

Carteira consolidada de investimentos - base (dezembro / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			4.662,87	0,00%			Artigo 20
BTG PACTUAL TESOURO IPCA LONGO FI RENDA FIXA	D+2	Não há	9.385.753,15	4,85%	226	10,95%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	6.118.856,87	3,16%	55	1,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2030	9.471.839,30	4,89%	26	4,52%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	15.850.100,00	8,18%	107	1,78%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.792.062,85	2,47%	620	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	4.888.821,07	2,52%	117	1,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2024	4.790.964,00	2,47%	17	2,83%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	5.586.427,88	2,88%	72	0,68%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	5.943.288,51	3,07%	6	13,63%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	12.273.180,79	6,34%	167	1,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2020	5.840.067,25	3,02%	122	0,72%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	9.465.300,53	4,89%	94	2,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2018	10.658.139,15	5,50%	223	0,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	4.170.958,61	2,15%	1.188	6,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	7.320.034,58	3,78%	242	0,70%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	5.167.263,85	2,67%	46	3,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	7.889.765,76	4,07%	5	8,16%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	16/05/2023	12.319.000,27	6,36%	52	4,66%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.166.859,19	1,64%	62	0,26%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	528.787,93	0,27%	758	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BTG PACTUAL NTN-B FI RENDA FIXA	D+0 ou D+1	Não há	1.830.120,00	0,94%	12	1,27%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "

Carteira consolidada de investimentos - base (dezembro / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	4.604,81	0,00%	190	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	454.816,22	0,23%	787	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	283.899,79	0,15%	588	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2018	3.842.307,00	1,98%	163	0,30%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CARTÃO DE COMPRAS SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	D+45 a D+75	Não há	4.206.248,25	2,17%	184	1,23%	Artigo 7º, Inciso VI
MAXIMUM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 7	Não se aplica	Não se aplica	112.809,84	0,06%	35	2,66%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	20.908,71	0,01%	46	0,09%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	2.019.294,48	1,04%	98	1,90%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se aplica	Não se aplica	7.987,78	0,00%	42	0,14%	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	3.504.630,81	1,81%	50	1,06%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BB RPPS IPCA II FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	Término do Fundo	Não há	558.855,45	0,29%	25	0,60%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	2.665.046,85	1,38%	16	9,63%	Artigo 8º, Inciso I
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	3.761.353,28	1,94%	154	1,49%	Artigo 8º, Inciso III
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	1.543.460,68	0,80%	493	1,08%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS FIC AÇÕES	D+43	5 anos	201.732,11	0,10%	60	0,16%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	3.762.660,20	1,94%	137	2,61%	Artigo 8º, Inciso III
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	D+33	Não há	667.778,95	0,34%	119	0,72%	Artigo 8º, Inciso III
BB ALOCAÇÃO FIC AÇÕES PREVIDENCIÁRIO	D+4	Não há	365.565,12	0,19%	28	0,95%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET VALUATION FI AÇÕES	D+4	Não há	922.205,07	0,48%	8	3,91%	Artigo 8º, Inciso III
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou D+33	Não há	1.702.235,91	0,88%	319	0,96%	Artigo 8º, Inciso III
AZ LEGAN BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	1.053.839,68	0,54%	84	1,98%	Artigo 8º, Inciso III
BB PIPE FIC AÇÕES	D+4	03/06/2018	384.361,12	0,20%	43	0,43%	Artigo 8º, Inciso III

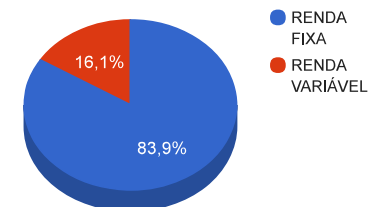
Carteira consolidada de investimentos - base (dezembro / 2016)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922 / 4.392 / 4.604
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	23/08/2017	371.351,73	0,19%	116	0,11%	Artigo 8º, Inciso III
BTG PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO I FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+31	Não há	2.873.342,31	1,48%	340	0,95%	Artigo 8º, Inciso IV
VOTORANTIM ATUARIAL FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+361	Não há	4.640.156,07	2,40%	17	2,91%	Artigo 8º, Inciso IV
GERAÇÃO FUTURO FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	731.081,97	0,38%	2.361	0,54%	Artigo 8º, Inciso IV
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	767.474,91	0,40%			Artigo 8º, Inciso V
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FICFIP	Não se aplica	Não se aplica	280.298,53	0,14%	40	0,13%	Artigo 8º, Inciso V
BRASIL ÓLEO & GÁS MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	321.508,74	0,17%			Artigo 8º, Inciso V
BB VOTORANTIM INFRAESTRUTURA ENERGIA SUST II FIP - ESUD11	Não se aplica	Não se aplica	691.482,43	0,36%			Artigo 8º, Inciso V
OURO PRETO DESENVOLVIMENTO IMOBILIÁRIO I FII - ORPD11	Não se aplica	Não se aplica	1.976.386,94	1,02%		6,90%	Artigo 8º, Inciso VI
KINEA II REAL ESTATE EQUITY FII - KNRE11	Não se aplica	Não se aplica	1.197.432,19	0,62%		0,62%	Artigo 8º, Inciso VI
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRCR11	S/Info	Não se aplica	309.246,42	0,16%		0,02%	Artigo 8º, Inciso VI
TOTAL -			193.668.618,76				

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

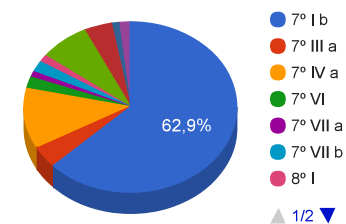
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	100,00%	121.723.058,39	62,85%	71.945.560,37
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	80,00%	7.889.765,76	4,07%	147.045.129,25
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	22.430.395,21	11,58%	35.670.190,42
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	5,00%	4.206.248,25	2,17%	5.477.182,69
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	5,00%	2.161.000,81	1,12%	7.522.430,13
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	5,00%	4.063.486,26	2,10%	5.619.944,68
Total Renda Fixa	100,00%	225,00	162.473.954,68	83,89%	

Distribuição por Segmento



Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	3,00%	2.665.046,85	1,38%	3.145.011,71
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	14,00%	14.736.543,85	7,61%	12.377.062,78
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	5,00%	8.244.580,35	4,26%	1.438.850,59
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	4,00%	2.060.764,61	1,06%	5.685.980,14
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	4,00%	3.483.065,55	1,80%	4.263.679,20
Total Renda Variável	30,00%	30,00	31.190.001,21	16,10%	

Distribuição por Artigo / Resolução



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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IMA-B 5+	3,71%	31,04%	2,33%	8,46%	31,04%	38,52%	-	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,71%	30,74%	2,24%	8,34%	30,74%	37,82%	0,20%	4,872%	10,46%
BTG PACTUAL TESOURO IPCA LONGO FI RENDA FIXA	3,65%	30,68%	2,14%	8,06%	30,68%	37,41%	0,20%	4,894%	10,53%
IMA-B	2,91%	24,81%	2,30%	7,46%	24,81%	35,90%	-	-	-
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3,34%	22,24%	2,45%	4,25%	22,24%	-	0,20%	4,487%	10,57%
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	3,06%	24,94%	2,03%	7,33%	24,94%	34,66%	0,50%	3,785%	7,79%
GERAÇÃO FUTURO IMA-B FIC RENDA FIXA	2,83%	23,98%	2,39%	7,58%	23,98%	35,93%	0,15%	3,648%	7,72%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,77%	16,37%	1,83%	3,84%	16,37%	-	0,20%	3,194%	8,54%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,74%	15,84%	1,81%	3,69%	15,84%	-	0,20%	3,199%	8,64%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,72%	20,93%	2,04%	6,76%	20,93%	-	0,20%	2,586%	6,11%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,55%	11,38%	2,11%	3,36%	11,38%	-	0,20%	1,959%	6,40%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,42%	15,11%	2,18%	5,84%	15,11%	-	0,20%	1,491%	2,60%
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,13%	8,58%	2,16%	2,88%	8,58%	-	0,20%	0,783%	4,98%
IRF-M 1+	2,11%	29,64%	3,51%	8,41%	29,64%	33,87%	-	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,08%	29,55%	3,50%	8,43%	29,55%	33,66%	0,20%	2,616%	5,62%
IMA Geral ex-C	1,93%	21,08%	3,00%	7,47%	21,08%	32,28%	-	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,93%	-	2,61%	-	-	-	0,30%	1,742%	-

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

	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
IDKA IPCA 5 Anos	1,76%	20,78%	2,10%	6,94%	20,78%	34,98%	-	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,76%	-	2,09%	6,92%	-	-	0,20%	2,531%	-
130% do CDI	1,46%	18,57%	4,23%	8,96%	18,57%	39,37%	-	-	-
MAXIMUM FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 7	-2,50%	-93,83%	33,74%	20,87%	-93,83%	-94,56%	0,45%	2,324%	103,56%
CDI + 3,50% ao ano	1,43%	17,97%	4,12%	8,69%	17,97%	38,23%	-	-	-
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	96,66%	34,21%	74,89%	57,07%	34,21%	-31,07%	0,20%	192,108%	119,93%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-2,33%	-73,59%	-71,85%	-72,01%	-73,59%	-64,62%	0,39%	1,145%	69,46%
115% do CDI	1,29%	16,26%	3,74%	7,88%	16,26%	34,13%	-	-	-
CARTÃO DE COMPRAS SUPPLIERCARD FIDC SÊNIOR	1,29%	16,27%	3,74%	7,89%	16,27%	34,12%	0,20%	0,002%	0,01%
IDKA IPCA 2 Anos	1,28%	15,21%	2,28%	6,11%	15,21%	34,09%	-	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,23%	14,94%	2,24%	6,02%	14,94%	32,76%	0,20%	1,023%	2,42%
CDI	1,12%	14,00%	3,24%	6,82%	14,00%	29,09%	-	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,13%	13,88%	3,28%	6,94%	13,88%	29,21%	0,20%	0,009%	0,17%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1,11%	14,00%	3,24%	6,81%	14,00%	29,18%	0,20%	0,016%	0,04%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,05%	13,11%	3,05%	6,44%	13,11%	27,10%	1,00%	0,007%	0,08%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	1,05%	13,05%	3,03%	6,38%	13,05%	26,96%	0,80%	0,001%	0,01%