

Relatório Analítico dos Investimentos em junho, 2º Trimestre e 1º semestre de 2016

Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	14.098.716,77	4,32%	14	13,46%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	5.957.464,14	1,83%	1.175	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	D+1	16/05/2019	11.100.993,02	3,40%	11	15,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	55.915.898,24	17,15%	701	1,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	21.583.995,96	6,62%	301	1,41%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	39.429.242,68	12,09%	738	0,63%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	39.038.985,69	11,97%	91	3,31%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	24.248.504,61	7,44%	77	2,40%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	41.375.874,16	12,69%	824	0,71%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BTG PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA	D+0 ou D+1	Não há	11.961.559,00	3,67%	12	8,43%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	13.007.093,97	3,99%	95	3,67%	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	6.092.022,92	1,87%	51	1,97%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	5.880.828,98	1,80%	22.018	1,36%	Artigo 8º, Inciso I
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	7.329.021,84	2,25%	3.282	3,08%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	23/08/2017	1.070.748,00	0,33%	116	0,33%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	D+5	Não há	4.182.082,78	1,28%	24	3,71%	Artigo 8º, Inciso IV
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	7.082.860,06	2,17%	226	5,28%	Artigo 8º, Inciso IV
CAIXA BRASIL IPCA VIII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+0	06/12/2016	1.810.890,00	0,56%	21	2,00%	Artigo 8º, Inciso IV
CAIXA BRASIL IPCA III FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+0	31/10/2016	3.683.938,00	1,13%	29	3,97%	Artigo 8º, Inciso IV
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	Não se aplica	Não se aplica	3.825.935,81	1,17%	98	0,72%	Artigo 8º, Inciso V
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	965.967,80	0,30%	19	1,02%	Artigo 8º, Inciso V
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	Não se aplica	Não se aplica	5.269.990,97	1,62%			Artigo 8º, Inciso VI

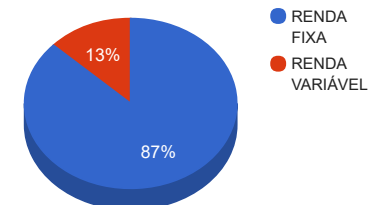
Carteira consolidada de investimentos - base (junho / 2016)

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 - BPF11	Não se aplica	Não se aplica	1.221.922,28	0,37%		0,77%	Artigo 8º, Inciso VI
		TOTAL -	326.134.537,68				

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

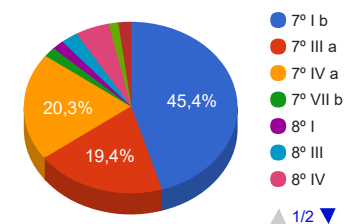
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	80,00%	148.086.310,81	45,41%	112.821.319,33
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	50,00%	63.287.490,30	19,41%	99.779.778,54
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	66.344.527,13	20,34%	31.495.834,17
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	0,00	0,00%	16.306.726,88
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	0,00	0,00%	16.306.726,88
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	6.092.022,92	1,87%	10.214.703,96
Total Renda Fixa	100,00%	175,00	283.810.351,16	87,02%	

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	5,00%	5.880.828,98	1,80%	10.425.897,90
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	10,00%	8.399.769,84	2,58%	24.213.683,93
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	16.759.770,84	5,14%	-453.043,96
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	4.791.903,61	1,47%	11.514.823,27
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	6.491.913,25	1,99%	9.814.813,63
Total Renda Variável	30,00%	30,00	42.324.186,52	12,98%	

Distribuição por Artigo / Resolução



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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B	1,93%	16,15%	5,83%	16,15%	16,73%	32,26%	-	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	1,94%	15,75%	5,94%	15,75%	15,97%	31,68%	0,20%	2,407%	9,79%
BRADESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	0,81%	7,33%	0,80%	7,33%	-	-	0,20%	1,553%	-
CDI	1,16%	6,72%	3,36%	6,72%	14,09%	27,57%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,07%	6,49%	3,22%	6,49%	13,92%	27,68%	0,20%	0,271%	0,17%
IRF-M 1	1,08%	7,42%	3,25%	7,42%	14,96%	27,79%	-	-	-
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	1,06%	7,38%	3,22%	7,38%	14,78%	27,34%	0,20%	0,114%	0,77%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,03%	7,34%	3,22%	7,34%	14,66%	27,00%	0,10%	0,117%	0,51%
IMA-B 5	0,94%	8,84%	3,31%	8,84%	16,94%	31,07%	-	-	-
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	0,99%	11,36%	3,87%	11,36%	16,91%	29,87%	0,40%	1,850%	4,67%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	0,92%	8,73%	3,26%	8,73%	16,74%	30,61%	0,10%	1,106%	3,52%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,92%	8,66%	3,26%	8,66%	16,43%	30,14%	0,20%	1,106%	3,51%
IDKA IPCA 2 Anos	0,93%	8,58%	3,25%	8,58%	17,00%	31,47%	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,82%	8,36%	3,26%	8,36%	16,56%	30,05%	0,20%	1,178%	3,23%
IPCA + 6,00% ao ano	0,86%	7,45%	3,24%	7,45%	15,38%	33,21%	-	-	-
BTG PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA	1,13%	4,74%	0,39%	4,74%	9,28%	12,44%	0,15%	0,093%	4,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,56%	12,94%	4,45%	12,94%	16,29%	29,77%	0,15%	2,997%	8,91%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IPCA	0,35%	4,42%	1,75%	4,42%	8,84%	18,53%	-	-	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,90%	11,61%	3,92%	11,61%	16,78%	30,73%	0,20%	2,184%	6,89%

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

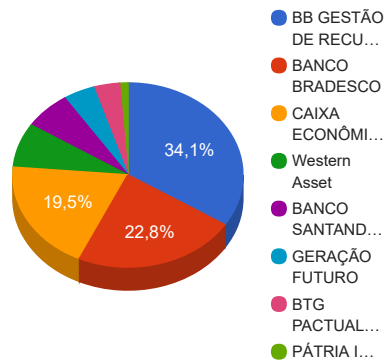
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDIV	7,69%	25,88%	6,70%	25,88%	-4,03%	-25,77%	-	-	-
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	3,91%	-12,48%	-3,08%	-12,48%	-15,14%	-20,58%	3,00%	10,830%	21,83%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	2,50%	6,47%	2,50%	6,47%	2,99%	2,50%	1,72%	5,552%	16,16%
Ibovespa	6,30%	18,86%	2,94%	18,86%	-2,93%	-3,09%	-	-	-
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	4,61%	-12,26%	-1,39%	-12,26%	-13,09%	-21,74%	4,00%	11,372%	21,18%
IFIX	1,61%	16,25%	10,30%	16,25%	12,19%	18,10%	-	-	-
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	-1,24%	-	7,50%	-	5,60%	-1,23%	0,40%	-	22,07%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	-	-	-	-	-	-	0,30%	-	-
CDI	1,16%	6,72%	3,36%	6,72%	14,09%	27,57%	-	-	-
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	0,93%	7,27%	3,21%	7,27%	16,36%	35,84%	2,00%	1,094%	1,91%
IPCA + 6,00% ao ano	0,86%	7,45%	3,24%	7,45%	15,38%	33,21%	-	-	-
CAIXA BRASIL IPCA VIII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1,28%	8,36%	3,29%	8,36%	16,16%	33,50%	0,15%	0,051%	0,43%
CAIXA BRASIL IPCA III FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1,21%	8,17%	3,28%	8,17%	15,89%	33,22%	0,20%	0,057%	0,33%
IPCA	0,35%	4,42%	1,75%	4,42%	8,84%	18,53%	-	-	-
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	-	-	-	-	-	-	1,00%	0,115%	9,15%
S&P 500	0,09%	2,69%	1,90%	2,69%	1,73%	7,07%	-	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	1,08%	7,65%	5,18%	7,65%	14,81%	35,17%	1,00%	9,323%	17,20%

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

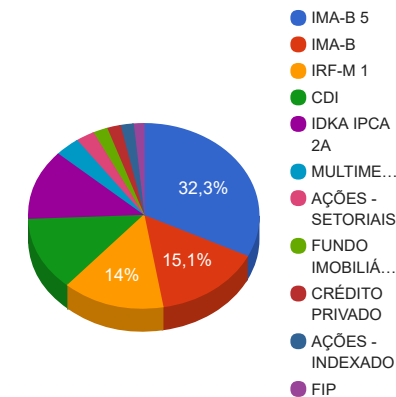
	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
Não Possui	-	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA FIP	-	-	-	-	-	-	1,50%	0,162%	38,74%

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

Administrador	Valor	%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	111.131.688,84	34,08%
BANCO BRADESCO	74.388.483,32	22,81%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	63.447.442,04	19,45%
Western Asset	25.363.659,61	7,78%
BANCO SANTANDER	21.583.995,96	6,62%
GERAÇÃO FUTURO	14.431.773,10	4,43%
BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS	11.961.559,00	3,67%
PÁTRIA INVESTIMENTOS	3.825.935,81	1,17%



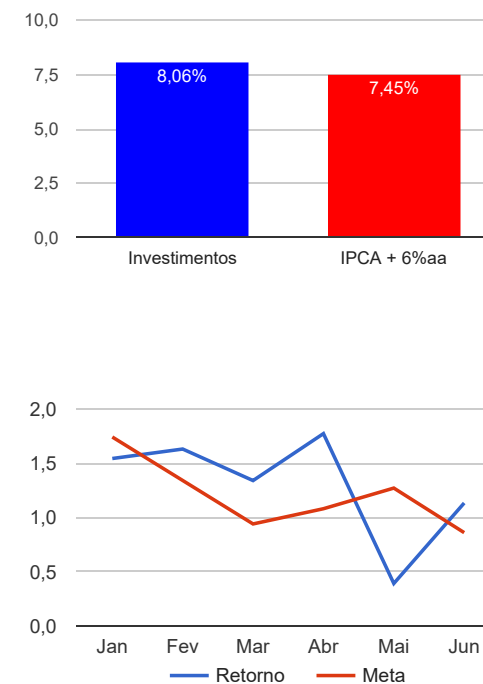
Sub-segmento	Valor	%
IMA-B 5	103.560.169,97	31,75%
IMA-B	48.356.591,60	14,83%
IRF-M 1	44.996.449,83	13,80%
CDI	41.375.874,16	12,69%
IDKA IPCA 2A	39.429.242,68	12,09%
MULTIMERCADO	11.264.942,84	3,45%
AÇÕES - SETORIAIS	8.399.769,84	2,58%
FUNDO IMOBILIÁRIO	6.491.913,25	1,99%
CRÉDITO PRIVADO	6.092.022,92	1,87%
AÇÕES - INDEXADO	5.880.828,98	1,80%
FIP	4.791.903,61	1,47%



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2016

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	308.051.335,34	6.737.337,95	5.182.608,69	314.380.496,84	4.774.432,24	1,54%	1,74%	88,66%	2,27%
Fevereiro	314.380.496,84	18.082.507,36	19.015.521,99	318.569.760,65	5.122.278,44	1,63%	1,34%	121,21%	2,16%
Março	318.569.760,65	74.303.565,24	75.371.269,37	321.768.125,22	4.266.068,70	1,34%	0,94%	142,13%	2,36%
Abril	321.768.125,22	7.534.703,96	8.379.525,53	326.622.539,80	5.699.236,15	1,77%	1,08%	164,56%	1,75%
Mai	326.622.539,80	5.461.192,96	6.763.556,47	326.600.595,78	1.280.419,49	0,39%	1,27%	30,85%	1,67%
Junho	326.600.595,78	12.976.057,50	17.141.219,13	326.134.537,68	3.699.103,53	1,13%	0,86%	131,43%	1,65%
Acumulado no ano					24.841.538,55	8,06%	7,45%	108,11%	

Acumulado no Ano



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

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	23.786.070,78	0,00	0,00	24.248.504,61	462.433,83	1,94%	2,41%	1,94%
BTG PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA	11.828.231,00	0,00	0,00	11.961.559,00	133.328,00	1,13%	0,09%	1,13%
BRADESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	36.632.792,99	2.000.000,00	0,00	39.038.985,69	406.192,70	1,05%	0,11%	1,06%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	13.960.650,37	0,00	0,00	14.098.716,77	138.066,40	0,99%	1,85%	0,99%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	21.387.001,68	0,00	0,00	21.583.995,96	196.994,28	0,92%	1,11%	0,92%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	55.410.194,96	0,00	3.000,00	55.915.898,24	508.703,28	0,92%	1,11%	0,92%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	5.903.429,55	0,00	5.957.464,14	54.034,59	0,92%	0,12%	1,03%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	6.037.954,51	0,00	0,00	6.092.022,92	54.068,41	0,90%	2,18%	0,90%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	39.108.361,95	0,00	0,00	39.429.242,68	320.880,73	0,82%	1,18%	0,82%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	53.060.948,04	4.906.000,00	17.063.976,05	41.375.874,16	472.902,17	0,82%	0,27%	1,07%
BRADESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	11.011.406,91	0,00	0,00	11.100.993,02	89.586,11	0,81%	1,55%	0,81%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12.935.037,93	0,00	0,00	13.007.093,97	72.056,04	0,56%	3,00%	0,56%
Total Renda Fixa					2.909.246,54	1,02%	1,07%	

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

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	5.621.508,75	0,00	0,00	5.880.828,98	259.320,23	4,61%	11,37%	4,61%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	7.053.512,82	0,00	0,00	7.329.021,84	275.509,02	3,91%	10,83%	3,91%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.044.647,00	0,00	0,00	1.070.748,00	26.101,00	2,50%	5,55%	2,50%
CAIXA BRASIL IPCA VIII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.788.068,00	0,00	0,00	1.810.890,00	22.822,00	1,28%	0,05%	1,28%
CAIXA BRASIL IPCA III FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	3.639.782,00	0,00	0,00	3.683.938,00	44.156,00	1,21%	0,06%	1,21%
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	1.222.893,99	0,00	14.243,08	1.221.922,28	13.271,37	1,09%	-	-1,24%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	7.006.940,75	0,00	0,00	7.082.860,06	75.919,31	1,08%	9,32%	1,08%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	4.143.399,80	0,00	0,00	4.182.082,78	38.682,98	0,93%	1,09%	0,93%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	5.296.449,04	0,00	60.000,00	5.269.990,97	33.541,93	0,63%	-	-
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA FIP	965.846,71	0,00	0,00	965.967,80	121,09	0,01%	0,16%	0,01%
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	3.658.895,80	166.627,95	0,00	3.825.935,81	412,06	0,01%	0,12%	0,03%
Total Renda Variável					789.856,99	1,90%	6,24%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre / 2016

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	54.155.938,07	0,00	3.000,00	55.915.898,24	1.762.960,17	3,26%	3,26%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	54.615.656,65	13.948.672,11	28.792.476,05	41.375.874,16	1.604.021,45	2,77%	3,22%
BRABESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	22.889.834,91	0,00	0,00	24.248.504,61	1.358.669,70	5,94%	5,94%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	38.182.807,46	0,00	0,00	39.429.242,68	1.246.435,22	3,26%	3,26%
BRABESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	34.585.374,50	3.291.239,46	0,00	39.038.985,69	1.162.371,73	3,19%	3,22%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	20.902.761,83	0,00	0,00	21.583.995,96	681.234,13	3,26%	3,26%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12.453.216,34	0,00	0,00	13.007.093,97	553.877,63	4,45%	4,45%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	13.573.343,80	0,00	0,00	14.098.716,77	525.372,97	3,87%	3,87%
BTG PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA	11.914.656,00	0,00	340.773,66	11.961.559,00	387.676,66	3,29%	0,39%
BRABESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	11.012.990,46	0,00	291.239,46	11.100.993,02	379.242,02	3,47%	0,80%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	5.861.942,50	0,00	0,00	6.092.022,92	230.080,42	3,92%	3,92%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	5.903.429,55	0,00	5.957.464,14	54.034,59	0,92%	3,22%
Total Renda Fixa					9.945.976,69	3,56%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre / 2016

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	6.733.946,54	0,00	0,00	7.082.860,06	348.913,52	5,18%	5,18%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	5.261.138,95	0,00	160.500,00	5.269.990,97	169.352,02	3,22%	-
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	4.051.967,82	0,00	0,00	4.182.082,78	130.114,96	3,21%	3,21%
CAIXA BRASIL IPCA III FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	3.566.972,00	0,00	0,00	3.683.938,00	116.966,00	3,28%	3,28%
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPFF11	1.140.317,72	0,00	34.326,61	1.221.922,28	115.931,17	10,21%	7,50%
ITAÚ FOF RPI VALOR FIC AÇÕES	2.561.776,79	0,00	2.661.985,35	0,00	100.208,56	3,91%	7,62%
CAIXA BRASIL IPCA VIII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.753.189,00	0,00	0,00	1.810.890,00	57.701,00	3,29%	3,29%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.044.647,00	0,00	0,00	1.070.748,00	26.101,00	2,50%	2,50%
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA FIP	967.009,68	0,00	0,00	965.967,80	-1.041,88	-0,11%	-
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	3.661.056,12	166.627,95	0,00	3.825.935,81	-1.748,26	-0,05%	-
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	5.963.722,42	0,00	0,00	5.880.828,98	-82.893,44	-1,39%	-1,39%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	4.913.858,66	2.661.985,35	0,00	7.329.021,84	-246.822,17	-3,26%	-3,08%
Total Renda Variável					732.782,48	1,76%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre / 2016

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	51.171.599,11	293.084,89	3.000,00	55.915.898,24	4.454.214,24	8,65%	8,66%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	20.949.936,17	0,00	0,00	24.248.504,61	3.298.568,44	15,75%	15,75%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	44.729.769,43	42.949.294,82	49.433.249,89	41.375.874,16	3.130.059,80	5,61%	6,49%
BRDESCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	33.247.315,37	3.291.239,46	0,00	39.038.985,69	2.500.430,86	7,34%	7,38%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	44.384.508,24	0,00	46.565.860,48	0,00	2.181.352,24	4,91%	15,96%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.872.580,41	0,00	369.470,66	13.007.093,97	1.503.984,22	12,90%	12,94%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	12.660.231,27	0,00	0,00	14.098.716,77	1.438.485,50	11,36%	11,36%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	38.150.082,94	0,00	39.429.242,68	1.279.159,74	3,35%	8,36%
BRDESCO INSTITUCIONAL B VÉRTICE 2019 FI RENDA FIXA	10.343.230,85	0,00	291.239,46	11.100.993,02	1.049.001,63	10,16%	7,33%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIX...	19.921.775,14	0,00	20.832.327,46	0,00	910.552,32	4,57%	16,13%
BTG PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA	11.419.780,00	0,00	340.773,66	11.961.559,00	882.552,66	7,76%	4,74%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	0,00	20.834.317,83	0,00	21.583.995,96	749.678,13	3,60%	8,73%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	5.458.265,35	0,00	0,00	6.092.022,92	633.757,57	11,61%	11,61%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	5.903.429,55	0,00	5.957.464,14	54.034,59	0,92%	7,34%
Total Renda Fixa					24.065.831,94	9,02%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre / 2016

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	6.579.240,76	0,00	0,00	7.082.860,06	503.619,30	7,65%	7,65%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	5.115.544,72	0,00	260.500,00	5.269.990,97	414.946,25	8,20%	-
ITAÚ FOF RPI VALOR FIC AÇÕES	2.324.229,41	0,00	2.661.985,35	0,00	337.755,94	14,53%	18,62%
CAIXA BRASIL IPCA III FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	3.405.582,00	0,00	0,00	3.683.938,00	278.356,00	8,17%	8,17%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	0,00	3.997.273,84	0,00	4.182.082,78	184.808,94	4,62%	7,27%
BRASIL PLURAL ABSOLUTO FUNDO DE FUNDOS FII - BPF11	1.125.108,16	0,00	64.904,47	1.221.922,28	161.718,59	14,92%	-
CAIXA BRASIL IPCA VIII FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.671.209,00	0,00	0,00	1.810.890,00	139.681,00	8,36%	8,36%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.005.698,00	0,00	16.646,33	1.070.748,00	81.696,33	8,29%	6,47%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	1.638.430,16	0,00	1.672.041,34	0,00	33.611,18	2,05%	10,12%
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA FIP	1.245.182,24	0,00	275.468,56	965.967,80	-3.745,88	-0,38%	-
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	3.556.133,88	273.655,27	0,00	3.825.935,81	-3.853,34	-0,11%	-
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4.125.028,52	0,00	3.997.273,84	0,00	-127.754,68	-3,10%	19,84%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	5.222.106,06	0,00	5.068.959,68	0,00	-153.146,38	-2,93%	19,90%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	0,00	7.730.945,03	0,00	7.329.021,84	-401.923,19	-6,22%	-12,48%
GERAÇÃO FUTURO PROGRAMADO IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	4.878.851,09	1.672.041,34	0,00	5.880.828,98	-670.063,45	-11,68%	-12,26%
Total Renda Variável					775.706,61	1,88%	