

Relatório Analítico dos Investimentos em setembro e 3º Trimestre 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 (setembro / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	5.597.663,58	1,73%	612	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	29.989.709,64	9,28%	754	0,45%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	7.366.878,56	2,28%	1.331	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	45.331.851,25	14,03%	728	0,87%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	15.224.735,55	4,71%	639	0,33%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.248.511,66	1,01%	1.171	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	17.821.248,21	5,51%	179	2,75%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	23.771.480,65	7,36%	733	0,39%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	5.017.633,50	1,55%	237	0,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	17.658.670,93	5,46%	116	2,97%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	D+1471	Não há	2.321.582,93	0,72%	34	2,04%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	8.505.520,00	2,63%	38	1,84%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1901	Não há	3.257.910,43	1,01%	9	7,44%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	D+0	Não há	6.076.656,26	1,88%	801	0,11%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	16/05/2023	10.576.999,15	3,27%	52	3,97%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.000.700,54	1,55%	463	0,23%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	12.076.688,77	3,74%	63	17,83%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	21.430.394,82	6,63%	760	0,45%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	11.279.821,42	3,49%	52	0,98%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TRX CORPORATIVO I FIDC SÊNIOR	D+1401	Não Informado	10.433.938,97	3,23%	7	20,78%	Artigo 7º, Inciso VI
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	13.177.358,21	4,08%		4,89%	Artigo 7º, Inciso VI
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	5.873.568,95	1,82%	71	3,12%	Artigo 7º, Inciso VI

Carteira consolidada de investimentos - base (setembro / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	494.187,79	0,15%	133	3,80%	Artigo 8º, Inciso III
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.120.067,70	0,66%	137	2,60%	Artigo 8º, Inciso III
CONSTÂNCIA BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	503.191,19	0,16%	91	0,87%	Artigo 8º, Inciso III
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	4.017.084,46	1,24%	143	6,99%	Artigo 8º, Inciso III
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	D+13	Não há	494.346,46	0,15%	153	1,33%	Artigo 8º, Inciso III
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	3.364.000,77	1,04%	35	19,09%	Artigo 8º, Inciso IV
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+180	Não há	5.780.855,30	1,79%	32	3,92%	Artigo 8º, Inciso IV
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	7.205.230,22	2,23%	8	14,08%	Artigo 8º, Inciso V
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	7.864.264,16	2,43%	20	9,26%	Artigo 8º, Inciso V
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	Não se aplica	Não se aplica	9.122.691,20	2,82%			Artigo 8º, Inciso VI
CSHG BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	Não se aplica	Não se aplica	1.193.633,29	0,37%			Artigo 8º, Inciso VI
		Total	323.199.076,52				

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

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	100,00%	171.028.383,53	52,92%	152.170.692,99
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	30,00%	14.085.013,36	4,36%	82.874.709,60
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	66.441.260,96	20,56%	30.518.462,00
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	11,00%	29.484.866,13	9,12%	6.067.032,29
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	4,00%	0,00	0,00%	12.927.963,06
Total Renda Fixa	100,00%	175,00	281.039.523,98	86,96%	

Artigos	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	7.628.877,60	2,36%	40.850.983,88
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	9.144.856,07	2,83%	7.015.097,76
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	15.069.494,38	4,66%	1.090.459,45
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	10.316.324,49	3,19%	5.843.629,34
Total	30,00%	30,00	42.159.552,54	13,04%	

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
IMA-B 5+	1,67%	28,05%	5,98%	13,71%	34,70%	38,62%	-	-	-
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%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,64%	27,87%	5,97%	13,71%	34,39%	38,07%	0,20%	3,129%	10,20%
IMA-B	1,57%	22,00%	5,04%	11,16%	28,36%	35,87%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,58%	21,72%	4,97%	11,04%	27,66%	33,42%	0,20%	2,300%	7,11%
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%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,56%	21,80%	5,03%	11,08%	27,99%	35,08%	0,20%	2,302%	7,06%
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%
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%	-	-	-
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1,45%	12,36%	3,85%	7,37%	17,21%	-	0,97%	0,974%	2,88%
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%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1,23%	6,60%	3,98%	8,26%	1,38%	10,35%	0,70%	0,819%	12,74%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	1,06%	-	-3,29%	-	-	-	0,70%	0,846%	-
IRF-M 1	1,19%	11,14%	3,46%	6,82%	15,14%	28,83%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,17%	11,05%	3,42%	6,78%	14,99%	28,37%	0,20%	0,075%	0,40%

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

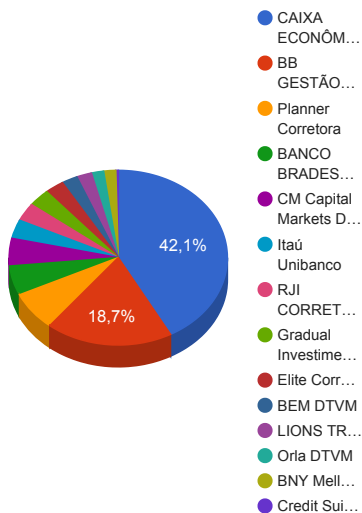
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,16%	10,97%	3,39%	6,72%	14,91%	28,05%	0,10%	0,076%	0,39%
CDI	1,11%	10,42%	3,47%	6,94%	14,13%	28,50%	-	-	-
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	1,30%	11,62%	4,24%	7,67%	15,94%	31,27%	0,75%	1,453%	6,14%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	1,11%	10,26%	3,54%	6,88%	14,00%	28,66%	0,20%	0,027%	0,17%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,10%	10,42%	3,46%	6,94%	14,12%	28,60%	0,20%	0,017%	0,06%
IPCA + 7,00% ao ano	0,65%	11,00%	2,82%	6,41%	16,07%	35,98%	-	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	0,85%	11,21%	3,07%	6,67%	15,78%	32,39%	1,65%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-6,01%	-49,25%	-1,98%	-41,86%	-48,61%	-39,75%	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%
IPCA	0,08%	5,51%	1,04%	2,81%	8,48%	18,77%	-	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,81%	18,05%	4,46%	10,29%	21,56%	-	0,40%	1,647%	3,64%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
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%
TRX CORPORATIVO I FIDC SÊNIOR	1,03%	-	3,21%	-	-	-	1,55%	-	-

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

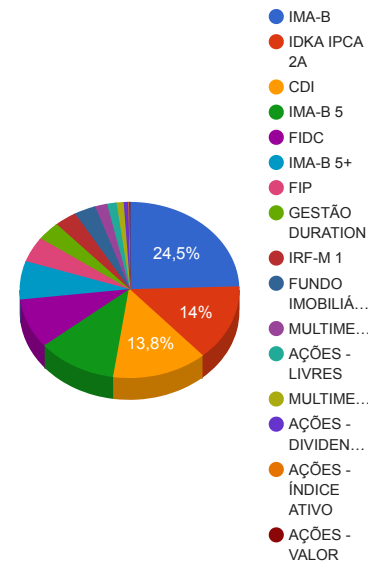
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CDI	1,11%	10,42%	3,47%	6,94%	14,13%	28,50%	-	-	-
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	2,65%	12,49%	3,26%	8,27%	17,45%	41,58%	1,00%	9,012%	19,24%
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1,00%	11,11%	3,60%	7,55%	15,15%	31,33%	0,55%	0,512%	1,30%
Ibovespa	0,80%	34,64%	13,28%	16,61%	29,53%	7,86%	-	-	-
CONSTÂNCIA BRASIL FI AÇÕES	0,87%	25,30%	10,61%	12,69%	22,21%	-7,54%	2,00%	9,059%	23,93%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,63%	33,76%	11,57%	19,85%	32,33%	18,66%	1,85%	5,556%	13,57%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	0,43%	30,48%	10,87%	18,34%	25,96%	8,91%	2,00%	7,659%	17,62%
IBX	0,60%	33,33%	13,24%	17,03%	27,85%	8,48%	-	-	-
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	0,40%	21,65%	7,38%	13,46%	23,67%	11,75%	2,00%	7,732%	14,69%
IDIV	-0,27%	44,15%	14,52%	22,19%	36,47%	-14,52%	-	-	-
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	-0,45%	29,48%	9,20%	14,17%	33,70%	23,25%	2,00%	6,830%	14,35%
Não Informado	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CSHG BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	4,56%	42,90%	16,16%	29,36%	-	-	0,60%	-	20,29%
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	0,27%	-9,96%	0,70%	-0,80%	-8,29%	-11,41%	0,00%	0,223%	30,57%
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	-	-	-	-	-	-	1,35%	-	0,00%

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

Administrador	Valor	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	135.947.289,58	42,06%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	60.507.173,79	18,72%
Planner Corretora	23.304.953,70	7,21%
BANCO BRADESCO	17.658.670,93	5,46%
CM Capital Markets DTVM	16.435.268,64	5,09%
Itaú Unibanco	11.279.821,42	3,49%
RJI CORRETORA DE VALORES	10.827.102,93	3,35%
Gradual Investimentos	10.433.938,97	3,23%
Elite Corretora	9.122.691,20	2,82%
BEM DTVM	7.628.877,60	2,36%
LIONS TRUST	7.205.230,22	2,23%
Orla DTVM	5.873.568,95	1,82%
BNY Mellon Serviços Financeiros	5.780.855,30	1,79%
Credit Suisse Hedging-Griffo Corretora	1.193.633,29	0,37%



Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	79.165.184,91	24,49%
IDKA IPCA 2A	45.214.445,19	13,99%
CDI	44.584.440,39	13,79%
IMA-B 5	37.856.494,01	11,71%
FIDC	29.484.866,13	9,12%
IMA-B 5+	22.838.881,71	7,07%
FIP	15.069.494,38	4,66%
GESTÃO DURATION	11.279.821,42	3,49%
IRF-M 1	10.615.390,22	3,28%
FUNDO IMOBILIÁRIO	10.316.324,49	3,19%
MULTIMERCADO - CRÉDITO PRIVADO	5.780.855,30	1,79%
AÇÕES - LIVRES	4.511.272,25	1,40%
MULTIMERCADO - MODERADO	3.364.000,77	1,04%
AÇÕES - DIVIDENDOS	2.120.067,70	0,66%
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	503.191,19	0,16%
AÇÕES - VALOR	494.346,46	0,15%



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%
Setembro	319.522.897,98	5.583.582,80	5.284.251,12	323.199.076,52	3.376.846,86	1,06%	0,57%	186,17%	1,52%
Acumulado no ano					27.658.094,15	9,37%	10,22%	91,70%	

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(%)
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	11.118.169,81	8.601,19	47.768,24	11.279.821,42	200.818,66	1,80%	1,65%	1,81%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	17.529.516,02	0,00	0,00	17.821.248,21	291.732,19	1,66%	3,13%	1,66%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.936.454,97	0,00	0,00	5.017.633,50	81.178,53	1,64%	3,13%	1,64%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	44.625.278,72	0,00	0,00	45.331.851,25	706.572,53	1,58%	2,30%	1,58%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	17.385.308,51	0,00	0,00	17.658.670,93	273.362,42	1,57%	2,34%	1,57%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.511.475,78	0,00	0,00	5.597.663,58	86.187,80	1,56%	2,30%	1,56%
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	3.211.343,27	0,00	0,00	3.257.910,43	46.567,16	1,45%	0,97%	1,45%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	23.443.603,29	0,00	0,00	23.771.480,65	327.877,36	1,40%	0,78%	1,40%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	29.590.712,08	0,00	0,00	29.989.709,64	398.997,56	1,35%	0,56%	1,35%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.442.255,28	0,00	0,00	10.576.999,15	134.743,87	1,29%	2,13%	1,29%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	16.022.259,91	0,00	1.000.000,00	15.224.735,55	202.475,64	1,26%	0,55%	1,33%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	8.401.829,04	0,00	0,00	8.505.520,00	103.690,96	1,23%	0,82%	1,23%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.281.593,66	0,00	0,00	7.366.878,56	85.284,90	1,17%	0,08%	1,17%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.289.471,90	0,00	79.034,03	3.248.511,66	38.073,79	1,16%	0,08%	1,16%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	6.009.670,78	0,00	0,00	6.076.656,26	66.985,48	1,11%	0,03%	1,11%
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	9.948.064,76	2.000.000,00	0,00	12.076.688,77	128.624,01	1,08%	1,45%	1,30%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	20.801.412,15	2.518.981,61	2.140.916,45	21.430.394,82	250.917,51	1,08%	0,02%	1,10%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	2.297.245,80	0,00	0,00	2.321.582,93	24.337,13	1,06%	0,85%	1,06%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.928.787,43	0,00	2.000.000,00	5.000.700,54	71.913,11	1,04%	0,02%	1,10%
TRX CORPORATIVO I FIDC SÊNIOR	10.327.820,58	0,00	0,00	10.433.938,97	106.118,39	1,03%	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	13.066.368,29	0,00	0,00	13.177.358,21	110.989,92	0,85%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	6.458.632,17	0,00	0,00	5.873.568,95	-585.063,22	-9,06%	-	-
				Total Renda Fixa	3.152.385,70	1,13%	1,37%	

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(%)
CSHG BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	1.140.519,96	0,00	16.532,40	1.193.633,29	69.645,73	6,11%	-	4,56%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	3.277.115,37	0,00	0,00	3.364.000,77	86.885,40	2,65%	9,01%	2,65%
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	5.723.877,62	0,00	0,00	5.780.855,30	56.977,68	1,00%	0,51%	1,00%
CONSTÂNCIA BRASIL FI AÇÕES	498.870,33	0,00	0,00	503.191,19	4.320,86	0,87%	9,06%	0,87%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3.991.922,05	0,00	0,00	4.017.084,46	25.162,41	0,63%	5,56%	0,63%
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	7.139.590,68	56.000,00	0,00	7.205.230,22	9.639,54	0,13%	0,22%	0,27%
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	9.116.464,80	0,00	0,00	9.122.691,20	6.226,40	0,07%	-	-
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	7.877.573,51	0,00	0,00	7.864.264,16	-13.309,35	-0,17%	0,00%	-0,17%
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.129.689,46	0,00	0,00	2.120.067,70	-9.621,76	-0,45%	6,83%	-0,45%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	0,00	500.000,00	0,00	494.346,46	-5.653,54	-1,13%	7,73%	0,40%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	0,00	500.000,00	0,00	494.187,79	-5.812,21	-1,16%	7,66%	0,43%
Total Renda Variável					224.461,16	0,54%	2,63%	

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 IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	42.632.100,60	0,00	14.000.000,00	29.989.709,64	1.357.609,04	3,70%	3,73%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	14.058.078,99	30.224.041,63	0,00	45.331.851,25	1.049.730,63	3,99%	4,97%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	28.840.735,48	0,00	14.500.000,00	15.224.735,55	884.000,07	3,66%	3,70%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	22.922.924,57	0,00	0,00	23.771.480,65	848.556,08	3,70%	3,70%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	16.816.927,40	0,00	0,00	17.658.670,93	841.743,53	5,01%	5,01%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	15.121.216,79	12.189.585,55	6.529.153,01	21.430.394,82	648.745,49	3,15%	3,46%
CAIXA BRASIL 2016 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	32.613.540,00	0,00	33.213.360,00	0,00	599.820,00	1,84%	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	24.260.919,02	0,00	17.483.392,22	7.366.878,56	589.351,76	3,27%	3,42%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	10.072.162,65	0,00	0,00	10.576.999,15	504.836,50	5,01%	5,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	10.932.538,92	33.311,25	170.768,24	11.279.821,42	484.739,49	4,45%	4,46%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	12.785.012,96	0,00	0,00	13.177.358,21	392.345,25	3,07%	3,07%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	17.483.392,22	0,00	17.821.248,21	337.855,99	1,93%	5,93%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	8.180.190,50	0,00	0,00	8.505.520,00	325.329,50	3,98%	3,98%
TRX CORPORATIVO I FIDC SÊNIOR	7.626.280,59	2.500.000,00	0,00	10.433.938,97	307.658,38	3,04%	3,21%
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	4.780.415,79	7.000.000,00	0,00	12.076.688,77	296.272,98	3,67%	4,24%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.772.768,96	0,00	2.000.000,00	5.000.700,54	227.931,58	3,37%	3,43%
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	3.137.263,56	0,00	0,00	3.257.910,43	120.646,87	3,85%	3,85%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.421.222,73	0,00	284.876,81	3.248.511,66	112.165,74	3,38%	3,39%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	5.500.000,00	0,00	5.597.663,58	97.663,58	1,78%	5,03%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,00	6.000.000,00	0,00	6.076.656,26	76.656,26	1,28%	3,54%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	5.002.291,11	0,00	5.017.633,50	15.342,39	0,31%	5,97%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	5.000.000,00	5.002.291,11	0,00	2.291,11	0,05%	3,29%

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 (%)
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	2.400.542,87	0,00	0,00	2.321.582,93	-78.959,94	-3,29%	-3,29%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	6.703.568,28	0,00	0,00	5.873.568,95	-829.999,33	-12,38%	-1,98%
				Total Renda Fixa	9.212.332,95	3,36%	

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 (%)
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3.600.405,06	0,00	0,00	4.017.084,46	416.679,40	11,57%	11,57%
CSHG BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	1.023.822,78	0,00	33.064,80	1.193.633,29	202.875,31	19,95%	16,16%
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	5.579.969,26	0,00	0,00	5.780.855,30	200.886,04	3,60%	3,60%
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.941.450,46	0,00	0,00	2.120.067,70	178.617,24	9,20%	9,20%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	2.758.900,58	500.000,00	0,00	3.364.000,77	105.100,19	3,46%	3,26%
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	7.007.274,84	179.000,00	8.601,19	7.205.230,22	27.556,57	0,39%	0,70%
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	9.100.881,08	0,00	0,00	9.122.691,20	21.810,12	0,24%	-
CONSTÂNCIA BRASIL FI AÇÕES	0,00	500.000,00	0,00	503.191,19	3.191,19	0,64%	10,61%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	0,00	500.000,00	0,00	494.346,46	-5.653,54	-1,13%	7,38%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	0,00	500.000,00	0,00	494.187,79	-5.812,21	-1,16%	10,87%
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	7.906.620,10	0,00	0,00	7.864.264,16	-42.355,94	-0,54%	-0,54%
Total Renda Variável					1.102.894,37	2,79%	