

# Relatório Analítico dos Investimentos em agosto de 2016



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 (agosto / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	7.281.593,66	2,28%	1.336	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	17.385.308,51	5,44%	116	2,99%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	16.022.259,91	5,01%	631	0,36%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.289.471,90	1,03%	1.176	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	29.590.712,08	9,26%	753	0,44%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	44.625.278,72	13,97%	716	0,85%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	5.511.475,78	1,72%	601	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	17.529.516,02	5,49%	176	2,47%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	4.936.454,97	1,54%	240	0,36%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	23.443.603,29	7,34%	731	0,40%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	D+1471	Não há	2.297.245,80	0,72%	35	2,03%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	8.401.829,04	2,63%	1	1,83%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1901	Não há	3.211.343,27	1,01%	9	7,44%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	20.801.412,15	6,51%	763	0,41%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	6.928.787,43	2,17%	467	0,31%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	9.948.064,76	3,11%	61	16,95%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	16/05/2023	10.442.255,28	3,27%	52	3,97%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	6.009.670,78	1,88%	808	0,11%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	11.118.169,81	3,48%	51	0,99%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TRX CORPORATIVO I FIDC SÊNIOR	D+1401	Não Informado	10.327.820,58	3,23%	7	20,78%	Artigo 7º, Inciso VI
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	13.066.368,29	4,09%		4,89%	Artigo 7º, Inciso VI
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	6.458.632,17	2,02%	71	3,22%	Artigo 7º, Inciso VI

Carteira consolidada de investimentos - base (agosto / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	3.991.922,05	1,25%	95	7,06%	Artigo 8º, Inciso III
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.129.689,46	0,67%	138	2,61%	Artigo 8º, Inciso III
CONSTÂNCIA BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	498.870,33	0,16%	91	0,89%	Artigo 8º, Inciso III
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+180	Não há	5.723.877,62	1,79%	37	2,63%	Artigo 8º, Inciso IV
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	3.277.115,37	1,03%	33	19,31%	Artigo 8º, Inciso IV
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	7.877.573,51	2,47%	20	9,26%	Artigo 8º, Inciso V
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	7.139.590,68	2,23%	8	14,08%	Artigo 8º, Inciso V
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	Não se aplica	Não se aplica	9.116.464,80	2,85%			Artigo 8º, Inciso VI
CSHG BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	Não se aplica	Não se aplica	1.140.519,96	0,36%			Artigo 8º, Inciso VI
		<b>Total</b>	<b>319.522.897,98</b>				

## Enquadramentos na Resolução 3.922 / 4.392 / 4.604 e Política de Investimentos - base (agosto / 2016)

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	100,00%	169.615.674,84	53,08%	149.907.223,14
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	30,00%	13.910.418,11	4,35%	81.946.451,28
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	65.248.360,21	20,42%	30.608.509,18
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	11,00%	29.852.821,04	9,34%	5.294.697,74
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	4,00%	0,00	0,00%	12.780.915,92
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>175,00</b>	<b>278.627.274,20</b>	<b>87,20%</b>	

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	6.620.481,84	2,07%	41.307.952,86
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	9.000.992,99	2,82%	6.975.151,91
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	15.017.164,19	4,70%	958.980,71
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	10.256.984,76	3,21%	5.719.160,14
<b>Total</b>	<b>30,00%</b>	<b>30,00</b>	<b>40.895.623,78</b>	<b>12,80%</b>	

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDKA IPCA 2 Anos	1,29%	10,97%	3,16%	5,69%	17,70%	31,48%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,28%	10,91%	3,19%	6,25%	17,70%	30,36%	0,20%	0,755%	3,06%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,22%	10,94%	3,23%	6,39%	17,78%	30,85%	0,20%	0,732%	2,94%
CDI	1,21%	9,21%	3,52%	7,00%	14,13%	28,23%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,25%	9,04%	3,49%	6,87%	14,01%	28,38%	0,20%	0,021%	0,17%
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	1,23%	10,18%	3,84%	7,69%	15,88%	30,73%	0,75%	2,555%	6,71%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,21%	9,21%	3,51%	7,02%	14,14%	28,35%	0,20%	0,008%	0,06%
IRF-M 1	1,19%	9,83%	3,35%	6,89%	14,87%	28,36%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,17%	9,76%	3,30%	6,83%	14,74%	27,89%	0,20%	0,051%	0,45%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,16%	9,70%	3,26%	6,78%	14,60%	27,58%	0,10%	0,051%	0,47%
IMA-B 5	1,09%	11,35%	3,27%	6,50%	18,11%	31,19%	-	-	-
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1,23%	5,30%	4,20%	5,73%	0,60%	8,71%	0,70%	0,776%	12,95%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,07%	11,13%	3,21%	6,38%	17,61%	30,24%	0,20%	0,801%	3,29%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	1,06%	-	-3,02%	-	-	-	0,70%	0,688%	-
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1,05%	10,76%	3,26%	6,71%	15,89%	-	0,97%	0,798%	3,85%
IPCA + 7,00% ao ano	1,06%	10,29%	3,13%	6,81%	16,60%	36,69%	-	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	2,32%	-46,01%	0,67%	-45,30%	-44,74%	-35,22%	0,00%	-	-

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

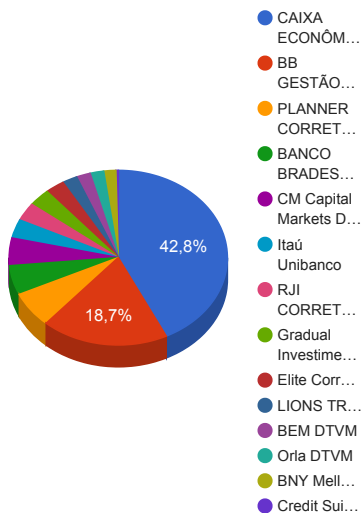
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1,12%	10,27%	3,46%	7,16%	15,87%	-	1,65%	0,390%	0,79%
IPCA + 6,00% ao ano	0,98%	9,60%	2,87%	6,29%	15,51%	34,14%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,36%	18,08%	4,20%	12,53%	23,58%	28,81%	0,15%	1,574%	8,78%
IMA-B	0,89%	20,11%	5,41%	15,26%	25,51%	29,04%	-	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,89%	19,92%	5,38%	15,20%	25,07%	28,34%	0,20%	1,899%	9,26%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,83%	19,82%	5,32%	15,12%	24,30%	26,87%	0,20%	1,871%	9,20%
BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	0,83%	19,85%	5,30%	15,08%	24,87%	27,69%	0,20%	1,905%	9,30%
IMA-B 5+	0,87%	25,95%	6,93%	21,12%	30,33%	28,94%	-	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,89%	25,80%	6,92%	21,25%	29,82%	28,63%	0,20%	2,561%	13,42%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,82%	25,55%	6,88%	20,93%	29,43%	27,40%	0,20%	2,523%	13,15%
IPCA	0,44%	5,42%	1,32%	3,17%	8,97%	19,36%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,92%	15,95%	4,67%	12,46%	20,17%	-	0,40%	1,177%	3,68%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
TRX CORPORATIVO I FIDC SÊNIOR	1,22%	-	20,29%	-	-	-	1,55%	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,19%	9,30%	3,48%	6,97%	13,97%	27,77%	0,20%	0,011%	0,21%

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

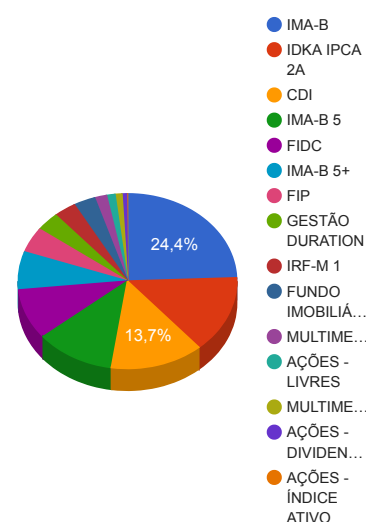
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDIV	1,88%	44,54%	23,66%	47,75%	28,38%	-25,39%	-	-	-
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	0,23%	30,07%	15,18%	27,82%	32,89%	19,07%	2,00%	4,331%	14,56%
CDI	1,21%	9,21%	3,52%	7,00%	14,13%	28,23%	-	-	-
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1,18%	10,02%	3,88%	7,81%	15,04%	30,96%	0,55%	0,219%	1,35%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	-0,91%	9,59%	3,16%	7,56%	16,29%	38,01%	1,00%	10,214%	18,85%
Ibovespa	1,03%	33,57%	19,45%	35,30%	24,18%	-5,53%	-	-	-
CONSTÂNCIA BRASIL FI AÇÕES	0,41%	24,23%	15,18%	24,81%	17,04%	-15,03%	2,00%	6,548%	24,37%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-0,06%	32,93%	16,63%	27,81%	26,57%	9,96%	1,85%	5,056%	14,19%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CSHG BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	3,54%	36,67%	9,79%	37,05%	-	-	0,60%	-	20,26%
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	0,14%	-10,20%	-6,20%	5,43%	-8,78%	-11,89%	0,00%	0,280%	30,57%
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	-	-	-	-	-	-	1,35%	-	0,00%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	136.632.451,18	42,76%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	59.780.040,79	18,71%
PLANNER CORRETORA	21.102.753,64	6,60%
BANCO BRADESCO	17.385.308,51	5,44%
CM Capital Markets DTVM	16.277.711,56	5,09%
Itaú Unibanco	11.118.169,81	3,48%
RJI CORRETORA DE VALORES	10.699.074,84	3,35%
Gradual Investimentos	10.327.820,58	3,23%
Elite Corretora	9.116.464,80	2,85%
LIONS TRUST	7.139.590,68	2,23%
BEM DTVM	6.620.481,84	2,07%
Orla DTVM	6.458.632,17	2,02%
BNY Mellon Serviços Financeiros	5.723.877,62	1,79%
Credit Suisse Hedging-Griffo Corretora	1.140.519,96	0,36%



Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	77.964.318,29	24,40%
IDKA IPCA 2A	45.612.971,99	14,28%
CDI	43.687.935,12	13,67%
IMA-B 5	37.354.021,40	11,69%
FIDC	29.852.821,04	9,34%
IMA-B 5+	22.465.970,99	7,03%
FIP	15.017.164,19	4,70%
GESTÃO DURATION	11.118.169,81	3,48%
IRF-M 1	10.571.065,56	3,31%
FUNDO IMOBILIÁRIO	10.256.984,76	3,21%
MULTIMERCADO - CRÉDITO PRIVADO	5.723.877,62	1,79%
AÇÕES - LIVRES	3.991.922,05	1,25%
MULTIMERCADO - MODERADO	3.277.115,37	1,03%
AÇÕES - DIVIDENDOS	2.129.689,46	0,67%
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	498.870,33	0,16%

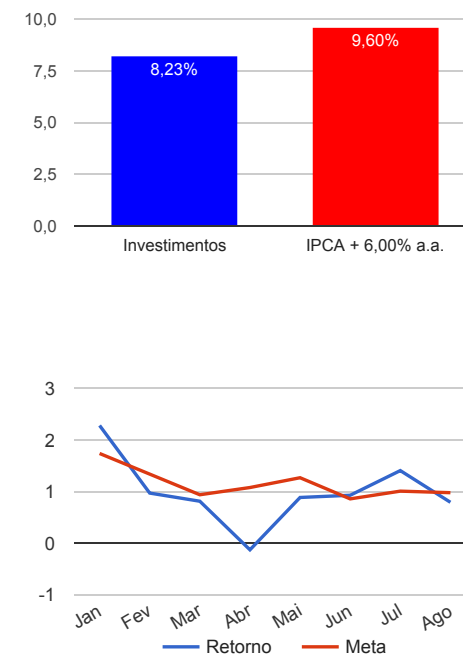




Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	294.155.551,80	6.101.666,64	6.032.327,66	300.941.364,38	6.716.473,60	2,28%	1,74%	131,24%	3,00%
Fevereiro	300.941.364,38	4.968.148,77	8.590.258,37	300.245.158,57	2.925.903,79	0,97%	1,34%	72,33%	2,44%
Março	300.245.158,57	9.774.815,85	5.387.537,27	307.113.429,13	2.480.991,98	0,81%	0,94%	86,44%	2,17%
Abril	307.113.429,13	7.457.869,56	7.126.805,12	307.052.783,06	-391.710,51	-0,13%	1,08%	-11,84%	1,18%
Mai	307.052.783,06	4.737.090,47	4.517.657,61	309.998.524,44	2.726.308,52	0,89%	1,27%	69,83%	1,34%
Junho	309.998.524,44	38.600.661,48	38.486.350,55	312.997.734,82	2.884.899,45	0,93%	0,86%	107,95%	1,65%
Julho	312.997.734,82	5.338.706,27	4.889.817,99	317.861.011,67	4.414.388,57	1,41%	1,01%	139,54%	0,87%
Agosto	317.861.011,67	82.189.332,69	83.051.438,27	319.522.897,98	2.523.991,89	0,79%	0,98%	81,39%	1,29%
Acumulado no ano					24.281.247,29	8,23%	9,60%	85,74%	

**Acumulado no Ano**



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.302.303,84	0,00	0,00	10.442.255,28	139.951,44	1,36%	1,57%	1,36%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	40.577.418,04	0,00	11.500.000,00	29.590.712,08	513.294,04	1,26%	0,75%	1,28%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	29.159.714,93	0,00	13.500.000,00	16.022.259,91	362.544,98	1,24%	0,73%	1,22%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	8.299.859,36	0,00	0,00	8.401.829,04	101.969,68	1,23%	0,78%	1,24%
TRX CORPORATIVO I FIDC SÊNIOR	10.203.187,90	0,00	0,00	10.327.820,58	124.632,68	1,22%	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.847.035,91	0,00	0,00	6.928.787,43	81.751,52	1,19%	0,01%	1,19%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.377.377,79	0,00	126.878,30	3.289.471,90	38.972,41	1,15%	0,05%	1,16%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	12.922.039,18	0,00	0,00	13.066.368,29	144.329,11	1,12%	0,39%	1,12%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	23.195.907,57	0,00	0,00	23.443.603,29	247.695,72	1,07%	0,80%	1,07%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	2.273.040,08	0,00	0,00	2.297.245,80	24.205,72	1,06%	0,69%	1,06%
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	3.177.861,37	0,00	0,00	3.211.343,27	33.481,90	1,05%	0,80%	1,05%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	24.511.169,62	0,00	17.483.392,22	7.281.593,66	253.816,26	1,04%	0,05%	1,17%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	14.556.190,28	8.235.254,81	2.208.649,25	20.801.412,15	218.616,31	0,96%	0,01%	1,21%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	11.009.093,72	8.244,16	0,00	11.118.169,81	100.831,93	0,92%	1,18%	0,92%
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	4.859.079,58	5.000.000,00	0,00	9.948.064,76	88.985,18	0,90%	2,55%	1,23%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	17.242.310,36	0,00	0,00	17.385.308,51	142.998,15	0,83%	1,91%	0,83%
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	32.990.160,00	0,00	33.213.360,00	0,00	223.200,00	0,68%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	17.483.392,22	0,00	17.529.516,02	46.123,80	0,26%	2,52%	0,82%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	5.500.000,00	0,00	5.511.475,78	11.475,78	0,21%	1,90%	0,89%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,00	6.000.000,00	0,00	6.009.670,78	9.670,78	0,16%	0,02%	1,25%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	5.000.000,00	5.002.291,11	0,00	2.291,11	0,05%	0,02%	1,16%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	15.696.801,05	28.960.150,39	0,00	44.625.278,72	-31.672,72	-0,07%	1,87%	0,83%

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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	5.002.291,11	0,00	4.936.454,97	-65.836,14	-1,32%	2,56%	0,89%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	6.847.248,45	0,00	0,00	6.458.632,17	-388.616,28	-5,68%	-	-
Total Renda Fixa					2.424.713,36	0,87%	1,18%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CSHG BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	1.103.573,64	0,00	8.266,20	1.140.519,96	45.212,52	4,10%	-	3,54%
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	5.657.380,16	0,00	0,00	5.723.877,62	66.497,46	1,18%	0,22%	1,18%
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	7.129.532,50	0,00	8.601,19	7.139.590,68	18.659,37	0,26%	0,28%	0,14%
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.124.892,96	0,00	0,00	2.129.689,46	4.796,50	0,23%	4,33%	0,23%
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	9.108.406,22	0,00	0,00	9.116.464,80	8.058,58	0,09%	-	-
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3.994.517,93	0,00	0,00	3.991.922,05	-2.595,88	-0,06%	5,06%	-0,06%
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	7.894.096,95	0,00	0,00	7.877.573,51	-16.523,44	-0,21%	0,05%	-0,21%
CONSTÂNCIA BRASIL FI AÇÕES	0,00	500.000,00	0,00	498.870,33	-1.129,67	-0,23%	6,55%	0,41%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	2.800.812,28	500.000,00	0,00	3.277.115,37	-23.696,91	-0,72%	10,21%	-0,91%
<b>Total Renda Variável</b>					<b>99.278,53</b>	<b>0,24%</b>	<b>2,28%</b>	