

Relatório Analítico dos Investimentos em outubro de 2016



Carteira consolidada de investimentos - base (outubro / 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	11.121.228,83	3,92%	197	1,69%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2024	706.425,90	0,25%	17	0,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	785.511,11	0,28%	1.145	1,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	18.126.507,07	6,39%	208	1,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	28.519.363,77	10,05%	601	0,81%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	21.219.606,02	7,48%	116	3,45%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	16.842.596,62	5,94%	115	3,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	3.826.523,73	1,35%	21	1,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	16.865.343,79	5,94%	733	0,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	2.554.418,39	0,90%	36	4,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	12.647.832,30	4,46%	641	0,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.945.280,02	0,69%	754	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	6.723.174,59	2,37%	364	0,39%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	806.268,44	0,28%	1.170	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	4.033.415,00	1,42%	193	1,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	548.575,99	0,19%	38	0,19%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	D+1	Não há	2.521.866,16	0,89%	13	0,76%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADERCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.349.928,19	0,48%	87	0,16%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	53.703.562,18	18,93%	344	2,23%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	2.535.629,80	0,89%	143	0,25%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VIII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	01/01/2017	2.716.547,81	0,96%	49	0,41%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.578.475,83	1,26%	454	0,18%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "

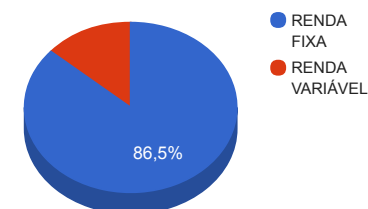
Carteira consolidada de investimentos - base (outubro / 2016)

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	3.983.498,71	1,40%	52	1,49%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	20.263.739,61	7,14%	399	0,31%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.499.380,35	0,53%	180	0,59%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.139.984,79	1,11%	792	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	1.500.362,46	0,53%	50	0,47%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	3 anos	1.244.908,00	0,44%	100	0,61%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	2.909.847,20	1,03%	235	12,03%	Artigo 8º, Inciso III
BB CIELO FI AÇÕES	D+4	Não há	1.940.979,11	0,68%	6.302	1,12%	Artigo 8º, Inciso III
BB PIPE FIC AÇÕES	D+4	03/06/2018	1.106.204,01	0,39%	48	1,13%	Artigo 8º, Inciso III
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	D+4	Não há	3.449.506,15	1,22%	8.841	1,89%	Artigo 8º, Inciso III
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	1.476.982,76	0,52%	3.785	1,18%	Artigo 8º, Inciso III
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	2.700.866,69	0,95%	27	5,73%	Artigo 8º, Inciso III
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	D+4	Não há	4.194.093,05	1,48%	3.707	7,35%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	1.672.399,09	0,59%	140	1,01%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	D+12	Não há	1.802.659,11	0,64%	392	2,26%	Artigo 8º, Inciso III
XP INVESTOR FI AÇÕES	D+4	Não há	2.189.872,80	0,77%	3.976	0,84%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.501.323,85	0,88%	3.045	0,86%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	8.531.536,94	3,01%	249	6,55%	Artigo 8º, Inciso IV
CAIXA BRASIL IPCA VIII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+0	06/12/2016	1.871.404,00	0,66%	21	2,00%	Artigo 8º, Inciso IV
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	D+5	Não há	2.076.773,90	0,73%	30	1,06%	Artigo 8º, Inciso IV
		TOTAL -	283.734.404,12				

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

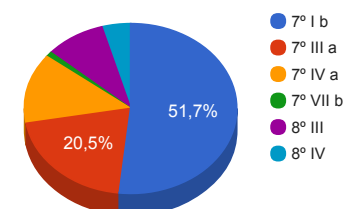
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	10,00%	0,00	0,00%	28.373.440,41
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	75,00%	146.723.495,58	51,71%	66.077.307,51
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	50,00%	58.123.932,52	20,49%	83.743.269,54
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	37.717.256,90	13,29%	47.403.064,34
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	14.186.720,21
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	14.186.720,21
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	2.745.270,46	0,97%	11.441.449,75
Total Renda Fixa	100,00%	180,00	245.309.955,46	86,46%	

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%	14.186.720,21
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	25.944.733,82	9,14%	16.615.426,80
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	12.479.714,84	4,40%	1.707.005,37
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	14.186.720,21
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	14.186.720,21
Total Renda Variável	30,00%	35,00	38.424.448,66	13,54%	

Distribuição por Artigo / Resolução



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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IRF-M 1+	1,35%	26,92%	4,61%	8,81%	28,19%	32,15%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,44%	26,97%	4,72%	8,92%	28,31%	32,06%	0,20%	1,608%	5,31%
IRF-M	1,22%	20,75%	4,21%	8,12%	22,56%	30,78%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,23%	20,68%	4,23%	8,08%	22,44%	30,20%	0,20%	1,178%	3,30%
IDKA IPCA 20 Anos	1,09%	50,46%	3,63%	12,63%	50,76%	41,08%	-	-	-
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,95%	36,59%	3,25%	10,55%	38,13%	37,90%	0,20%	4,512%	13,74%
Selic	1,05%	11,59%	3,41%	6,95%	14,08%	28,69%	-	-	-
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,17%	11,74%	3,53%	7,13%	14,23%	28,98%	0,20%	0,040%	0,04%
CDI	1,05%	11,58%	3,41%	6,94%	14,06%	28,63%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,07%	11,43%	3,48%	6,97%	13,94%	28,77%	0,20%	0,013%	0,17%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,04%	11,65%	3,37%	6,84%	14,05%	28,15%	0,20%	0,016%	0,12%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VIII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,01%	13,02%	3,35%	6,56%	15,35%	25,27%	0,20%	0,047%	0,89%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,98%	10,80%	3,19%	6,49%	13,11%	26,50%	0,80%	0,003%	0,00%
IRF-M 1	0,94%	12,18%	3,36%	6,69%	14,72%	28,94%	-	-	-
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	1,00%	11,84%	3,41%	6,82%	14,42%	29,06%	0,50%	0,224%	0,39%
BRADERCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,96%	12,09%	3,34%	6,61%	14,54%	28,54%	0,20%	0,182%	0,38%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,94%	12,02%	3,30%	6,54%	14,50%	28,20%	0,10%	0,177%	0,35%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA Geral	0,90%	18,76%	3,50%	7,58%	21,23%	31,01%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,99%	18,63%	3,64%	7,60%	21,07%	30,17%	0,20%	1,147%	3,38%
IMA-B 5+	0,73%	28,98%	3,30%	8,70%	32,20%	35,92%	-	-	-
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	0,71%	28,46%	3,28%	8,66%	31,42%	34,49%	0,20%	3,161%	9,85%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,70%	28,53%	3,22%	8,54%	31,37%	34,60%	0,20%	3,091%	9,77%
IPCA + 6,00% ao ano	0,72%	11,02%	2,28%	5,53%	14,32%	33,15%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,61%	11,76%	2,60%	5,99%	15,12%	34,14%	0,20%	0,159%	0,37%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,43%	20,12%	3,11%	6,47%	24,43%	31,69%	0,15%	1,757%	6,56%
IMA-B	0,64%	22,78%	3,13%	7,65%	25,94%	33,95%	-	-	-
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	0,86%	22,13%	3,32%	7,66%	25,74%	34,63%	0,15%	2,357%	7,14%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	0,84%	22,16%	3,35%	7,86%	25,16%	33,00%	0,20%	2,261%	6,22%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	0,63%	20,72%	3,01%	7,30%	23,86%	34,31%	0,45%	2,314%	6,23%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	0,63%	22,50%	3,06%	7,44%	25,54%	32,83%	0,20%	2,263%	6,81%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,26%	14,58%	0,02%	3,56%	18,92%	-	0,20%	2,026%	8,32%
IMA-B 5	0,46%	13,44%	2,99%	6,05%	16,48%	32,40%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,46%	13,20%	2,95%	5,95%	16,15%	31,42%	0,20%	0,735%	2,53%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	0,44%	13,25%	2,95%	5,94%	16,24%	31,87%	0,10%	0,738%	2,51%
IDKA IPCA 2 Anos	0,41%	13,11%	3,23%	5,80%	15,48%	32,92%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,43%	12,90%	3,00%	5,89%	15,70%	31,80%	0,20%	0,673%	2,42%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,42%	12,87%	3,08%	5,81%	15,63%	31,54%	0,20%	0,673%	2,49%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,41%	11,24%	2,45%	6,34%	14,15%	-	0,20%	0,695%	1,05%
IPCA	0,26%	5,78%	0,78%	2,45%	7,87%	18,59%	-	-	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,54%	17,67%	3,79%	6,87%	21,76%	33,06%	0,20%	1,153%	4,66%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,17%	14,62%	2,92%	5,99%	17,34%	-	0,20%	0,804%	2,89%

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

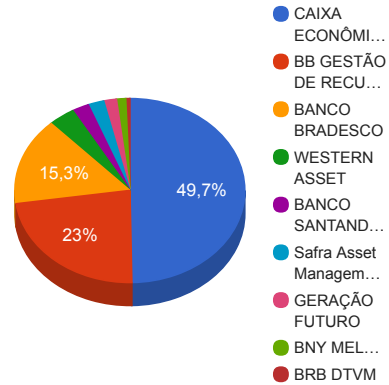
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDIV	14,87%	65,58%	16,71%	24,88%	47,26%	4,03%	-	-	-
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	10,46%	8,09%	13,30%	18,04%	7,86%	0,72%	3,00%	5,554%	21,57%
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	8,40%	52,43%	8,95%	23,33%	55,53%	39,97%	3,00%	3,833%	19,17%
IFNC	14,10%	62,06%	14,60%	21,37%	57,22%	35,86%	-	-	-
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	13,84%	60,96%	14,42%	21,29%	56,35%	33,42%	1,00%	8,087%	31,28%
Ibovespa	11,23%	49,77%	13,29%	20,43%	41,55%	18,85%	-	-	-
GERAÇÃO FI AÇÕES	12,05%	10,80%	14,16%	20,96%	12,52%	6,82%	3,00%	5,912%	21,39%
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	11,10%	37,31%	12,09%	21,13%	32,26%	23,67%	1,00%	5,442%	21,35%
XP INVESTOR FI AÇÕES	10,58%	62,71%	12,51%	31,47%	65,02%	48,34%	2,00%	4,521%	20,24%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	10,36%	15,76%	14,62%	24,57%	18,86%	11,32%	2,00%	6,164%	20,61%
BB PIPE FIC AÇÕES	6,05%	33,94%	1,24%	15,76%	28,84%	24,82%	1,20%	4,971%	15,03%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	5,77%	46,96%	3,24%	22,17%	38,14%	0,87%	2,00%	5,388%	22,14%
BBSEGURIDADE ON NM - BBSE3	7,56%	40,47%	9,61%	10,12%	28,48%	9,29%	-	-	-
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	7,43%	38,31%	9,30%	9,37%	26,23%	5,69%	1,5%	9,116%	41,75%
CDI	1,05%	11,58%	3,41%	6,94%	14,06%	28,63%	-	-	-
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	2,42%	14,67%	4,86%	8,92%	17,54%	39,96%	2,00%	0,740%	1,88%
IPCA + 6,00% ao ano	0,72%	11,02%	2,28%	5,53%	14,32%	33,15%	-	-	-

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

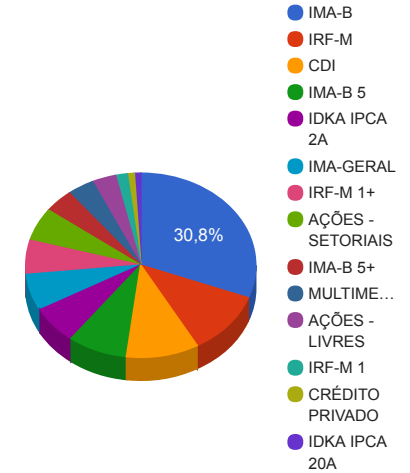
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL IPCA VIII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	0,47%	11,98%	2,50%	5,87%	15,26%	33,46%	0,15%	0,178%	0,42%
S&P 500	-1,94%	4,02%	-2,18%	2,95%	2,25%	5,36%	-	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	-0,80%	13,89%	1,10%	9,92%	15,81%	33,97%	1,00%	3,012%	14,02%
CIELO ON NM - CIEL3	-0,34%	17,71%	-11,11%	-2,48%	8,00%	18,82%	-	-	-
BB CIELO FI AÇÕES	-0,40%	15,79%	-11,29%	-3,27%	5,98%	14,91%	1,50%	11,120%	32,28%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	141.117.512,07	49,74%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	65.126.418,20	22,95%
BANCO BRADESCO	43.381.849,81	15,29%
WESTERN ASSET	10.608.310,84	3,74%
BANCO SANTANDER	6.723.174,59	2,37%
Safra Asset Management	6.348.389,89	2,24%
GERAÇÃO FUTURO	5.089.494,07	1,79%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	3.666.855,56	1,29%
BRB DTVM	1.672.399,09	0,59%



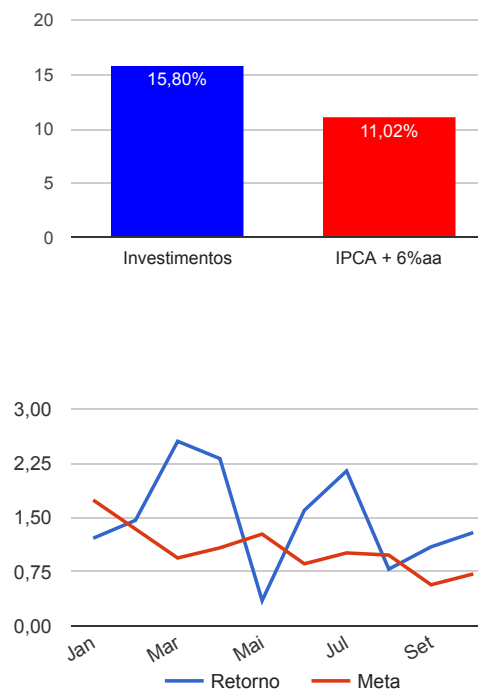
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	86.760.757,45	30,58%
IRF-M	31.235.911,58	11,01%
CDI	28.481.580,58	10,04%
IMA-B 5	23.588.518,38	8,31%
IDKA IPCA 2A	18.626.527,32	6,56%
IMA-GERAL	18.126.507,07	6,39%
IRF-M 1+	16.842.596,62	5,94%
AÇÕES - SETORIAIS	16.472.732,12	5,81%
IMA-B 5+	11.669.804,82	4,11%
MULTIMERCADO	10.608.310,84	3,74%
AÇÕES - LIVRES	9.472.001,70	3,34%
IRF-M 1	4.678.062,79	1,65%
CRÉDITO PRIVADO	2.745.270,46	0,97%
IDKA IPCA 20A	2.554.418,39	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%
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%
Outubro	279.465.140,67	55.467.324,82	54.814.015,01	283.734.404,12	3.615.953,64	1,29%	0,72%	178,12%	1,95%
Acumulado no ano					38.448.767,55	15,80%	11,02%	143,39%	

Acumulado no Ano



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de outubro / 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	16.603.492,11	0,00	0,00	16.842.596,62	239.104,51	1,44%	1,61%	1,44%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	28.173.182,70	0,00	0,00	28.519.363,77	346.181,07	1,23%	1,18%	1,23%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	20.028.696,47	0,00	0,00	20.263.739,61	235.043,14	1,17%	0,04%	1,17%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.106.826,63	0,00	0,00	3.139.984,79	33.158,16	1,07%	0,01%	1,07%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3.541.591,30	0,00	0,00	3.578.475,83	36.884,53	1,04%	0,02%	1,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VIII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.689.478,33	0,00	0,00	2.716.547,81	27.069,48	1,01%	0,05%	1,01%
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	2.496.882,21	0,00	0,00	2.521.866,16	24.983,95	1,00%	0,22%	1,00%
BB IDKA 20 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.530.495,52	0,00	0,00	2.554.418,39	23.922,87	0,95%	4,51%	0,95%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	798.737,67	0,00	0,00	806.268,44	7.530,77	0,94%	0,18%	0,94%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	778.794,06	0,00	0,00	785.511,11	6.717,05	0,86%	2,36%	0,86%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	544.699,34	0,00	0,00	548.575,99	3.876,65	0,71%	3,16%	0,71%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	9.285.614,58	0,00	8.000.000,00	1.349.928,19	64.313,61	0,69%	0,18%	0,96%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	3.802.384,82	0,00	0,00	3.826.523,73	24.138,91	0,63%	2,31%	0,63%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.520.265,99	0,00	0,00	2.535.629,80	15.363,81	0,61%	0,16%	0,61%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1.492.312,42	0,00	0,00	1.500.362,46	8.050,04	0,54%	1,15%	0,54%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	29.723.867,48	0,00	13.000.000,00	16.865.343,79	141.476,31	0,48%	0,74%	0,46%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	6.693.787,32	0,00	0,00	6.723.174,59	29.387,27	0,44%	0,74%	0,44%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.966.374,67	0,00	0,00	3.983.498,71	17.124,04	0,43%	1,76%	0,43%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.937.205,67	0,00	0,00	1.945.280,02	8.074,35	0,42%	0,67%	0,42%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	39.983.225,81	0,00	27.500.000,00	12.647.832,30	164.606,49	0,41%	0,67%	0,43%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.017.012,89	0,00	0,00	4.033.415,00	16.402,11	0,41%	0,70%	0,41%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	9.061.305,64	9.000.000,00	0,00	18.126.507,07	65.201,43	0,36%	1,15%	0,99%

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	704.580,25	0,00	0,00	706.425,90	1.845,65	0,26%	2,03%	0,26%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.242.748,00	0,00	0,00	1.244.908,00	2.160,00	0,17%	0,80%	0,17%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	32.024.970,54	21.596.982,48	0,00	53.703.562,18	81.609,16	0,15%	2,26%	0,84%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	934.973,32	6.870.342,34	6.314.015,01	1.499.380,35	8.079,70	0,10%	0,00%	0,98%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	13.220.486,48	8.000.000,00	0,00	21.219.606,02	-880,46	0,00%	2,26%	0,63%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.268.126,59	10.000.000,00	0,00	11.121.228,83	-146.897,76	-1,30%	3,09%	0,70%
Total Renda Fixa					1.484.526,84	0,61%	1,44%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB SETOR FINANCEIRO FIC AÇÕES	3.684.100,25	0,00	0,00	4.194.093,05	509.992,80	13,84%	8,09%	13,84%
GERAÇÃO FI AÇÕES	1.492.539,45	0,00	0,00	1.672.399,09	179.859,64	12,05%	5,91%	12,05%
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	2.430.957,09	0,00	0,00	2.700.866,69	269.909,60	11,10%	5,44%	11,10%
XP INVESTOR FI AÇÕES	1.980.409,37	0,00	0,00	2.189.872,80	209.463,43	10,58%	4,52%	10,58%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.264.448,73	0,00	0,00	2.501.323,85	236.875,12	10,46%	5,55%	10,46%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	1.633.366,06	0,00	0,00	1.802.659,11	169.293,05	10,36%	6,16%	10,36%
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.362.525,87	0,00	0,00	1.476.982,76	114.456,89	8,40%	3,83%	8,40%
BB AÇÕES BB SEGURIDADE FI AÇÕES	3.210.800,34	0,00	0,00	3.449.506,15	238.705,81	7,43%	9,12%	7,43%
BB PIPE FIC AÇÕES	1.043.119,99	0,00	0,00	1.106.204,01	63.084,02	6,05%	4,97%	6,05%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	2.751.053,66	0,00	0,00	2.909.847,20	158.793,54	5,77%	5,39%	5,77%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	2.027.695,87	0,00	0,00	2.076.773,90	49.078,03	2,42%	0,74%	2,42%
CAIXA BRASIL IPCA VIII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.862.626,00	0,00	0,00	1.871.404,00	8.778,00	0,47%	0,18%	0,47%
BB CIELO FI AÇÕES	1.948.833,99	0,00	0,00	1.940.979,11	-7.854,88	-0,40%	11,12%	-0,40%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	8.600.545,19	0,00	0,00	8.531.536,94	-69.008,25	-0,80%	3,01%	-0,80%
Total Renda Variável					2.131.426,80	5,87%	5,23%	