

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 3.922/2010 - 4.392/2014
TÍTULOS PÚBLICOS			12.520.791,16	7,07%			Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	30.823.529,57	17,41%	731	0,57%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	12.574.403,63	7,10%	192	1,99%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	4.594.999,01	2,60%	1.340	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	4.961.589,25	2,80%	603	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	7.381.650,84	4,17%	713	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	63.667.192,54	35,96%	620	1,72%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	15.738.739,71	8,89%	326	0,69%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	5.517.154,85	3,12%	411	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	5.531.794,47	3,12%	787	0,10%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	2.975.567,63	1,68%	4.376	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	6.162,20	0,00%	190	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	84.380,77	0,05%	758	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 3	Não se aplica	Não se aplica	13.200,09	0,01%	5	0,99%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+30 a D+2880	Não há	1.541.013,27	0,87%	50	0,46%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BB RPPS IPCA II FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	Término do Fundo	Não há	931.425,75	0,53%	25	1,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IBX 50 FI AÇÕES	D+4	Não há	356.172,08	0,20%	82	0,47%	Artigo 8º, Inciso I
BRADESCO PLUS IBOVESPA FI AÇÕES	D+3	Não há	440.721,89	0,25%	30	1,51%	Artigo 8º, Inciso I
BRADESCO INFRA-ESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	224.885,39	0,13%	69	0,52%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	23/08/2017	912.246,60	0,52%	116	0,26%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	D+33	5 anos	214.115,94	0,12%	60	0,17%	Artigo 8º, Inciso III
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	197.491,35	0,11%	83	0,18%	Artigo 8º, Inciso III

Carteira consolidada de investimentos - base (dezembro / 2016)

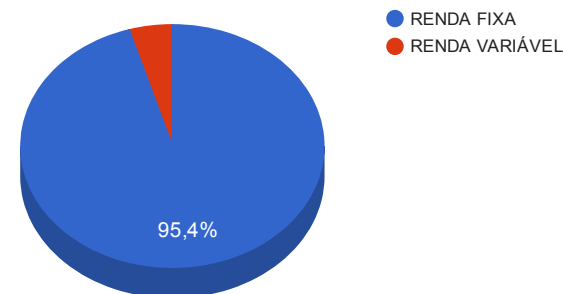
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
BRADESCO DIVIDENDOS FIAÇÕES	D+4	Não há	307.359,33	0,17%	353	0,08%	Artigo 8º, Inciso III
BRADESCO SMALL CAP PLUS FIAÇÕES	D+4	Não há	320.850,92	0,18%	70	0,31%	Artigo 8º, Inciso III
BRADESCO PLUS I FI MULTIMERCADO	D+0	Não há	1.294.798,58	0,73%	15	5,69%	Artigo 8º, Inciso IV
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	1.052.797,81	0,59%	19	1,31%	Artigo 8º, Inciso V
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se aplica	Não se aplica	1.020.000,00	0,58%		0,63%	Artigo 8º, Inciso VI
BB RENDA CORPORATIVA FII - BBRC11	s/info	Não se aplica	238.000,00	0,13%		0,13%	Artigo 8º, Inciso VI
CAIXA CEDAE FII - CXCE11B	S/Info	Não se aplica	1.145.000,00	0,65%		0,73%	Artigo 8º, Inciso VI
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	S/Info	Não se aplica	442.000,00	0,25%		0,37%	Artigo 8º, Inciso VI
		TOTAL -	177.030.034,63				

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

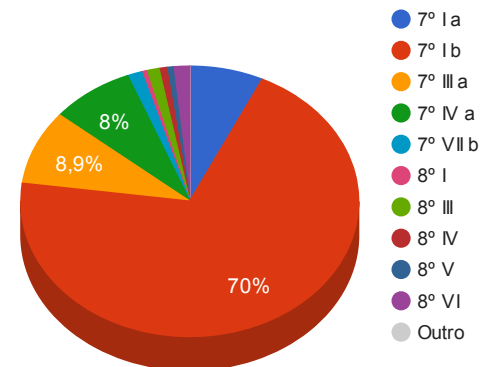
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	100,00%	12.520.791,16	7,07%	164.509.243,47
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	100,00%	124.003.364,84	70,05%	53.026.669,79
Artigo 7º, Inciso II	15,00%	15,00%	0,00	0,00%	26.554.505,19
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	80,00%	15.738.739,71	8,89%	125.885.287,99
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	14.115.059,92	7,97%	38.993.950,47
Artigo 7º, Inciso V, Alínea " a "	20,00%	20,00%	0,00	0,00%	35.406.006,93
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	15,00%	0,00	0,00%	26.554.505,19
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	13.200,09	0,01%	8.838.301,64
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	2.472.439,02	1,40%	6.379.062,71
Total Renda Fixa	100,00%	370,00	168.863.594,74	95,39%	

Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	30,00%	796.893,97	0,45%	52.312.116,42
Artigo 8º, Inciso II	20,00%	20,00%	0,00	0,00%	35.406.006,93
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	2.176.949,53	1,23%	24.377.555,66
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	1.294.798,58	0,73%	7.556.703,15
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	1.052.797,81	0,59%	7.798.703,92
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	2.845.000,00	1,61%	6.006.501,73
Total Renda Variável	30,00%	80,00	8.166.439,89	4,61%	

Distribuição por Segmento



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	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 NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	2,80%	24,14%	2,48%	7,53%	24,14%	34,80%	0,20%	3,446%	6,85%
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%
120% do CDI	1,35%	17,02%	3,90%	8,24%	17,02%	35,85%	-	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 3	-3,64%	-19,01%	-8,97%	-3,35%	-19,01%	-29,00%	0,00%	-	-
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%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,23%	14,94%	2,24%	6,02%	14,94%	32,76%	0,20%	1,023%	2,42%
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%
BRADESCO 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%
Selic	1,12%	14,02%	3,24%	6,83%	14,02%	29,15%	-	-	-
BRADESCO 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 Fixa e Benchmark's - base (dezembro / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,11%	14,06%	3,26%	6,84%	14,06%	29,36%	0,25%	0,016%	0,05%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,11%	14,00%	3,24%	6,81%	14,00%	29,18%	0,20%	0,016%	0,04%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	1,05%	13,05%	3,03%	6,38%	13,05%	26,96%	0,80%	0,001%	0,01%
IPCA + 6,00% ao ano	0,81%	12,64%	2,20%	4,83%	12,64%	32,08%	-	-	-
BB RPPS IPCA II FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,83%	13,52%	1,97%	5,60%	13,52%	33,04%	0,20%	0,158%	1,42%
IPCA	0,30%	6,29%	0,74%	1,79%	6,29%	17,63%	-	-	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1,64%	19,98%	2,51%	7,50%	19,98%	34,50%	0,20%	2,044%	4,70%

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 RENDA CORPORATIVA FII - BBRC11	4,67%	-	7,70%	25,26%	-	34,46%	0,60%	-	23,23%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	4,62%	27,50%	3,13%	9,67%	27,50%	22,89%	1,20%	-	23,63%
CAIXA CEDAE FII - CXCE11B	4,04%	30,11%	6,46%	14,50%	30,11%	33,14%	5,00%	-	28,19%
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	3,16%	9,06%	1,58%	8,33%	9,06%	-1,69%	0,00%	-	25,87%
CDI	1,12%	14,00%	3,24%	6,82%	14,00%	29,09%	-	-	-
BRADESCO PLUS I FI MULTIMERCADO	1,25%	14,37%	3,20%	6,89%	14,37%	28,54%	0,50%	0,312%	0,57%
IBX-50	-2,80%	36,82%	2,88%	16,20%	36,82%	18,91%	-	-	-
CAIXA BRASIL IBX 50 FIAÇÕES	-2,43%	22,39%	2,34%	13,57%	22,39%	3,44%	0,70%	10,587%	24,83%
Ibovespa	-2,71%	38,94%	3,19%	16,89%	38,94%	20,44%	-	-	-
BRADESCO INFRA-ESTRUTURA FIAÇÕES	1,17%	30,29%	0,25%	12,44%	30,29%	4,89%	1,00%	9,112%	21,02%
BRADESCO PLUS IBOVESPA FIAÇÕES	-2,66%	39,22%	3,21%	16,83%	39,22%	21,14%	0,50%	10,967%	26,56%
IGC	-1,39%	28,91%	0,94%	11,74%	28,91%	13,48%	-	-	-
BB GOVERNANÇA FIAÇÕES 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%	-	-	-
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIAÇÕES	-0,53%	12,37%	-0,47%	5,55%	12,37%	8,75%	1,72%	7,338%	16,38%
BRADESCO DIVIDENDOS FIAÇÕES	-1,15%	32,46%	4,28%	13,67%	32,46%	17,57%	1,50%	10,337%	22,88%

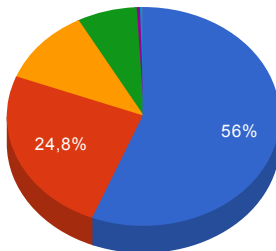
Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (dezembro / 2016)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Não Possui	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,50%	0,018%	26,62%
SMLL	-	-	-	-	-	-	-	-	-
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%
BRADESCO SMALL CAP PLUS FIC AÇÕES	-1,07%	24,76%	-0,73%	10,48%	24,76%	12,46%	1,50%	9,508%	18,89%

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

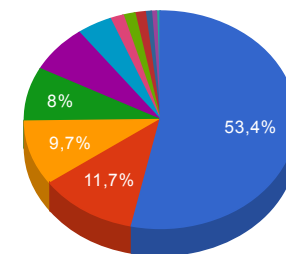
Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	99.149.025,13	56,01%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	43.986.843,66	24,85%
BANCO BRADESCO	19.827.078,95	11,20%
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBLICOS)	12.520.791,16	7,07%
VOTORANTIM ASSET MANAGEMENT	680.000,00	0,38%
BEM DTVM	532.244,72	0,30%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	320.850,92	0,18%
GRADUAL INVESTIMENTOS	13.200,09	0,01%

- CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
- BB GESTÃO DE RECURSO...
- BANCO BRADESCO
- TESOURO NACIONAL...
- VOTORAN...
- BEM DTVM
- BRADESCO ASSET MA...
- Outro



Sub-segmento	Valor	%
IDKA IPCA 2A	94.490.722,11	53,38%
IMA-B	20.700.328,96	11,69%
IRF-M 1	17.169.402,64	9,70%
CDI	14.115.059,92	7,97%
TÍTULOS PÚBLICOS	12.520.791,16	7,07%
IMA-B 5	7.381.650,84	4,17%
FUNDO IMOBILIÁRIO	2.845.000,00	1,61%
CRÉDITO PRIVADO	2.472.439,02	1,40%
AÇÕES - SETORIAIS	2.176.949,53	1,23%
MULTIMERCADO	1.294.798,58	0,73%
FIP	1.052.797,81	0,59%
AÇÕES - INDEXADO	796.893,97	0,45%
FIDC - FECHADO	13.200,09	0,01%

- IDKA IPCA 2A
- IMA-B
- IRF-M 1
- CDI
- TÍTULOS PÚBLICOS
- IMA-B 5
- FUNDO IMOBILIÁRIO
- CRÉDITO PRIVADO
- AÇÕES - SETORIAIS
- MULTIMER...
- FIP
- AÇÕES - INDEXADO
- Outro



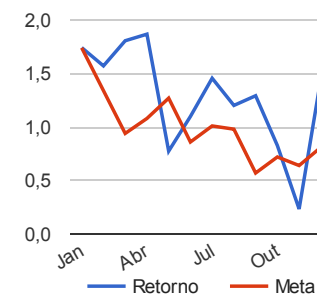
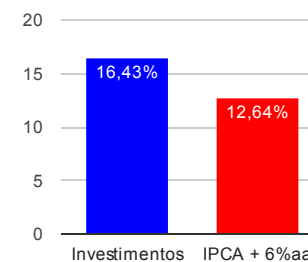
Carteira de Títulos Públicos - base (dezembro / 2016)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde.	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	GAP (Atual - Pago)
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	30/06/2004	4115	1.458,08019441	3.042,719603	6.000.000,00	12.520.791,17	6.520.791,17

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	146.297.718,11	11.025.800,25	7.520.452,62	152.413.023,46	2.609.957,72	1,74%	1,74%	100,16%	1,58%
Fevereiro	152.413.023,46	6.676.948,66	5.683.414,85	155.817.292,24	2.410.734,97	1,57%	1,34%	116,90%	1,20%
Março	155.817.292,24	12.704.393,23	10.948.281,47	160.419.988,84	2.846.584,84	1,81%	0,94%	191,74%	1,81%
Abril	160.419.988,84	8.080.829,62	5.955.829,87	165.581.338,10	3.036.349,51	1,87%	1,08%	173,55%	1,24%
Mai	165.581.338,10	7.688.701,32	6.409.267,79	168.153.443,52	1.292.671,89	0,77%	1,27%	60,97%	1,28%
Junho	168.153.443,52	7.472.353,36	6.060.675,88	171.428.226,04	1.863.105,04	1,10%	0,86%	127,50%	1,02%
Julho	171.428.226,04	9.069.857,80	8.642.906,80	174.357.529,33	2.502.352,29	1,46%	1,01%	144,27%	0,89%
Agosto	174.357.529,33	11.630.381,86	12.561.672,01	175.521.798,44	2.095.559,26	1,20%	0,98%	123,20%	0,79%
Setembro	175.521.798,44	3.298.386,02	4.172.640,77	176.916.005,63	2.268.461,94	1,29%	0,57%	227,88%	0,80%
Outubro	176.916.005,63	5.126.398,56	6.085.301,54	177.419.789,95	1.462.687,30	0,83%	0,72%	114,08%	1,03%
Novembro	177.419.789,95	5.479.413,04	6.512.832,30	176.800.632,52	414.261,83	0,23%	0,64%	36,24%	1,70%
Dezembro	176.800.632,52	4.220.571,42	6.558.328,12	177.030.034,63	2.567.158,81	1,45%	0,81%	178,92%	1,31%
Acumulado no ano					25.369.885,40	16,43%	12,64%	130,02%	

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(%)
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.822.213,08	0,00	0,00	4.961.589,25	139.376,17	2,89%	3,58%	2,89%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	15.309.618,82	0,00	0,00	15.738.739,71	429.120,89	2,80%	3,45%	2,80%
TÍTULOS PÚBLICOS	12.300.717,84	0,00	0,00	12.520.791,16	220.073,32	1,79%	-	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1.516.102,52	0,00	0,00	1.541.013,27	24.910,75	1,64%	2,04%	1,64%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.281.295,47	0,00	0,00	7.381.650,84	100.355,37	1,38%	1,32%	1,38%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	30.001.192,42	443.774,47	0,00	30.823.529,57	378.562,68	1,24%	1,06%	1,25%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	60.767.245,35	2.187.044,35	48.718,74	63.667.192,54	761.621,58	1,21%	1,02%	1,23%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.428.740,22	0,00	0,00	12.574.403,63	145.663,41	1,17%	0,10%	1,17%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4.528.805,80	139.243,95	127.652,20	4.594.999,01	54.601,46	1,17%	0,10%	1,18%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.469.792,31	0,00	0,00	5.531.794,47	62.002,16	1,13%	0,01%	1,13%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	5.456.195,20	0,00	0,00	5.517.154,85	60.959,65	1,12%	0,01%	1,12%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	83.456,67	0,00	0,00	84.380,77	924,10	1,11%	0,02%	1,11%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	7.630.227,55	0,00	4.718.841,42	2.975.567,63	64.181,50	0,84%	0,02%	1,11%
BB RPPS IPCA II FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	923.738,30	0,00	0,00	931.425,75	7.687,45	0,83%	0,16%	0,83%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	194.977,76	1.450.508,65	1.641.120,86	6.162,20	1.796,65	0,11%	0,00%	1,05%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 3	13.698,12	0,00	0,00	13.200,09	-498,03	-3,64%	-	-
Total Renda Fixa					2.451.339,11	1,45%	1,18%	

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(%)
BB RENDA CORPORATIVA FII - BBRC11	226.000,00	0,00	1.580,00	238.000,00	13.580,00	6,01%	-	4,67%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	975.000,00	0,00	8.000,00	1.020.000,00	53.000,00	5,44%	-	4,62%
CAIXA CEDAE FII - CXCE11B	1.100.515,00	0,00	9.210,74	1.145.000,00	53.695,74	4,88%	-	4,04%
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	433.704,00	0,00	3.204,16	442.000,00	11.500,16	2,65%	-	3,16%
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	211.409,60	0,00	0,00	214.115,94	2.706,34	1,28%	3,54%	1,28%
BRADESCO PLUS I FI MULTIMERCADO	1.278.795,67	0,00	0,00	1.294.798,58	16.002,91	1,25%	0,31%	1,25%
BRADESCO INFRA-ESTRUTURA FIAÇÕES	222.294,24	0,00	0,00	224.885,39	2.591,15	1,17%	9,11%	1,17%
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA FIP	1.054.326,71	0,00	0,00	1.052.797,81	-1.528,90	-0,15%	0,02%	-0,15%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	917.118,89	0,00	0,00	912.246,60	-4.872,29	-0,53%	7,34%	-0,53%
BRADESCO SMALL CAP PLUS FIAÇÕES	324.335,67	0,00	0,00	320.850,92	-3.484,75	-1,07%	9,51%	-1,07%
BRADESCO DIVIDENDOS FIAÇÕES	310.935,40	0,00	0,00	307.359,33	-3.576,07	-1,15%	10,34%	-1,15%
BB GOVERNANÇA FIAÇÕES PREVIDENCIÁRIO	200.347,73	0,00	0,00	197.491,35	-2.856,38	-1,43%	10,12%	-1,43%
CAIXA BRASIL IBX 50 FIAÇÕES	365.060,41	0,00	0,00	356.172,08	-8.888,33	-2,43%	10,59%	-2,43%
BRADESCO PLUS IBOVESPA FIAÇÕES	452.771,77	0,00	0,00	440.721,89	-12.049,88	-2,66%	10,97%	-2,66%
Total Renda Variável					115.819,70	1,43%	5,03%	

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 (%)
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	54.563.994,70	7.802.516,77	48.718,74	63.667.192,54	1.349.399,81	2,22%	2,24%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	29.252.604,34	910.284,46	0,00	30.823.529,57	660.640,77	2,21%	2,22%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.186.880,24	0,00	0,00	12.574.403,63	387.523,39	3,18%	3,18%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	15.587.900,59	0,00	231.382,28	15.738.739,71	382.221,40	2,48%	2,48%
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	12.763.170,55	333.055,02	10.410.028,32	2.975.567,63	289.370,38	2,78%	3,26%
TÍTULOS PÚBLICOS	12.288.346,87	0,00	0,00	12.520.791,16	232.444,29	1,89%	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	5.333.053,04	0,00	0,00	5.517.154,85	184.101,81	3,45%	3,45%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.280.421,44	76.164,49	0,00	5.531.794,47	175.208,54	3,27%	3,28%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.299.651,45	415.359,85	2.294.476,77	4.594.999,01	174.464,48	3,05%	3,18%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.322.377,04	0,00	101.672,74	7.381.650,84	160.946,54	2,22%	2,23%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.929.147,13	0,00	76.164,49	4.961.589,25	108.606,61	2,23%	2,23%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1.503.313,43	0,00	0,00	1.541.013,27	37.699,84	2,51%	2,51%
BB RPPS IPCA II FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	913.439,58	0,00	0,00	931.425,75	17.986,17	1,97%	1,97%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	36.466,12	5.289.002,43	5.323.097,09	6.162,20	3.790,74	0,21%	3,03%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	81.732,57	0,00	0,00	84.380,77	2.648,20	3,24%	3,24%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 3	14.500,38	0,00	0,00	13.200,09	-1.300,29	-8,97%	-8,97%
				Total Renda Fixa	4.165.752,68	2,49%	

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 CEDAE FII - CXCE11B	1.075.500,00	0,00	27.569,32	1.145.000,00	97.069,32	9,05%	6,46%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	989.000,00	0,00	24.000,00	1.020.000,00	55.000,00	5,59%	3,13%
BRADESCO PLUS I FI MULTIMERCADO	1.254.593,18	0,00	0,00	1.294.798,58	40.205,40	3,20%	3,20%
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	434.860,00	0,00	26.418,00	442.000,00	33.558,00	7,90%	1,58%
BB RENDA CORPORATIVA FII - BBRC11	216.340,00	0,00	4.740,00	238.000,00	26.400,00	12,28%	7,70%
BRADESCO PLUS IBOVESPA FIAÇÕES	427.028,13	0,00	0,00	440.721,89	13.693,76	3,21%	3,21%
BRADESCO DIVIDENDOS FIAÇÕES	294.746,80	0,00	0,00	307.359,33	12.612,53	4,28%	4,28%
CAIXA BRASIL IBX 50 FIAÇÕES	348.036,12	0,00	0,00	356.172,08	8.135,96	2,34%	2,34%
CAIXA BRASIL IPCA II FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	561.573,60	0,00	564.224,70	0,00	2.651,10	0,47%	-
BB GOVERNANÇA FIAÇÕES PREVIDENCIÁRIO	195.809,74	0,00	0,00	197.491,35	1.681,61	0,86%	0,86%
BRADESCO INFRA-ESTRUTURA FIAÇÕES	224.313,70	0,00	0,00	224.885,39	571,69	0,25%	0,25%
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	240.288,21	0,00	23.969,51	214.115,94	-2.202,76	-0,79%	-10,89%
BRADESCO SMALL CAP PLUS FIAÇÕES	323.217,72	0,00	0,00	320.850,92	-2.366,80	-0,73%	-0,73%
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA FIP	1.057.100,72	0,00	0,00	1.052.797,81	-4.302,91	-0,41%	-
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	916.598,24	0,00	0,00	912.246,60	-4.351,64	-0,47%	-0,47%
Total Renda Variável					278.355,26	3,11%	

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 BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	24.893.098,59	34.705.093,20	1.910.478,44	63.667.192,54	5.979.479,19	14,20%	14,94%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	21.754.985,57	6.846.172,83	1.382.382,72	30.823.529,57	3.604.753,89	14,77%	14,89%
CAIXA NOVO BRASIL IMA-B FIC RENDA FIXA LP	11.866.782,14	3.489.736,17	2.415.965,27	15.738.739,71	2.798.186,67	23,90%	24,14%
TÍTULOS PÚBLICOS	10.751.519,89	0,00	698.153,25	12.520.791,16	2.467.424,52	23,60%	-
CAIXA MEGA FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	13.271.549,62	5.012.320,35	17.176.976,47	2.975.567,63	1.868.674,13	13,11%	14,06%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.979.428,94	0,00	0,00	12.574.403,63	1.594.974,69	14,53%	14,53%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.848.118,96	4.863,68	989.324,23	4.961.589,25	1.097.930,84	24,51%	24,52%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.720.704,30	1.500.000,00	734.595,38	7.381.650,84	895.541,92	15,19%	15,19%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	5.100.880,20	1.782.395,92	3.075.350,64	4.594.999,01	787.073,53	14,37%	14,58%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	16.841.688,60	0,00	17.469.871,46	84.380,77	712.563,63	12,73%	14,00%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	4.828.859,04	0,00	0,00	5.517.154,85	688.295,81	14,25%	14,25%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.578.155,78	2.371.706,95	0,00	5.531.794,47	581.931,74	13,35%	13,88%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	1.284.409,15	0,00	0,00	1.541.013,27	256.604,12	19,98%	19,98%
CAIXA BRASIL IPCA XIII FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	2.726.695,50	0,00	2.965.294,50	0,00	238.599,00	8,75%	-
BB RPPS IPCA II FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	820.473,25	0,00	0,00	931.425,75	110.952,50	13,52%	13,52%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	5.195,97	36.761.746,04	36.781.352,69	6.162,20	20.572,88	0,70%	13,05%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 3	16.298,75	0,00	0,00	13.200,09	-3.098,66	-19,01%	-19,01%
Total Renda Fixa					23.700.460,40	16,13%	

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 CEDAE FII - CXCE11B	879.995,00	0,00	101.323,89	1.145.000,00	366.328,89	43,93%	30,11%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	800.000,00	0,00	102.143,68	1.020.000,00	322.143,68	42,68%	27,50%
BRADESCO PLUS I FI MULTIMERCADO	1.132.110,48	0,00	0,00	1.294.798,58	162.688,10	14,37%	14,37%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	811.803,75	0,00	31.392,01	912.246,60	131.834,86	16,55%	12,37%
BRADESCO PLUS IBOVESPA FIAÇÕES	316.560,77	0,00	0,00	440.721,89	124.161,12	39,22%	39,22%
RB CAPITAL RENDA II FII - RBRD11	405.280,00	0,00	55.351,32	442.000,00	92.071,32	24,40%	9,06%
BB RENDA CORPORATIVA FII - BBRC11	175.800,00	0,00	20.736,40	238.000,00	82.936,40	50,64%	-
BRADESCO DIVIDENDOS FIAÇÕES	232.045,51	0,00	0,00	307.359,33	75.313,82	32,46%	32,46%
CAIXA BRASIL IBX 50 FIAÇÕES	291.004,35	0,00	0,00	356.172,08	65.167,73	22,39%	22,39%
BRADESCO SMALL CAP PLUS FIAÇÕES	257.176,45	0,00	0,00	320.850,92	63.674,47	24,76%	24,76%
CAIXA BRASIL IPCA II FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	505.240,80	0,00	564.224,70	0,00	58.983,90	11,67%	-
BRADESCO INFRA-ESTRUTURA FIAÇÕES	172.600,65	0,00	0,00	224.885,39	52.284,74	30,29%	30,29%
BB GOVERNANÇA FIAÇÕES PREVIDENCIÁRIO	153.827,51	0,00	0,00	197.491,35	43.663,84	28,38%	28,38%
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	270.527,04	0,00	96.881,94	214.115,94	40.470,84	17,53%	-20,85%
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA FIP	1.604.901,55	0,00	539.805,03	1.052.797,81	-12.298,71	-1,08%	-
Total Renda Variável					1.669.425,00	22,46%	