

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
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			39.333,21	0,02%			Artigo 20
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	9.154.379,64	5,17%	94	2,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	11.845.822,34	6,69%	167	1,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	4.003.592,95	2,26%	983	6,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.052.700,01	1,72%	631	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	5.426.099,90	3,07%	70	0,71%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	16.098.441,85	9,10%	240	1,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BTG PACTUAL TESOURO IPCA LONGO FI RENDA FIXA	D+2	Não há	6.909.215,03	3,90%	93	19,32%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2020	5.635.528,90	3,18%	122	0,72%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	15.298.584,00	8,64%	97	2,59%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	10.294.716,10	5,82%	194	0,53%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2024	4.652.400,00	2,63%	17	2,83%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2030	9.184.313,60	5,19%	25	4,64%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	5.738.880,96	3,24%	6	13,63%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	368.449,14	0,21%	583	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BTG PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA	D+0 ou D+1	Não há	1.829.760,90	1,03%	12	1,27%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.022.824,01	1,71%	51	0,27%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	506.599,18	0,29%	763	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	5.469.091,14	3,09%	4	5,44%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2018	3.735.051,00	2,11%	163	0,30%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	435.497,18	0,25%	808	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	16/05/2023	12.269.649,93	6,93%	52	4,66%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "

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
CARTÃO DE COMPRAS SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	D+45 a D+75	Não há	4.005.964,00	2,26%	164	1,26%	Artigo 7º, Inciso VI
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	2.135.308,39	1,21%	98	1,90%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	5.027,03	0,00%	42	0,14%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
MAXIMUM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 7	Não se aplica	Não se aplica	84.877,59	0,05%	30	2,66%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	74.463,08	0,04%	1	0,09%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou D+30 a D+2880	Não há	3.360.027,86	1,90%	51	1,05%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BB RPPS IPCA II FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	Término do Fundo	Não há	542.566,95	0,31%	25	0,60%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
VOTORANTIM PREMIUM BANKS FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+30	Não há	1.267.532,18	0,72%	51	0,12%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BNP PARIBAS MATCH FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	D+0	Não há	1.530.713,66	0,86%	683	0,03%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	2.558.545,23	1,45%	18	7,73%	Artigo 8º, Inciso I
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	D+43	5 anos	228.315,36	0,13%	60	0,16%	Artigo 8º, Inciso III
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	D+33	Não há	703.731,60	0,40%	113	0,84%	Artigo 8º, Inciso III
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	1.529.432,41	0,86%	476	1,16%	Artigo 8º, Inciso III
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou D+33	Não há	1.808.077,16	1,02%	261	1,22%	Artigo 8º, Inciso III
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	3.487.397,49	1,97%	154	2,04%	Artigo 8º, Inciso III
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	358.731,83	0,20%	30	0,67%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	3.478.817,76	1,97%	148	2,37%	Artigo 8º, Inciso III
AZ LEGAN BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	1.009.821,88	0,57%	91	1,81%	Artigo 8º, Inciso III
BB PIPE FIC AÇÕES	D+4	03/06/2018	395.544,35	0,22%	48	0,43%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	23/08/2017	373.061,06	0,21%	116	0,11%	Artigo 8º, Inciso III
VOTORANTIM ATUARIAL FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+361	Não há	4.456.324,21	2,52%	18	2,78%	Artigo 8º, Inciso IV
GERAÇÃO FUTURO FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	700.647,86	0,40%	2.682	0,46%	Artigo 8º, Inciso IV

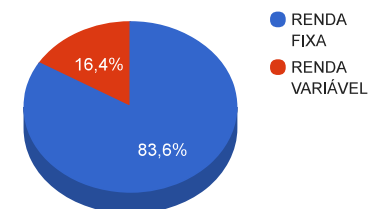
Carteira consolidada de investimentos - base (agosto / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
BTG PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO I FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+31	Não há	2.718.512,53	1,54%	273	1,80%	Artigo 8º, Inciso IV
BRASIL ÓLEO & GÁS MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	322.779,32	0,18%			Artigo 8º, Inciso V
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	286.588,25	0,16%	40	0,13%	Artigo 8º, Inciso V
BB VOTORANTIM INFRAESTRUTURA ENERGIA SUST II FIP - ESUD11	Não se aplica	Não se aplica	666.831,73	0,38%	134	0,40%	Artigo 8º, Inciso V
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	514.918,09	0,29%			Artigo 8º, Inciso V
KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII - KNRE11	Não se aplica	Não se aplica	1.161.284,35	0,66%			Artigo 8º, Inciso VI
OURO PRETO DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - ORPD11	Não se aplica	Não se aplica	1.954.484,61	1,10%			Artigo 8º, Inciso VI
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRCR11	S/Info	Não se aplica	308.012,94	0,17%		0,02%	Artigo 8º, Inciso VI
		TOTAL -	176.999.271,73				

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

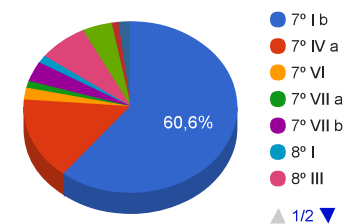
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	100,00%	107.294.675,28	60,62%	69.704.596,45
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	80,00%	0,00	0,00%	141.599.417,38
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	27.636.922,48	15,61%	25.462.859,04
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	4.005.964,00	2,26%	4.843.999,59
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	2.299.676,09	1,30%	6.550.287,50
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	6.700.840,65	3,79%	2.149.122,94
Total Renda Fixa	100,00%	225,00	147.938.078,50	83,58%	

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	3,00%	2.558.545,23	1,45%	2.751.432,92
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	14,00%	13.372.930,90	7,56%	11.406.967,14
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	7.875.484,60	4,45%	974.478,99
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	4,00%	1.791.117,39	1,01%	5.288.853,48
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	4,00%	3.423.781,90	1,93%	3.656.188,97
Total Renda Variável	30,00%	30,00	29.021.860,02	16,40%	

Distribuição por Artigo / Resolução



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
130% do CDI	1,58%	12,14%	4,60%	9,19%	18,75%	38,16%	-	-	-
MAXIMUM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 7	-1,28%	-95,36%	-31,16%	-95,48%	-96,31%	-95,71%	0,45%	1,478%	88,66%
CDI + 3,50% ao ano	1,53%	11,75%	4,46%	8,90%	18,13%	37,38%	-	-	-
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	2,63%	-15,54%	-1,89%	-9,01%	-27,25%	-62,03%	0,20%	9,028%	10,39%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-0,21%	-5,95%	-0,68%	-2,72%	-2,06%	-6,05%	0,39%	0,186%	11,08%
115% do CDI	1,40%	10,66%	4,06%	8,09%	16,42%	33,10%	-	-	-
CARTÃO DE COMPRAS SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	1,40%	10,67%	4,06%	8,09%	16,42%	33,09%	0,20%	0,000%	0,00%
IDKA IPCA 2 Anos	1,29%	10,97%	3,16%	5,69%	17,70%	31,48%	-	-	-
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 PREVIDENCIÁRIO	1,25%	9,04%	3,49%	6,87%	14,01%	28,38%	0,20%	0,021%	0,17%
BNP PARIBAS MATCH FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	1,25%	9,36%	3,61%	7,12%	14,41%	28,85%	0,33%	0,038%	0,04%
VOTORANTIM PREMIUM BANKS FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,24%	9,46%	3,61%	7,17%	14,49%	29,35%	0,15%	0,003%	0,05%
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%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,16%	8,63%	3,42%	6,60%	13,22%	26,27%	1,00%	0,016%	0,08%
IPCA + 6,00% ao ano	0,98%	9,60%	2,87%	6,29%	15,51%	34,14%	-	-	-
BB RPPS IPCA II FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,54%	10,21%	3,83%	6,89%	16,67%	31,38%	0,20%	0,453%	1,92%

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
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%
BTG PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA	1,09%	6,82%	3,13%	3,59%	9,06%	19,57%	0,15%	0,131%	4,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,05%	11,73%	3,25%	6,70%	18,38%	29,53%	0,15%	0,896%	3,86%
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,70%	3,91%	0,24%	3,61%	9,22%	19,92%	0,20%	4,347%	3,94%
101,50% do IPCA + 5,75% ao ano	0,97%	9,57%	2,85%	6,26%	15,47%	34,01%	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-4,45%	-8,52%	-4,90%	-8,21%	-8,34%	-14,58%	0,25%	5,173%	4,98%
IMA-B	0,89%	20,11%	5,41%	15,26%	25,51%	29,04%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,24%	16,95%	3,93%	10,80%	-	-	0,20%	1,464%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,86%	11,11%	3,21%	6,88%	17,72%	-	0,20%	0,869%	3,09%
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	0,84%	20,34%	5,38%	15,22%	25,17%	27,42%	0,50%	2,134%	9,38%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	0,67%	19,00%	5,00%	14,29%	24,94%	29,48%	0,15%	2,015%	9,51%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,35%	13,01%	1,58%	10,51%	18,10%	-	0,20%	4,850%	10,60%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,40%	18,53%	3,84%	16,70%	22,76%	-	0,20%	5,090%	13,42%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,48%	12,51%	1,45%	10,38%	17,41%	-	0,20%	5,034%	10,67%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,60%	4,88%	0,19%	3,26%	11,34%	-	0,20%	4,583%	5,70%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,81%	7,51%	0,44%	4,24%	13,26%	-	0,20%	5,224%	7,67%