

Relatório Analítico dos Investimentos em dezembro, 4º Trimestre e ano de 2015



Carteira consolidada de investimentos - base (dezembro / 2015)

Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	143.453,28	0,18%	1.165	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2020	1.016.906,73	1,28%	76	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	6.861.630,32	8,63%	277	0,66%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	8.867.401,60	11,15%	647	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2016 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2016	1.065.753,00	1,34%	132	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	8.757.655,99	11,01%	643	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2016 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2016	1.049.809,00	1,32%	154	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	2.979.578,80	3,75%	549	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	429.134,04	0,54%	1.280	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2016 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	16/08/2016	1.054.296,00	1,33%	104	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	9.779.239,16	12,30%	473	0,40%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	1.029.715,01	1,29%	167	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2018	5.221.135,52	6,56%	193	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	721.539,18	0,91%	18	0,45%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	2.680.844,06	3,37%	43	0,47%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B FI RENDA FIXA	D+31 ou D+1801	Não há	1.818.779,92	2,29%	13	3,31%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	3.168.797,83	3,98%	481	0,17%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRDESCO PREMIUM FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	4.510.307,36	5,67%	390	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS FIC REFERENCIADO DI	D+0	Não há	7.827.714,26	9,84%	158	1,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.904.743,66	3,65%	831	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	Não se aplica	Não se aplica	28.984,45	0,04%	11	1,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	975.842,59	1,23%	3.711	0,37%	Artigo 8º, Inciso III

Carteira consolidada de investimentos - base (dezembro / 2015)

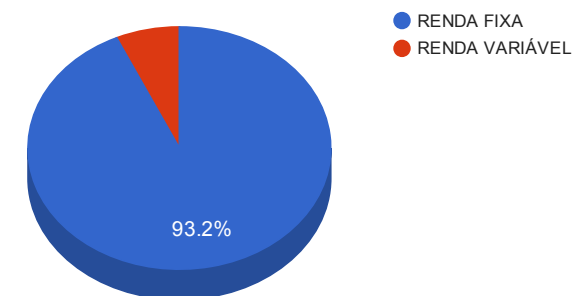
Produto / Fundo	Disponibilidade Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Qtde. Cotistas	% S/ PL Fundo	RESOLUÇÃO 3.922/2010 - 4.392/2014
ROMA AÇÕES FI AÇÕES	D+4	360 dias	187.178,77	0,24%	6	10,40%	Artigo 8º, Inciso III
ÁTICO GERAÇÃO DE ENERGIA FIP	Não se aplica	Não se aplica	2.448.454,37	3,08%	32	0,71%	Artigo 8º, Inciso V
ÁTICO RENDA FII - ATCR11	Não se aplica	Não se aplica	1.042.488,00	1,31%		7,58%	Artigo 8º, Inciso VI
LMX IMA-B FI RENDA FIXA	D+31 ou D+1461	Não há	2.205.804,11	2,77%	12	5,08%	Desenquadrado - RF
GÊNUS INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	D+31 ou D+1800	1800 dias	755.375,36	0,95%	1	5,20%	Desenquadrado - RV
		TOTAL	79.532.562,37				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010, 4.392/2014 e Política de Investimentos - base (dezembro / 2015)

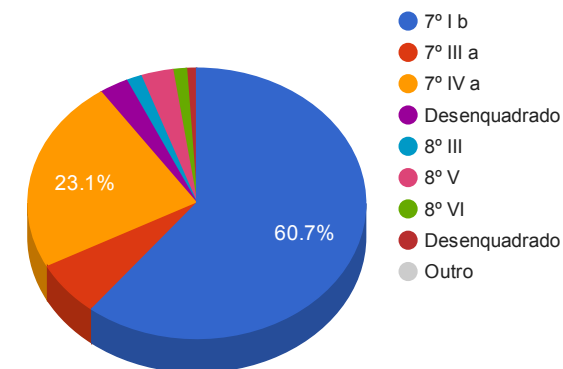
Artigos - Renda Fixa	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	80,00%	48.255.708,45	60,67%	15.370.341,45
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	80,00%	40,00%	5.221.163,16	6,56%	26.591.861,79
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	30,00%	30,00%	18.411.563,11	23,15%	5.448.205,60
Artigo 7º, Inciso VI	15,00%	11,00%	0,00	0,00%	8.748.581,86
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	2,00%	28.984,45	0,04%	1.561.666,80
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	2,00%	0,00	0,00%	1.590.651,25
Desenquadrado - RF	0,00%	0,00%	2.205.804,11	2,77%	-2.205.804,11
Total Renda Fixa	100,00%	165,00	74.123.223,28	93,20%	

Artigos - Renda Variável	Limite Resolução	Limite Política	Total Artigo	% Carteira	GAP Política
Artigo 8º, Inciso I	30,00%	5,00%	0,00	0,00%	3.976.628,12
Artigo 8º, Inciso III	15,00%	10,00%	1.163.021,36	1,46%	6.790.234,88
Artigo 8º, Inciso IV	5,00%	4,00%	0,00	0,00%	3.181.302,49
Artigo 8º, Inciso V	5,00%	5,00%	2.448.454,37	3,08%	1.528.173,75
Artigo 8º, Inciso VI	5,00%	5,00%	1.042.488,00	1,31%	2.934.140,12
Desenquadrado - RV	0,00%	0,00%	755.375,36	0,95%	-755.375,36
Total Renda Variável	30,00%	29,00	5.409.339,09	6,80%	

Distribuição por Segmento



Distribuição por Artigo / Resolução



Retorno dos investimentos de Renda Fixa - base (dezembro / 2015)

Ativos Renda Fixa	Benchmark	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	IMA-B	2,68%	-	5,41%	-	-	0,20%	1,536%	-
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B FI RENDA FIXA	IMA-B	2,30%	2,78%	6,72%	-1,94%	2,78%	1,30%	1,716%	9,68%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	IMA-B 5	2,10%	15,24%	5,17%	7,37%	15,24%	0,10%	0,823%	3,18%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	IMA-B	2,06%	-	5,13%	6,67%	-	0,20%	0,709%	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	IDKA IPCA 2 Anos	1,98%	15,38%	5,20%	7,57%	15,38%	0,20%	0,781%	2,87%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	IDKA IPCA 2 Anos	1,96%	15,50%	5,21%	7,68%	15,50%	0,20%	0,740%	2,78%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	IDKA IPCA 2 Anos	1,73%	-	4,88%	8,30%	-	0,20%	0,306%	-
CAIXA BRASIL 2016 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	IMA-B	1,67%	-	4,75%	5,41%	-	0,20%	0,225%	-
CAIXA BRASIL 2016 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	IMA-B	1,67%	-	4,75%	-	-	0,20%	0,224%	-
CAIXA BRASIL 2016 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	IMA-B	1,67%	-	4,74%	-	-	0,20%	0,224%	-
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	IMA-B	1,58%	10,40%	4,92%	2,86%	10,40%	0,45%	1,254%	6,71%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	IMA-B	1,48%	8,53%	5,08%	0,23%	8,53%	0,20%	1,453%	9,17%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	IMA-B	1,46%	7,27%	4,88%	-0,64%	7,27%	0,20%	1,406%	9,24%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	CDI	1,18%	13,46%	3,39%	6,98%	13,46%	0,20%	0,010%	0,07%
BRDESCO PREMIUM FI REFERENCIADO DI	Selic	1,16%	13,35%	3,36%	6,93%	13,35%	0,20%	0,013%	0,05%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	IRF-M 1	1,16%	12,76%	3,55%	6,92%	12,76%	0,20%	0,107%	0,50%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENC...	IRF-M 1	1,15%	12,58%	3,54%	6,82%	12,58%	0,10%	0,100%	0,52%
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS FIC REFERENCIADO DI	CDI	1,13%	12,89%	3,28%	6,74%	12,89%	0,30%	0,002%	0,05%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	CDI	1,13%	12,82%	3,28%	6,62%	12,82%	0,20%	0,082%	0,23%
LMX IMA-B FI RENDA FIXA	IMA-B	-1,08%	13,38%	3,82%	5,46%	13,38%	0,80%	7,980%	6,17%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	120% do CDI	-3,41%	-12,34%	-11,17%	-13,68%	-12,34%	0,00%	-	-
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	IMA-B 5	-7,71%	1,61%	-4,90%	-4,04%	1,61%	0,70%	10,953%	7,85%

Indicadores e Benchmark's de Renda Fixa - base (dezembro / 2015)

Indicadores - Renda Fixa	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses
IMA-B 5	2,12%	15,46%	5,23%	7,45%	15,46%
IDKA IPCA 2 Anos	1,89%	16,38%	5,14%	7,75%	16,38%
IMA-B	1,52%	8,88%	5,21%	0,50%	8,88%
IPCA + 6% a.a. (Meta Atuarial)	1,47%	17,26%	4,32%	7,37%	17,26%
120% do CDI	1,40%	16,09%	4,05%	8,34%	16,09%
IRF-M 1	1,18%	13,01%	3,60%	7,02%	13,01%
Selic	1,16%	13,27%	3,36%	6,91%	13,27%
CDI	1,16%	13,24%	3,36%	6,91%	13,24%

Retorno dos investimentos de Renda Variável - base (dezembro / 2015)

Ativos Renda Variável	Benchmark	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses	Taxa adm	VaR - Mês	Volatilidade - 12 meses
ROMA AÇÕES FI AÇÕES	Ibovespa	-2,05%	-16,73%	-15,61%	-14,62%	-16,73%	4,00%	50,648%	64,99%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	IDIV	-3,11%	-1,23%	-0,82%	-3,03%	-1,23%	3,00%	7,251%	18,65%
GÊNUS INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	Ibovespa	-3,67%	-12,42%	-3,45%	-16,23%	-12,42%	3,00%	9,922%	18,34%
ÁTICO RENDA FII - ATCR11	IFIX	-	-	-	-	-	1,20%	-	-
ÁTICO GERAÇÃO DE ENERGIA FIP	IPCA	-	-	-	-	-	1,50%	0,015%	39,67%

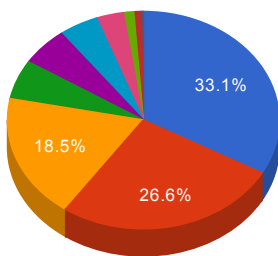
Indicadores e Benchmark's de Renda Variável - base (dezembro / 2015)

Indicadores - Renda Variável	Mês	Ano	3 meses	6 meses	12 meses
IPCA + 6% a.a. (Meta Atuarial)	1,47%	17,26%	4,32%	7,37%	17,26%
IPCA	0,96%	10,67%	2,82%	4,24%	10,67%
Ibovespa	-3,93%	-13,31%	-3,80%	-18,33%	-13,31%
IDIV	-3,75%	-27,45%	-5,33%	-23,76%	-27,45%
IFIX	-2,96%	5,46%	0,64%	-3,49%	5,46%

Distribuição dos ativos por Administradores e Sub-Segmentos - base (dezembro / 2015)

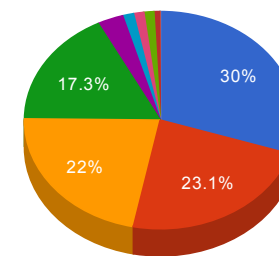
Administrador	Valor	%
Caixa Econômica Federal	26.321.591,75	33,10%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	21.146.027,87	26,59%
BANCO SANTANDER	14.689.344,58	18,47%
BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS	4.654.258,48	5,85%
BANCO BRADESCO	4.510.307,36	5,67%
GRADUAL INVESTIMENTOS	3.752.316,51	4,72%
BRIDGE TRUST	2.574.155,28	3,24%
GERAÇÃO FUTURO	975.842,59	1,23%
J SAFRA ASSET MANAGEMENT	721.539,18	0,91%
NSG CAPITAL	187.178,77	0,24%

- Caixa Econômica...
- BB GESTÃO DE RECUR...
- BANCO SANTANDER
- BNY MELLON S...
- BANCO BRADESCO
- GRADUAL INVESTIM...
- BRIDGE TRUST
- GERAÇÃO FUTURO
- J SAFRA ASSET MA...
- NSG CAPI...



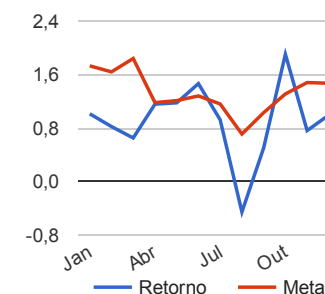
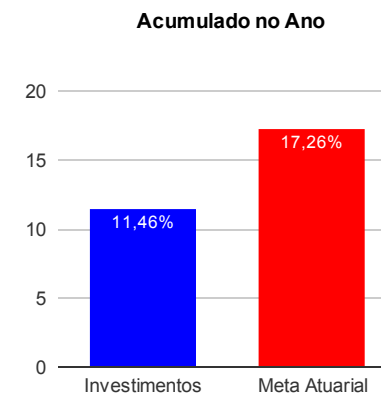
Sub-segmento	Valor	%
IDKA 2A	23.867.776,28	30,01%
CDI	18.411.563,11	23,15%
IMA-B	17.513.073,01	22,02%
IMA-B 5	13.729.239,11	17,26%
FIP	2.448.454,37	3,08%
FUNDO IMOBILIÁRIO	1.042.488,00	1,31%
AÇÕES - SETORIAIS	975.842,59	1,23%
AÇÕES - LIVRES	942.554,13	1,19%
IRF-M 1	572.587,32	0,72%
FIDC - FECHADO	28.984,45	0,04%

- IDKA 2A
- CDI
- IMA-B
- IMA-B 5
- FIP
- FUNDO IMOBILIÁRIO
- AÇÕES - SETORIAIS
- AÇÕES - LIVRES
- IRF-M 1
- Outro



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2015

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (\$)	Retorno (%)	Meta (%)	Gap (%)	VaR (%)
Janeiro	77.258.181,73	1.623.904,18	850.000,00	78.822.367,57	790.281,66	1,01%	1,73%	58,45%	1,00%
Fevereiro	78.822.367,57	3.640.222,39	2.750.000,00	80.368.054,31	655.464,35	0,82%	1,64%	50,07%	1,09%
Março	80.368.054,31	2.404.068,31	1.758.169,38	81.541.387,45	527.434,21	0,65%	1,84%	35,45%	1,05%
Abril	81.541.387,45	4.927.796,47	4.266.990,90	83.153.158,43	950.965,41	1,16%	1,18%	98,30%	0,93%
Mai	83.153.158,43	7.415.959,83	6.775.592,87	84.779.654,73	986.129,34	1,18%	1,21%	97,51%	0,98%
Junho	84.779.654,73	22.922.286,13	25.143.172,91	83.800.313,22	1.241.545,27	1,46%	1,28%	114,36%	0,82%
Julho	83.800.313,22	1.405.985,11	3.206.815,02	82.773.087,09	773.603,78	0,92%	1,16%	79,82%	1,32%
Agosto	82.773.087,09	5.520.075,18	7.168.940,57	80.746.608,01	-377.613,69	-0,46%	0,71%	-64,45%	1,63%
Setembro	80.746.608,01	5.353.264,18	7.020.154,06	79.485.156,29	405.438,16	0,50%	1,03%	48,78%	3,38%
Outubro	79.485.156,29	4.041.385,75	3.203.000,00	81.852.558,07	1.529.016,03	1,90%	1,31%	145,23%	1,77%
Novembro	81.852.558,07	1.052.035,28	3.207.000,00	80.321.235,42	623.642,07	0,76%	1,48%	51,54%	1,52%
Dezembro	80.321.235,42	6.725.678,06	8.313.202,40	79.532.562,37	798.851,29	0,99%	1,47%	67,43%	1,49%
Acumulado no ano					8.904.757,88	11,46%	17,26%	66,38%	
Acumulado no 4º Trimestre					2.951.509,39	3,70%	4,32%	85,58%	



Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de dezembro / 2015

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B FI RENDA FIXA	1.777.831,13	0,00	0,00	1.818.779,92	40.948,79	2,30%	1,72%	2,30%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	6.720.759,45	0,00	0,00	6.861.630,32	140.870,87	2,10%	0,82%	2,10%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.008.952,14	0,00	0,00	1.029.715,01	20.762,87	2,06%	0,71%	2,06%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.695.100,49	0,00	0,00	8.867.401,60	172.301,11	1,98%	0,78%	1,98%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.798.808,75	803.678,06	0,00	9.779.239,16	176.752,35	1,84%	0,74%	1,96%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.132.448,60	0,00	0,00	5.221.135,52	88.686,92	1,73%	0,31%	1,73%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	1.000.000,00	0,00	1.016.906,73	16.906,73	1,69%	1,54%	2,68%
CAIXA BRASIL 2016 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.036.989,00	0,00	0,00	1.054.296,00	17.307,00	1,67%	0,22%	1,67%
CAIXA BRASIL 2016 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.048.259,00	0,00	0,00	1.065.753,00	17.494,00	1,67%	0,22%	1,67%
CAIXA BRASIL 2016 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.032.588,00	0,00	0,00	1.049.809,00	17.221,00	1,67%	0,22%	1,67%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	710.286,21	0,00	0,00	721.539,18	11.252,97	1,58%	1,25%	1,58%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.936.208,12	0,00	0,00	2.979.578,80	43.370,68	1,48%	1,45%	1,48%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.631.647,53	0,00	0,00	8.757.655,99	126.008,46	1,46%	1,41%	1,46%
BRDESCO PREMIUM FI REFERENCIADO DI	4.458.438,96	0,00	0,00	4.510.307,36	51.868,40	1,16%	0,01%	1,16%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	424.206,31	0,00	0,00	429.134,04	4.927,73	1,16%	0,11%	1,16%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	141.817,16	0,00	0,00	143.453,28	1.636,12	1,15%	0,10%	1,15%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.059.234,06	0,00	931.682,00	3.168.797,83	41.245,77	1,02%	0,08%	1,13%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.844.099,03	0,00	5.000.000,00	2.904.743,66	60.644,63	0,77%	0,01%	1,18%
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS FIC REFERENCIADO DI	5.211.745,89	4.922.000,00	2.371.000,00	7.827.714,26	64.968,37	0,64%	0,00%	1,13%
LMX IMA-B FI RENDA FIXA	2.229.783,27	0,00	0,00	2.205.804,11	-23.979,16	-1,08%	7,98%	-1,08%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	30.008,00	0,00	0,00	28.984,45	-1.023,55	-3,41%	-	-
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2.904.892,88	0,00	0,00	2.680.844,06	-224.048,82	-7,71%	10,95%	-7,67%
Total Renda Fixa					866.123,24	1,16%	1,25%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de dezembro / 2015

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	VaR - Mês (%)	Instituição(%)
ÁTICO RENDA FII - ATCR11	1.047.626,15	0,00	10.520,40	1.042.488,00	5.382,25	0,51%	-	0,00%
ÁTICO GERAÇÃO DE ENERGIA FIP	2.456.478,74	0,00	0,00	2.448.454,37	-8.024,37	-0,33%	0,01%	-0,33%
ROMA AÇÕES FI AÇÕES	191.099,90	0,00	0,00	187.178,77	-3.921,13	-2,05%	50,65%	-2,05%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.007.121,14	0,00	0,00	975.842,59	-31.278,55	-3,11%	7,25%	-3,11%
GÊNUS INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	784.805,51	0,00	0,00	755.375,36	-29.430,15	-3,75%	9,92%	-3,75%
Total Renda Variável					-67.271,95	-1,23%	5,52%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre / 2015

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.428.768,76	0,00	0,00	8.867.401,60	438.632,84	5,20%	5,20%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.755.461,11	1.598.199,09	0,00	9.779.239,16	425.578,96	4,92%	5,21%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.349.783,94	0,00	0,00	8.757.655,99	407.872,05	4,88%	4,88%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	5.890.168,28	650.000,00	0,00	6.861.630,32	321.462,04	4,92%	5,17%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.859.295,76	1.990.900,00	7.200.000,00	2.904.743,66	254.547,90	2,76%	3,39%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.978.241,91	0,00	0,00	5.221.135,52	242.893,61	4,88%	4,88%
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS FIC REFERENCIADO DI	4.469.068,59	5.580.000,00	2.381.000,00	7.827.714,26	159.645,67	2,64%	3,28%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.954.404,10	0,00	1.931.682,00	3.168.797,83	146.075,73	3,15%	3,28%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.835.537,84	0,00	0,00	2.979.578,80	144.040,96	5,08%	5,08%
BRDESCO PREMIUM FI REFERENCIADO DI	3.367.317,94	1.000.000,00	0,00	4.510.307,36	142.989,42	3,27%	3,36%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B FI RENDA FIXA	1.704.205,17	0,00	0,00	1.818.779,92	114.574,75	6,72%	6,72%
LMX IMA-B FI RENDA FIXA	2.124.707,48	0,00	0,00	2.205.804,11	81.096,63	3,82%	3,82%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	979.451,86	0,00	0,00	1.029.715,01	50.263,15	5,13%	5,13%
CAIXA BRASIL 2016 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.017.458,00	0,00	0,00	1.065.753,00	48.295,00	4,75%	4,75%
CAIXA BRASIL 2016 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.006.514,00	0,00	0,00	1.054.296,00	47.782,00	4,75%	4,75%
CAIXA BRASIL 2016 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.002.268,00	0,00	0,00	1.049.809,00	47.541,00	4,74%	4,74%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	687.691,26	0,00	0,00	721.539,18	33.847,92	4,92%	4,92%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.401.878,36	0,00	1.000.000,00	429.134,04	27.255,68	3,53%	3,55%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.325.776,92	0,00	2.200.000,00	143.453,28	17.676,36	2,85%	3,54%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	1.000.000,00	0,00	1.016.906,73	16.906,73	1,69%	5,41%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	32.629,38	0,00	0,00	28.984,45	-3.644,93	-11,17%	-11,17%
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2.818.930,16	0,00	0,00	2.680.844,06	-138.086,10	-4,90%	-4,90%
Total Renda Fixa					3.027.247,37	4,08%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre / 2015

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
ÁTICO RENDA FII - ATCR11	1.042.144,45	0,00	10.520,40	1.042.488,00	10.863,95	1,04%	-
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	983.944,90	0,00	0,00	975.842,59	-8.102,31	-0,82%	-0,82%
ÁTICO GERAÇÃO DE ENERGIA FIP	2.464.653,13	0,00	0,00	2.448.454,37	-16.198,76	-0,66%	-
GÊNUS INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	783.042,80	0,00	0,00	755.375,36	-27.667,44	-3,53%	-3,45%
ROMA AÇÕES FI AÇÕES	221.812,19	0,00	0,00	187.178,77	-34.633,42	-15,61%	-15,61%
				Total Renda Variável	-75.737,98	-1,38%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no Ano de 2015

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.224.644,35	324.949,23	16.400.000,00	143.453,28	993.859,70	10,84%	12,58%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.486.786,37	8.375.924,09	12.887.966,99	2.904.743,66	930.000,19	12,23%	13,46%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.176.397,78	4.818.286,45	0,00	8.867.401,60	872.717,37	15,12%	15,38%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6.453.339,19	0,00	4.007.274,87	3.168.797,83	722.733,51	12,57%	12,82%
SANTANDER TÍTULOS PÚBLICOS FIC REFERENCIADO DI	6.136.532,43	19.131.869,92	18.114.815,02	7.827.714,26	674.126,93	10,66%	12,89%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,00	9.176.653,47	0,00	9.779.239,16	602.585,69	7,87%	15,50%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	8.164.008,99	0,00	0,00	8.757.655,99	593.647,00	7,27%	7,27%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.726.135,97	3.619.783,61	10.467.197,68	429.134,04	550.412,14	11,57%	12,76%
SANTANDER IMA B 5 TÍTULOS PUBLICOS FIC RENDA FIXA	0,00	6.406.807,95	0,00	6.861.630,32	454.822,37	7,64%	15,24%
BRDESCO PREMIUM FI REFERENCIADO DI	3.070.491,09	1.000.000,00	0,00	4.510.307,36	439.816,27	13,26%	13,35%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	4.966.365,76	114.549,29	5.221.135,52	369.319,05	9,51%	-
LMX IMA-B FI RENDA FIXA	1.945.525,22	0,00	0,00	2.205.804,11	260.278,89	13,38%	13,38%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	4.205.323,76	3.211.512,33	7.674.634,95	0,00	257.798,86	4,28%	12,58%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.745.496,04	0,00	0,00	2.979.578,80	234.082,76	8,53%	8,53%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	2.040.076,07	0,00	2.139.035,93	0,00	98.959,86	4,85%	12,76%
CAIXA BRASIL 2016 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	1.000.000,00	29.952,21	1.054.296,00	84.248,21	8,61%	-
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	653.565,48	0,00	0,00	721.539,18	67.973,70	10,40%	10,40%
CAIXA BRASIL 2016 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	1.000.000,00	0,00	1.065.753,00	65.753,00	6,58%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	1.000.000,00	29.005,78	1.029.715,01	58.720,79	6,04%	-
CAIXA BRASIL 2016 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	1.000.000,00	0,00	1.049.809,00	49.809,00	4,98%	-
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B FI RENDA FIXA	1.769.642,13	0,00	0,00	1.818.779,92	49.137,79	2,78%	2,78%
TOWER BRIDGE IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2.638.375,06	0,00	0,00	2.680.844,06	42.469,00	1,61%	1,61%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no Ano de 2015

Ativos de Renda Fixa	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,00	1.000.000,00	0,00	1.016.906,73	16.906,73	1,69%	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	33.063,88	0,00	0,00	28.984,45	-4.079,43	-12,34%	-12,34%
Total Renda Fixa					8.486.099,38	11,75%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no Ano de 2015

Ativos de Renda Variável	Sado Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	Instituição (%)
ÁTICO GERAÇÃO DE ENERGIA FIP	1.781.112,76	0,00	0,00	2.448.454,37	667.341,61	37,47%	-
ÁTICO RENDA FII - ATCR11	1.039.698,77	0,00	23.445,11	1.042.488,00	26.234,34	2,54%	-
HUMAITÁ EQUITY HEDGE FIC MULTIMERCADO	651.604,80	0,00	658.169,38	0,00	6.564,58	1,01%	11,46%
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES	0,00	1.000.508,06	0,00	975.842,59	-24.665,47	-2,47%	-1,23%
ROMA AÇÕES FI AÇÕES	224.773,93	0,00	0,00	187.178,77	-37.595,16	-16,73%	-16,73%
GÊNUS INSTITUCIONAL VALUE FI AÇÕES	863.179,89	0,00	0,00	755.375,36	-107.804,53	-12,49%	-12,42%
HUMAITÁ VALUE FI AÇÕES I	1.228.407,77	0,00	1.116.990,90	0,00	-111.416,87	-9,07%	-27,03%
Total Renda Variável					418.658,50	8,59%	

