	765.397,32	0,00	0,00	778.794,06	13.396,74	1,75%	2,52%	1,75%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.920.337,92	0,00	0,00	9.061.305,64	140.967,72	1,58%	1,25%	1,58%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	13.015.828,70	0,00	0,00	13.220.486,48	204.657,78	1,57%	2,34%	1,57%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	3.744.286,44	0,00	0,00	3.802.384,82	58.098,38	1,55%	2,43%	1,55%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	6.602.113,70	0,00	0,00	6.693.787,32	91.673,62	1,39%	0,78%	1,39%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.911.432,15	0,00	0,00	1.937.205,67	25.773,52	1,35%	0,56%	1,35%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.964.135,27	0,00	0,00	4.017.012,89	52.877,62	1,33%	0,46%	1,33%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.915.845,72	0,00	0,00	3.966.374,67	50.528,95	1,29%	2,13%	1,29%
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	2.467.727,98	0,00	0,00	2.496.882,21	29.154,23	1,18%	0,23%	1,18%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	789.589,65	0,00	0,00	798.737,67	9.148,02	1,16%	0,08%	1,16%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VIII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.659.193,91	0,00	0,00	2.689.478,33	30.284,42	1,14%	0,05%	1,14%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	696.748,34	0,00	0,00	704.580,25	7.831,91	1,12%	2,21%	1,12%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.072.578,80	0,00	0,00	3.106.826,63	34.247,83	1,11%	0,03%	1,11%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.503.118,17	0,00	0,00	3.541.591,30	38.473,13	1,10%	0,02%	1,10%
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	19.811.209,60	0,00	0,00	20.028.696,47	217.486,87	1,10%	0,01%	1,10%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	27.554.439,45	12.000.000,00	0,00	39.983.225,81	428.786,36	1,08%	0,55%	1,33%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.231.106,00	0,00	0,00	1.242.748,00	11.642,00	0,95%	0,59%	0,95%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.499.128,21	0,00	0,00	2.520.265,99	21.137,78	0,85%	0,07%	0,85%

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.481.945,68	22.000.000,00	0,00	29.723.867,48	241.921,80	0,82%	0,78%	1,40%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	53.584.825,92	82.839,42	22.000.000,00	32.024.970,54	357.305,20	0,67%	2,17%	1,51%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	737.263,60	8.500.000,00	0,00	9.285.614,58	48.350,98	0,52%	0,07%	1,17%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	686.739,83	6.381.600,23	6.138.608,75	934.973,32	5.242,01	0,07%	0,00%	1,04%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	13.385.322,18	0,00	12.000.000,00	1.268.126,59	-117.195,59	-0,88%	3,13%	1,66%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	9.134.954,40	0,00	8.500.000,00	544.699,34	-90.255,06	-0,99%	3,17%	1,68%
Total Renda Fixa					2.907.265,84	1,21%	1,15%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	3.136.501,74	0,00	0,00	3.210.800,34	74.298,60	2,37%	13,42%	2,37%
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.348.151,00	0,00	0,00	1.362.525,87	14.374,87	1,07%	8,91%	1,07%
GERAÇÃO FI AÇÕES	1.477.481,10	0,00	0,00	1.492.539,45	15.058,35	1,02%	11,42%	1,02%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.243.569,62	0,00	0,00	2.264.448,73	20.879,11	0,93%	10,49%	0,93%
CAIXA BRASIL IPCA VIII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.845.897,00	0,00	0,00	1.862.626,00	16.729,00	0,91%	0,03%	0,91%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	1.619.110,79	0,00	0,00	1.633.366,06	14.255,27	0,88%	10,52%	0,88%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	2.011.376,88	0,00	0,00	2.027.695,87	16.318,99	0,81%	0,70%	0,81%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	8.533.052,42	0,00	0,00	8.600.545,19	67.492,77	0,79%	6,81%	0,79%
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	2.423.446,35	0,00	0,00	2.430.957,09	7.510,74	0,31%	10,74%	0,31%
XP INVESTOR FI AÇÕES	1.976.374,71	0,00	0,00	1.980.409,37	4.034,66	0,20%	10,66%	0,20%
BB PIPE FIC AÇÕES	1.048.014,07	0,00	0,00	1.043.119,99	-4.894,08	-0,47%	7,45%	-0,47%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	2.785.137,55	0,00	0,00	2.751.053,66	-34.083,89	-1,22%	11,65%	-1,22%
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	3.730.177,94	0,00	0,00	3.684.100,25	-46.077,69	-1,24%	11,44%	-1,24%
BB CIELO FI AÇÕES	1.998.916,93	0,00	0,00	1.948.833,99	-50.082,94	-2,51%	9,50%	-2,51%
<b>Total Renda Variável</b>					<b>115.813,76</b>	<b>0,32%</b>	<b>8,84%</b>	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º 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	37.211.325,95	15.296.395,44	22.000.000,00	32.024.970,54	1.517.249,15	3,59%	4,94%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	36.842.954,13	12.000.000,00	10.000.000,00	39.983.225,81	1.140.271,68	3,37%	3,70%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	25.307.905,12	7.000.000,00	13.003.684,31	20.028.696,47	724.475,66	3,09%	3,49%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.931.486,59	10.000.000,00	0,00	16.603.492,11	672.005,52	4,22%	4,76%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	27.535.006,74	0,00	28.173.182,70	638.175,96	3,01%	4,32%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	27.698.720,20	0,00	24.262.470,10	4.017.012,89	580.762,79	3,27%	3,19%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.315.772,85	22.000.000,00	0,00	29.723.867,48	408.094,63	3,11%	3,70%
CAIXA BRASIL 2016 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	21.964.060,00	0,00	22.368.020,00	0,00	403.960,00	1,84%	-
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.687.252,90	0,00	0,00	9.061.305,64	374.052,74	4,31%	4,31%
CAIXA BRASIL 2016 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	16.379.070,00	0,00	16.680.105,00	0,00	301.035,00	1,84%	-
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	6.454.778,66	0,00	0,00	6.693.787,32	239.008,66	3,70%	3,70%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	0,00	13.003.684,31	0,00	13.220.486,48	216.802,17	1,91%	5,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.777.060,99	0,00	0,00	3.966.374,67	189.313,68	5,01%	5,01%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	3.624.773,61	0,00	0,00	3.802.384,82	177.611,21	4,90%	4,90%
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.364.106,88	0,00	0,00	2.530.495,52	166.388,64	7,04%	7,04%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	9.656.728,25	8.500.000,00	9.000.000,00	9.285.614,58	128.886,33	2,47%	3,40%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.186.757,41	0,00	3.200.000,00	3.106.826,63	120.069,22	3,17%	3,54%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VIII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.601.506,53	0,00	0,00	2.689.478,33	87.971,80	3,38%	3,38%
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	2.411.809,93	0,00	0,00	2.496.882,21	85.072,28	3,53%	3,53%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.458.200,92	2.000.000,00	0,00	3.541.591,30	83.390,38	3,06%	3,43%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.520.737,22	0,00	72.536,64	2.520.265,99	72.065,41	2,88%	2,90%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.867.504,18	0,00	0,00	1.937.205,67	69.701,49	3,73%	3,73%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre / 2016

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1.423.051,09	0,00	0,00	1.492.312,42	69.261,33	4,87%	4,87%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	0,00	9.000.000,00	8.500.000,00	544.699,34	44.699,34	0,50%	5,97%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	1.702.095,82	58.248.768,03	59.060.558,98	934.973,32	44.668,45	0,27%	3,25%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.205.166,00	0,00	0,00	1.242.748,00	37.582,00	3,12%	3,12%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	741.231,38	0,00	0,00	778.794,06	37.562,68	5,07%	5,07%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	690.941,21	0,00	19.342,89	704.580,25	32.981,93	4,80%	1,97%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	772.572,60	0,00	0,00	798.737,67	26.165,07	3,39%	3,39%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2.411.339,62	11.000.000,00	12.000.000,00	1.268.126,59	-143.213,03	1,63%	5,93%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>8.546.072,17</b>	<b>3,60%</b>	



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre / 2016

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	8.064.434,76	0,00	0,00	8.600.545,19	536.110,43	6,65%	6,65%
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	3.318.835,54	0,00	0,00	3.684.100,25	365.264,71	11,01%	11,01%
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	2.948.076,87	0,00	0,00	3.210.800,34	262.723,47	8,91%	8,91%
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	2.172.580,66	0,00	0,00	2.430.957,09	258.376,43	11,89%	11,89%
XP INVESTOR FI AÇÕES	1.740.962,97	0,00	0,00	1.980.409,37	239.446,40	13,75%	13,75%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.025.283,75	0,00	0,00	2.264.448,73	239.164,98	11,81%	11,81%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	1.416.709,99	0,00	0,00	1.633.366,06	216.656,07	15,29%	15,29%
GERAÇÃO FI AÇÕES	1.325.152,53	0,00	0,00	1.492.539,45	167.386,92	12,63%	12,63%
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.267.072,59	0,00	0,00	1.362.525,87	95.453,28	7,53%	7,53%
CAIXA BRASIL IPCA VIII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.810.890,00	0,00	0,00	1.862.626,00	51.736,00	2,86%	2,86%
BB PIPE FIC AÇÕES	1.007.206,91	0,00	0,00	1.043.119,99	35.913,08	3,57%	3,57%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	0,00	2.000.000,00	0,00	2.027.695,87	27.695,87	1,38%	4,37%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	0,00	2.800.000,00	0,00	2.751.053,66	-48.946,34	-1,75%	11,37%
BB CIELO FI AÇÕES	2.019.606,43	0,00	0,00	1.948.833,99	-70.772,44	-3,50%	-3,50%
<b>Total Renda Variável</b>					<b>2.376.208,86</b>	<b>8,08%</b>	