

Relatório Analítico dos Investimentos em dezembro de 2015



Carteira consolidada de investimentos - base (dezembro / 2015)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	19.921.775,14	6,47%	95	5,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	44.384.508,24	14,41%	549	1,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	12.660.231,27	4,11%	7	8,36%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	51.171.599,11	16,61%	631	1,35%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	33.247.315,37	10,79%	87	3,66%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	20.949.936,17	6,80%	83	2,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	D+1	16/05/2019	10.343.230,85	3,36%	11	15,06%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	44.729.769,43	14,52%	831	0,75%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	11.872.580,41	3,85%	95	3,67%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BTG PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA	D+0 ou D+1	Não há	11.419.780,00	3,71%	12	8,43%	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	5.458.265,35	1,77%	52	1,93%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	4.878.851,09	1,58%	23.387	0,97%	Artigo 8º, Inciso I
ITAÚ FOF RPI VALOR FIC AÇÕES	D+48	Não há	2.324.229,41	0,75%	10	2,21%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	23/08/2017	1.005.698,00	0,33%	116	0,33%	Artigo 8º, Inciso III
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou D+33	Não há	4.125.028,52	1,34%	238	0,44%	Artigo 8º, Inciso III
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	D+33	Não há	5.222.106,06	1,70%	183	1,45%	Artigo 8º, Inciso III
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	1.638.430,16	0,53%	492	1,76%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA BRASIL IPCA III FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+0	31/10/2016	3.405.582,00	1,11%	29	3,97%	Artigo 8º, Inciso IV
CAIXA BRASIL IPCA VIII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+0	06/12/2016	1.671.209,00	0,54%	21	2,00%	Artigo 8º, Inciso IV
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	6.579.240,76	2,14%	306	3,49%	Artigo 8º, Inciso IV
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	Não se aplica	Não se aplica	3.556.133,88	1,15%	98	0,71%	Artigo 8º, Inciso V
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	1.245.182,24	0,40%			Artigo 8º, Inciso V

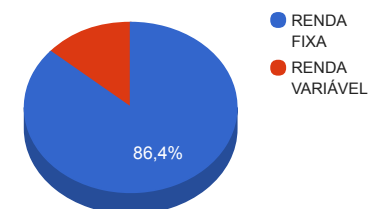
Carteira consolidada de investimentos - base (dezembro / 2015)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	Não se aplica	Não se aplica	1.125.108,16	0,37%		0,84%	Artigo 8º, Inciso VI
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	Não se aplica	Não se aplica	5.115.544,72	1,66%			Artigo 8º, Inciso VI
		TOTAL -	308.051.335,34				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (dezembro / 2015)

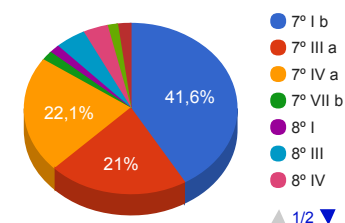
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	80,00%	128.138.113,76	41,60%	118.302.954,51
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	60,00%	64.540.482,39	20,95%	120.290.318,81
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	68.022.129,84	22,08%	24.393.270,76
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	7,00%	0,00	0,00%	21.563.593,47
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	15.402.566,77
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	3,00%	5.458.265,35	1,77%	3.783.274,71
Total Renda Fixa	100,00%	185,00	266.158.991,34	86,40%	

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	10,00%	4.878.851,09	1,58%	25.926.282,44
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	15,00%	14.315.492,15	4,65%	31.892.208,15
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	11.656.031,76	3,78%	3.746.535,01
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	4.801.316,12	1,56%	10.601.250,65
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	6.240.652,88	2,03%	9.161.913,89
Total Renda Variável	30,00%	40,00	41.892.344,00	13,60%	

Distribuição por Artigo / Resolução



Retorno dos investimentos de Renda Fixa e Benchmark's - base (dezembro / 2015)

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5	2,12%	15,46%	5,23%	7,45%	15,46%	28,90%	-	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,04%	14,86%	5,10%	7,14%	14,86%	28,00%	0,20%	0,798%	3,20%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	1,96%	13,32%	4,96%	4,98%	13,32%	24,89%	0,40%	1,207%	4,05%
IMA-B	1,52%	8,88%	5,21%	0,50%	8,88%	24,72%	-	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	2,40%	-	2,20%	-	-	-	0,20%	1,298%	-
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP	1,50%	8,72%	5,15%	0,39%	8,72%	23,33%	0,20%	1,458%	9,20%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,48%	8,53%	5,08%	0,23%	8,53%	23,86%	0,20%	1,453%	9,17%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	1,43%	8,64%	5,06%	0,19%	8,64%	24,20%	0,20%	1,435%	9,22%
IPCA + 6,00% ao ano	1,47%	17,26%	4,32%	7,37%	17,26%	32,29%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,86%	10,35%	5,25%	2,96%	10,35%	-	0,15%	1,607%	8,36%
BTG PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA	1,65%	10,66%	1,22%	4,33%	10,66%	-	0,15%	0,161%	4,11%
IRF-M 1	1,18%	13,01%	3,60%	7,02%	13,01%	24,96%	-	-	-
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1,15%	12,83%	3,75%	6,90%	12,83%	24,44%	0,20%	0,120%	0,78%
CDI	1,16%	13,24%	3,36%	6,91%	13,24%	25,48%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,18%	13,46%	3,39%	6,98%	13,46%	25,97%	0,20%	0,010%	0,07%
IPCA	0,96%	10,67%	2,82%	4,24%	10,67%	17,77%	-	-	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	2,64%	12,10%	5,32%	4,63%	12,10%	27,43%	0,20%	1,468%	6,63%

Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (dezembro / 2015)

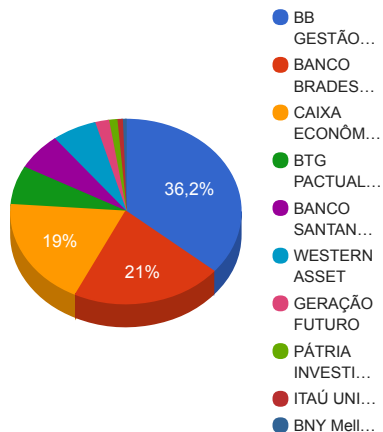
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA + 6,00% ao ano	1,47%	17,26%	4,32%	7,37%	17,26%	32,29%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA VIII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1,59%	16,88%	4,10%	7,20%	16,88%	30,67%	0,15%	0,257%	0,47%
CAIXA BRASIL IPCA III FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1,56%	16,81%	3,91%	7,13%	16,81%	30,36%	0,20%	0,123%	0,33%
IPCA	0,96%	10,67%	2,82%	4,24%	10,67%	17,77%	-	-	-
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	-	-	-	-	-	-	1,00%	0,440%	-
SMLL	-5,27%	-22,36%	-2,09%	-16,68%	-22,36%	-35,52%	-	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	-4,12%	-6,47%	0,60%	-0,67%	-6,47%	-9,23%	2,00%	5,625%	11,49%
Ibovespa	-3,93%	-13,31%	-3,80%	-18,33%	-13,31%	-15,84%	-	-	-
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	-1,14%	0,69%	1,00%	-0,94%	0,69%	4,13%	4,00%	6,164%	17,94%
ITAÚ FOF RPI VALOR FIC AÇÕES	-1,90%	-7,16%	-0,04%	-8,69%	-7,16%	-11,68%	1,50%	7,299%	12,63%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-2,14%	-1,18%	-5,78%	-11,72%	-1,18%	8,32%	3,00%	8,852%	17,21%
IDIV	-3,75%	-27,45%	-5,33%	-23,76%	-27,45%	-40,53%	-	-	-
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	0,11%	-3,22%	6,48%	-3,27%	-3,22%	2,24%	1,72%	9,771%	15,03%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	-2,05%	-2,20%	-1,81%	-11,49%	-2,20%	1,50%	2,50%	8,931%	16,89%
IFIX	-2,96%	5,46%	0,64%	-3,49%	5,46%	2,55%	-	-	-
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	-	-	-	-	-	-	0,30%	-	-
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	-	-	-	-	-	-	0,40%	-	13,71%

Retorno dos investimentos de Renda Variável e Benchmark's - base (dezembro / 2015)

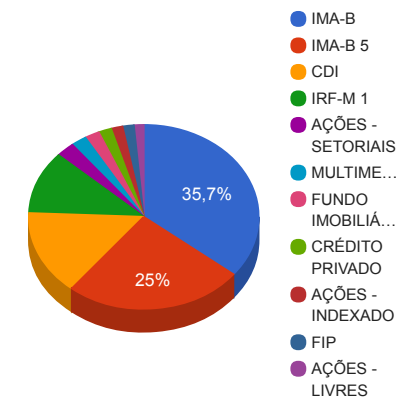
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
S&P 500	-1,75%	-0,73%	6,45%	-0,93%	-0,73%	10,58%	-	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	0,31%	12,08%	11,23%	6,65%	12,08%	40,11%	1,00%	8,675%	15,33%

Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (dezembro / 2015)

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	111.560.668,15	36,21%
BANCO BRADESCO	64.540.482,39	20,95%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	58.499.270,35	18,99%
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS	20.766.914,58	6,74%
BANCO SANTANDER	19.921.775,14	6,47%
WESTERN ASSET	19.239.472,03	6,25%
GERAÇÃO FUTURO	6.003.959,25	1,95%
PÁTRIA INVESTIMENTOS	3.556.133,88	1,15%
ITAÚ UNIBANCO	2.324.229,41	0,75%
BNY Mellon Serviços Financeiros	1.638.430,16	0,53%



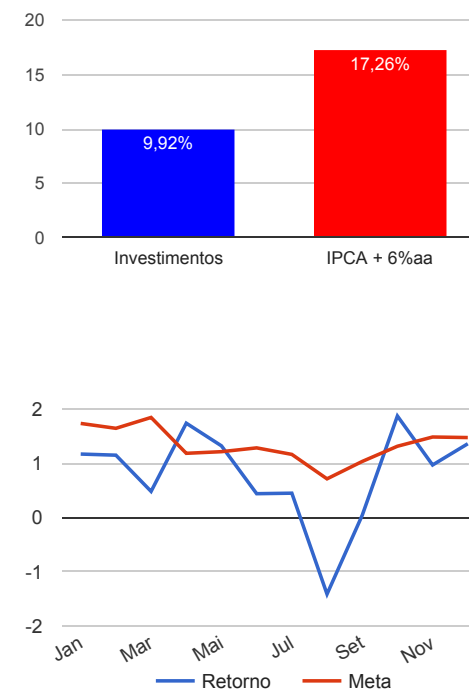
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B	107.472.030,81	34,89%
IMA-B 5	75.251.610,38	24,43%
CDI	44.729.769,43	14,52%
IRF-M 1	33.247.315,37	10,79%
AÇÕES - SETORIAIS	7.866.234,22	2,55%
MULTIMERCADO	6.579.240,76	2,14%
FUNDO IMOBILIÁRIO	6.240.652,88	2,03%
CRÉDITO PRIVADO	5.458.265,35	1,77%
AÇÕES - INDEXADO	4.878.851,09	1,58%
FIP	4.801.316,12	1,56%
AÇÕES - LIVRES	4.125.028,52	1,34%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2015

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	258.511.903,95	14.499.048,33	4.426.053,59	271.717.470,39	3.132.571,70	1,17%	1,73%	67,31%	2,15%
Fevereiro	271.717.470,39	11.002.832,96	7.066.504,47	278.811.672,96	3.157.874,08	1,15%	1,64%	69,76%	2,17%
Março	278.811.672,96	10.150.000,00	6.090.728,72	284.226.494,23	1.355.549,99	0,48%	1,84%	26,09%	2,27%
Abril	284.226.494,23	8.426.988,42	4.446.450,16	293.205.772,42	4.998.739,93	1,73%	1,18%	147,38%	1,89%
Mai	293.205.772,42	10.606.256,71	7.372.892,87	300.343.416,34	3.904.280,08	1,32%	1,21%	109,12%	2,13%
Junho	300.343.416,34	30.796.034,12	31.471.665,49	300.979.306,94	1.311.521,97	0,44%	1,28%	34,10%	1,62%
Julho	300.979.306,94	6.443.595,52	5.090.124,33	303.681.769,75	1.348.991,62	0,45%	1,16%	38,58%	2,24%
Agosto	303.681.769,75	6.684.530,68	5.335.306,13	300.725.721,48	-4.305.272,82	-1,41%	0,71%	-199,40%	2,67%
Setembro	300.725.721,48	25.127.262,18	23.910.258,92	302.060.772,28	118.047,54	0,04%	1,03%	3,80%	5,35%
Outubro	302.060.772,28	34.312.022,47	35.245.340,16	306.765.371,76	5.637.917,17	1,87%	1,31%	142,40%	2,58%
Novembro	306.765.371,76	33.267.191,86	34.845.814,34	308.147.076,27	2.960.326,99	0,97%	1,48%	65,28%	2,75%
Dezembro	308.147.076,27	6.027.660,74	10.301.598,73	308.051.335,34	4.178.197,06	1,36%	1,47%	91,93%	1,45%
Acumulado no ano					27.798.745,31	9,92%	17,26%	57,48%	

Acumulado no Ano



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de dezembro / 2015

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.542.868,53	0,00	0,00	11.872.580,41	329.711,88	2,86%	1,61%	2,86%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	5.317.820,30	0,00	0,00	5.458.265,35	140.445,05	2,64%	1,47%	2,64%
BRANCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	10.100.783,74	0,00	0,00	10.343.230,85	242.447,11	2,40%	1,30%	2,40%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	48.261.697,52	1.922.235,00	0,00	51.171.599,11	987.666,59	1,97%	0,80%	2,04%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	12.417.145,42	0,00	0,00	12.660.231,27	243.085,85	1,96%	1,21%	1,96%
BTG PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA	11.234.875,00	0,00	0,00	11.419.780,00	184.905,00	1,65%	0,16%	1,65%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIX...	19.627.722,78	0,00	0,00	19.921.775,14	294.052,36	1,50%	1,46%	1,50%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	43.738.448,34	0,00	0,00	44.384.508,24	646.059,90	1,48%	1,45%	1,48%
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	20.654.540,26	0,00	0,00	20.949.936,17	295.395,91	1,43%	1,43%	1,43%
CAIXA BRASIL IPCA V FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.897.376,00	0,00	1.923.205,00	0,00	25.829,00	1,36%	-	-
BRANCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	32.867.850,31	0,00	0,00	33.247.315,37	379.465,06	1,15%	0,12%	1,15%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	48.422.457,61	4.105.425,74	8.340.400,00	44.729.769,43	542.286,08	1,03%	0,01%	1,18%
Total Renda Fixa					4.311.349,79	1,62%	0,85%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de dezembro / 2015

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA FIP	1.152.547,22	0,00	0,00	1.245.182,24	92.635,02	8,04%	-	-
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	5.052.756,92	0,00	27.500,00	5.115.544,72	90.287,80	1,79%	-	-
CAIXA BRASIL IPCA VIII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.645.007,00	0,00	0,00	1.671.209,00	26.202,00	1,59%	0,26%	1,59%
CAIXA BRASIL IPCA III FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	3.353.176,00	0,00	0,00	3.405.582,00	52.406,00	1,56%	0,12%	1,56%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	6.558.897,73	0,00	0,00	6.579.240,76	20.343,03	0,31%	8,67%	0,31%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.004.550,00	0,00	0,00	1.005.698,00	1.148,00	0,11%	9,77%	0,11%
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	3.577.238,31	0,00	0,00	3.556.133,88	-21.104,43	-0,59%	0,44%	-0,59%
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	4.935.256,64	0,00	0,00	4.878.851,09	-56.405,55	-1,14%	6,16%	-1,14%
ITAÚ FOF RPI VALOR FIC AÇÕES	2.369.256,93	0,00	0,00	2.324.229,41	-45.027,52	-1,90%	7,30%	-1,90%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	5.331.362,88	0,00	0,00	5.222.106,06	-109.256,82	-2,05%	8,93%	-2,05%
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	1.159.382,79	0,00	10.493,73	1.125.108,16	-23.780,90	-2,05%	-	-2,75%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4.215.233,53	0,00	0,00	4.125.028,52	-90.205,01	-2,14%	8,85%	-2,14%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	1.708.824,51	0,00	0,00	1.638.430,16	-70.394,35	-4,12%	5,62%	-4,12%
				Total Renda Variável	-133.152,73	-0,32%	6,07%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre / 2015

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	42.238.840,17	0,00	0,00	44.384.508,24	2.145.668,07	5,08%	5,08%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	38.910.783,39	23.214.917,42	18.929.900,00	44.729.769,43	1.533.968,62	2,93%	3,39%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	49.814.863,26	0,00	51.171.599,11	1.356.735,85	3,41%	5,10%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	31.742.478,54	308.563,60	0,00	33.247.315,37	1.196.273,23	3,75%	3,75%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	19.941.560,15	0,00	0,00	20.949.936,17	1.008.376,02	5,06%	5,06%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIX...	18.946.016,91	0,00	0,00	19.921.775,14	975.758,23	5,15%	5,15%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	47.149.001,83	0,00	47.892.628,26	0,00	743.626,43	1,93%	3,52%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	12.061.460,45	0,00	0,00	12.660.231,27	598.770,82	4,96%	4,96%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.280.598,72	0,00	0,00	11.872.580,41	591.981,69	5,25%	5,25%
BRADESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	10.120.415,31	0,00	308.563,60	10.343.230,85	531.379,14	5,32%	2,20%
BTG PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA	11.282.071,00	0,00	328.187,17	11.419.780,00	465.896,17	4,18%	1,22%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	5.182.363,09	0,00	0,00	5.458.265,35	275.902,26	5,32%	5,32%
CAIXA BRASIL IPCA V FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.854.496,00	0,00	1.923.205,00	0,00	68.709,00	3,70%	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.738.648,92	0,00	9.807.293,23	0,00	68.644,31	0,70%	3,54%
DACASA FINANCEIRA (GRUPO DADALTO) II FIDC SÊNIOR 2	1.071.020,83	0,00	1.091.495,03	0,00	20.474,20	1,95%	-100,00%
Total Renda Fixa					11.582.164,04	4,45%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre / 2015

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	5.914.937,93	0,00	0,00	6.579.240,76	664.302,83	11,23%	11,23%
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	3.024.493,96	268.530,79	0,00	3.556.133,88	263.109,13	7,99%	-
BB RECEÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	4.995.107,94	0,00	80.000,00	5.115.544,72	200.436,78	4,04%	-
CAIXA BRASIL IPCA III FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	3.277.536,00	0,00	0,00	3.405.582,00	128.046,00	3,91%	3,91%
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA FIP	1.153.768,82	0,00	0,00	1.245.182,24	91.413,42	7,92%	-
CAIXA BRASIL IPCA VIII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.605.449,00	0,00	0,00	1.671.209,00	65.760,00	4,10%	4,10%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	944.500,00	0,00	0,00	1.005.698,00	61.198,00	6,48%	6,48%
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	4.830.452,96	0,00	0,00	4.878.851,09	48.398,13	1,00%	1,00%
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPF11	1.144.821,47	0,00	31.480,94	1.125.108,16	11.767,63	1,00%	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	1.628.627,53	0,00	0,00	1.638.430,16	9.802,63	0,60%	0,60%
ITAÚ FOF RPI VALOR FIC AÇÕES	2.325.102,60	0,00	0,00	2.324.229,41	-873,19	-0,04%	-0,04%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	5.318.224,13	0,00	0,00	5.222.106,06	-96.118,07	-1,81%	-1,81%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4.377.994,63	0,00	0,00	4.125.028,52	-252.966,11	-5,78%	-5,78%
Total Renda Variável					1.194.277,18	2,93%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no Ano de 2015

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	39.767.903,74	85.639.717,42	86.717.900,00	44.729.769,43	6.040.048,27	11,43%	13,46%
BRDESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	32.958.629,91	4.688.205,16	8.378.245,01	33.247.315,37	3.978.725,31	12,56%	12,83%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	36.129.035,86	5.175.000,00	0,00	44.384.508,24	3.080.472,38	8,47%	8,53%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	39.077.852,18	6.129.549,76	47.892.646,61	0,00	2.685.244,67	7,04%	8,70%
BTG PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA	10.319.649,00	0,00	648.463,37	11.419.780,00	1.748.594,37	17,27%	10,66%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIX...	18.323.712,44	0,00	0,00	19.921.775,14	1.598.062,70	8,72%	8,72%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	49.814.863,26	0,00	51.171.599,11	1.356.735,85	3,41%	14,86%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	13.761.210,41	6.000.491,84	0,00	20.949.936,17	1.188.233,92	8,66%	8,64%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.399.188,17	0,00	662.748,93	11.872.580,41	1.136.141,17	10,30%	10,35%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.763.425,51	11.814.648,18	21.564.335,04	0,00	986.261,35	8,67%	12,58%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	0,00	12.000.000,00	0,00	12.660.231,27	660.231,27	5,55%	13,32%
BRDESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	0,00	10.000.000,00	308.563,60	10.343.230,85	651.794,45	6,59%	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	4.868.984,46	0,00	0,00	5.458.265,35	589.280,89	12,10%	12,10%
CAIXA BRASIL IPCA V FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1.654.548,00	0,00	1.923.205,00	0,00	268.657,00	16,24%	-
DACASA FINANCEIRA (GRUPO DADALTO) II FIDC SÊNIOR 2	1.344.118,67	0,00	1.518.353,84	0,00	174.235,17	15,15%	-100,00%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	915.000,00	915.394,52	0,00	394,52	0,04%	12,36%
Total Renda Fixa					26.143.113,29	10,90%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no Ano de 2015

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	5.869.888,12	0,00	0,00	6.579.240,76	709.352,64	12,08%	12,08%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	4.950.264,62	0,00	435.000,00	5.115.544,72	600.280,10	12,68%	-
CAIXA BRASIL IPCA III FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	2.915.434,00	0,00	0,00	3.405.582,00	490.148,00	16,81%	16,81%
CAIXA BRASIL IPCA VIII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.429.798,00	0,00	0,00	1.671.209,00	241.411,00	16,88%	16,88%
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	2.580.856,29	787.044,57	0,00	3.556.133,88	188.233,02	5,24%	-
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA FIP	1.167.588,36	0,00	87.687,41	1.245.182,24	165.281,29	14,83%	-
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	1.205.364,56	0,00	129.446,78	1.125.108,16	49.190,38	3,96%	-
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	4.845.630,47	0,00	0,00	4.878.851,09	33.220,62	0,69%	0,69%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.039.170,00	0,00	41.844,00	1.005.698,00	8.372,00	0,86%	-3,22%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	1.751.720,96	0,00	0,00	1.638.430,16	-113.290,80	-6,47%	-6,47%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	5.339.729,23	0,00	0,00	5.222.106,06	-117.623,17	-2,20%	-2,20%
BRANCO ÍNDICE DE SUSTENTABILIDADE EMPRESARIAL FI AÇÕES	4.544.597,62	0,00	4.378.903,80	0,00	-165.693,82	-3,65%	-15,12%
ITAÚ FOF RPI VALOR FIC AÇÕES	2.503.603,37	0,00	0,00	2.324.229,41	-179.373,96	-7,16%	-7,16%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,00	4.378.903,80	0,00	4.125.028,52	-253.875,28	-5,80%	-1,18%
Total Renda Variável					1.655.632,02	4,08%	