

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
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			10.853,18	0,01%			Artigo 20
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	4.073.667,76	2,23%	1.027	6,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	12.011.375,25	6,56%	167	1,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	10.432.801,09	5,70%	200	0,48%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BTG PACTUAL TESOURO IPCA LONGO FI RENDA FIXA	D+2	Não há	8.284.796,77	4,53%	131	15,79%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	9.696.886,21	5,30%	237	0,72%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	5.050.256,97	2,76%	29	2,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	15.522.430,00	8,48%	97	2,55%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2030	9.244.951,10	5,05%	26	4,52%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2020	5.714.603,99	3,12%	122	0,72%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2024	4.704.696,00	2,57%	17	2,83%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	5.487.171,48	3,00%	70	0,71%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	5.818.439,54	3,18%	6	13,63%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.707.871,17	2,57%	639	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	9.275.848,72	5,07%	94	2,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	512.192,45	0,28%	760	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BTG PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA	D+0 ou D+1	Não há	1.844.535,30	1,01%	12	1,27%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.077.422,58	1,68%	52	0,27%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.738.604,03	0,95%	587	0,16%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2018	3.764.787,00	2,06%	164	0,30%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	16/05/2023	12.427.973,98	6,79%	52	4,66%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	440.351,36	0,24%	801	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "

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
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	6.826.232,65	3,73%	4	6,78%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CARTÃO DE COMPRAS SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	D+45 a D+75	Não há	4.057.036,01	2,22%	171	1,25%	Artigo 7º, Inciso VI
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	4.567,21	0,00%	1	0,14%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	2.070.823,81	1,13%	98	1,90%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
MAXIMUM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 7	Não se aplica	Não se aplica	84.352,51	0,05%	30	2,66%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	74.277,83	0,04%	1	0,09%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
VOTORANTIM PREMIUM BANKS FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+30	Não há	1.281.904,17	0,70%	47	0,16%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BNP PARIBAS MATCH FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	D+0	Não há	1.547.707,82	0,85%	702	0,03%	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	3.418.892,40	1,87%	51	1,05%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BB RPPS IPCA II FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	Término do Fundo	Não há	548.063,75	0,30%	25	0,60%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	2.582.532,30	1,41%	17	8,80%	Artigo 8º, Inciso I
BB PIPE FIC AÇÕES	D+4	03/06/2018	393.697,21	0,22%	48	0,43%	Artigo 8º, Inciso III
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	3.505.528,29	1,92%	155	1,78%	Artigo 8º, Inciso III
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou D+33	Não há	1.786.568,46	0,98%	282	1,17%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	D+43	5 anos	226.390,66	0,12%	60	0,16%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	3.514.273,53	1,92%	145	2,35%	Artigo 8º, Inciso III
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	D+33	Não há	693.393,41	0,38%	114	0,88%	Artigo 8º, Inciso III
AZ LEGAN BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	1.018.568,23	0,56%	91	1,77%	Artigo 8º, Inciso III
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	1.507.581,72	0,82%	475	1,12%	Artigo 8º, Inciso III
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	359.843,61	0,20%	29	0,69%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	23/08/2017	373.123,17	0,20%	116	0,11%	Artigo 8º, Inciso III
BTG PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO I FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+31	Não há	2.753.830,94	1,50%	281	1,09%	Artigo 8º, Inciso IV

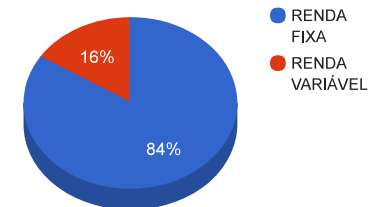
Carteira consolidada de investimentos - base (setembro / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
GERAÇÃO FUTURO FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	706.414,04	0,39%	2.581	0,48%	Artigo 8º, Inciso IV
VOTORANTIM ATUARIAL FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+361	Não há	4.514.713,39	2,47%	17	2,91%	Artigo 8º, Inciso IV
BRASIL ÓLEO & GÁS MULTISTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	322.453,18	0,18%			Artigo 8º, Inciso V
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	596.622,46	0,33%			Artigo 8º, Inciso V
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	284.988,05	0,16%	40	0,13%	Artigo 8º, Inciso V
BB VOTORANTIM INFRAESTRUTURA ENERGIA SUST II FIP - ESUD11	Não se aplica	Não se aplica	673.509,38	0,37%	134	0,40%	Artigo 8º, Inciso V
KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII - KNRE11	Não se aplica	Não se aplica	1.201.002,61	0,66%			Artigo 8º, Inciso VI
OURO PRETO DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - ORPD11	Não se aplica	Não se aplica	1.959.671,76	1,07%			Artigo 8º, Inciso VI
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRC11	S/Info	Não se aplica	316.030,56	0,17%		0,02%	Artigo 8º, Inciso VI
<b>TOTAL -</b>			<b>183.047.111,05</b>				

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

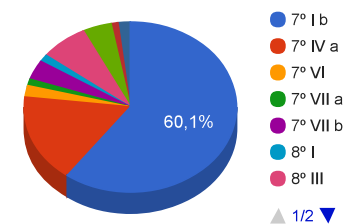
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	100,00%	110.025.796,05	60,11%	73.021.315,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	80,00%	0,00	0,00%	146.437.688,84
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	30.632.099,35	16,73%	24.282.033,97
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	4.057.036,01	2,22%	5.095.319,54
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	2.234.021,36	1,22%	6.918.334,19
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	6.796.568,14	3,71%	2.355.787,41
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>225,00</b>	<b>153.745.520,91</b>	<b>83,99%</b>	

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	3,00%	2.582.532,30	1,41%	2.908.881,03
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	14,00%	13.378.968,29	7,31%	12.247.627,26
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	7.974.958,37	4,36%	1.177.397,18
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	4,00%	1.877.573,07	1,03%	5.444.311,37
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	4,00%	3.476.704,93	1,90%	3.845.179,51
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>30,00</b>	<b>29.290.736,96</b>	<b>16,00%</b>	

Distribuição por Artigo / Resolução



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%	-	-	-
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%
BTG PACTUAL TESOIRO IPCA LONGO FI RENDA FIXA	1,64%	27,95%	5,80%	13,76%	34,36%	37,59%	0,20%	3,112%	10,21%
IMA Geral ex-C	1,59%	17,56%	4,35%	9,71%	21,74%	31,48%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,57%	-	-	-	-	-	0,30%	1,490%	-
IMA-B	1,57%	22,00%	5,04%	11,16%	28,36%	35,87%	-	-	-
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	1,76%	22,45%	5,19%	11,37%	28,50%	34,71%	0,50%	2,743%	7,30%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	1,75%	21,08%	5,07%	10,97%	27,56%	36,43%	0,15%	2,524%	7,44%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,46%	9,08%	1,22%	4,60%	14,98%	-	0,20%	1,260%	6,70%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,40%	12,66%	3,59%	7,28%	18,44%	-	0,20%	0,970%	2,50%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,34%	6,28%	0,70%	4,21%	12,34%	-	0,20%	0,462%	5,24%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,33%	18,51%	4,63%	9,24%	-	-	0,20%	1,775%	6,32%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,13%	13,78%	1,85%	7,28%	19,52%	-	0,20%	2,215%	8,78%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,12%	14,28%	1,97%	7,40%	20,22%	-	0,20%	2,215%	8,70%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,66%	19,32%	1,75%	9,00%	25,51%	-	0,20%	2,773%	10,48%
IDKA IPCA 2 Anos	1,50%	12,64%	3,74%	7,11%	18,43%	33,53%	-	-	-
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%

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
130% do CDI	1,44%	13,75%	4,53%	9,12%	18,75%	38,53%	-	-	-
MAXIMUM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 7	-0,62%	-95,39%	-9,62%	-95,57%	-96,39%	-95,79%	0,45%	0,510%	88,64%
CDI + 3,50% ao ano	1,40%	13,31%	4,39%	8,83%	18,13%	37,65%	-	-	-
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-0,25%	-6,19%	-0,57%	-1,40%	-0,21%	-4,84%	0,39%	0,190%	-
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-9,15%	-23,26%	-10,19%	-21,57%	-31,12%	-64,22%	0,20%	4,634%	10,71%
115% do CDI	1,27%	12,07%	4,00%	8,03%	16,42%	33,42%	-	-	-
CARTÃO DE COMPRAS SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	1,27%	12,08%	4,00%	8,03%	16,42%	33,40%	0,20%	0,000%	0,00%
CDI	1,11%	10,42%	3,47%	6,94%	14,13%	28,50%	-	-	-
VOTORANTIM PREMIUM BANKS FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,13%	10,70%	3,56%	7,12%	14,43%	29,54%	0,15%	0,009%	0,04%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,11%	10,26%	3,54%	6,88%	14,00%	28,66%	0,20%	0,027%	0,17%
BNP PARIBAS MATCH FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO	1,11%	10,58%	3,53%	7,06%	14,35%	29,09%	0,33%	0,006%	0,04%
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%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,04%	9,76%	3,29%	6,59%	13,23%	26,53%	1,00%	0,016%	0,08%
IPCA + 6,00% ao ano	0,57%	10,22%	2,57%	5,90%	14,98%	33,45%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,40%	13,30%	3,76%	7,34%	19,39%	32,25%	0,15%	0,808%	3,12%
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%