



**DI BLASI**  
Consultoria Financeira

# IPASP - INST. PREV. ASSIST. SOCIAL FUNC. MUNIC. DE PIRACICABA.

Relatório Competência

11/2016

# VISÃO GERAL

| FUNDO  | DISP. DE RESGATE | SALDO R\$     | PARTICIPAÇÃO | QTDE. COTISTAS | % SOBRE PL DO FUNDO | PL DO FUNDO R\$  | RESOLUÇÃO      | GRAU DE RISCO |
|--|------------------|---------------|--------------|----------------|---------------------|------------------|----------------|---------------|
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO                   | D + 1            | 5.372.461,67  | 5,36 %       | 738            | 0,09 %              | 5.692.004.448,84 | Art 7º ,I, "b" | Baixo         |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO                   | D + 1            | 389.407,17    | 0,39 %       | 738            | 0,01 %              | 5.692.004.448,84 | Art 7º ,I, "b" | Baixo         |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO                    | D + 1            | 5.003.629,65  | 4,99 %       | 617            | 0,09 %              | 5.331.505.245,58 | Art 7º ,I, "b" | Médio         |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO                    | D + 1            | 6.769.538,49  | 6,75 %       | 617            | 0,13 %              | 5.331.505.245,58 | Art 7º ,I, "b" | Médio         |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI                                  | D + 0            | 1.845.504,68  | 1,84 %       | 1175           | 0,02 %              | 8.997.655.747,04 | Art 7º ,I, "b" | Baixo         |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI                                  | D + 0            | 2.182.712,94  | 2,18 %       | 1175           | 0,02 %              | 8.997.655.747,04 | Art 7º ,I, "b" | Baixo         |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO | D + 0            | 1.734.901,77  | 1,73 %       | 796            | 0,03 %              | 5.299.475.881,27 | Art 7º ,IV "a" | Baixo         |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO | D + 0            | 950.644,26    | 0,95 %       | 796            | 0,02 %              | 5.299.475.881,27 | Art 7º ,IV "a" | Baixo         |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IX FUNDO DE INVESTIMENTO                       | D + 0            | 798.536,85    | 0,80 %       | 193            | 0,23 %              | 342.148.092,56   | Art 7º ,I, "b" | Médio         |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII FUNDO DE INVESTIMENTO                      | D + 228          | 564.282,20    | 0,56 %       | 167            | 0,05 %              | 1.077.099.885,41 | Art 7º ,I, "b" | Médio         |
| BRDESCO FUNDO DE INVESTIMENTO REFERENCIADO DI PREMIUM  | D + 0            | 7.093.714,66  | 7,08 %       | 402            | 0,11 %              | 6.740.519.275,14 | Art 7º ,IV "a" | Baixo         |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2016 III TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA                      | D + 0            | 0,00          | 0,00 %       |                | 0,00 %              | 0,00             | Art 7º ,I, "b" | Médio         |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2016 V TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA                        | D + 0            | 0,00          | 0,00 %       |                | 0,00 %              | 0,00             | Art 7º ,I, "b" | Médio         |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2016 VI TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA                       | D + 0            | 0,00          | 0,00 %       |                | 0,00 %              | 0,00             | Art 7º ,I, "b" | Médio         |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA                       | D + 840          | 5.593.483,95  | 5,58 %       | 199            | 0,18 %              | 3.069.349.353,56 | Art 7º ,I, "b" | Médio         |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA                       | D + 0            | 1.115.367,72  | 1,11 %       | 107            | 0,14 %              | 817.863.068,60   | Art 7º ,I, "b" | Médio         |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO      | D + 0            | 10.506.557,57 | 10,48 %      | 628            | 0,27 %              | 3.920.493.354,72 | Art 7º ,I, "b" | Baixo         |

|   |        |              |        |      |         |                   |                  |       |
|---|--------|--------------|--------|------|---------|-------------------|------------------|-------|
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO             | D + 0  | 1.802.801,87 | 1,80 % | 628  | 0,05 %  | 3.920.493.354,72  | Art 7º ,I, "b"   | Baixo |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO                    | D + 0  | 0,00         | 0,00 % | 736  | 0,00 %  | 4.695.513.366,94  | Art 7º ,I, "b"   | Médio |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO                    | D + 0  | 6.082.718,43 | 6,07 % | 736  | 0,13 %  | 4.695.513.366,94  | Art 7º ,I, "b"   | Médio |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO                    | D + 0  | 24.958,60    | 0,02 % | 736  | 0,00 %  | 4.695.513.366,94  | Art 7º ,I, "b"   | Médio |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA                              | D + 0  | 3.881.731,06 | 3,87 % | 1346 | 0,03 %  | 11.370.896.051,98 | Art 7º ,I, "b"   | Baixo |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA                              | D + 0  | 3.236.556,29 | 3,23 % | 1346 | 0,03 %  | 11.370.896.051,98 | Art 7º ,I, "b"   | Baixo |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO                          | D + 0  | 8.838,93     | 0,01 % | 453  | 0,00 %  | 1.929.411.757,18  | Art 7º , IV "a"  | Baixo |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO                          | D + 0  | 2.371.632,91 | 2,37 % | 453  | 0,12 %  | 1.929.411.757,18  | Art 7º , IV "a"  | Baixo |
| FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B                                    | D + 1  | 2.149.586,18 | 2,14 % | 14   | 2,43 %  | 88.599.397,46     | Art 7º , III "a" | Médio |
| GENUS INSTITUCIONAL VALUE FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES  | D + 4  | 869.942,02   | 0,87 % | 10   | 5,20 %  | 16.721.258,99     | Art 8º , III     | Alto  |
| GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES  | D + 4  | 939.032,66   | 0,94 % | 3010 | 0,36 %  | 260.265.006,66    | Art 8º , III     | Alto  |
| GERAÇÃO FUTURO JURO REAL - IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO                       | D + 1  | 1.878.714,42 | 1,87 % | 1159 | 2,90 %  | 64.803.699,90     | Art 7º ,I, "b"   | Médio |
| LMX IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA  | D + 31 | 2.484.211,32 | 2,48 % | 13   | 2,11 %  | 117.979.467,24    | Art 7º , III "a" | Médio |
| ROMA AÇÕES FI DE AÇÕES  | D + 4  | 178.431,23   | 0,18 % | 6    | 10,40 % | 1.715.445,77      | Art 8º , III     | Alto  |
| SAFRA IMA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA                       | D + 0  | 860.065,46   | 0,86 % | 20   | 0,27 %  | 318.867.441,29    | Art 7º ,I, "b"   | Médio |
| SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TÍTULOS PUBLICOS RENDA FIXA  | D + 1  | 6.678.634,32 | 6,66 % | 368  | 0,42 %  | 1.584.955.687,70  | Art 7º ,I, "b"   | Médio |
| SANTANDER FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO TITULOS PUBLICOS REFERENCIADO DI | D + 0  | 22.730,75    | 0,02 % | 144  | 0,00 %  | 685.096.330,48    | Art 7º , IV "a"  | Baixo |
| SANTANDER FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO TITULOS PUBLICOS REFERENCIADO DI | D + 0  | 853.894,26   | 0,85 % | 144  | 0,12 %  | 685.096.330,48    | Art 7º , IV "a"  | Baixo |

|   |       |               |         |     |        |                |                 |       |
|---|-------|---------------|---------|-----|--------|----------------|-----------------|-------|
| SANTANDER FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO TITULOS PUBLICOS REFERENCIADO DI | D + 0 | 12.622.042,73 | 12,59 % | 144 | 1,84 % | 685.096.330,48 | Art 7º , IV "a" | Baixo |
| TOWER BRIDGE RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5   | D + 1 | 0,00          | 0,00 %  | 38  | 0,00 % | 544.212.352,08 | Art 7º, III "a" | Médio |
| FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL   | D + 0 | 24.359,68     | 0,02 %  | 20  | 0,31 % | 7.838.877,59   | Art 7º , VI     | Alto  |
| ÁTICO GERAÇÃO DE ENERGIA - FIP  | D + 0 | 2.413.596,74  | 2,41 %  | 33  | 0,71 % | 341.829.103,14 | Art 8º , V      | Alto  |
| ÁTICO RENDA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FII   | D + 0 | 951.363,59    | 0,95 %  | 33  | 1,08 % | 88.423.848,44  | Art 8º , VI     | Alto  |
| TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5  | D + 1 | 0,00          | 0,00 %  | 33  | 0,00 % | 114.497.463,97 | Art 7º, III "a" | Médio |

**TOTAL SALDO:** R\$ 100.256.587,03

# ENQUADRAMENTO

| RENDA FIXA - ARTIGOS | LIMITE DA RESOLUÇÃO | LIMITE POLÍTICA | TOTAL         | % CARTEIRA |
|----------------------|---------------------|-----------------|---------------|------------|
| Art 7º, I, "b"       | 100 %               | 70 %            | 64.587.663,34 | 64,42      |
| Art 7º, III "a"      | 80 %                | 15 %            | 4.633.797,50  | 4,62       |
| Art 7º, IV "a"       | 30 %                | 30 %            | 25.658.400,27 | 25,59      |
| Art 7º, VI           | 15 %                | 5 %             | 24.359,68     | 0,02       |

| RENDA VARIÁVEL - ARTIGOS                             | LIMITE DA RESOLUÇÃO | LIMITE POLÍTICA | TOTAL        | % CARTEIRA |
|--|---------------------|-----------------|--------------|------------|
| Fundos de investimentos em Ações - Art 8º, III       | 15 %                | 10 %            | 1.987.405,91 | 1,98       |
| Fundos de investimentos em participações - Art 8º, V | 5 %                 | 5 %             | 2.413.596,74 | 2,41       |
| Fundo de Investimento Imobiliário - Art 8º, VI       | 5 %                 | 5 %             | 951.363,59   | 0,95       |

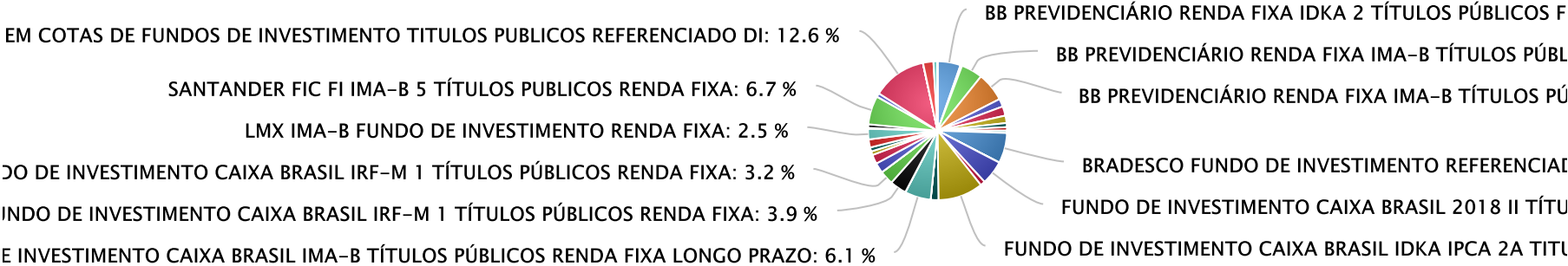
| DISTRIBUIÇÃO POR PARÂMETRO DE RENTABILIDADE | TOTAL         | % CARTEIRA |
|---|---------------|------------|
| AÇÕES                                       | 1.987.405,91  | 1,98       |
| CDI   | 25.658.400,27 | 25,59      |
| FIDC  | 24.359,68     | 0,02       |
| FIP   | 2.413.596,74  | 2,41       |
| IDKA 2                                      | 18.869.765,13 | 18,82      |
| IMA-B                                       | 30.376.970,24 | 30,30      |
| IMA-B 5                                     | 8.828.220,50  | 8,81       |
| IMOBILIARIO                                 | 951.363,59    | 0,95       |
| IRF-M1                                      | 11.146.504,97 | 11,12      |

| DISTRIBUIÇÃO POR INSTITUIÇÃO FINANCEIRA   | TOTAL        | % CARTEIRA |
|---|--------------|------------|
| FOCO DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA.   CNPJ: 00329598000167      | 2.149.586,18 | 2,14       |
| ICLA TRUST DISTRIBUIDORA DE TITULOS E VALORES MOBILIARIOS S.A.   CNPJ: 10274584000147 | 178.431,23   | 0,18       |
| BRIDGE ADMINISTRADORA DE RECURSOS LTDA.   CNPJ: 11010779000142                        | 869.942,02   | 0,87       |

|   |               |       |
|---|---------------|-------|
| BNY MELLON SERVICOS FINANCEIROS DTVM S.A.   CNPJ: 2201501000161 | 4.897.808,06  | 4,89  |
| GERAÇÃO FUTURO CORRETORA DE VALORES S/A   CNPJ: 27652684000162  | 2.817.747,08  | 2,81  |
| BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A   CNPJ: 30822936000169           | 25.611.619,68 | 25,55 |
| GRADUAL CCTVM S/A   CNPJ: 33918160000173                        | 975.723,27    | 0,97  |
| CAIXA ECONOMICA FEDERAL   CNPJ: 360305000104                    | 34.624.647,33 | 34,54 |
| JS ADMINISTRACAO DE RECURSOS S/A   CNPJ: 43826833000119         | 860.065,46    | 0,86  |
| BANCO BRADESCO S.A.   CNPJ: 60746948000112                      | 7.093.714,66  | 7,08  |
| BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.   CNPJ: 90400888000142            | 20.177.302,06 | 20,13 |

# DISTRIBUIÇÃO

## Visão Geral – Fundos de Investimento



# RETORNOS

| FUNDO  | SALDO ANTERIOR   | APLICAÇÕES       | RESGATES         | SALDO ATUAL       | RETORNO R\$    | RETORNO %  | EFETIVO %  |
|--|------------------|------------------|------------------|-------------------|----------------|------------|------------|
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO                   | R\$ 5.343.859,84 | R\$ 0,00         | R\$ 0,00         | R\$ 5.372.461,67  | R\$ 28.601,83  | 0,53523 %  | 0,53523 %  |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO                   | R\$ 387.334,05   | R\$ 0,00         | R\$ 0,00         | R\$ 389.407,17    | R\$ 2.073,12   | 0,53523 %  | 0,53523 %  |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO                    | R\$ 5.067.321,57 | R\$ 0,00         | R\$ 0,00         | R\$ 5.003.629,65  | R\$ -63.691,92 | -1,25691 % | -1,25691 % |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO                    | R\$ 6.855.708,92 | R\$ 0,00         | R\$ 0,00         | R\$ 6.769.538,49  | R\$ -86.170,43 | -1,25691 % | -1,25691 % |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI                                  | R\$ 1.826.889,69 | R\$ 0,00         | R\$ 0,00         | R\$ 1.845.504,68  | R\$ 18.614,99  | 1,01895 %  | 1,01895 %  |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI                                  | R\$ 2.160.696,64 | R\$ 0,00         | R\$ 0,00         | R\$ 2.182.712,94  | R\$ 22.016,30  | 1,01895 %  | 1,01895 %  |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO | R\$ 1.716.896,09 | R\$ 0,00         | R\$ 0,00         | R\$ 1.734.901,77  | R\$ 18.005,68  | 1,04874 %  | 1,04874 %  |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO | R\$ 4.667.807,65 | R\$ 349.035,44   | R\$ 4.100.000,00 | R\$ 950.644,26    | R\$ 33.801,17  | 1,04874 %  | 1,04874 %  |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IX FUNDO DE INVESTIMENTO                       | R\$ 793.135,21   | R\$ 0,00         | R\$ 0,00         | R\$ 798.536,85    | R\$ 5.401,64   | 0,68105 %  | 0,68105 %  |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII FUNDO DE INVESTIMENTO                      | R\$ 562.595,97   | R\$ 0,00         | R\$ 0,00         | R\$ 564.282,20    | R\$ 1.686,23   | 0,29972 %  | 0,29972 %  |
| BRDESCO FUNDO DE INVESTIMENTO REFERENCIADO DI PREMIUM  | R\$ 7.014.983,13 | R\$ 0,00         | R\$ 0,00         | R\$ 7.093.714,66  | R\$ 78.731,53  | 1,12233 %  | 1,12233 %  |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2016 III TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA                      | R\$ 0,00         | R\$ 0,00         | R\$ 0,00         | R\$ 0,00          | R\$ 0,00       | -          | -          |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2016 V TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA                        | R\$ 0,00         | R\$ 0,00         | R\$ 0,00         | R\$ 0,00          | R\$ 0,00       | -          | -          |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2016 VI TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA                       | R\$ 0,00         | R\$ 0,00         | R\$ 0,00         | R\$ 0,00          | R\$ 0,00       | -          | -          |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA                       | R\$ 2.755.107,28 | R\$ 2.800.000,00 | R\$ 0,00         | R\$ 5.593.483,95  | R\$ 38.376,67  | 0,61972 %  | 0,69084 %  |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA                       | R\$ 1.114.207,19 | R\$ 0,00         | R\$ 0,00         | R\$ 1.115.367,72  | R\$ 1.160,53   | 0,10416 %  | 0,10416 %  |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO      | R\$ 9.458.908,64 | R\$ 993.658,97   | R\$ 0,00         | R\$ 10.506.557,57 | R\$ 53.989,96  | 0,57078 %  | 0,51652 %  |



|   |                  |                |          |                  |                 |             |             |
|---|------------------|----------------|----------|------------------|-----------------|-------------|-------------|
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO             | R\$ 1.123.476,13 | R\$ 672.913,11 | R\$ 0,00 | R\$ 1.802.801,87 | R\$ 6.412,63    | 0,57078 %   | 0,57078 %   |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO                    | R\$ 0,00         | R\$ 0,00       | R\$ 0,00 | R\$ 0,00         | R\$ 0,00        | -1,16541 %  | -1,16541 %  |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO                    | R\$ 6.154.443,17 | R\$ 0,00       | R\$ 0,00 | R\$ 6.082.718,43 | R\$ -71.724,74  | -1,16541 %  | -1,16541 %  |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO                    | R\$ 25.252,90    | R\$ 0,00       | R\$ 0,00 | R\$ 24.958,60    | R\$ -294,30     | -1,16541 %  | -1,16541 %  |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA                              | R\$ 3.842.338,97 | R\$ 0,00       | R\$ 0,00 | R\$ 3.881.731,06 | R\$ 39.392,09   | 1,02521 %   | 1,02521 %   |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA                              | R\$ 3.203.711,49 | R\$ 0,00       | R\$ 0,00 | R\$ 3.236.556,29 | R\$ 32.844,80   | 1,02521 %   | 1,02521 %   |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO                          | R\$ 8.749,55     | R\$ 0,00       | R\$ 0,00 | R\$ 8.838,93     | R\$ 89,38       | 1,02147 %   | 1,02147 %   |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO                          | R\$ 2.347.652,32 | R\$ 0,00       | R\$ 0,00 | R\$ 2.371.632,91 | R\$ 23.980,59   | 1,02147 %   | 1,02147 %   |
| FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B                                    | R\$ 2.138.584,98 | R\$ 0,00       | R\$ 0,00 | R\$ 2.149.586,18 | R\$ 11.001,20   | 0,63486 %   | 0,63486 %   |
| GENUS INSTITUCIONAL VALUE FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES  | R\$ 919.250,70   | R\$ 0,00       | R\$ 0,00 | R\$ 869.942,02   | R\$ -49.308,68  | -5,36401 %  | -5,36401 %  |
| GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES  | R\$ 1.054.745,08 | R\$ 0,00       | R\$ 0,00 | R\$ 939.032,66   | R\$ -115.712,42 | -10,97065 % | -10,97065 % |
| GERAÇÃO FUTURO JURO REAL - IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO                       | R\$ 1.903.086,66 | R\$ 0,00       | R\$ 0,00 | R\$ 1.878.714,42 | R\$ -24.372,24  | -1,28067 %  | -1,28067 %  |
| LMX IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA  | R\$ 2.495.355,76 | R\$ 0,00       | R\$ 0,00 | R\$ 2.484.211,32 | R\$ -11.144,44  | -0,36096 %  | -0,36096 %  |
| ROMA AÇÕES FI DE AÇÕES  | R\$ 202.463,19   | R\$ 0,00       | R\$ 0,00 | R\$ 178.431,23   | R\$ -24.031,96  | -11,86979 % | -11,86979 % |
| SAFRA IMA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA                       | R\$ 871.017,30   | R\$ 0,00       | R\$ 0,00 | R\$ 860.065,46   | R\$ -10.951,84  | -1,25736 %  | -1,25736 %  |
| SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TÍTULOS PUBLICOS RENDA FIXA  | R\$ 6.652.697,11 | R\$ 0,00       | R\$ 0,00 | R\$ 6.678.634,32 | R\$ 25.937,21   | 0,38988 %   | 0,38988 %   |
| SANTANDER FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO TITULOS PUBLICOS REFERENCIADO DI | R\$ 22.503,67    | R\$ 0,00       | R\$ 0,00 | R\$ 22.730,75    | R\$ 227,08      | 1,00910 %   | 1,00910 %   |
| SANTANDER FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO TITULOS PUBLICOS REFERENCIADO DI | R\$ 746.362,76   | R\$ 100.000,00 | R\$ 0,00 | R\$ 853.894,26   | R\$ 7.531,50    | 1,00910 %   | 0,88987 %   |

|   |                    |                  |                  |                    |                |            |            |
|---|--------------------|------------------|------------------|--------------------|----------------|------------|------------|
| SANTANDER FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO TITULOS PUBLICOS REFERENCIADO DI | R\$ 12.431.596,06  | R\$ 65.000,00    | R\$ 0,00         | R\$ 12.622.042,73  | R\$ 125.446,67 | 1,00910 %  | 1,00385 %  |
| TOWER BRIDGE RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5   | R\$ 2.225.161,27   | R\$ 0,00         | R\$ 2.226.611,53 | R\$ 0,00           | R\$ 1.450,26   | 0,20771 %  | 0,20771 %  |
| FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL   | R\$ 24.994,21      | R\$ 0,00         | R\$ 0,00         | R\$ 24.359,68      | R\$ -634,53    | -2,53870 % | -2,53870 % |
| ÁTICO GERAÇÃO DE ENERGIA - FIP  | R\$ 2.416.564,88   | R\$ 0,00         | R\$ 0,00         | R\$ 2.413.596,74   | R\$ -2.968,14  | -0,12282 % | -0,12282 % |
| ÁTICO RENDA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FII   | R\$ 951.911,60     | R\$ 0,00         | R\$ 0,00         | R\$ 951.363,59     | R\$ -548,01    | -0,05757 % | -0,05757 % |
| TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5  | R\$ 616.437,55     | R\$ 0,00         | R\$ 608.609,60   | R\$ 0,00           | R\$ -7.827,95  | -0,96723 % | -0,96723 % |
| TOTAIS  | R\$ 102.103.809,18 | R\$ 4.980.607,52 | R\$ 6.935.221,13 | R\$ 100.256.587,03 | R\$ 107.391,46 | 0,1278 %   | 0,1244 %   |

# RETORNOS ACUMULADO

| MÊS       | SALDO ANTERIOR     | APLICAÇÕES        | RESGATES          | SALDO ATUAL        | RETORNO R\$       | RETORNO % | META % | ATINGIMENTO % |
|-----------|--------------------|-------------------|-------------------|--------------------|-------------------|-----------|--------|---------------|
| JANEIRO   | R\$ 79.533.189,53  | R\$ 466.365,66    | R\$ 5.917.602,46  | R\$ 75.446.407,99  | R\$ 1.364.455,26  | 1,7229 %  | 1,76 % | 97,73 %       |
| FEVEREIRO | R\$ 75.446.407,99  | R\$ 8.596.513,31  | R\$ 7.795.896,57  | R\$ 77.165.724,18  | R\$ 918.699,45    | 1,2246 %  | 1,39 % | 88,02 %       |
| MARÇO     | R\$ 77.165.724,18  | R\$ 1.811.575,81  | R\$ 5.010.766,96  | R\$ 75.097.639,07  | R\$ 1.131.106,04  | 1,4718 %  | 0,92 % | 160,17 %      |
| ABRIL     | R\$ 75.097.639,07  | R\$ 9.948.263,12  | R\$ 9.201.000,00  | R\$ 77.159.937,26  | R\$ 1.315.035,07  | 1,7091 %  | 1,10 % | 155,40 %      |
| MAIO      | R\$ 77.159.937,26  | R\$ 4.489.020,64  | R\$ 4.020.039,04  | R\$ 78.092.393,27  | R\$ 463.474,41    | 0,6168 %  | 1,27 % | 48,54 %       |
| JUNHO     | R\$ 78.092.393,27  | R\$ 4.044.783,91  | R\$ 7.025.000,00  | R\$ 75.983.468,24  | R\$ 871.291,06    | 1,1052 %  | 0,84 % | 131,81 %      |
| JULHO     | R\$ 75.983.468,24  | R\$ 6.217.639,88  | R\$ 5.835.659,35  | R\$ 77.525.769,90  | R\$ 1.160.321,13  | 1,6416 %  | 1,01 % | 162,65 %      |
| AGOSTO    | R\$ 77.525.769,90  | R\$ 15.539.109,22 | R\$ 15.733.828,43 | R\$ 78.093.067,50  | R\$ 762.016,81    | 1,0288 %  | 0,93 % | 110,76 %      |
| SETEMBRO  | R\$ 78.093.067,50  | R\$ 27.215.021,81 | R\$ 4.260.000,00  | R\$ 102.270.250,89 | R\$ 1.222.161,58  | 1,2215 %  | 0,57 % | 215,35 %      |
| OUTUBRO   | R\$ 102.270.250,89 | R\$ 5.286.970,00  | R\$ 6.301.393,37  | R\$ 102.103.809,18 | R\$ 847.981,66    | 0,7894 %  | 0,75 % | 105,52 %      |
| NOVEMBRO  | R\$ 102.103.809,18 | R\$ 4.980.607,52  | R\$ 6.935.221,13  | R\$ 100.256.587,03 | R\$ 107.391,46    | 0,1244 %  | 0,67 % | 18,62 %       |
| TOTAIS    |                    | R\$ 88.595.870,88 | R\$ 78.036.407,31 |                    | R\$ 10.163.933,93 | 13,40     | 11,78  | 113,67        |

# MEDIDA DE RISCO

**GESTÃO DE RISCO - MERCADO:** O valor dos ativos que compõem a carteira do fundo pode aumentar ou diminuir de acordo com flutuações de preços e cotações de mercado, mudanças no cenário político e econômico, alterações nas taxas de juros e, ainda, com os resultados das empresas emissoras de valores mobiliários (ações, debêntures, notas promissórias, entre outros).

**Índice Sharpe:** O índice de Sharpe é uma medida que permite a classificação do fundo em termos de desempenho global, sendo considerados melhores os fundos com maior índice. Vale lembrar ainda que o índice varia se o resultado for calculado com base em rentabilidades semanais, mensais ou anuais.

**VaR - Value at Risk:** *Value-at-risk* ou Valor sob Risco pode ser definido como perda máxima, num determinado período, sob condições normais de mercado, com determinado grau de confiança.

| FUNDO  | BENCHMARK | VAR 12 MESES | SHARPE  | VOLATILIDADE 3 MESES | VOLATILIDADE 6 MESES | VOLATILIDADE 12 MESES |
|--|-----------|--------------|---------|----------------------|----------------------|-----------------------|
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO                   | IDKA 2    | 0,24 %       | -0,49 % | 2,37 %               | 1,95 %               | 2,31%                 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO                   | IDKA 2    | 0,24 %       | -0,49 % | 2,37 %               | 1,95 %               | 2,31%                 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO                    | IMA-B     | 0,77 %       | 1,27 %  | 8,18 %               | 6,58 %               | 7,47%                 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO                    | IMA-B     | 0,77 %       | 1,27 %  | 8,18 %               | 6,58 %               | 7,47%                 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI                                  | IRF-M1    | 0,03 %       | 0,06 %  | 0,41 %               | 0,33 %               | 0,32%                 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI                                  | IRF-M1    | 0,03 %       | 0,06 %  | 0,41 %               | 0,33 %               | 0,32%                 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO | CDI       | 0,02 %       | -0,63 % | 0,04 %               | 0,05 %               | 0,17%                 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO | CDI       | 0,02 %       | -0,63 % | 0,04 %               | 0,05 %               | 0,17%                 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IX FUNDO DE INVESTIMENTO                       | IDKA 2    | 0,13 %       | -1,20 % | 1,78 %               | 1,53 %               | 1,22%                 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII FUNDO DE INVESTIMENTO                      | IMA-B     | 0,27 %       | -0,10 % | 3,40 %               | 2,76 %               | 2,61%                 |
| BRDESCO FUNDO DE INVESTIMENTO REFERENCIADO DI PREMIUM  | CDI       | 0,01 %       | 4,43 %  | 0,07 %               | 0,07 %               | 0,05%                 |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2016 III TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA                      | IMA-B     | 0,00 %       | 0,00 %  | 0,00 %               | 0,00 %               | 0,00%                 |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2016 V TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA                        | IMA-B     | 0,00 %       | 0,00 %  | 0,00 %               | 0,00 %               | 0,00%                 |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2016 VI TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA                       | IMA-B     | 0,00 %       | 0,00 %  | 0,00 %               | 0,00 %               | 0,00%                 |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA                       | IMA-B     | 0,49 %       | -1,40 % | 1,86 %               | 4,38 %               | 4,83%                 |

|   |         |        |         |         |         |        |
|---|---------|--------|---------|---------|---------|--------|
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA                              | IMA-B   | 0,65 % | -0,69 % | 4,20 %  | 5,71 %  | 6,29%  |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO             | IDKA 2  | 0,23 % | -0,43 % | 2,29 %  | 1,89 %  | 2,25%  |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO             | IDKA 2  | 0,23 % | -0,43 % | 2,29 %  | 1,89 %  | 2,25%  |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO                    | IMA-B   | 0,77 % | 1,28 %  | 8,14 %  | 6,55 %  | 7,46%  |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO                    | IMA-B   | 0,77 % | 1,28 %  | 8,14 %  | 6,55 %  | 7,46%  |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO                    | IMA-B   | 0,77 % | 1,28 %  | 8,14 %  | 6,55 %  | 7,46%  |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA                              | IRF-M1  | 0,03 % | 0,33 %  | 0,39 %  | 0,32 %  | 0,31%  |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA                              | IRF-M1  | 0,03 % | 0,33 %  | 0,39 %  | 0,32 %  | 0,31%  |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO                          | CDI     | 0,01 % | -0,80 % | 0,06 %  | 0,05 %  | 0,09%  |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO                          | CDI     | 0,01 % | -0,80 % | 0,06 %  | 0,05 %  | 0,09%  |
| FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B                                    | IMA-B 5 | 0,00 % | 0,00 %  | 0,00 %  | 0,00 %  | 0,00%  |
| GENUS INSTITUCIONAL VALUE FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES  | AÇÕES   | 0,00 % | 0,00 %  | 0,00 %  | 0,00 %  | 0,00%  |
| GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES  | AÇÕES   | 2,24 % | -0,07 % | 23,93 % | 21,41 % | 21,78% |
| GERAÇÃO FUTURO JURO REAL - IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO                       | IMA-B   | 0,81 % | 1,19 %  | 8,39 %  | 6,87 %  | 7,88%  |
| LMX IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA  | IMA-B   | 0,53 % | 0,04 %  | 5,66 %  | 5,23 %  | 5,16%  |
| ROMA AÇÕES FI DE AÇÕES  | AÇÕES   | 6,58 % | 0,28 %  | 17,11 % | 55,02 % | 63,15% |
| SAFRA IMA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA                       | IMA-B   | 0,75 % | 1,05 %  | 8,61 %  | 6,90 %  | 7,25%  |
| SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TÍTULOS PUBLICOS RENDA FIXA  | IMA-B 5 | 0,26 % | -0,28 % | 2,91 %  | 2,35 %  | 2,48%  |
| SANTANDER FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO TITULOS PUBLICOS REFERENCIADO DI | CDI     | 0,00 % | -3,91 % | 0,02 %  | 0,02 %  | 0,02%  |
| SANTANDER FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO TITULOS PUBLICOS REFERENCIADO DI | CDI     | 0,00 % | -3,91 % | 0,02 %  | 0,02 %  | 0,02%  |

|   |             |        |           |         |         |        |
|---|-------------|--------|-----------|---------|---------|--------|
| SANTANDER FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO TITULOS PUBLICOS REFERENCIADO DI | CDI         | 0,00 % | -3,91 %   | 0,02 %  | 0,02 %  | 0,02%  |
| TOWER BRIDGE RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5   | IMA-B 5     | 0,68 % | -1,11 %   | 3,89 %  | 3,13 %  | 6,67%  |
| FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL   | FIDC        | 0,00 % | -0,63 %   | 41,90 % | 48,55 % | 41,67% |
| ÁTICO GERAÇÃO DE ENERGIA - FIP  | FIP         | 0,00 % | -579,90 % | 0,01 %  | 0,01 %  | 0,02%  |
| ÁTICO RENDA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FII   | IMOBILIARIO | 0,89 % | -2,34 %   | 0,45 %  | 0,53 %  | 8,99%  |
| TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5  | IMA-B 5     | 0,68 % | -1,11 %   | 3,89 %  | 3,13 %  | 6,67%  |

# PROVISÃO DE RISCO - INDICATIVO

| FUNDO  | CNPJ               | BENCHMARK | SALDO (R\$)   | VAR 12 MESES | VOLATILIDADE 12 MESES | VAR% BASE 1 DIA CONFIANÇA 95% 252 DU* (R\$) |
|--|--------------------|-----------|---------------|--------------|-----------------------|---|
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO                   | 13.322.205/0001-35 | IDKA 2    | 5.372.461,67  | 0,60 %       | 2,48 %                | 32.234,77                                   |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO                   | 13.322.205/0001-35 | IDKA 2    | 389.407,17    | 0,60 %       | 2,48 %                | 2.336,44                                    |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO                    | 07.442.078/0001-05 | IMA-B     | 5.003.629,65  | 0,70 %       | 6,76 %                | 35.025,41                                   |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO                    | 07.442.078/0001-05 | IMA-B     | 6.769.538,49  | 0,70 %       | 6,76 %                | 47.386,77                                   |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI                                  | 11.328.882/0001-35 | IRF-M1    | 1.845.504,68  | 0,04 %       | 0,35 %                | 738,20                                      |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI                                  | 11.328.882/0001-35 | IRF-M1    | 2.182.712,94  | 0,04 %       | 0,35 %                | 873,09                                      |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO | 13.077.418/0001-49 | CDI       | 1.734.901,77  | 0,02 %       | 0,17 %                | 346,98                                      |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO | 13.077.418/0001-49 | CDI       | 950.644,26    | 0,02 %       | 0,17 %                | 190,13                                      |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IX FUNDO DE INVESTIMENTO                       | 20.734.937/0001-06 | IDKA 2    | 798.536,85    | 0,11 %       | 1,05 %                | 878,39                                      |
| BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII FUNDO DE INVESTIMENTO                      | 19.523.305/0001-06 | IMA-B     | 564.282,20    | 0,24 %       | 2,35 %                | 1.354,28                                    |
| BRDESCO FUNDO DE INVESTIMENTO REFERENCIADO DI PREMIUM  | 03.399.411/0001-90 | CDI       | 7.093.714,66  | 0,00 %       | 0,04 %                | 0,00  |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2016 III TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA                      | 21.919.240/0001-64 | IMA-B     | 0,00          | 0,00 %       | 0,00 %                | 0,00  |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2016 V TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA                        | 21.922.168/0001-24 | IMA-B     | 0,00          | 0,00 %       | 0,00 %                | 0,00  |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2016 VI TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA                       | 22.791.300/0001-79 | IMA-B     | 0,00          | 0,00 %       | 0,00 %                | 0,00  |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA                       | 19.768.733/0001-07 | IMA-B     | 5.593.483,95  | 0,52 %       | 5,12 %                | 29.086,12                                   |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA                       | 21.919.953/0001-28 | IMA-B     | 1.115.367,72  | 0,66 %       | 6,45 %                | 7.361,43                                    |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO      | 14.386.926/0001-71 | IDKA 2    | 10.506.557,57 | 0,25 %       | 2,41 %                | 26.266,39                                   |

|   |                    |         |               |        |         |           |
|---|--------------------|---------|---------------|--------|---------|-----------|
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO             | 14.386.926/0001-71 | IDKA 2  | 1.802.801,87  | 0,25 % | 2,41 %  | 4.507,00  |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO                    | 10.740.658/0001-93 | IMA-B   | 0,00          | 0,70 % | 6,79 %  | 0,00      |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO                    | 10.740.658/0001-93 | IMA-B   | 6.082.718,43  | 0,70 % | 6,79 %  | 42.579,03 |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO                    | 10.740.658/0001-93 | IMA-B   | 24.958,60     | 0,70 % | 6,79 %  | 174,71    |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA                              | 10.740.670/0001-06 | IRF-M1  | 3.881.731,06  | 0,04 % | 0,35 %  | 1.552,69  |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA                              | 10.740.670/0001-06 | IRF-M1  | 3.236.556,29  | 0,04 % | 0,35 %  | 1.294,62  |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO                          | 05.164.356/0001-84 | CDI     | 8.838,93      | 0,01 % | 0,12 %  | 0,88      |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO                          | 05.164.356/0001-84 | CDI     | 2.371.632,91  | 0,01 % | 0,12 %  | 237,16    |
| FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B                                    | 15.153.656/0001-11 | IMA-B 5 | 2.149.586,18  | 0,00 % | 0,00 %  | 0,00      |
| GENUS INSTITUCIONAL VALUE FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES  | 15.769.621/0001-01 | AÇÕES   | 869.942,02    | 0,00 % | 0,00 %  | 0,00      |
| GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES  | 11.898.349/0001-09 | AÇÕES   | 939.032,66    | 2,23 % | 21,64 % | 20.940,43 |
| GERAÇÃO FUTURO JURO REAL - IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO                       | 19.419.157/0001-84 | IMA-B   | 1.878.714,42  | 0,74 % | 7,15 %  | 13.902,49 |
| LMX IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA  | 13.594.673/0001-69 | IMA-B   | 2.484.211,32  | 0,69 % | 6,77 %  | 17.141,06 |
| ROMA AÇÕES FI DE AÇÕES  | 11.357.758/0001-06 | AÇÕES   | 178.431,23    | 7,52 % | 72,42 % | 13.418,03 |
| SAFRA IMA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA                       | 10.787.822/0001-18 | IMA-B   | 860.065,46    | 0,64 % | 6,21 %  | 5.504,42  |
| SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TÍTULOS PUBLICOS RENDA FIXA  | 13.455.117/0001-01 | IMA-B 5 | 6.678.634,32  | 0,26 % | 2,51 %  | 17.364,45 |
| SANTANDER FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO TITULOS PUBLICOS REFERENCIADO DI | 04.682.022/0001-30 | CDI     | 22.730,75     | 0,00 % | 0,00 %  | 0,00      |
| SANTANDER FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO TITULOS PUBLICOS REFERENCIADO DI | 04.682.022/0001-30 | CDI     | 853.894,26    | 0,00 % | 0,00 %  | 0,00      |
| SANTANDER FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO TITULOS PUBLICOS REFERENCIADO DI | 04.682.022/0001-30 | CDI     | 12.622.042,73 | 0,00 % | 0,00 %  | 0,00      |
| TOWER BRIDGE RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5   | 12.845.801/0001-37 | IMA-B 5 | 0,00          | 0,99 % | 9,75 %  | 0,00      |



|  |                    |             |              |        |        |        |
|--|--------------------|-------------|--------------|--------|--------|--------|
| FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL        | 08.927.488/0001-09 | FIDC        | 24.359,68    | 0,00 % | 0,00 % | 0,00   |
| ÁTICO GERAÇÃO DE ENERGIA - FIP                           | 11.490.580/0001-69 | FIP         | 2.413.596,74 | 0,01 % | 0,05 % | 241,36 |
| ÁTICO RENDA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FII      | 14.631.148/0001-39 | IMOBILIARIO | 951.363,59   | 0,00 % | 0,00 % | 0,00   |
| TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5 | 23.954.899/0001-87 | IMA-B 5     | 0,00         | 0,68 % | 6,67 % | 0,00   |

**Saldo Total:** R\$ 100.256.587,03

**Provisão para perda e Investimentos** R\$ 322.936,73

# CAPITAL PROTEGIDO

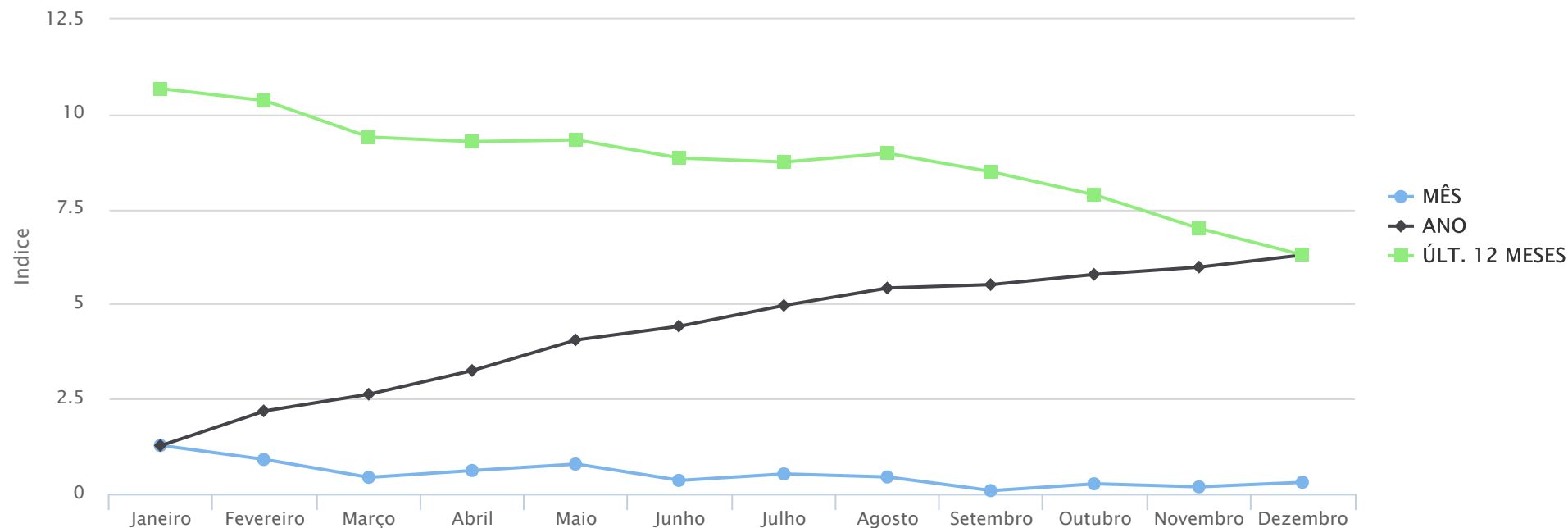
| TIPO DE PRODUTO E PERCENTUAL DO CAPITAL INVESTIDO PROTEGIDO  | TIPO DE PRODUTO PERCENTUAL DO CAPITAL |
|--|---------------------------------------|
| INVESTIDO PROTEGIDO  | INVESTIDO PROTEGIDO (Até)             |
| Títulos Públicos Federais/ Carteira Própria  | 100%                                  |
| Fundos de Investimento Referenciado e Renda Fixa 100% Títulos Públicos Federais (previsto no regulamento do fundo) | 100%                                  |
| Fundos de Investimento Referenciado e Renda Fixa (50% de títulos públicos federais)                                | 50%                                   |
| Fundos de Investimentos Crédito Privado  | 0%                                    |
| FIDC   | 0%                                    |
| Fundos de Ações  | 0%                                    |
| Fundos de Índices - ETF  | 0%                                    |
| Fundos Multimercados   | 0%                                    |
| Fundos Imobiliários  | 0%                                    |
| Fundos de Participação   | 0%                                    |

PERCENTUAL MÍNIMO DE ALOCAÇÃO DA CARTEIRA TOTAL DO RPPS EM PRODUTOS COM CAPITAL INVESTIDO PROTEGIDO: 80% do Patrimônio Líquido do RPPS, apurado concomitantemente na data de fechamento dos dados para envio do DAIR ao Ministério da Previdência Social - MPS.

# ÍNDICES ECONÔMICOS

## IPCA

2016

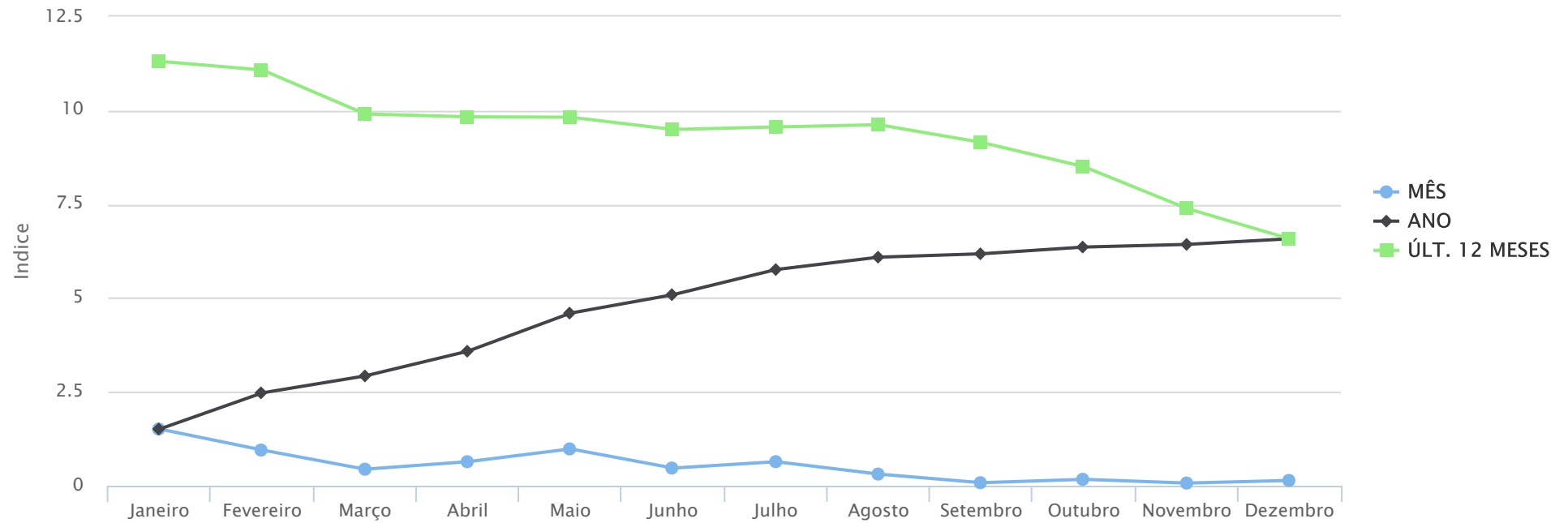


Highcharts.com

| 2016      | Janeiro | Fevereiro | Março  | Abril  | Mai    | Junho  | Julho  | Agosto | Setembro | Outubro | Novembro | Dezembro |
|-----------|---------|-----------|--------|--------|--------|--------|--------|--------|----------|---------|----------|----------|
| MÊS       | 1.2700  | 0.9000    | 0.4300 | 0.6100 | 0.7800 | 0.3500 | 0.5200 | 0.4400 | 0.0800   | 0.2600  | 0.1800   | 0.3000   |
| ANO       | 1.2700  | 2.1814    | 2.6208 | 3.2468 | 4.0521 | 4.4163 | 4.9600 | 5.4200 | 5.5100   | 5.7800  | 5.9700   | 6.2900   |
| ULT. 12 M | 10.6735 | 10.3563   | 9.3969 | 9.2783 | 9.3217 | 8.8445 | 8.7400 | 8.9700 | 8.4800   | 7.8700  | 6.9900   | 6.2900   |

# INPC

2016

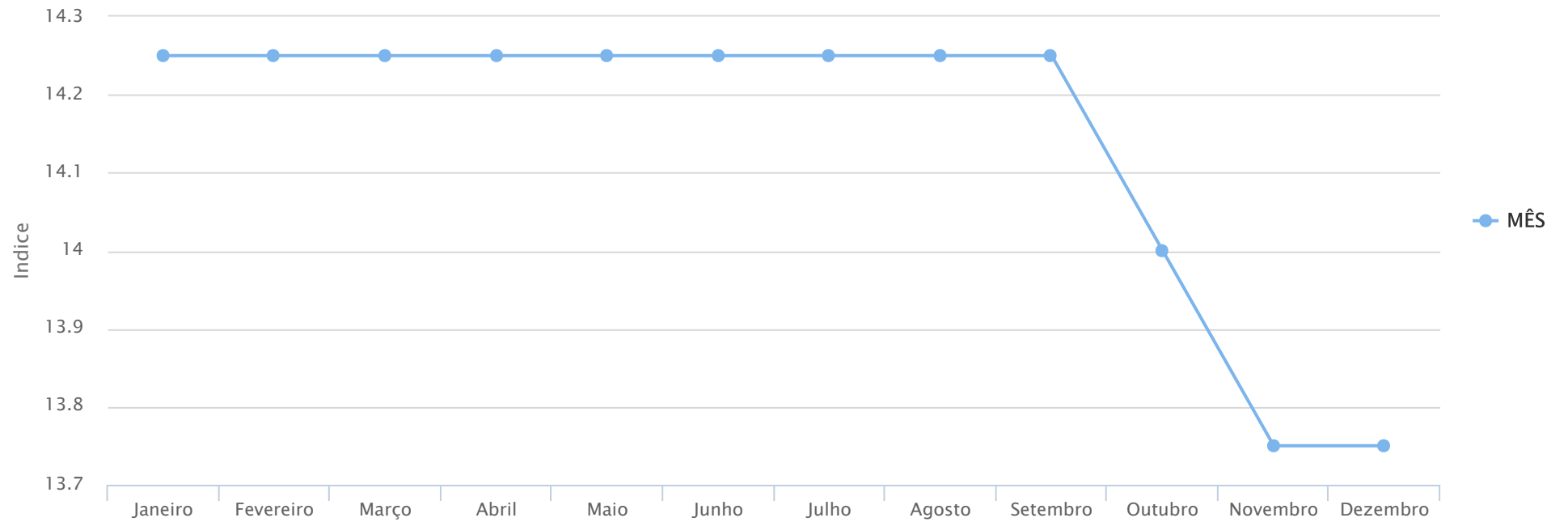


Highcharts.com

| 2016      | Janeiro | Fevereiro | Março  | Abril  | Mai    | Junho  | Julho | Agosto | Setembro | Outubro | Novembro | Dezembro |
|-----------|---------|-----------|--------|--------|--------|--------|-------|--------|----------|---------|----------|----------|
| MÊS       | 1.51    | 0.95      | 0.44   | 0.64   | 0.98   | 0.47   | 0.64  | 0.31   | 0.08     | 0.17    | 0.07     | 0.14     |
| ANO       | 1.51    | 2.4743    | 2.9252 | 3.5840 | 4.5991 | 5.0907 | 5.76  | 6.09   | 6.18     | 6.36    | 6.43     | 6.58     |
| ULT. 12 M | 11.3091 | 11.0780   | 9.9071 | 9.8307 | 9.8199 | 9.4929 | 9.56  | 9.62   | 9.15     | 8.50    | 7.39     | 6.58     |

# SELIC

2016



Highcharts.com

| Janeiro | Fevereiro | Março | Abril | Mai   | Junho | Julho | Agosto | Setembro | Outubro | Novembro | Dezembro |
|---------|-----------|-------|-------|-------|-------|-------|--------|----------|---------|----------|----------|
| 14.25   | 14.25     | 14.25 | 14.25 | 14.25 | 14.25 | 14.25 | 14.25  | 14.25    | 14.00   | 13.75    | 13.75    |

# CADPREV

|   |                                     |                                    |
|---|-------------------------------------|------------------------------------|
| <b>Renda Fixa</b>   |                                     | Tipo de Fundo: IDKA 2              |
| Fundo: BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO | CNPJ: 13.322.205/0001-35            | Saldo em 11/2016: R\$ 5.372.461,67 |
| Administrador: BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A                                     | CNPJ: 30.822.936/0001-69            | Performance: 0,00%                 |
| Resolução 3.922/2010: Art 7º, I, "b"  | Disponibilidade: D + 1              | Adesão: 01/02/2016                 |
| Valor da Cota: R\$ 1,938304993  | Quantidade de Cotas: 2.771.731,8427 | PL do Fundo: R\$ 5.692.004.448,84  |
| % do PL do Fundo: 0,09%   | Limite Cumulativo: 5,36%            | Limite do Fundo: 70%               |

|   |                                   |                                   |
|---|-----------------------------------|-----------------------------------|
| <b>Renda Fixa</b>   |                                   | Tipo de Fundo: IDKA 2             |
| Fundo: BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO | CNPJ: 13.322.205/0001-35          | Saldo em 11/2016: R\$ 389.407,17  |
| Administrador: BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A                                     | CNPJ: 30.822.936/0001-69          | Performance: 0,00%                |
| Resolução 3.922/2010: Art 7º, I, "b"  | Disponibilidade: D + 1            | Adesão: 01/12/2015                |
| Valor da Cota: R\$ 1,938304993  | Quantidade de Cotas: 200.900,8755 | PL do Fundo: R\$ 5.692.004.448,84 |
| % do PL do Fundo: 0,01%   | Limite Cumulativo: 0,39%          | Limite do Fundo: 70%              |

|  |                                     |                                    |
|--|-------------------------------------|------------------------------------|
| <b>Renda Fixa</b>  |                                     | Tipo de Fundo: IMA-B               |
| Fundo: BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO | CNPJ: 74.420.780/0010-5             | Saldo em 11/2016: R\$ 5.003.629,65 |
| Administrador: BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A                                    | CNPJ: 30.822.936/0001-69            | Performance: 0,00%                 |
| Resolução 3.922/2010: Art 7º, I, "b"   | Disponibilidade: D + 1              | Adesão: 01/12/2015                 |
| Valor da Cota: R\$ 3,849363177   | Quantidade de Cotas: 1.299.859,0728 | PL do Fundo: R\$ 5.331.505.245,58  |
| % do PL do Fundo: 0,09%  | Limite Cumulativo: 4,99%            | Limite do Fundo: 70%               |

|  |                                     |                                    |
|--|-------------------------------------|------------------------------------|
| <b>Renda Fixa</b>  |                                     | Tipo de Fundo: IMA-B               |
| Fundo: BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO | CNPJ: 74.420.780/0010-5             | Saldo em 11/2016: R\$ 6.769.538,49 |
| Administrador: BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A                                    | CNPJ: 30.822.936/0001-69            | Performance: 0,00%                 |
| Resolução 3.922/2010: Art 7º, I, "b"   | Disponibilidade: D + 1              | Adesão: 01/02/2016                 |
| Valor da Cota: R\$ 3,849363177   | Quantidade de Cotas: 1.758.612,5753 | PL do Fundo: R\$ 5.331.505.245,58  |
| % do PL do Fundo: 0,13%  | Limite Cumulativo: 6,75%            | Limite do Fundo: 70%               |

|                   |  |                       |
|-------------------|--|-----------------------|
| <b>Renda Fixa</b> |  | Tipo de Fundo: IRF-M1 |
|-------------------|--|-----------------------|

|  |                                   |                                    |
|--|-----------------------------------|------------------------------------|
| Fundo: BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI | CNPJ: 11.328.882/0001-35          | Saldo em 11/2016: R\$ 1.845.504,68 |
| Administrador: BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A                      | CNPJ: 30.822.936/0001-69          | Performance: 0,00%                 |
| Resolução 3.922/2010: Art 7º, I, "b"                               | Disponibilidade: D + 0            | Adesão: 02/02/2016                 |
| Valor da Cota: R\$ 2,065585000                                     | Quantidade de Cotas: 893.453,7577 | PL do Fundo: R\$ 8.997.655.747,04  |
| % do PL do Fundo: 0,02%  | Limite Cumulativo: 1,84%          | Limite do Fundo: 70%               |

|  |                                     |                                    |
|--|-------------------------------------|------------------------------------|
| <b>Renda Fixa</b>  |                                     | Tipo de Fundo: IRF-M1              |
| Fundo: BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI | CNPJ: 11.328.882/0001-35            | Saldo em 11/2016: R\$ 2.182.712,94 |
| Administrador: BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A                      | CNPJ: 30.822.936/0001-69            | Performance: 0,00%                 |
| Resolução 3.922/2010: Art 7º, I, "b"                               | Disponibilidade: D + 0              | Adesão: 01/12/2015                 |
| Valor da Cota: R\$ 2,065585000                                     | Quantidade de Cotas: 1.056.704,4881 | PL do Fundo: R\$ 8.997.655.747,04  |
| % do PL do Fundo: 0,02%  | Limite Cumulativo: 2,18%            | Limite do Fundo: 70%               |

|   |                                   |                                    |
|---|-----------------------------------|------------------------------------|
| <b>Renda Fixa</b>   |                                   | Tipo de Fundo: CDI                 |
| Fundo: BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO | CNPJ: 13.077.418/0001-49          | Saldo em 11/2016: R\$ 1.734.901,77 |
| Administrador: BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A   | CNPJ: 30.822.936/0001-69          | Performance: 0,00%                 |
| Resolução 3.922/2010: Art 7º, IV "a"  | Disponibilidade: D + 0            | Adesão: 01/02/2016                 |
| Valor da Cota: R\$ 1,795720000  | Quantidade de Cotas: 966.131,5628 | PL do Fundo: R\$ 5.299.475.881,27  |
| % do PL do Fundo: 0,03%   | Limite Cumulativo: 1,73%          | Limite do Fundo: 30%               |

|   |                                   |                                   |
|---|-----------------------------------|-----------------------------------|
| <b>Renda Fixa</b>   |                                   | Tipo de Fundo: CDI                |
| Fundo: BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO | CNPJ: 13.077.418/0001-49          | Saldo em 11/2016: R\$ 950.644,26  |
| Administrador: BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A   | CNPJ: 30.822.936/0001-69          | Performance: 0,00%                |
| Resolução 3.922/2010: Art 7º, IV "a"  | Disponibilidade: D + 0            | Adesão: 01/12/2015                |
| Valor da Cota: R\$ 1,795720000  | Quantidade de Cotas: 529.394,4824 | PL do Fundo: R\$ 5.299.475.881,27 |
| % do PL do Fundo: 0,02%   | Limite Cumulativo: 0,95%          | Limite do Fundo: 30%              |

|   |                                   |                                  |
|---|-----------------------------------|----------------------------------|
| <b>Renda Fixa</b>   |                                   | Tipo de Fundo: IDKA 2            |
| Fundo: BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IX FUNDO DE INVESTIMENTO | CNPJ: 20.734.937/0001-06          | Saldo em 11/2016: R\$ 798.536,85 |
| Administrador: BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A                                 | CNPJ: 30.822.936/0001-69          | Performance: 0,00%               |
| Resolução 3.922/2010: Art 7º, I, "b"  | Disponibilidade: D + 0            | Adesão: 01/02/2016               |
| Valor da Cota: R\$ 1,240865589  | Quantidade de Cotas: 643.532,1094 | PL do Fundo: R\$ 342.148.092,56  |

|                         |                          |                      |
|-------------------------|--------------------------|----------------------|
| % do PL do Fundo: 0,23% | Limite Cumulativo: 0,80% | Limite do Fundo: 70% |
|-------------------------|--------------------------|----------------------|

|  |                                   |                                   |
|--|-----------------------------------|-----------------------------------|
| <b>Renda Fixa</b>  |                                   | Tipo de Fundo: IMA-B              |
| Fundo: BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII FUNDO DE INVESTIMENTO | CNPJ: 19.523.305/0001-06          | Saldo em 11/2016: R\$ 564.282,20  |
| Administrador: BB GESTAO DE RECURSOS DTVM S.A                                  | CNPJ: 30.822.936/0001-69          | Performance: 0,00%                |
| Resolução 3.922/2010: Art 7º, I, "b"   | Disponibilidade: D + 228          | Adesão: 01/02/2016                |
| Valor da Cota: R\$ 1,262532140   | Quantidade de Cotas: 446.944,8200 | PL do Fundo: R\$ 1.077.099.885,41 |
| % do PL do Fundo: 0,05%  | Limite Cumulativo: 0,56%          | Limite do Fundo: 70%              |

|   |                                   |                                    |
|---|-----------------------------------|------------------------------------|
| <b>Renda Fixa</b>   |                                   | Tipo de Fundo: CDI                 |
| Fundo: BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO REFERENCIADO DI PREMIUM | CNPJ: 33.994.110/0019-0           | Saldo em 11/2016: R\$ 7.093.714,66 |
| Administrador: BANCO BRADESCO S.A.                            | CNPJ: 60.746.948/0001-12          | Performance: 0,00%                 |
| Resolução 3.922/2010: Art 7º, IV "a"                          | Disponibilidade: D + 0            | Adesão: 01/02/2016                 |
| Valor da Cota: R\$ 9,579553300                                | Quantidade de Cotas: 740.505,7875 | PL do Fundo: R\$ 6.740.519.275,14  |
| % do PL do Fundo: 0,11%                                       | Limite Cumulativo: 7,08%          | Limite do Fundo: 30%               |

|  |                             |                            |
|--|-----------------------------|----------------------------|
| <b>Renda Fixa</b>  |                             | Tipo de Fundo: IMA-B       |
| Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2016 III TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA | CNPJ: 21.919.240/0001-64    | Saldo em 11/2016: R\$ 0,00 |
| Administrador: CAIXA ECONOMICA FEDERAL   | CNPJ: 00.360.305/0001-04    | Performance: 0,00%         |
| Resolução 3.922/2010: Art 7º, I, "b"   | Disponibilidade: D + 0      | Adesão: 01/02/2016         |
| Valor da Cota: R\$ 0,000000000   | Quantidade de Cotas: 0,0000 | PL do Fundo: R\$ 0,00      |
| % do PL do Fundo: 0,00%  | Limite Cumulativo: 0,00%    | Limite do Fundo: 70%       |

|  |                             |                            |
|--|-----------------------------|----------------------------|
| <b>Renda Fixa</b>  |                             | Tipo de Fundo: IMA-B       |
| Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2016 V TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA | CNPJ: 21.922.168/0001-24    | Saldo em 11/2016: R\$ 0,00 |
| Administrador: CAIXA ECONOMICA FEDERAL                                       | CNPJ: 00.360.305/0001-04    | Performance: 0,00%         |
| Resolução 3.922/2010: Art 7º, I, "b"   | Disponibilidade: D + 0      | Adesão: 01/02/2016         |
| Valor da Cota: R\$ 0,000000000   | Quantidade de Cotas: 0,0000 | PL do Fundo: R\$ 0,00      |
| % do PL do Fundo: 0,00%  | Limite Cumulativo: 0,00%    | Limite do Fundo: 70%       |

|                   |  |                      |
|-------------------|--|----------------------|
| <b>Renda Fixa</b> |  | Tipo de Fundo: IMA-B |
|-------------------|--|----------------------|



|   |                             |                            |
|---|-----------------------------|----------------------------|
| Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2016 VI TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA | CNPJ: 22.791.300/0001-79    | Saldo em 11/2016: R\$ 0,00 |
| Administrador: CAIXA ECONOMICA FEDERAL  | CNPJ: 00.360.305/0001-04    | Performance: 0,00%         |
| Resolução 3.922/2010: Art 7º, I, "b"  | Disponibilidade: D + 0      | Adesão: 01/02/2016         |
| Valor da Cota: R\$ 0,000000000  | Quantidade de Cotas: 0,0000 | PL do Fundo: R\$ 0,00      |
| % do PL do Fundo: 0,00%   | Limite Cumulativo: 0,00%    | Limite do Fundo: 70%       |

|   |                                     |                                    |
|---|-------------------------------------|------------------------------------|
| <b>Renda Fixa</b>   |                                     | Tipo de Fundo: IMA-B               |
| Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA | CNPJ: 19.768.733/0001-07            | Saldo em 11/2016: R\$ 5.593.483,95 |
| Administrador: CAIXA ECONOMICA FEDERAL  | CNPJ: 00.360.305/0001-04            | Performance: 0,00%                 |
| Resolução 3.922/2010: Art 7º, I, "b"  | Disponibilidade: D + 840            | Adesão: 29/07/2016                 |
| Valor da Cota: R\$ 1,149697000  | Quantidade de Cotas: 4.865.180,9564 | PL do Fundo: R\$ 3.069.349.353,56  |
| % do PL do Fundo: 0,18%   | Limite Cumulativo: 5,58%            | Limite do Fundo: 70%               |

|   |                                     |                                    |
|---|-------------------------------------|------------------------------------|
| <b>Renda Fixa</b>   |                                     | Tipo de Fundo: IMA-B               |
| Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA | CNPJ: 21.919.953/0001-28            | Saldo em 11/2016: R\$ 1.115.367,72 |
| Administrador: CAIXA ECONOMICA FEDERAL  | CNPJ: 00.360.305/0001-04            | Performance: 0,00%                 |
| Resolução 3.922/2010: Art 7º, I, "b"  | Disponibilidade: D + 0              | Adesão: 01/02/2016                 |
| Valor da Cota: R\$ 1,114858000  | Quantidade de Cotas: 1.000.457,2062 | PL do Fundo: R\$ 817.863.068,60    |
| % do PL do Fundo: 0,14%   | Limite Cumulativo: 1,11%            | Limite do Fundo: 70%               |

|  |                                     |                                     |
|--|-------------------------------------|-------------------------------------|
| <b>Renda Fixa</b>  |                                     | Tipo de Fundo: IDKA 2               |
| Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO | CNPJ: 14.386.926/0001-71            | Saldo em 11/2016: R\$ 10.506.557,57 |
| Administrador: CAIXA ECONOMICA FEDERAL   | CNPJ: 00.360.305/0001-04            | Performance: 0,00%                  |
| Resolução 3.922/2010: Art 7º, I, "b"   | Disponibilidade: D + 0              | Adesão: 01/02/2016                  |
| Valor da Cota: R\$ 1,605512000   | Quantidade de Cotas: 6.544.054,2145 | PL do Fundo: R\$ 3.920.493.354,72   |
| % do PL do Fundo: 0,27%  | Limite Cumulativo: 10,48%           | Limite do Fundo: 70%                |

|  |                                     |                                    |
|--|-------------------------------------|------------------------------------|
| <b>Renda Fixa</b>  |                                     | Tipo de Fundo: IDKA 2              |
| Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TITULOS PUBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO | CNPJ: 14.386.926/0001-71            | Saldo em 11/2016: R\$ 1.802.801,87 |
| Administrador: CAIXA ECONOMICA FEDERAL   | CNPJ: 00.360.305/0001-04            | Performance: 0,00%                 |
| Resolução 3.922/2010: Art 7º, I, "b"   | Disponibilidade: D + 0              | Adesão: 01/12/2015                 |
| Valor da Cota: R\$ 1,605512000   | Quantidade de Cotas: 1.122.882,8374 | PL do Fundo: R\$ 3.920.493.354,72  |

|                         |                          |                      |
|-------------------------|--------------------------|----------------------|
| % do PL do Fundo: 0,05% | Limite Cumulativo: 1,80% | Limite do Fundo: 70% |
|-------------------------|--------------------------|----------------------|

|   |                             |                                   |
|---|-----------------------------|-----------------------------------|
| <b>Renda Fixa</b>   |                             | Tipo de Fundo: IMA-B              |
| Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO | CNPJ: 10.740.658/0001-93    | Saldo em 11/2016: R\$ 0,00        |
| Administrador: CAIXA ECONOMICA FEDERAL  | CNPJ: 00.360.305/0001-04    | Performance: 0,00%                |
| Resolução 3.922/2010: Art 7º, I, "b"  | Disponibilidade: D + 0      | Adesão: 01/12/2015                |
| Valor da Cota: R\$ 2,174606000  | Quantidade de Cotas: 0,0000 | PL do Fundo: R\$ 4.695.513.366,94 |
| % do PL do Fundo: 0,00%   | Limite Cumulativo: 0,00%    | Limite do Fundo: 70%              |

|   |                                     |                                    |
|---|-------------------------------------|------------------------------------|
| <b>Renda Fixa</b>   |                                     | Tipo de Fundo: IMA-B               |
| Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO | CNPJ: 10.740.658/0001-93            | Saldo em 11/2016: R\$ 6.082.718,43 |
| Administrador: CAIXA ECONOMICA FEDERAL  | CNPJ: 00.360.305/0001-04            | Performance: 0,00%                 |
| Resolução 3.922/2010: Art 7º, I, "b"  | Disponibilidade: D + 0              | Adesão: 01/02/2016                 |
| Valor da Cota: R\$ 2,174606000  | Quantidade de Cotas: 2.797.158,8554 | PL do Fundo: R\$ 4.695.513.366,94  |
| % do PL do Fundo: 0,13%   | Limite Cumulativo: 6,07%            | Limite do Fundo: 70%               |

|   |                                  |                                   |
|---|----------------------------------|-----------------------------------|
| <b>Renda Fixa</b>   |                                  | Tipo de Fundo: IMA-B              |
| Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO | CNPJ: 10.740.658/0001-93         | Saldo em 11/2016: R\$ 24.958,60   |
| Administrador: CAIXA ECONOMICA FEDERAL  | CNPJ: 00.360.305/0001-04         | Performance: 0,00%                |
| Resolução 3.922/2010: Art 7º, I, "b"  | Disponibilidade: D + 0           | Adesão: 01/12/2015                |
| Valor da Cota: R\$ 2,174606000  | Quantidade de Cotas: 11.477,2975 | PL do Fundo: R\$ 4.695.513.366,94 |
| % do PL do Fundo: 0,00%   | Limite Cumulativo: 0,02%         | Limite do Fundo: 70%              |

|   |                                     |                                    |
|---|-------------------------------------|------------------------------------|
| <b>Renda Fixa</b>   |                                     | Tipo de Fundo: IRF-M1              |
| Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA | CNPJ: 10.740.670/0001-06            | Saldo em 11/2016: R\$ 3.881.731,06 |
| Administrador: CAIXA ECONOMICA FEDERAL  | CNPJ: 00.360.305/0001-04            | Performance: 0,00%                 |
| Resolução 3.922/2010: Art 7º, I, "b"  | Disponibilidade: D + 0              | Adesão: 01/02/2016                 |
| Valor da Cota: R\$ 1,973971000  | Quantidade de Cotas: 1.966.457,9976 | PL do Fundo: R\$ 11.370.896.051,98 |
| % do PL do Fundo: 0,03%   | Limite Cumulativo: 3,87%            | Limite do Fundo: 70%               |

|                   |  |                       |
|-------------------|--|-----------------------|
| <b>Renda Fixa</b> |  | Tipo de Fundo: IRF-M1 |
|-------------------|--|-----------------------|

|   |                                     |                                    |
|---|-------------------------------------|------------------------------------|
| Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA | CNPJ: 10.740.670/0001-06            | Saldo em 11/2016: R\$ 3.236.556,29 |
| Administrador: CAIXA ECONOMICA FEDERAL  | CNPJ: 00.360.305/0001-04            | Performance: 0,00%                 |
| Resolução 3.922/2010: Art 7º, I, "b"  | Disponibilidade: D + 0              | Adesão: 01/12/2015                 |
| Valor da Cota: R\$ 1,973971000  | Quantidade de Cotas: 1.639.616,9397 | PL do Fundo: R\$ 11.370.896.051,98 |
| % do PL do Fundo: 0,03%   | Limite Cumulativo: 3,23%            | Limite do Fundo: 70%               |

|   |                                 |                                   |
|---|---------------------------------|-----------------------------------|
| <b>Renda Fixa</b>   |                                 | Tipo de Fundo: CDI                |
| Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO | CNPJ: 51.643.560/0018-4         | Saldo em 11/2016: R\$ 8.838,93    |
| Administrador: CAIXA ECONOMICA FEDERAL  | CNPJ: 00.360.305/0001-04        | Performance: 0,00%                |
| Resolução 3.922/2010: Art 7º , IV "a"   | Disponibilidade: D + 0          | Adesão: 01/12/2015                |
| Valor da Cota: R\$ 3,163056000  | Quantidade de Cotas: 2.794,4273 | PL do Fundo: R\$ 1.929.411.757,18 |
| % do PL do Fundo: 0,00%   | Limite Cumulativo: 0,01%        | Limite do Fundo: 30%              |

|   |                                   |                                    |
|---|-----------------------------------|------------------------------------|
| <b>Renda Fixa</b>   |                                   | Tipo de Fundo: CDI                 |
| Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA LONGO PRAZO | CNPJ: 51.643.560/0018-4           | Saldo em 11/2016: R\$ 2.371.632,91 |
| Administrador: CAIXA ECONOMICA FEDERAL  | CNPJ: 00.360.305/0001-04          | Performance: 0,00%                 |
| Resolução 3.922/2010: Art 7º , IV "a"   | Disponibilidade: D + 0            | Adesão: 01/02/2016                 |
| Valor da Cota: R\$ 3,163056000  | Quantidade de Cotas: 749.791,6287 | PL do Fundo: R\$ 1.929.411.757,18  |
| % do PL do Fundo: 0,12%   | Limite Cumulativo: 2,37%          | Limite do Fundo: 30%               |

|  |                                 |                                    |
|--|---------------------------------|------------------------------------|
| <b>Renda Fixa</b>  |                                 | Tipo de Fundo: IMA-B 5             |
| Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B  | CNPJ: 15.153.656/0001-11        | Saldo em 11/2016: R\$ 2.149.586,18 |
| Administrador: FOCO DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS LTDA. | CNPJ: 00.329.598/0001-67        | Performance: 0,00%                 |
| Resolução 3.922/2010: Art 7º, III "a"                                    | Disponibilidade: D + 1          | Adesão: 01/02/2016                 |
| Valor da Cota: R\$ 1.124,899703280                                       | Quantidade de Cotas: 1.910,9136 | PL do Fundo: R\$ 88.599.397,46     |
| % do PL do Fundo: 2,43%  | Limite Cumulativo: 2,14%        | Limite do Fundo: 15%               |

|   |                                 |                                  |
|---|---------------------------------|----------------------------------|
| <b>Renda Variável</b>   |                                 | Tipo de Fundo: AÇÕES             |
| Fundo: GENUS INSTITUCIONAL VALUE FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES | CNPJ: 15.769.621/0001-01        | Saldo em 11/2016: R\$ 869.942,02 |
| Administrador: BRIDGE ADMINISTRADORA DE RECURSOS LTDA.          | CNPJ: 11.010.779/0001-42        | Performance: 0,00%               |
| Resolução 3.922/2010: Art 8º , III                              | Disponibilidade: D + 4          | Adesão: 01/02/2016               |
| Valor da Cota: R\$ 662,166039200                                | Quantidade de Cotas: 1.313,7823 | PL do Fundo: R\$ 16.721.258,99   |

|                         |                          |                      |
|-------------------------|--------------------------|----------------------|
| % do PL do Fundo: 5,20% | Limite Cumulativo: 0,87% | Limite do Fundo: 10% |
|-------------------------|--------------------------|----------------------|

|   |                                   |                                  |
|---|-----------------------------------|----------------------------------|
| <b>Renda Variável</b>   |                                   | Tipo de Fundo: AÇÕES             |
| Fundo: GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES | CNPJ: 11.898.349/0001-09          | Saldo em 11/2016: R\$ 939.032,66 |
| Administrador: GERAÇÃO FUTURO CORRETORA DE VALORES S/A          | CNPJ: 27.652.684/0001-62          | Performance: 0,00%               |
| Resolução 3.922/2010: Art 8º, III                               | Disponibilidade: D + 4            | Adesão: 01/02/2016               |
| Valor da Cota: R\$ 1,464982700                                  | Quantidade de Cotas: 640.985,4942 | PL do Fundo: R\$ 260.265.006,66  |
| % do PL do Fundo: 0,36%   | Limite Cumulativo: 0,94%          | Limite do Fundo: 10%             |

|  |                                     |                                    |
|--|-------------------------------------|------------------------------------|
| <b>Renda Fixa</b>  |                                     | Tipo de Fundo: IMA-B               |
| Fundo: GERAÇÃO FUTURO JURO REAL - IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA LONGO PRAZO | CNPJ: 19.419.157/0001-84            | Saldo em 11/2016: R\$ 1.878.714,42 |
| Administrador: GERAÇÃO FUTURO CORRETORA DE VALORES S/A                               | CNPJ: 27.652.684/0001-62            | Performance: 0,00%                 |
| Resolução 3.922/2010: Art 7º, I, "b"   | Disponibilidade: D + 1              | Adesão: 01/02/2016                 |
| Valor da Cota: R\$ 1,575117680   | Quantidade de Cotas: 1.192.745,4335 | PL do Fundo: R\$ 64.803.699,90     |
| % do PL do Fundo: 2,90%  | Limite Cumulativo: 1,87%            | Limite do Fundo: 70%               |

|  |                                     |                                    |
|--|-------------------------------------|------------------------------------|
| <b>Renda Fixa</b>  |                                     | Tipo de Fundo: IMA-B               |
| Fundo: LMX IMA-B FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA        | CNPJ: 13.594.673/0001-69            | Saldo em 11/2016: R\$ 2.484.211,32 |
| Administrador: BNY MELLON SERVICOS FINANCEIROS DTVM S.A. | CNPJ: 22.015.010/0016-1             | Performance: 0,00%                 |
| Resolução 3.922/2010: Art 7º, III "a"                    | Disponibilidade: D + 31             | Adesão: 01/02/2016                 |
| Valor da Cota: R\$ 1,287240700                           | Quantidade de Cotas: 1.929.873,1931 | PL do Fundo: R\$ 117.979.467,24    |
| % do PL do Fundo: 2,11%                                  | Limite Cumulativo: 2,48%            | Limite do Fundo: 15%               |

|   |                                   |                                  |
|---|-----------------------------------|----------------------------------|
| <b>Renda Variável</b>   |                                   | Tipo de Fundo: AÇÕES             |
| Fundo: ROMA AÇÕES FI DE AÇÕES   | CNPJ: 11.357.758/0001-06          | Saldo em 11/2016: R\$ 178.431,23 |
| Administrador: ICLA TRUST DISTRIBUIDORA DE TITULOS E VALORES MOBILIARIOS S.A. | CNPJ: 10.274.584/0001-47          | Performance: 0,00%               |
| Resolução 3.922/2010: Art 8º, III   | Disponibilidade: D + 4            | Adesão: 01/02/2016               |
| Valor da Cota: R\$ 0,268626690  | Quantidade de Cotas: 664.234,9277 | PL do Fundo: R\$ 1.715.445,77    |
| % do PL do Fundo: 10,40%  | Limite Cumulativo: 0,18%          | Limite do Fundo: 10%             |

|                   |  |                      |
|-------------------|--|----------------------|
| <b>Renda Fixa</b> |  | Tipo de Fundo: IMA-B |
|-------------------|--|----------------------|

|  |                                 |                                  |
|--|---------------------------------|----------------------------------|
| Fundo: SAFRA IMA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO RENDA FIXA | CNPJ: 10.787.822/0001-18        | Saldo em 11/2016: R\$ 860.065,46 |
| Administrador: JS ADMINISTRACAO DE RECURSOS S/A                                      | CNPJ: 43.826.833/0001-19        | Performance: 0,00%               |
| Resolução 3.922/2010: Art 7º, I, "b"   | Disponibilidade: D + 0          | Adesão: 01/02/2016               |
| Valor da Cota: R\$ 216,550083000   | Quantidade de Cotas: 3.971,6700 | PL do Fundo: R\$ 318.867.441,29  |
| % do PL do Fundo: 0,27%  | Limite Cumulativo: 0,86%        | Limite do Fundo: 70%             |

|   |                                   |                                    |
|---|-----------------------------------|------------------------------------|
| <b>Renda Fixa</b>   |                                   | Tipo de Fundo: IMA-B 5             |
| Fundo: SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TÍTULOS PUBLICOS RENDA FIXA | CNPJ: 13.455.117/0001-01          | Saldo em 11/2016: R\$ 6.678.634,32 |
| Administrador: BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.                | CNPJ: 90.400.888/0001-42          | Performance: 0,00%                 |
| Resolução 3.922/2010: Art 7º, I, "b"                        | Disponibilidade: D + 1            | Adesão: 01/02/2016                 |
| Valor da Cota: R\$ 18,002805600                             | Quantidade de Cotas: 370.977,4170 | PL do Fundo: R\$ 1.584.955.687,70  |
| % do PL do Fundo: 0,42%                                     | Limite Cumulativo: 6,66%          | Limite do Fundo: 70%               |

|  |                               |                                 |
|--|-------------------------------|---------------------------------|
| <b>Renda Fixa</b>  |                               | Tipo de Fundo: CDI              |
| Fundo: SANTANDER FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO TITULOS PUBLICOS REFERENCIADO DI | CNPJ: 46.820.220/0013-0       | Saldo em 11/2016: R\$ 22.730,75 |
| Administrador: BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.   | CNPJ: 90.400.888/0001-42      | Performance: 0,00%              |
| Resolução 3.922/2010: Art 7º, IV "a"   | Disponibilidade: D + 0        | Adesão: 01/12/2015              |
| Valor da Cota: R\$ 60,560942800  | Quantidade de Cotas: 375,3368 | PL do Fundo: R\$ 685.096.330,48 |
| % do PL do Fundo: 0,00%  | Limite Cumulativo: 0,02%      | Limite do Fundo: 30%            |

|  |                                  |                                  |
|--|----------------------------------|----------------------------------|
| <b>Renda Fixa</b>  |                                  | Tipo de Fundo: CDI               |
| Fundo: SANTANDER FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO TITULOS PUBLICOS REFERENCIADO DI | CNPJ: 46.820.220/0013-0          | Saldo em 11/2016: R\$ 853.894,26 |
| Administrador: BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.   | CNPJ: 90.400.888/0001-42         | Performance: 0,00%               |
| Resolução 3.922/2010: Art 7º, IV "a"   | Disponibilidade: D + 0           | Adesão: 01/12/2015               |
| Valor da Cota: R\$ 60,560942800  | Quantidade de Cotas: 14.099,7518 | PL do Fundo: R\$ 685.096.330,48  |
| % do PL do Fundo: 0,12%  | Limite Cumulativo: 0,85%         | Limite do Fundo: 30%             |

|  |                                   |                                     |
|--|-----------------------------------|-------------------------------------|
| <b>Renda Fixa</b>  |                                   | Tipo de Fundo: CDI                  |
| Fundo: SANTANDER FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO TITULOS PUBLICOS REFERENCIADO DI | CNPJ: 46.820.220/0013-0           | Saldo em 11/2016: R\$ 12.622.042,73 |
| Administrador: BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A.   | CNPJ: 90.400.888/0001-42          | Performance: 0,00%                  |
| Resolução 3.922/2010: Art 7º, IV "a"   | Disponibilidade: D + 0            | Adesão: 01/02/2016                  |
| Valor da Cota: R\$ 60,560942800  | Quantidade de Cotas: 208.418,8612 | PL do Fundo: R\$ 685.096.330,48     |

|                         |                           |                      |
|-------------------------|---------------------------|----------------------|
| % do PL do Fundo: 1,84% | Limite Cumulativo: 12,59% | Limite do Fundo: 30% |
|-------------------------|---------------------------|----------------------|

|  |                             |                                 |
|--|-----------------------------|---------------------------------|
| <b>Renda Fixa</b>  |                             | Tipo de Fundo: IMA-B 5          |
| Fundo: TOWER BRIDGE RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5 | CNPJ: 12.845.801/0001-37    | Saldo em 11/2016: R\$ 0,00      |
| Administrador: GRADUAL CCTVM S/A                             | CNPJ: 33.918.160/0001-73    | Performance: 0,00%              |
| Resolução 3.922/2010: Art 7º, III "a"                        | Disponibilidade: D + 1      | Adesão: 01/02/2016              |
| Valor da Cota: R\$ 1,442724100                               | Quantidade de Cotas: 0,0000 | PL do Fundo: R\$ 544.212.352,08 |
| % do PL do Fundo: 0,00%                                      | Limite Cumulativo: 0,00%    | Limite do Fundo: 15%            |

|  |                              |                                 |
|--|------------------------------|---------------------------------|
| <b>Renda Fixa</b>  |                              | Tipo de Fundo: FIDC             |
| Fundo: FIDC TREND BANK BANCO DE FOMENTO - MULTISSETORIAL | CNPJ: 08.927.488/0001-09     | Saldo em 11/2016: R\$ 24.359,68 |
| Administrador: GRADUAL CCTVM S/A                         | CNPJ: 33.918.160/0001-73     | Performance: 0,00%              |
| Resolução 3.922/2010: Art 7º, VI                         | Disponibilidade: D + 0       | Adesão: 01/02/2016              |
| Valor da Cota: R\$ 245,569751250                         | Quantidade de Cotas: 99,1966 | PL do Fundo: R\$ 7.838.877,59   |
| % do PL do Fundo: 0,31%                                  | Limite Cumulativo: 0,02%     | Limite do Fundo: 5%             |

|  |                                     |                                    |
|--|-------------------------------------|------------------------------------|
| <b>Renda Variável</b>                                    |                                     | Tipo de Fundo: FIP                 |
| Fundo: ÁTICO GERAÇÃO DE ENERGIA - FIP                    | CNPJ: 11.490.580/0001-69            | Saldo em 11/2016: R\$ 2.413.596,74 |
| Administrador: BNY MELLON SERVICOS FINANCEIROS DTVM S.A. | CNPJ: 22.015.010/0016-1             | Performance: 0,00%                 |
| Resolução 3.922/2010: Art 8º, V                          | Disponibilidade: D + 0              | Adesão: 01/02/2016                 |
| Valor da Cota: R\$ 1,856612880                           | Quantidade de Cotas: 1.299.999,9978 | PL do Fundo: R\$ 341.829.103,14    |
| % do PL do Fundo: 0,71%                                  | Limite Cumulativo: 2,41%            | Limite do Fundo: 5%                |

|  |                                  |                                  |
|--|----------------------------------|----------------------------------|
| <b>Renda Variável</b>  |                                  | Tipo de Fundo: IMOBILIARIO       |
| Fundo: ÁTICO RENDA FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FII                     | CNPJ: 14.631.148/0001-39         | Saldo em 11/2016: R\$ 951.363,59 |
| Administrador: GRADUAL CORRETORA DE CÂMBIO, TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A. | CNPJ: 33.918.160/0001-73         | Performance: 0,00%               |
| Resolução 3.922/2010: Art 8º, VI   | Disponibilidade: D + 0           | Adesão: 01/02/2016               |
| Valor da Cota: R\$ 95,136358550  | Quantidade de Cotas: 10.000,0000 | PL do Fundo: R\$ 88.423.848,44   |
| % do PL do Fundo: 1,08%  | Limite Cumulativo: 0,95%         | Limite do Fundo: 5%              |

|                   |  |                        |
|-------------------|--|------------------------|
| <b>Renda Fixa</b> |  | Tipo de Fundo: IMA-B 5 |
|-------------------|--|------------------------|

|   |                             |                                 |
|---|-----------------------------|---------------------------------|
| Fundo: TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO IMA-B 5 | CNPJ: 23.954.899/0001-87    | Saldo em 11/2016: R\$ 0,00      |
| Administrador: BRIDGE ADMINISTRADORA DE RECURSOS LTDA.          | CNPJ: 11.010.779/0001-42    | Performance: 0,00%              |
| Resolução 3.922/2010: Art 7º, III "a"                           | Disponibilidade: D + 1      | Adesão: 01/03/2016              |
| Valor da Cota: R\$ 1,356755300                                  | Quantidade de Cotas: 0,0000 | PL do Fundo: R\$ 114.497.463,97 |
| % do PL do Fundo: 0,00%   | Limite Cumulativo: 0,00%    | Limite do Fundo: 15%            |

**TOTAL: R\$ 100.256.587,03**

# CARTEIRA SUGERIDA

## ESTRATEGIA PRÓXIMO MÊS - PERFIL CONSERVADOR

| CARTEIRA ATUAL |                |           | MOVIMENTAÇÕES      | CARTEIRA SUGERIDA |           |
|----------------|----------------|-----------|--------------------|-------------------|-----------|
| INDICE         | SALDO ATUAL    | % CAPITAL | APLICAR / RESGATAR | SALDO FINAL       | % CAPITAL |
| FIDC           | 24.359,68      | 0,02      | -4.308,36          | 20.051,32         | 0,02      |
| CRED PRIVADO   | 0,00           | 0,00      | 0,00               | 0,00              | 0,00      |
| MULTIMERCADO   | 0,00           | 0,00      | 0,00               | 0,00              | 0,00      |
| GERAL          | 0,00           | 0,00      | 0,00               | 0,00              | 0,00      |
| IPCA           | 0,00           | 0,00      | 0,00               | 0,00              | 0,00      |
| IMA-B          | 30.376.970,24  | 30,30     | -25.364.140,89     | 5.012.829,35      | 5,00      |
| IMA-B 5        | 8.828.220,50   | 8,81      | -3.815.391,15      | 5.012.829,35      | 5,00      |
| IMA-B 5+       | 0,00           | 0,00      | 0,00               | 0,00              | 0,00      |
| IDKA 2         | 18.869.765,13  | 18,82     | -8.844.106,43      | 10.025.658,70     | 10,00     |
| IDKA 20        | 0,00           | 0,00      | 0,00               | 0,00              | 0,00      |
| IRF-M          | 0,00           | 0,00      | 0,00               | 0,00              | 0,00      |
| IRF-M1         | 11.146.504,97  | 11,12     | 38.981.788,54      | 50.128.293,51     | 50,00     |
| IRF-M1+        | 0,00           | 0,00      | 0,00               | 0,00              | 0,00      |
| AÇÕES          | 1.987.405,91   | 1,98      | -2.325,49          | 1.985.080,42      | 1,98      |
| POUPANÇA       | 0,00           | 0,00      | 0,00               | 0,00              | 0,00      |
| FIP            | 3.364.960,33   | 3,36      | 3.660,99           | 3.368.621,32      | 3,36      |
| SELIC/CDI      | 25.658.400,27  | 25,59     | -955.177,23        | 24.703.223,04     | 24,64     |
| TOTAL:         | 100.256.587,03 | 100,00    |                    | 100.256.587,03    | 100,00    |



# ESTRATEGIA PRÓXIMO MÊS - PERFIL MODERADO

| CARTEIRA ATUAL |                |           | MOVIMENTAÇÕES      | CARTEIRA SUGERIDA |           |
|----------------|----------------|-----------|--------------------|-------------------|-----------|
| INDICE         | SALDO ATUAL    | % CAPITAL | APLICAR / RESGATAR | SALDO FINAL       | % CAPITAL |
| FIDC           | 24.359,68      | 0,02      | -4.308,36          | 20.051,32         | 0,02      |
| CRED PRIVADO   | 0,00           | 0,00      | 0,00               | 0,00              | 0,00      |
| MULTIMERCADO   | 0,00           | 0,00      | 0,00               | 0,00              | 0,00      |
| GERAL          | 0,00           | 0,00      | 0,00               | 0,00              | 0,00      |
| IPCA           | 0,00           | 0,00      | 0,00               | 0,00              | 0,00      |
| IMA-B          | 30.376.970,24  | 30,30     | -20.351.311,54     | 10.025.658,70     | 10,00     |
| IMA-B 5        | 8.828.220,50   | 8,81      | 1.197.438,20       | 10.025.658,70     | 10,00     |
| IMA-B 5+       | 0,00           | 0,00      | 0,00               | 0,00              | 0,00      |
| IDKA 2         | 18.869.765,13  | 18,82     | 1.181.552,28       | 20.051.317,41     | 20,00     |
| IDKA 20        | 0,00           | 0,00      | 0,00               | 0,00              | 0,00      |
| IRF-M          | 0,00           | 0,00      | 0,00               | 0,00              | 0,00      |
| IRF-M1         | 11.146.504,97  | 11,12     | 18.930.471,14      | 30.076.976,11     | 30,00     |
| IRF-M1+        | 0,00           | 0,00      | 0,00               | 0,00              | 0,00      |
| AÇÕES          | 1.987.405,91   | 1,98      | -2.325,49          | 1.985.080,42      | 1,98      |
| POUPANÇA       | 0,00           | 0,00      | 0,00               | 0,00              | 0,00      |
| FIP            | 3.364.960,33   | 3,36      | 3.660,99           | 3.368.621,32      | 3,36      |
| SELIC/CDI      | 25.658.400,27  | 25,59     | -955.177,23        | 24.703.223,04     | 24,64     |
| TOTAL:         | 100.256.587,03 | 100,00    |                    | 100.256.587,03    | 100,00    |

*Kenzo Leonardo de Blasi*

DI BLASI CONSULTORIA FINANCEIRA LTDA

CNPJ 03.866.812/0001-02

CONSULTORIA DE INVESTIMENTOS HABILITADA PELA COMISSÃO DE VALORES MOBILIÁRIOS - CVM