

Carteira consolidada de investimentos - base (julho / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			9.317,94	0,01%			Artigo 20
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	9.340.455,52	5,49%	94	2,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2030	9.314.774,70	5,48%	25	4,64%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.976.810,75	2,34%	859	6,71%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2020	7.666.706,61	4,51%	122	0,72%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2016 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2016	1.692.027,00	0,99%	113	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	23.629.855,55	13,89%	167	1,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BTG PACTUAL TESOURO IPCA LONGO FI RENDA FIXA	D+2	Não há	4.997.155,38	2,94%	43	16,54%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	15.580.418,00	9,16%	97	2,75%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	10.123.490,79	5,95%	604	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2024	4.716.292,00	2,77%	17	2,83%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	5.507.643,23	3,24%	70	0,71%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	5.839.426,38	3,43%	6	13,63%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	421.917,14	0,25%	576	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BTG PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA	D+0 ou D+1	Não há	1.809.952,20	1,06%	12	1,27%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	5.423.599,54	3,19%	4	5,80%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.016.779,91	0,60%	39	0,13%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	500.559,48	0,29%	748	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2018	3.799.800,00	2,23%	163	0,30%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	430.103,61	0,25%	811	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	16/05/2023	12.105.207,00	7,12%	52	4,66%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CARTÃO DE COMPRAS SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	D+45 a D+75	Não há	3.950.766,29	2,32%	159	1,27%	Artigo 7º, Inciso VI

Carteira consolidada de investimentos - base (julho / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	2.234.811,34	1,31%	98	1,90%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
MAXIMUM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 7	Não se aplica	Não se aplica	85.976,13	0,05%	30	2,66%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	74.621,52	0,04%	46	0,09%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	4.898,27	0,00%	42	0,14%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
BNP PARIBAS MATCH FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	D+0	Não há	1.511.798,06	0,89%	649	0,04%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
VOTORANTIM PREMIUM BANKS FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+30	Não há	1.251.998,95	0,74%	55	0,12%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IPCA XIII FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+0	01/08/2016	296.402,55	0,17%	49	0,27%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+30 a D+2880	Não há	3.311.966,52	1,95%	51	1,05%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BB RPPS IPCA II FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	Término do Fundo	Não há	534.334,24	0,31%	25	0,60%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	2.538.393,63	1,49%	18	7,73%	Artigo 8º, Inciso I
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	356.680,65	0,21%	28	0,79%	Artigo 8º, Inciso III
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	1.559.827,59	0,92%	441	1,28%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	D+43	5 anos	227.879,66	0,13%	60	0,16%	Artigo 8º, Inciso III
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	3.426.624,97	2,01%	157	2,10%	Artigo 8º, Inciso III
BB PIPE FIC AÇÕES	D+4	03/06/2018	412.393,57	0,24%	48	0,43%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	23/08/2017	369.853,68	0,22%	116	0,11%	Artigo 8º, Inciso III
AZ LEGAN BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	1.005.703,29	0,59%	92	2,14%	Artigo 8º, Inciso III
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou D+33	Não há	1.866.726,51	1,10%	206	1,25%	Artigo 8º, Inciso III
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	D+33	Não há	723.567,59	0,43%	106	0,85%	Artigo 8º, Inciso III
VOTORANTIM ATUARIAL FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+361	Não há	4.391.705,21	2,58%	18	2,78%	Artigo 8º, Inciso IV
GERAÇÃO FUTURO FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	694.567,96	0,41%	2.771	0,45%	Artigo 8º, Inciso IV
BTG PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO I FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+31	Não há	2.682.673,52	1,58%	274	1,73%	Artigo 8º, Inciso IV

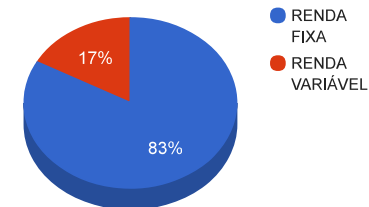
Carteira consolidada de investimentos - base (julho / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BRASIL ÓLEO & GÁS MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	323.189,92	0,19%			Artigo 8º, Inciso V
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	520.165,86	0,31%			Artigo 8º, Inciso V
BB VOTORANTIM INFRAESTRUTURA ENERGIA SUST II FIP - ESUD11	Não se aplica	Não se aplica	659.390,50	0,39%	136	0,40%	Artigo 8º, Inciso V
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	306.387,65	0,18%	40	0,13%	Artigo 8º, Inciso V
OURO PRETO DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - ORPD11	Não se aplica	Não se aplica	1.949.875,02	1,15%			Artigo 8º, Inciso VI
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRCR11	S/Info	Não se aplica	310.285,14	0,18%		0,02%	Artigo 8º, Inciso VI
KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII - KNRE11	Não se aplica	Não se aplica	1.157.461,62	0,68%			Artigo 8º, Inciso VI
GERAÇÃO FIAÇÕES	D+4	Não há	3.449.421,88	2,03%	149	2,38%	Desenquadrado - RV
		TOTAL -	170.092.642,02				

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

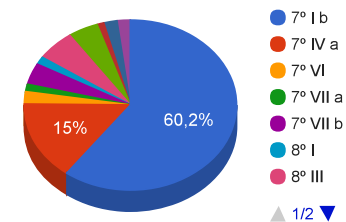
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	100,00%	102.385.055,91	60,19%	67.707.586,11
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	80,00%	0,00	0,00%	136.074.113,62
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	25.507.918,88	15,00%	25.519.873,73
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	3.950.766,29	2,32%	4.553.865,81
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	2.400.307,26	1,41%	6.104.324,84
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	6.906.500,32	4,06%	1.598.131,78
Total Renda Fixa	100,00%	225,00	141.150.548,66	82,98%	

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	3,00%	2.538.393,63	1,49%	2.564.385,63
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	14,00%	9.949.257,51	5,85%	13.863.712,37
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	7.768.946,69	4,57%	735.685,41
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	4,00%	1.809.133,93	1,06%	4.994.571,75
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	4,00%	3.417.621,78	2,01%	3.386.083,90
Desenquadrado - RV	0,00%	0,00%	3.449.421,88	2,03%	-3.449.421,88
Total Renda Variável	30,00%	30,00	28.932.775,42	17,01%	

Distribuição por Artigo / Resolução



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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5+	3,34%	24,86%	5,22%	23,37%	23,27%	36,66%	-	-	-
BTG PACTUAL TESOURO IPCA LONGO FI RENDA FIXA	3,31%	24,94%	5,36%	23,69%	23,27%	-	0,20%	2,882%	13,88%
IMA-B	2,51%	19,06%	4,38%	16,82%	20,53%	34,07%	-	-	-
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	2,57%	18,20%	4,20%	16,18%	19,85%	35,19%	0,15%	1,988%	9,82%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,52%	20,22%	5,22%	17,45%	15,44%	-	0,20%	2,503%	13,73%
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	2,52%	19,34%	4,25%	16,92%	19,73%	32,53%	0,50%	2,005%	-
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,23%	14,20%	3,55%	12,44%	12,20%	-	0,20%	1,938%	10,86%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,23%	14,56%	3,55%	12,76%	-	-	0,20%	1,940%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,99%	15,52%	3,08%	12,80%	-	-	0,20%	1,534%	-
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,60%	9,49%	2,64%	5,73%	9,85%	-	0,20%	1,347%	7,66%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,29%	10,16%	3,31%	7,60%	15,78%	-	0,20%	0,530%	3,27%
CAIXA BRASIL 2016 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,15%	5,37%	4,00%	3,74%	9,55%	-	0,20%	0,086%	4,20%
130% do CDI	1,44%	10,39%	4,46%	8,90%	18,59%	37,53%	-	-	-
MAXIMUM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 7	-7,88%	-95,30%	-87,33%	-95,36%	-96,21%	-	0,45%	7,932%	89,03%
CDI + 3,50% ao ano	1,40%	10,06%	4,32%	8,61%	17,97%	36,87%	-	-	-
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-0,11%	-5,75%	-0,60%	-4,23%	-2,45%	-7,98%	0,39%	0,283%	11,12%
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-3,68%	-17,70%	-6,75%	-12,41%	-33,07%	-64,07%	0,20%	2,037%	8,88%

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
115% do CDI	1,27%	9,14%	3,94%	7,83%	16,28%	32,57%	-	-	-
CARTÃO DE COMPRAS SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	1,27%	9,14%	3,94%	7,83%	16,28%	32,55%	0,20%	0,000%	0,00%
CDI	1,11%	7,90%	3,41%	6,78%	14,01%	27,78%	-	-	-
VOTORANTIM PREMIUM BANKS FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,14%	8,11%	3,50%	6,95%	14,39%	28,93%	0,15%	0,022%	0,05%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,13%	7,69%	3,37%	6,57%	13,85%	27,91%	0,20%	0,011%	0,17%
BNP PARIBAS MATCH FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	1,13%	8,01%	3,47%	6,86%	14,29%	28,37%	0,33%	0,007%	0,03%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,11%	7,91%	3,41%	6,79%	14,05%	27,92%	0,20%	0,009%	0,06%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,05%	7,39%	3,33%	6,34%	13,09%	25,82%	1,00%	0,011%	0,08%
IPCA + 6,00% ao ano	1,01%	8,54%	3,17%	6,68%	15,21%	33,82%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,28%	16,50%	3,26%	14,33%	18,83%	31,98%	0,15%	1,640%	9,14%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,25%	10,57%	2,95%	7,41%	16,11%	30,43%	0,15%	0,755%	4,03%
BB RPPS IPCA II FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,97%	8,54%	3,75%	5,98%	15,69%	30,79%	0,20%	0,573%	2,02%
BTG PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA	0,88%	5,66%	0,36%	4,13%	8,88%	15,60%	0,15%	0,020%	4,03%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,86%	5,71%	3,24%	4,15%	8,98%	19,32%	0,20%	0,027%	3,98%
101,50% do IPCA + 5,75% ao ano	1,00%	8,52%	3,16%	6,66%	15,16%	33,69%	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,37%	-4,25%	-1,36%	-5,11%	-4,41%	-13,06%	0,25%	1,067%	3,71%