



Relatório Analítico dos Investimentos em dezembro, 4º Trimestre e ano de 2016

SIRU 

Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

Carteira consolidada de investimentos - base (dezembro / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	31.046.008,31	7,11%	223	1,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	24.050.538,82	5,51%	200	3,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	52.105.479,75	11,94%	713	0,96%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	37.188.757,46	8,52%	603	0,74%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	608.919,08	0,14%	193	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	40.384.116,11	9,25%	598	1,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	10.062.887,78	2,30%	14	7,55%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	5.662.484,12	1,30%	94	1,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	19.867.576,30	4,55%	365	1,49%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	16.885.179,02	3,87%	731	0,31%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	50.481.923,74	11,56%	88	3,97%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	42.816.814,34	9,81%	787	0,81%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	69.812.218,17	15,99%	411	0,95%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	88.067,22	0,02%	46	0,37%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	Não se aplica	Não se aplica	23.502,81	0,01%	1	0,83%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	D+12	Não há	3.215.466,39	0,74%	384	4,27%	Artigo 8º, Inciso III
SANTANDER SELEÇÃO MAX FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.784.258,49	0,41%	8.683	12,60%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	13.087.458,15	3,00%	2.948	4,96%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	D+5	Não há	6.910.572,25	1,58%	33	2,71%	Artigo 8º, Inciso IV
ÁTICO GERAÇÃO DE ENERGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	3.708.194,10	0,85%	33	1,09%	Artigo 8º, Inciso V
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	Não se aplica	Não se aplica	3.360.165,48	0,77%	115	0,61%	Artigo 8º, Inciso V
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	S/Info	Não se aplica	2.042.301,77	0,47%		13,11%	Artigo 8º, Inciso VI

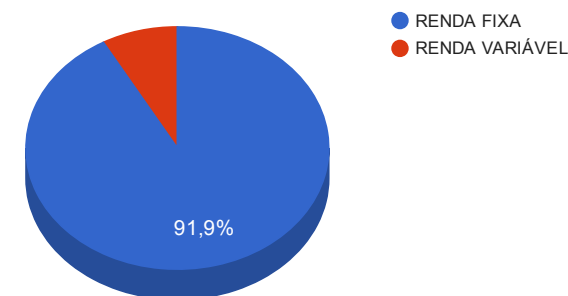
Carteira consolidada de investimentos - base (dezembro / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se aplica	Não se aplica	1.383.337,92	0,32%		3,26%	Artigo 8º, Inciso VI
		TOTAL -	436.576.227,58				

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

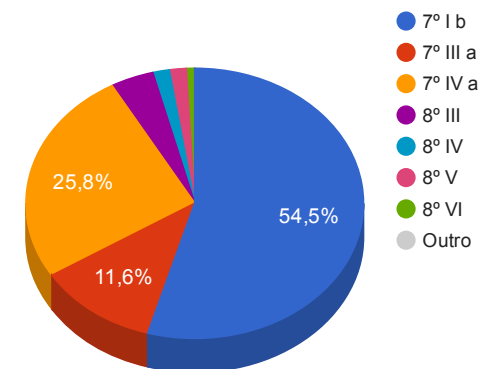
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	100,00%	237.861.946,75	54,48%	198.714.280,83
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	80,00%	50.481.923,74	11,56%	298.779.058,32
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	112.629.032,51	25,80%	18.343.835,76
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	111.570,03	0,03%	21.717.241,35
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	100,00%	0,00	0,00%	436.576.227,58
Artigo 7º, Inciso II	15,00%	15,00%	0,00	0,00%	65.486.434,14
Artigo 7º, Inciso V, Alínea " a "	20,00%	20,00%	0,00	0,00%	87.315.245,52
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	21.828.811,38
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	21.828.811,38
Total Renda Fixa	100,00%	360,00	401.084.473,03	91,87%	

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	18.087.183,03	4,14%	47.399.251,11
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	6.910.572,25	1,58%	14.918.239,13
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	7.068.359,58	1,62%	14.760.451,80
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	3.425.639,69	0,78%	18.403.171,69
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	30,00%	0,00	0,00%	130.972.868,27
Artigo 8º, Inciso II	20,00%	20,00%	0,00	0,00%	87.315.245,52
Total Renda Variável	30,00%	80,00	35.491.754,55	8,13%	

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%	-	-	-
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%	-	-	-
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	3,00%	24,64%	2,42%	7,69%	24,64%	35,41%	0,20%	3,678%	7,48%
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%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,72%	20,93%	2,04%	6,76%	20,93%	-	0,20%	2,586%	6,11%
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%
IRF-M	1,84%	23,37%	3,41%	7,88%	23,37%	32,16%	-	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,81%	23,21%	3,35%	7,81%	23,21%	31,53%	0,20%	1,844%	3,61%
CDI + 3,50% ao ano	1,43%	17,97%	4,12%	8,69%	17,97%	38,23%	-	-	-
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-2,33%	-73,59%	-71,85%	-72,01%	-73,59%	-64,62%	0,39%	1,145%	69,46%
IMA-B 5	1,39%	15,48%	2,27%	6,11%	15,48%	33,33%	-	-	-
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	1,73%	18,27%	1,97%	6,21%	18,27%	34,03%	0,40%	1,633%	3,81%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	1,38%	15,27%	2,22%	6,01%	15,27%	32,83%	0,10%	1,325%	2,61%
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%

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
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,12%	13,26%	2,23%	5,49%	13,26%	-	0,20%	0,771%	1,21%
110% do CDI	1,23%	15,50%	3,57%	7,53%	15,50%	32,43%	-	-	-
TRENBANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	-3,64%	-19,01%	-8,37%	-3,35%	-19,01%	-29,00%	0,00%	-	-
Selic	1,12%	14,02%	3,24%	6,83%	14,02%	29,15%	-	-	-
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1,12%	14,25%	3,45%	7,06%	14,25%	29,51%	0,20%	0,006%	0,05%
CDI	1,12%	14,00%	3,24%	6,82%	14,00%	29,09%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,13%	13,88%	3,28%	6,94%	13,88%	29,21%	0,20%	0,009%	0,17%

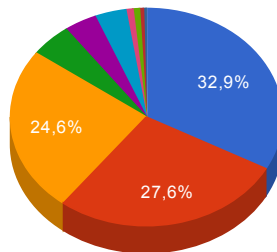
Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (dezembro / 2016)

	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%	-	-	-
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	0,00%	-	0,00%	0,00%	-	-	0,14%	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	0,00%	-	-32,65%	-32,65%	-	-70,90%	1,50%	-	32,72%
CDI	1,12%	14,00%	3,24%	6,82%	14,00%	29,09%	-	-	-
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	1,39%	17,48%	4,94%	9,52%	17,48%	-	2,00%	0,617%	1,88%
IPCA	0,30%	6,29%	0,74%	1,79%	6,29%	17,63%	-	-	-
ÁTICO GERAÇÃO DE ENERGIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,50%	0,001%	0,01%
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	-	-	-	-	-	-	1,00%	0,137%	2,04%
IBX-50	-2,80%	36,82%	2,88%	16,20%	36,82%	18,91%	-	-	-
SANTANDER SELEÇÃO MAX FIC AÇÕES	-1,11%	27,53%	0,54%	12,74%	27,53%	17,98%	0,50%	9,641%	21,98%
Ibovespa	-2,71%	38,94%	3,19%	16,89%	38,94%	20,44%	-	-	-
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	5,13%	8,56%	3,50%	19,33%	8,56%	6,91%	2,00%	10,213%	22,67%
IDIV	-0,88%	60,49%	11,34%	27,50%	60,49%	16,45%	-	-	-
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	2,22%	-1,64%	0,52%	12,40%	-1,64%	-2,85%	3,00%	9,609%	23,20%

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

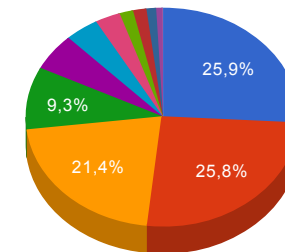
Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	143.546.270,13	32,88%
BANCO BRADESCO	120.294.141,91	27,55%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	107.202.026,88	24,56%
BANCO SANTANDER	21.651.834,79	4,96%
Western Asset	16.973.460,03	3,89%
GERAÇÃO FUTURO	16.302.924,54	3,73%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	3.708.194,10	0,85%
PÁTRIA INVESTIMENTOS	3.360.165,48	0,77%
PLANNER CORRETORA	2.042.301,77	0,47%
Foco DTVM	1.383.337,92	0,32%
BRL Trust Investimentos	88.067,22	0,02%
GRADUAL INVESTIMENTOS	23.502,81	0,01%

- BB GESTÃO DE RECURSO...
- BANCO BRADESCO
- CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
- BANCO SANTANDER
- Western Asset
- GERAÇÃO FUTURO
- BNY MELLON S...
- PÁTRIA INVESTIM...
- PLANNER CORRETORA
- Foco DTVM
- Outro



Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5	113.081.952,14	25,90%
CDI	112.629.032,51	25,80%
IMA-B	93.333.165,32	21,38%
IRF-M	40.384.116,11	9,25%
IMA-B 5+	24.050.538,82	5,51%
IDKA IPCA 2A	17.494.098,10	4,01%
AÇÕES - SETORIAIS	13.087.458,15	3,00%
FIP	7.068.359,58	1,62%
MULTIMERCADO	6.910.572,25	1,58%
AÇÕES - LIVRES	4.999.724,88	1,15%
FUNDO IMOBILIÁRIO	3.425.639,69	0,78%
FIDC - FECHADO	111.570,03	0,03%

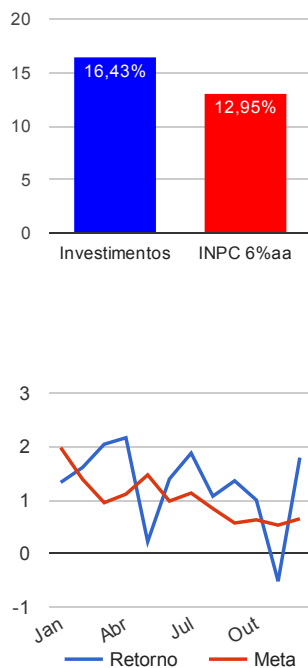
- IMA-B 5
- CDI
- IMA-B
- IRF-M
- IMA-B 5+
- IDKA IPCA 2A
- AÇÕES - SETORIAIS
- FIP
- MULTIMER...
- AÇÕES - LIVRES
- FUNDO IMOBILIÁRIO
- Outro



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	345.968.360,78	32.874.880,74	30.402.957,08	353.072.575,17	4.632.290,73	1,33%	1,98%	67,13%	2,05%
Fevereiro	353.072.575,17	10.515.241,14	8.100.381,38	361.198.980,18	5.711.545,25	1,61%	1,39%	115,22%	2,06%
Março	361.198.980,18	15.087.777,04	13.018.190,41	370.690.669,96	7.422.103,15	2,04%	0,95%	214,56%	3,56%
Abril	370.690.669,96	14.698.959,52	10.767.809,53	382.730.376,45	8.108.556,50	2,16%	1,11%	195,62%	2,21%
Mai	382.730.376,45	11.546.574,12	9.199.945,46	385.930.470,76	853.465,65	0,22%	1,47%	15,06%	1,94%
Junho	385.930.470,76	7.068.487,38	4.727.636,51	393.682.147,84	5.410.826,21	1,39%	0,98%	141,85%	1,67%
Julho	393.682.147,84	18.805.040,07	16.389.196,74	403.531.491,36	7.433.500,19	1,88%	1,13%	166,10%	1,19%
Agosto	403.531.491,36	70.837.325,31	68.508.765,01	410.208.035,17	4.347.983,51	1,07%	0,84%	126,80%	1,55%
Setembro	410.208.035,17	7.093.717,13	4.846.162,80	418.061.714,86	5.606.125,36	1,36%	0,57%	239,66%	1,47%
Outubro	418.061.714,86	62.827.603,63	60.580.571,01	424.507.786,06	4.199.038,58	1,00%	0,63%	157,50%	1,43%
Novembro	424.507.786,06	7.090.645,20	8.993.213,94	420.403.543,63	-2.201.673,69	-0,52%	0,53%	-97,15%	3,03%
Dezembro	420.403.543,63	69.609.574,52	61.123.964,32	436.576.227,58	7.687.073,75	1,79%	0,65%	275,44%	1,99%
Acumulado no ano					59.210.835,19	16,43%	12,95%	126,86%	

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(%)
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	25.027.020,01	157.654,85	2.000.000,00	24.050.538,82	865.863,96	3,44%	4,85%	3,70%
BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	49.009.961,31	0,00	0,00	50.481.923,74	1.471.962,43	3,00%	3,68%	3,00%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	36.144.086,87	0,00	0,00	37.188.757,46	1.044.670,59	2,89%	3,58%	2,89%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	39.667.214,44	0,00	0,00	40.384.116,11	716.901,67	1,81%	1,84%	1,81%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	9.891.609,20	0,00	0,00	10.062.887,78	171.278,58	1,73%	1,63%	1,73%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.566.560,72	0,00	0,00	5.662.484,12	95.923,40	1,72%	2,59%	1,72%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	90.167,21	0,00	3.575,64	88.067,22	1.475,65	1,64%	1,15%	1,71%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	51.397.092,88	0,00	0,00	52.105.479,75	708.386,87	1,38%	1,32%	1,38%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	16.676.828,65	0,00	0,00	16.885.179,02	208.350,37	1,25%	1,06%	1,25%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	30.700.311,80	0,00	0,00	31.046.008,31	345.696,51	1,13%	0,78%	1,13%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	602.159,97	0,00	0,00	608.919,08	6.759,11	1,12%	0,77%	1,12%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	47.421.744,71	4.072,44	5.120.388,68	42.816.814,34	511.385,87	1,08%	0,01%	1,13%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	73.248.867,66	0,00	54.000.000,00	19.867.576,30	618.708,64	0,84%	1,33%	1,38%
BRASESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,00	69.447.847,23	0,00	69.812.218,17	364.370,94	0,52%	0,01%	1,12%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	24.389,54	0,00	0,00	23.502,81	-886,73	-3,64%	-	-
Total Renda Fixa					7.130.847,86	1,81%	1,70%	

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(%)
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	3.058.675,60	0,00	0,00	3.215.466,39	156.790,79	5,13%	10,21%	5,13%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	12.803.394,25	0,00	0,00	13.087.458,15	284.063,90	2,22%	9,61%	2,22%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	1.999.653,14	0,00	0,00	2.042.301,77	42.648,63	2,13%	-	0,00%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	6.815.554,40	0,00	0,00	6.910.572,25	95.017,85	1,39%	0,62%	1,39%
ÁQUILLA FII - AQLL11	1.377.646,60	0,00	0,00	1.383.337,92	5.691,32	0,41%	-	0,00%
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	3.363.084,43	0,00	0,00	3.360.165,48	-2.918,95	-0,09%	0,14%	-0,09%
ÁTICO GERAÇÃO DE ENERGIA FIP	3.713.225,76	0,00	0,00	3.708.194,10	-5.031,66	-0,14%	0,00%	-0,14%
SANTANDER SELEÇÃO MAX FIC AÇÕES	1.804.294,48	0,00	0,00	1.784.258,49	-20.035,99	-1,11%	9,64%	-1,11%
Total Renda Variável					556.225,89	1,59%	5,63%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre / 2016

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	53.071.871,50	32.095.626,44	43.984.438,00	42.816.814,34	1.633.754,40	2,82%	3,28%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	72.645.467,12	0,00	54.000.000,00	19.867.576,30	1.222.109,18	1,68%	2,22%
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	49.291.115,72	0,00	0,00	50.481.923,74	1.190.808,02	2,42%	2,42%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	50.971.349,74	0,00	0,00	52.105.479,75	1.134.130,01	2,23%	2,23%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.292.901,26	25.026.492,01	0,00	40.384.116,11	1.064.722,84	2,71%	3,35%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	36.377.433,99	0,00	0,00	37.188.757,46	811.323,47	2,23%	2,23%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	30.389.622,87	0,00	0,00	31.046.008,31	656.385,44	2,16%	2,16%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	16.519.192,13	0,00	0,00	16.885.179,02	365.986,89	2,22%	2,22%
BRANCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,00	69.447.847,23	0,00	69.812.218,17	364.370,94	0,52%	3,45%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	12.793.121,82	12.898.401,68	2.000.000,00	24.050.538,82	359.015,32	1,38%	2,29%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	9.868.822,67	0,00	0,00	10.062.887,78	194.065,11	1,97%	1,97%
SANTANDER FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	24.932.867,40	0,00	25.051.296,39	0,00	118.428,99	0,47%	3,28%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.549.147,22	0,00	0,00	5.662.484,12	113.336,90	2,04%	2,04%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	5.591.976,74	0,00	5.648.438,02	0,00	56.461,28	1,01%	2,48%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	595.654,55	0,00	0,00	608.919,08	13.264,53	2,23%	2,23%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	25.648,80	0,00	0,00	23.502,81	-2.145,99	-8,37%	-8,37%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	312.857,33	0,00	13.571,02	88.067,22	-211.219,09	-67,45%	-71,85%
Total Renda Fixa					9.084.798,24	2,33%	

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 (%)
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	6.585.455,53	0,00	0,00	6.910.572,25	325.116,72	4,94%	4,94%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	3.106.778,13	0,00	0,00	3.215.466,39	108.688,26	3,50%	3,50%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	13.019.206,10	0,00	0,00	13.087.458,15	68.252,05	0,52%	0,52%
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	3.237.589,49	59.455,99	0,00	3.360.165,48	63.120,00	1,91%	-
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	2.000.724,79	0,00	0,00	2.042.301,77	41.576,98	2,08%	0,00%
SANTANDER SELEÇÃO MAX FIC AÇÕES	1.774.589,29	0,00	0,00	1.784.258,49	9.669,20	0,54%	0,54%
CONQUEST FIP - FCCQ11	5,83	0,00	5,84	0,00	0,01	0,17%	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	1.385.960,38	0,00	0,00	1.383.337,92	2.622,46	0,19%	32,65%
ÁTICO GERAÇÃO DE ENERGIA FIP	3.722.354,46	0,00	0,00	3.708.194,10	-14.160,36	-0,38%	-
Total Renda Variável					599.640,40	1,72%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no Ano de 2016

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	62.133.218,52	0,00	73.911.552,22	0,00	11.778.333,70	22,77%	24,14%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	43.267.285,35	7.383.229,70	9.614.679,54	50.481.923,74	9.446.088,23	24,35%	24,64%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	62.621.525,04	19.618.424,56	71.500.000,00	19.867.576,30	9.127.626,70	14,30%	15,27%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	62.443.241,50	38.625.343,37	65.460.321,42	42.816.814,34	7.208.550,89	13,27%	13,88%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	51.464.042,64	391.762,02	6.750.000,00	52.105.479,75	6.999.675,09	15,03%	15,19%
SANTANDER FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,00	41.459.580,92	44.668.566,96	0,00	3.208.986,04	10,02%	14,10%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	10.861.136,38	15.056.778,05	4.808.713,76	24.050.538,82	2.941.338,15	29,03%	30,56%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	38.911.986,51	0,00	40.384.116,11	1.472.129,60	5,95%	23,21%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	15.587.069,81	0,00	16.885.179,02	1.298.109,21	9,10%	14,89%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	36.105.254,93	0,00	37.188.757,46	1.083.502,53	2,95%	24,52%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	30.000.000,00	0,00	31.046.008,31	1.046.008,31	3,49%	8,58%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.100.285,13	0,00	455.751,84	5.662.484,12	1.017.950,83	20,86%	20,93%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	0,00	9.299.404,80	0,00	10.062.887,78	763.482,98	9,12%	18,27%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.937.149,30	0,00	3.711.954,96	608.919,08	383.724,74	13,32%	13,26%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,00	69.447.847,23	0,00	69.812.218,17	364.370,94	0,52%	14,25%
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	4.914,41	0,00	192.382,82	0,00	187.468,41	3.814,67%	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	29.019,98	0,00	0,00	23.502,81	-5.517,17	-19,01%	-19,01%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	333.491,90	0,00	57.635,50	88.067,22	-187.789,18	-64,98%	-73,59%
Total Renda Fixa					58.134.040,00	17,91%	

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 (%)
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	0,00	5.925.823,63	0,00	6.910.572,25	984.748,62	16,62%	17,48%
SANTANDER SELEÇÃO MAX FIC AÇÕES	1.399.067,49	0,00	0,00	1.784.258,49	385.191,00	27,53%	27,53%
GERAÇÃO FUTURO SELEÇÃO FI AÇÕES	2.962.043,09	0,00	0,00	3.215.466,39	253.423,30	8,56%	8,56%
BRADESCO SMALL CAP PLUS FI AÇÕES	1.255.890,97	0,00	1.496.403,28	0,00	240.512,31	19,15%	24,76%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	1.887.450,10	0,00	0,00	2.042.301,77	154.851,67	8,20%	-
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	3.060.298,96	243.320,27	0,00	3.360.165,48	56.546,25	1,70%	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	1.363.606,58	0,00	0,00	1.383.337,92	19.731,34	1,45%	-
CONQUEST FIP - FCCQ11	4,68	0,00	5,84	0,00	1,16	24,79%	-
ÁTICO GERAÇÃO DE ENERGIA FIP	3.766.852,88	0,00	0,00	3.708.194,10	-58.658,78	-1,56%	-
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	6.135.790,92	0,00	5.925.823,63	0,00	-209.967,29	-3,42%	18,32%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	13.305.285,36	0,00	0,00	13.087.458,15	-217.827,21	-1,64%	-1,64%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	8.641.674,01	0,00	8.297.385,24	0,00	-344.288,77	-3,98%	18,27%
Total Renda Variável					1.264.263,60	4,50%	