



DEMONSTRATIVO DAS APLICAÇÕES E INVESTIMENTOS DOS RECURSOS

1. ENTE

| | |
|--|--|
| Nome: Prefeitura Municipal de Recife / PE | CNPJ: 10.565.000/0001-92 |
| Endereço: AV. CAIS DO APOLO, 925 | Complemento: |
| Bairro: RECIFE | CEP: 50030-009 |
| Telefone: (081) 3355-8000 | Fax: (081) 3355-8000 |
| | E-mail: recife@recife.pe.gov.br |

2. REPRESENTANTE LEGAL DO ENTE

| | |
|---|--|
| Nome: GERALDO JULIO DE MELLO FILHO | CPF: 756.252.294-49 |
| Cargo: Prefeito | Complemento do Cargo: |
| E-mail: geraldo.julio@recife.pe.gov.br | Data Início de Gestão: 01/01/2013 |

3. REGIME PRÓPRIO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL/MUNICÍPIO/UF

| | |
|--|--|
| Nome: AUTARQUIA MUNICIPAL DE PREVIDENCIA E ASSISTENCIA A SAUDE DOS SERVIDORES | CNPJ: 05.244.336/0001-13 |
| Endereço: AV. MANOEL BORBA, 488 | Complemento: |
| Bairro: BOA VISTA | CEP: 50070-000 |
| Telefone: (081) 3355-1650 | Fax: (081) 3355-1647 |
| | E-mail: reciprev@recife.pe.gov.br |

4. REPRESENTANTE LEGAL DA UNIDADE GESTORA

| | | |
|---|------------------------------|--|
| Nome: MANOEL CARNEIRO SOARES CARDOSO | CPF: 091.325.624-20 | Data Início de Gestão: 01/01/2013 |
| Cargo: Presidente | Complemento do Cargo: | |
| Telefone: (081) 3355-1650 | Fax: (081) 3355-1647 | E-mail: manoel.carneiro@reciprev.gov.br |

5. GESTOR DE RECURSOS

| | | |
|--|---|--|
| Nome: JOSE MARCOS ALVES DE BARROS | CPF: 334.326.354-00 | Data Início de Gestão: 24/04/2013 |
| Cargo: Gestor | Complemento do Cargo: Gerente de Investimentos | |
| Telefone: (081) 3355-1642 | Fax: (081) 3355-1647 | E-mail: zemarcos@recife.pe.gov.br |
| Entidade Certificadora: ANBIMA | | Validade Certificação: 03/05/2019 |

6. RESPONSÁVEL PELO ENVIO

| | |
|--|--|
| Nome: JOSE MARCOS ALVES DE BARROS | CPF: 334.326.354-00 |
| Telefone: (081) 3355-1642 | Fax: (081) 3355-1647 |
| | E-mail: zemarcos@recife.pe.gov.br |

7. DEMONSTRATIVO – RECURSOS APLICADOS

Exercício: 2016

Bimestre: NOV/DEZ

Gestão: Própria

Entidade Credenciada:

CNPJ da Entidade Credenciada:

7.1. DEMONSTRATIVO – OPERAÇÕES COM TÍTULOS DO TN NO BIMESTRE

Não existe Operação com Títulos do TN neste bimestre.

7.2. DEMONSTRATIVO - CARTEIRA

Aplicação Nº: 001

Segmento: Renda Variável

Tipo de Ativo: FI em Ações - Art. 8º, III

Data da Posição Atual: 30/12/2016

Instituição Financeira: BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A

CNPJ da Instituição Financeira: 30.822.936/0001-69

Fundo: BB AÇÕES PIPE FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO

CNPJ do Fundo: 17.116.227/0001-08

Quantidade de Cotas: 3.918.013,7780590000

Valor Atual da Cota: 1,2459266640

Valor Total Atual: 4.881.557,84

Patrimônio Líquido do Fundo: 90.359.940,89

% dos Recursos do RPPS: 0,34 %

% do Patrimônio Líquido do Fundo: 5,40 %

Aplicação Nº: 002

Segmento: Renda Fixa

Tipo de Ativo: FI de Renda Fixa - Art. 7º, IV, a

Data da Posição Atual: 30/12/2016

Instituição Financeira: BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A

CNPJ da Instituição Financeira: 30.822.936/0001-69

Fundo: BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO

CNPJ do Fundo: 13.077.415/0001-05

Quantidade de Cotas: 342.710,5052320000

Valor Atual da Cota: 1,7313073470

Valor Total Atual: 593.337,22

Índice de Referência: CDI

Patrimônio Líquido do Fundo: 1.370.183.014,53

% dos Recursos do RPPS: 0,04 %

% do Patrimônio Líquido do Fundo: 0,04 %

Aplicação Nº: 003

Segmento: Renda Fixa

Tipo de Ativo: FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, "b"

Data da Posição Atual: 30/12/2016

Instituição Financeira: BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A

CNPJ da Instituição Financeira: 30.822.936/0001-69

Fundo: BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO

CNPJ do Fundo: 13.322.205/0001-35

Quantidade de Cotas: 41.683.039,8141820000

Valor Atual da Cota: 1,9625210220

Valor Total Atual: 81.803.841,90

Índice de Referência: IDkA

Patrimônio Líquido do Fundo: 5.356.426.609,06

% dos Recursos do RPPS: 5,78 %

% do Patrimônio Líquido do Fundo: 1,53 %

| | | |
|--|--|---|
| Aplicação Nº: 004 | Tipo de Ativo: FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, "b" | |
| Segmento: Renda Fixa | | |
| Data da Posição Atual: 30/12/2016 | | |
| Instituição Financeira: BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A | | CNPJ da Instituição Financeira: 30.822.936/0001-69 |
| Fundo: BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDO DE INVE | | CNPJ do Fundo: 11.328.882/0001-35 |
| Quantidade de Cotas: 14.695.651,0809160000 | Valor Atual da Cota: 2,0897054150 | Valor Total Atual: 30.709.581,64 |
| Índice de Referência: IMA | | |
| Patrimônio Líquido do Fundo: 9.883.521.432,70 | | |
| % dos Recursos do RPPS: 2,17 % | | % do Patrimônio Líquido do Fundo: 0,31 % |
| Aplicação Nº: 005 | Tipo de Ativo: FI de Renda Fixa - Art. 7º, IV, a | |
| Segmento: Renda Fixa | | |
| Data da Posição Atual: 30/12/2016 | | |
| Instituição Financeira: BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A | | CNPJ da Instituição Financeira: 30.822.936/0001-69 |
| Fundo: BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA PERFIL FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO | | CNPJ do Fundo: 13.077.418/0001-49 |
| Quantidade de Cotas: 572.539,2369020000 | Valor Atual da Cota: 1,8160753880 | Valor Total Atual: 1.039.774,42 |
| Índice de Referência: CDI | | |
| Patrimônio Líquido do Fundo: 5.295.826.434,29 | | |
| % dos Recursos do RPPS: 0,07 % | | % do Patrimônio Líquido do Fundo: 0,02 % |
| Aplicação Nº: 006 | Tipo de Ativo: FI de Renda Fixa - Art. 7º, IV, a | |
| Segmento: Renda Fixa | | |
| Data da Posição Atual: 30/12/2016 | | |
| Instituição Financeira: CAIXA ECONÔMICA FEDERAL | | CNPJ da Instituição Financeira: 00.360.305/0001-04 |
| Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LONGO PRAZO | | CNPJ do Fundo: 03.737.206/0001-97 |
| Quantidade de Cotas: 1.540.353,7008150000 | Valor Atual da Cota: 2,9573040000 | Valor Total Atual: 4.555.294,16 |
| Índice de Referência: CDI | | |
| Patrimônio Líquido do Fundo: 5.991.830.971,91 | | |
| % dos Recursos do RPPS: 0,32 % | | % do Patrimônio Líquido do Fundo: 0,08 % |
| Aplicação Nº: 007 | Tipo de Ativo: FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, "b" | |
| Segmento: Renda Fixa | | |
| Data da Posição Atual: 30/12/2016 | | |
| Instituição Financeira: CAIXA ECONÔMICA FEDERAL | | CNPJ da Instituição Financeira: 00.360.305/0001-04 |
| Fundo: CX FI BRASIL IMA-B 5 TP RF LP | | CNPJ do Fundo: 11.060.913/0001-10 |
| Quantidade de Cotas: 29.665.838,7771990000 | Valor Atual da Cota: 2,1545030000 | Valor Total Atual: 63.915.138,64 |
| Índice de Referência: IMA | | |
| Patrimônio Líquido do Fundo: 5.448.499.722,12 | | |
| % dos Recursos do RPPS: 4,52 % | | % do Patrimônio Líquido do Fundo: 1,17 % |

| | | |
|--|--|---|
| Aplicação Nº: 008 | Tipo de Ativo: FI de Renda Fixa - Art. 7º, IV, a | |
| Segmento: Renda Fixa | | |
| Data da Posição Atual: 30/12/2016 | | |
| Instituição Financeira: CAIXA ECONÔMICA FEDERAL | | CNPJ da Instituição Financeira: 00.360.305/0001-04 |
| Fundo: CAIXA FI BRASIL 2018 I TP RF | | CNPJ do Fundo: 18.598.256/0001-08 |
| Quantidade de Cotas: 75.000.000,0000000000 | Valor Atual da Cota: 1,2807690000 | Valor Total Atual: 96.057.675,00 |
| Índice de Referência: IPCA + 6% a.a. | | |
| Patrimônio Líquido do Fundo: 1.283.737.631,75 | | |
| % dos Recursos do RPPS: 6,79 % | | % do Patrimônio Líquido do Fundo: 7,48 % |
| Aplicação Nº: 009 | Tipo de Ativo: FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, "b" | |
| Segmento: Renda Fixa | | |
| Data da Posição Atual: 30/12/2016 | | |
| Instituição Financeira: CAIXA ECONÔMICA FEDERAL | | CNPJ da Instituição Financeira: 00.360.305/0001-04 |
| Fundo: CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF LP | | CNPJ do Fundo: 18.598.288/0001-03 |
| Quantidade de Cotas: 15.000.000,0000000000 | Valor Atual da Cota: 1,3330160000 | Valor Total Atual: 19.995.240,00 |
| Índice de Referência: IMA | | |
| Patrimônio Líquido do Fundo: 356.120.062,22 | | |
| % dos Recursos do RPPS: 1,41 % | | % do Patrimônio Líquido do Fundo: 5,61 % |
| Aplicação Nº: 010 | Tipo de Ativo: FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, "b" | |
| Segmento: Renda Fixa | | |
| Data da Posição Atual: 30/12/2016 | | |
| Instituição Financeira: CAIXA ECONÔMICA FEDERAL | | CNPJ da Instituição Financeira: 00.360.305/0001-04 |
| Fundo: CAIXA FI BRASIL 2030 II TP RF | | CNPJ do Fundo: 19.769.046/0001-06 |
| Quantidade de Cotas: 4.000.000,0000000000 | Valor Atual da Cota: 1,3697300000 | Valor Total Atual: 5.478.920,00 |
| Índice de Referência: IMA | | |
| Patrimônio Líquido do Fundo: 50.406.584,72 | | |
| % dos Recursos do RPPS: 0,39 % | | % do Patrimônio Líquido do Fundo: 10,87 % |
| Aplicação Nº: 011 | Tipo de Ativo: FI Imobiliário - cotas negociadas em bolsa - Art. 8º, VI | |
| Segmento: Renda Variável | | |
| Data da Posição Atual: 30/12/2016 | | |
| Instituição Financeira: CAIXA ECONÔMICA FEDERAL | | CNPJ da Instituição Financeira: 00.360.305/0001-04 |
| Fundo: FII CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FII | | CNPJ do Fundo: 17.098.794/0001-70 |
| Quantidade de Cotas: 4.000,0000000000 | Valor Atual da Cota: 1.020,0000000000 | Valor Total Atual: 4.080.000,00 |
| Patrimônio Líquido do Fundo: 160.727.520,00 | | |
| % dos Recursos do RPPS: 0,29 % | | % do Patrimônio Líquido do Fundo: 2,54 % |

| | | |
|--|--|---|
| Aplicação Nº: 012 | Tipo de Ativo: FI em Ações - Art. 8º, III | |
| Segmento: Renda Variável | | |
| Data da Posição Atual: 30/12/2016 | | |
| Instituição Financeira: BNY MELLON SERVIÇOS FINANCEIROS DTVM S.A | | CNPJ da Instituição Financeira: 02.201.501/0001-61 |
| Fundo: AZ QUEST SMALL FIC FIA | | CNPJ do Fundo: 11.392.165/0001-72 |
| Quantidade de Cotas: 1.322.434,7958420000 | Valor Atual da Cota: 2,6721567400 | Valor Total Atual: 3.533.753,05 |
| Patrimônio Líquido do Fundo: 143.255.740,72 | | % do Patrimônio Líquido do Fundo: 2,47 % |
| % dos Recursos do RPPS: 0,25 % | | |
| Aplicação Nº: 013 | Tipo de Ativo: FI em Participações - fechado - Art. 8º, V | |
| Segmento: Renda Variável | | |
| Data da Posição Atual: 30/12/2016 | | |
| Instituição Financeira: BNY Mellon Serviços Financeiros DTVM S.A, | | CNPJ da Instituição Financeira: 02.201.501/0001-61 |
| Fundo: ÁTICO GERAÇÃO DE ENERGIO FIP | | CNPJ do Fundo: 11.490.580/0001-69 |
| Quantidade de Cotas: 5.762.023,7933121200 | Valor Atual da Cota: 1,8540970500 | Valor Total Atual: 10.683.351,32 |
| Patrimônio Líquido do Fundo: 340.549.678,89 | | % do Patrimônio Líquido do Fundo: 3,14 % |
| % dos Recursos do RPPS: 0,75 % | | |
| Aplicação Nº: 014 | Tipo de Ativo: FI em Participações - fechado - Art. 8º, V | |
| Segmento: Renda Variável | | |
| Data da Posição Atual: 30/12/2016 | | |
| Instituição Financeira: BNY Mellon Serviços Financeiros DTVM S.A, | | CNPJ da Instituição Financeira: 02.201.501/0001-61 |
| Fundo: ÁTICO FLORESTAL FIP | | CNPJ do Fundo: 12.312.767/0001-35 |
| Quantidade de Cotas: 8,3048839600 | Valor Atual da Cota: 971.270,8331251400 | Valor Total Atual: 8.066.291,56 |
| Patrimônio Líquido do Fundo: 176.771.033,76 | | % do Patrimônio Líquido do Fundo: 4,56 % |
| % dos Recursos do RPPS: 0,57 % | | |
| Aplicação Nº: 015 | Tipo de Ativo: FI Imobiliário - cotas negociadas em bolsa - Art. 8º, VI | |
| Segmento: Renda Variável | | |
| Data da Posição Atual: 30/12/2016 | | |
| Instituição Financeira: SOCOPA SOCIEDADE CORRETORA PAULISTA S.A | | CNPJ da Instituição Financeira: 62.285.390/0001-40 |
| Fundo: REIT RIVIERA FII | | CNPJ do Fundo: 16.841.067/0001-99 |
| Quantidade de Cotas: 5.991,0000000000 | Valor Atual da Cota: 1.203,1342128500 | Valor Total Atual: 7.207.977,07 |
| Patrimônio Líquido do Fundo: 31.981.395,51 | | % do Patrimônio Líquido do Fundo: 22,54 % |
| % dos Recursos do RPPS: 0,51 % | | |

| | | |
|--|--|---|
| Aplicação Nº: 016 | Tipo de Ativo: FI Multimercado - aberto - Art. 8º, IV | |
| Segmento: Renda Variável | | |
| Data da Posição Atual: 30/12/2016 | | |
| Instituição Financeira: VOTORANTIM ASSET MANAGEMENT DTVM LTDA. | | CNPJ da Instituição Financeira: 03.384.738/0001-98 |
| Fundo: VOTORANTIM ATUARIAL MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO FUNDO DE INVESTIMENTO | | CNPJ do Fundo: 14.491.564/0001-89 |
| Quantidade de Cotas: 4.458.962,5900479600 | Valor Atual da Cota: 1,5417886580 | Valor Total Atual: 6.874.777,95 |
| Patrimônio Líquido do Fundo: 159.541.661,28 | | % do Patrimônio Líquido do Fundo: 4,31 % |
| % dos Recursos do RPPS: 0,49 % | | |
| Aplicação Nº: 017 | Tipo de Ativo: FI em Participações - fechado - Art. 8º, V | |
| Segmento: Renda Variável | | |
| Data da Posição Atual: 30/12/2016 | | |
| Instituição Financeira: ICLA TRUST DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A | | CNPJ da Instituição Financeira: 10.274.584/0001-47 |
| Fundo: FIP PORTO CAIS MAUÁ | | CNPJ do Fundo: 17.213.821/0001-09 |
| Quantidade de Cotas: 616,3975453000 | Valor Atual da Cota: 10.729,7032443000 | Valor Total Atual: 6.613.762,74 |
| Patrimônio Líquido do Fundo: 164.132.666,72 | | % do Patrimônio Líquido do Fundo: 4,03 % |
| % dos Recursos do RPPS: 0,47 % | | |
| Aplicação Nº: 018 | Tipo de Ativo: FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, "b" | |
| Segmento: Renda Fixa | | |
| Data da Posição Atual: 30/12/2016 | | |
| Instituição Financeira: BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A | | CNPJ da Instituição Financeira: 30.822.936/0001-69 |
| Fundo: BB Previdenciário TP IPCA VI | | CNPJ do Fundo: 19.523.306/0001-50 |
| Quantidade de Cotas: 16.264.171,6894240000 | Valor Atual da Cota: 1,5020975030 | Valor Total Atual: 24.430.371,68 |
| Índice de Referência: IMA | | % do Patrimônio Líquido do Fundo: 8,13 % |
| Patrimônio Líquido do Fundo: 300.459.415,39 | | |
| % dos Recursos do RPPS: 1,73 % | | |
| Aplicação Nº: 019 | Tipo de Ativo: FI de Renda Fixa - Art. 7º, IV, a | |
| Segmento: Renda Fixa | | |
| Data da Posição Atual: 30/12/2016 | | |
| Instituição Financeira: BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A | | CNPJ da Instituição Financeira: 30.822.936/0001-69 |
| Fundo: BB Previdenciário TP IPCA | | CNPJ do Fundo: 15.486.093/0001-83 |
| Quantidade de Cotas: 12.626.096,8122460000 | Valor Atual da Cota: 1,5563313420 | Valor Total Atual: 19.650.390,20 |
| Índice de Referência: IPCA + 6% | | % do Patrimônio Líquido do Fundo: 7,44 % |
| Patrimônio Líquido do Fundo: 264.127.465,87 | | |
| % dos Recursos do RPPS: 1,39 % | | |

| | | | |
|---|--|--|--|
| Aplicação Nº: 020 | Segmento: Renda Fixa | Tipo de Ativo: FI de Renda Fixa - Art. 7º, IV, a | |
| Data da Posição Atual: 30/12/2016 | Instituição Financeira: BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A. | CNPJ da Instituição Financeira: 30.822.936/0001-69 | |
| Fundo: BB Previdenciário TP IPCA III | Quantidade de Cotas: 51.926.776,4159950000 | CNPJ do Fundo: 19.303.795/0001-35 | |
| Índice de Referência: IPCA + 6% | Valor Atual da Cota: 1,4869854440 | Valor Total Atual: 77.214.360,68 | |
| Patrimônio Líquido do Fundo: 1.022.662.459,32 | | % do Patrimônio Líquido do Fundo: 7,55 % | |
| % dos Recursos do RPPS: 5,45 % | | | |
| Aplicação Nº: 021 | Segmento: Renda Fixa | Tipo de Ativo: FI Renda Fixa "Crédito Privado" - Art. 7º, VII, b | |
| Data da Posição Atual: 30/12/2016 | Instituição Financeira: SUL AMÉRICA INVESTIMENTOS DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A. | CNPJ da Instituição Financeira: 32.206.435/0001-83 | |
| Fundo: SUL AMÉRICA EXCELLENCE FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO | Quantidade de Cotas: 262.520,7921064520 | CNPJ do Fundo: 04.899.128/0001-90 | |
| Patrimônio Líquido do Fundo: 1.085.020.914,89 | Valor Atual da Cota: 59,0352805000 | Valor Total Atual: 15.497.988,60 | |
| % dos Recursos do RPPS: 1,09 % | | % do Patrimônio Líquido do Fundo: 1,43 % | |
| Taxa de Performance: | Nível de Risco: BAIXO | Agência de Risco: Standard & Poor's | |
| Aplicação Nº: 022 | Segmento: Renda Fixa | Tipo de Ativo: FI em Direitos Creditórios - Fechado - Cota Sênior - Art. 7º, VII, a | |
| Data da Posição Atual: 30/12/2016 | Instituição Financeira: GRADUAL CORRETORA DE CÂMBIOTÍTULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A | CNPJ da Instituição Financeira: 33.918.160/0001-73 | |
| Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTOS EM DIREITOS CREDITÓRIOS MULTISSETORIAL VALE SÊNIOR 4 | Quantidade de Cotas: 2,9391287300 | CNPJ do Fundo: 11.278.761/0001-26 | |
| Patrimônio Líquido do Fundo: 20.154.385,52 | Valor Atual da Cota: 1.012.334,6834795600 | Valor Total Atual: 2.975.381,95 | |
| % dos Recursos do RPPS: 0,21 % | | % do Patrimônio Líquido do Fundo: 14,76 % | |
| Taxa de Performance: | Nível de Risco: BAIXO | Agência de Risco: Standard & Poor's | |
| Aplicação Nº: 023 | Segmento: Renda Fixa | Tipo de Ativo: FI em Direitos Creditórios - Fechado - Cota Sênior - Art. 7º, VII, a | |
| Data da Posição Atual: 30/12/2016 | Instituição Financeira: Gradual CCTVM S.A. | CNPJ da Instituição Financeira: 33.918.160/0001-73 | |
| Fundo: SUL INVEST FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 6 | Quantidade de Cotas: 28,1647939900 | CNPJ do Fundo: 09.257.784/0001-02 | |
| Patrimônio Líquido do Fundo: 120.375.087,48 | Valor Atual da Cota: 107.072,2673301500 | Valor Total Atual: 3.015.668,35 | |
| % dos Recursos do RPPS: 0,21 % | | % do Patrimônio Líquido do Fundo: 2,51 % | |
| Taxa de Performance: | Nível de Risco: BAIXO | Agência de Risco: Standard & Poor's | |

| | |
|--|--|
| Aplicação Nº: 024 Segmento: Renda Fixa Intermediário: SAGRES DISTRIBUIDORA DE TITULOS E VALORES MOBILIARIOS Código SELIC: 760199 Indexador/Índice de Referência: IPCA Data de Emissão: 15/07/2000 Quantidade: 21.500 P.U. de Compra: 1.587,3661100000 P.U. Atual: 3.077,0630040000 Nº da Nota de Negociação: Instituição Custodiante: Banco do Brasil | Tipo de Ativo: Títulos Tesouro Nacional - SELIC - Art. 7º, I, "a" Carteira: Própria CNPJ do Intermediário: 62.050.554/0001-50 Tipo: NTN - Nota do Tesouro Nacional Taxa de Juros: Data de Vencimento: 15/05/2045 Data de Negociação: 06/10/2008 Valor Total de Compra: 34.128.371,36 Valor Total Atual: 66.156.854,59 |
| Aplicação Nº: 025 Segmento: Renda Fixa Intermediário: SAGRES DISTRIBUIDORA DE TITULOS E VALORES MOBILIARIOS Código SELIC: 760199 Indexador/Índice de Referência: IPCA Data de Emissão: 15/07/2000 Quantidade: 10.000 P.U. de Compra: 1.586,2114300000 P.U. Atual: 3.077,0630040000 Nº da Nota de Negociação: Instituição Custodiante: Banco do Brasil | Tipo de Ativo: Títulos Tesouro Nacional - SELIC - Art. 7º, I, "a" Carteira: Própria CNPJ do Intermediário: 62.050.554/0001-50 Tipo: NTN - Nota do Tesouro Nacional Taxa de Juros: Data de Vencimento: 15/05/2045 Data de Negociação: 02/10/2008 Valor Total de Compra: 15.862.114,30 Valor Total Atual: 30.770.630,04 |
| Aplicação Nº: 026 Segmento: Renda Fixa Intermediário: SAGRES DISTRIBUIDORA DE TITULOS E VALORES MOBILIARIOS Código SELIC: 760199 Indexador/Índice de Referência: IPCA Data de Emissão: 15/07/2000 Quantidade: 10.000 P.U. de Compra: 1.761,0000000000 P.U. Atual: 3.077,0630040000 Nº da Nota de Negociação: Instituição Custodiante: Banco do Brasil | Tipo de Ativo: Títulos Tesouro Nacional - SELIC - Art. 7º, I, "a" Carteira: Própria CNPJ do Intermediário: 62.050.554/0001-50 Tipo: NTN - Nota do Tesouro Nacional Taxa de Juros: Data de Vencimento: 15/05/2045 Data de Negociação: 07/01/2009 Valor Total de Compra: 17.610.000,00 Valor Total Atual: 30.770.630,04 |

Aplicação Nº: 027
Segmento: Renda Fixa
Intermediário: SAGRES DISTRIBUIDORA DE TITULOS E VALORES MOBILIARIOS
Código SELIC: 760199
Indexador/Índice de Referência: IPCA
Data de Emissão: 15/07/2000
Quantidade: 10.000
P.U. de Compra: 1.763,1110000000
P.U. Atual: 3.077,0630040000
Nº da Nota de Negociação:
Instituição Custodiante: Banco do Brasil

Tipo de Ativo: Títulos Tesouro Nacional - SELIC - Art. 7º, I, "a"
Carteira: Própria
CNPJ do Intermediário: 62.050.554/0001-50
Tipo: NTN - Nota do Tesouro Nacional
Taxa de Juros:
Data de Vencimento: 15/05/2045
Data de Negociação: 13/01/2009
Valor Total de Compra: 17.631.110,00
Valor Total Atual: 30.770.630,04

Aplicação Nº: 028
Segmento: Renda Fixa
Data da Posição Atual: 30/12/2016
Instituição Financeira: SOCIEDADE CORRETORA PAULISTA - SOCOPA S.A
Fundo: SRM FIC FIDC SÊNIOR 3
Quantidade de Cotas: 4,0000000000
Patrimônio Líquido do Fundo: 74.939.029,76
% dos Recursos do RPPS: 0,44 %
Taxa de Performance:
Nível de Risco: BAIXO

Tipo de Ativo: FI em Direitos Creditórios - Fechado - Cota Sênior - Art. 7º, VII, a
CNPJ da Instituição Financeira: 33.918.160/0001-73
CNPJ do Fundo: 09.260.031/0001-56
Valor Atual da Cota: 1.540.522,4300000000
Valor Total Atual: 6.162.089,72
% do Patrimônio Líquido do Fundo: 8,22 %
Agência de Risco: Austin

Aplicação Nº: 029
Segmento: Renda Fixa
Data da Posição Atual: 30/12/2016
Instituição Financeira: CAIXA ECONÔMICA FEDERAL
Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDEITÓRIOS CASAN SANEAMENTO
Quantidade de Cotas: 3.000,0000000000
Patrimônio Líquido do Fundo: 251.546.716,05
% dos Recursos do RPPS: 0,21 %
Taxa de Performance:
Nível de Risco: BAIXO

Tipo de Ativo: FI em Direitos Creditórios - Fechado - Cota Sênior - Art. 7º, VII, a
CNPJ da Instituição Financeira: 00.360.305/0001-04
CNPJ do Fundo: 19.542.287/0001-00
Valor Atual da Cota: 1.006,6643590000
Valor Total Atual: 3.019.993,08
% do Patrimônio Líquido do Fundo: 1,20 %
Agência de Risco: Fitch

| | | |
|---|--|---|
| Aplicação Nº: 030 | Tipo de Ativo: FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, "b" | |
| Segmento: Renda Fixa | | |
| Data da Posição Atual: 30/12/2016 | | |
| Instituição Financeira: BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A | | CNPJ da Instituição Financeira: 30.822.936/0001-69 |
| Fundo: BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B TÍTULOS PUBLICOS FUNDO DE INVESTIMENTO | | CNPJ do Fundo: 07.442.078/0001-05 |
| Quantidade de Cotas: 31.880.752,0312040000 | Valor Atual da Cota: 3,9606211120 | Valor Total Atual: 126.267.579,56 |
| Índice de Referência: IMA | | |
| Patrimônio Líquido do Fundo: 5.026.161.243,16 | | |
| % dos Recursos do RPPS: 8,92 % | | % do Patrimônio Líquido do Fundo: 2,51 % |
| Aplicação Nº: 031 | Tipo de Ativo: FI em Participações - fechado - Art. 8º, V | |
| Segmento: Renda Variável | | |
| Data da Posição Atual: 30/12/2016 | | |
| Instituição Financeira: BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A | | CNPJ da Instituição Financeira: 30.822.936/0001-69 |
| Fundo: TERRAS BRASIL - FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES | | CNPJ do Fundo: 19.412.474/0001-79 |
| Quantidade de Cotas: 3.200,0000000000 | Valor Atual da Cota: 359,9334060000 | Valor Total Atual: 1.151.786,90 |
| Índice de Referência: IMA | | |
| Patrimônio Líquido do Fundo: 11.592.109,30 | | |
| % dos Recursos do RPPS: 0,08 % | | % do Patrimônio Líquido do Fundo: 9,94 % |
| Aplicação Nº: 032 | Tipo de Ativo: FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, "b" | |
| Segmento: Renda Fixa | | |
| Data da Posição Atual: 30/12/2016 | | |
| Instituição Financeira: CAIXA ECONOMICA FEDERAL | | CNPJ da Instituição Financeira: 00.360.305/0001-04 |
| Fundo: CAIXA FI BRASIL IMA-B TIT PUBL RF LP | | CNPJ do Fundo: 10.740.658/0001-93 |
| Quantidade de Cotas: 64.372.673,3688470000 | Valor Atual da Cota: 2,2371400000 | Valor Total Atual: 144.010.682,50 |
| Índice de Referência: IMA | | |
| Patrimônio Líquido do Fundo: 4.722.907.333,32 | | |
| % dos Recursos do RPPS: 10,17 % | | % do Patrimônio Líquido do Fundo: 3,05 % |
| Aplicação Nº: 033 | Tipo de Ativo: FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, "b" | |
| Segmento: Renda Fixa | | |
| Data da Posição Atual: 30/12/2016 | | |
| Instituição Financeira: CAIXA ECONOMICA FEDERAL | | CNPJ da Instituição Financeira: 00.360.305/0001-04 |
| Fundo: CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF | | CNPJ do Fundo: 10.740.670/0001-06 |
| Quantidade de Cotas: 14.011.763,0444720000 | Valor Atual da Cota: 1,9972680000 | Valor Total Atual: 27.985.245,95 |
| Índice de Referência: IMA | | |
| Patrimônio Líquido do Fundo: 12.143.855.090,16 | | |
| % dos Recursos do RPPS: 1,98 % | | % do Patrimônio Líquido do Fundo: 0,23 % |

| | | |
|---|--|---|
| Aplicação Nº: 034 | Tipo de Ativo: FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, "b" | |
| Segmento: Renda Fixa | | |
| Data da Posição Atual: 30/12/2016 | | |
| Instituição Financeira: BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A | | CNPJ da Instituição Financeira: 30.822.936/0001-69 |
| Fundo: BB PREVID RF IMA-B 5+ TP FI | | CNPJ do Fundo: 13.327.340/0001-73 |
| Quantidade de Cotas: 35.402.408,0032200000 | Valor Atual da Cota: 2,0234798870 | Valor Total Atual: 71.636.060,55 |
| Índice de Referência: IMA | | |
| Patrimônio Líquido do Fundo: 1.051.642.884,94 | | |
| % dos Recursos do RPPS: 5,06 % | | % do Patrimônio Líquido do Fundo: 6,81 % |
| Aplicação Nº: 035 | Tipo de Ativo: FI Multimercado - aberto - Art. 8º, IV | |
| Segmento: Renda Variável | | |
| Data da Posição Atual: 30/12/2016 | | |
| Instituição Financeira: SUL AMERICA INVESTIMENTOS DTVM S.A | | CNPJ da Instituição Financeira: 32.206.435/0001-83 |
| Fundo: SUL AMERICA CREDITO ATIVO FI MULTIMERCADO CP | | CNPJ do Fundo: 13.823.084/0001-05 |
| Quantidade de Cotas: 900.694,3239000000 | Valor Atual da Cota: 16,8616552000 | Valor Total Atual: 15.187.197,13 |
| Patrimônio Líquido do Fundo: 381.689.831,23 | | |
| % dos Recursos do RPPS: 1,07 % | | % do Patrimônio Líquido do Fundo: 3,98 % |
| Aplicação Nº: 036 | Tipo de Ativo: FI Multimercado - aberto - Art. 8º, IV | |
| Segmento: Renda Variável | | |
| Data da Posição Atual: 30/12/2016 | | |
| Instituição Financeira: SUL AMERICA INVESTIMENTOS DTVM S.A | | CNPJ da Instituição Financeira: 32.206.435/0001-83 |
| Fundo: SUL AMERICA HIGH YIELD FIM CP | | CNPJ do Fundo: 19.225.709/0001-13 |
| Quantidade de Cotas: 235.559,5805500000 | Valor Atual da Cota: 13,4344556000 | Valor Total Atual: 3.164.614,73 |
| Patrimônio Líquido do Fundo: 35.877.894,92 | | |
| % dos Recursos do RPPS: 0,22 % | | % do Patrimônio Líquido do Fundo: 8,82 % |
| Aplicação Nº: 037 | Tipo de Ativo: FI em Ações - Art. 8º, III | |
| Segmento: Renda Variável | | |
| Data da Posição Atual: 30/12/2016 | | |
| Instituição Financeira: BEM DTVM LTDA | | CNPJ da Instituição Financeira: 00.066.670/0001-00 |
| Fundo: AZ LEGAN BRASIL FIA | | CNPJ do Fundo: 14.550.994/0001-24 |
| Quantidade de Cotas: 5.769.626,6583227000 | Valor Atual da Cota: 0,9961918000 | Valor Total Atual: 5.747.654,77 |
| Patrimônio Líquido do Fundo: 53.262.385,99 | | |
| % dos Recursos do RPPS: 0,41 % | | % do Patrimônio Líquido do Fundo: 10,79 % |

| | | |
|---|--|--|
| Aplicação Nº: 038 | Tipo de Ativo: FI Imobiliário - cotas negociadas em bolsa - Art. 8º, VI | |
| Segmento: Renda Variável | | |
| Data da Posição Atual: 30/12/2016 | | |
| Instituição Financeira: BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A | CNPJ da Instituição Financeira: 30.822.936/0001-69 | |
| Fundo: BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII | CNPJ do Fundo: 20.716.161/0001-93 | |
| Quantidade de Cotas: 50.000,0000000000 | Valor Atual da Cota: 106,0791666000 | Valor Total Atual: 5.303.958,33 |
| Patrimônio Líquido do Fundo: 110.779.818,33 | | % do Patrimônio Líquido do Fundo: 4,79 % |
| % dos Recursos do RPPS: 0,37 % | | |
| Aplicação Nº: 039 | Tipo de Ativo: FI em Direitos Creditórios - Fechado - Cota Sênior - Art. 7º, VII, a | |
| Segmento: Renda Fixa | | |
| Data da Posição Atual: 30/12/2016 | | |
| Instituição Financeira: GRADUAL CORRETORA DE CÂMBIO, TITULOS E VALORES MOBILIÁRIOS S.A | CNPJ da Instituição Financeira: 33.918.160/0001-73 | |
| Fundo: SUL INVEST FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 7 | CNPJ do Fundo: 09.257.784/0001-02 | |
| Quantidade de Cotas: 28,5715653957 | Valor Atual da Cota: 87.891,9083591200 | Valor Total Atual: 2.511.209,41 |
| Patrimônio Líquido do Fundo: 120.375.087,48 | | % do Patrimônio Líquido do Fundo: 2,09 % |
| % dos Recursos do RPPS: 0,18 % | | |
| Taxa de Performance: | | |
| Nível de Risco: BAIXO | Agência de Risco: Standard & Poor's | |
| Aplicação Nº: 040 | Tipo de Ativo: FI em Direitos Creditórios - Aberto - Cota Sênior - Art. 7º, VI | |
| Segmento: Renda Fixa | | |
| Data da Posição Atual: 30/12/2016 | | |
| Instituição Financeira: SOCOPA SOCIEDADE CORRETORA PAULISTA S.A. | CNPJ da Instituição Financeira: 62.285.390/0001-40 | |
| Fundo: FUNDO DE INVESTIMENTO EM QUOTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO EM DIREITOS CREDITÓRIOS – BRAZIL PLUS | CNPJ do Fundo: 14.239.052/0001-20 | |
| Quantidade de Cotas: 257,6236920000 | Valor Atual da Cota: 17.549,3367350000 | Valor Total Atual: 4.521.124,92 |
| Patrimônio Líquido do Fundo: 37.331.190,18 | | % do Patrimônio Líquido do Fundo: 12,11 % |
| % dos Recursos do RPPS: 0,32 % | | |
| Taxa de Performance: | | |
| Nível de Risco: BAIXO | Agência de Risco: Standard & Poor's | |
| Aplicação Nº: 041 | Tipo de Ativo: FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, "b" | |
| Segmento: Renda Fixa | | |
| Data da Posição Atual: 30/12/2016 | | |
| Instituição Financeira: CAIXA ECONÔMICA FEDERAL | CNPJ da Instituição Financeira: 00.360.305/0001-04 | |
| Fundo: CAIXA FI BRASIL 2024 IV TP RF | CNPJ do Fundo: 20.139.595/0001-78 | |
| Quantidade de Cotas: 20.000.000,0000000000 | Valor Atual da Cota: 1,2028760000 | Valor Total Atual: 24.057.520,00 |
| Índice de Referência: IMA | | |
| Patrimônio Líquido do Fundo: 820.181.526,50 | | % do Patrimônio Líquido do Fundo: 2,93 % |
| % dos Recursos do RPPS: 1,70 % | | |

| | | |
|---|--|---|
| Aplicação Nº: 042 | Tipo de Ativo: FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, "b" | |
| Segmento: Renda Fixa | | |
| Data da Posição Atual: 30/12/2016 | | |
| Instituição Financeira: CAIXA ECONÔMICA FEDERAL | | CNPJ da Instituição Financeira: 00.360.305/0001-04 |
| Fundo: CAIXA FI BRASIL 2030 III TP RF | | CNPJ do Fundo: 20.139.534/0001-00 |
| Quantidade de Cotas: 7.000.000,0000000000 | Valor Atual da Cota: 1,2301090000 | Valor Total Atual: 8.610.763,00 |
| Índice de Referência: IMA | | |
| Patrimônio Líquido do Fundo: 209.283.075,67 | | |
| % dos Recursos do RPPS: 0,61 % | | % do Patrimônio Líquido do Fundo: 4,11 % |
| Aplicação Nº: 043 | Tipo de Ativo: FI em Ações - Art. 8º, III | |
| Segmento: Renda Variável | | |
| Data da Posição Atual: 30/12/2016 | | |
| Instituição Financeira: BEM DTVM LTDA. | | CNPJ da Instituição Financeira: 00.066.670/0001-00 |
| Fundo: QUELUZ VALOR FIA | | CNPJ do Fundo: 09.289.072/0001-75 |
| Quantidade de Cotas: 2.464.477,7623060000 | Valor Atual da Cota: 1,7985166000 | Valor Total Atual: 4.432.404,17 |
| Índice de Referência: IMA | | |
| Patrimônio Líquido do Fundo: 52.941.027,91 | | |
| % dos Recursos do RPPS: 0,31 % | | % do Patrimônio Líquido do Fundo: 8,37 % |
| Aplicação Nº: 044 | Tipo de Ativo: FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, "b" | |
| Segmento: Renda Fixa | | |
| Data da Posição Atual: 30/12/2016 | | |
| Instituição Financeira: BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A | | CNPJ da Instituição Financeira: 30.822.936/0001-69 |
| Fundo: BB PREV RF TP IX | | CNPJ do Fundo: 20.734.937/0001-06 |
| Quantidade de Cotas: 10.153.077,9182350000 | Valor Atual da Cota: 1,2547940150 | Valor Total Atual: 12.740.021,41 |
| Índice de Referência: IDkA | | |
| Patrimônio Líquido do Fundo: 345.863.921,27 | | |
| % dos Recursos do RPPS: 0,90 % | | % do Patrimônio Líquido do Fundo: 3,68 % |
| Aplicação Nº: 045 | Tipo de Ativo: FI Renda Fixa/Referenciados RF - Art. 7º, III, a | |
| Segmento: Renda Fixa | | |
| Data da Posição Atual: 30/12/2016 | | |
| Instituição Financeira: BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A | | CNPJ da Instituição Financeira: 30.822.936/0001-69 |
| Fundo: BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI | | CNPJ do Fundo: 03.543.447/0001-03 |
| Quantidade de Cotas: 9.182.891,6843240000 | Valor Atual da Cota: 13,7650009880 | Valor Total Atual: 126.402.513,11 |
| Índice de Referência: IMA | | |
| Patrimônio Líquido do Fundo: 1.969.469.108,90 | | |
| % dos Recursos do RPPS: 8,93 % | | % do Patrimônio Líquido do Fundo: 6,42 % |
| Taxa de Performance: | | |

| | | |
|--|---|--|
| Aplicação Nº: 046 | Tipo de Ativo: FI Renda Fixa "Crédito Privado" - Art. 7º, VII, b | |
| Segmento: Renda Fixa | | |
| Data da Posição Atual: 30/12/2016 | | |
| Instituição Financeira: BTG PACTUAL SERVIÇOS FINANCEIROS S.A | CNPJ da Instituição Financeira: 59.281.253/0001-23 | |
| Fundo: AZ LEGAN VALORE FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA - CRÉDITO PRIVADO | CNPJ do Fundo: 19.782.311/0001-88 | |
| Quantidade de Cotas: 7.267.896,0709720000 | Valor Atual da Cota: 1,3886436000 | Valor Total Atual: 10.092.517,36 |
| Patrimônio Líquido do Fundo: 77.176.697,86 | | % do Patrimônio Líquido do Fundo: 13,08 % |
| % dos Recursos do RPPS: 0,71 % | | |
| Taxa de Performance: | Agência de Risco: Outros | |
| Nível de Risco: BAIXO | | |
| Aplicação Nº: 047 | Tipo de Ativo: FI Renda Fixa/Referenciados RF - Art. 7º, III, a | |
| Segmento: Renda Fixa | | |
| Data da Posição Atual: 30/12/2016 | | |
| Instituição Financeira: BANCO BRADESCO S.A | CNPJ da Instituição Financeira: 60.746.948/0001-12 | |
| Fundo: BRADESCO INST FIC FI RF IMA B | CNPJ do Fundo: 08.702.798/0001-25 | |
| Quantidade de Cotas: 13.421.126,9679903000 | Valor Atual da Cota: 3,0883894000 | Valor Total Atual: 41.449.666,26 |
| Índice de Referência: IMA | | % do Patrimônio Líquido do Fundo: 3,26 % |
| Patrimônio Líquido do Fundo: 1.271.004.079,86 | | |
| % dos Recursos do RPPS: 2,93 % | | |
| Taxa de Performance: | | |
| Aplicação Nº: 048 | Tipo de Ativo: FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, "b" | |
| Segmento: Renda Fixa | | |
| Data da Posição Atual: 30/12/2016 | | |
| Instituição Financeira: BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A | CNPJ da Instituição Financeira: 30.822.936/0001-69 | |
| Fundo: BB PREV RF TP VII FI | CNPJ do Fundo: 19.523.305/0001-06 | |
| Quantidade de Cotas: 17.290.471,5870840000 | Valor Atual da Cota: 1,2804398850 | Valor Total Atual: 22.139.409,45 |
| Índice de Referência: IMA | | % do Patrimônio Líquido do Fundo: 2,03 % |
| Patrimônio Líquido do Fundo: 1.091.984.120,32 | | |
| % dos Recursos do RPPS: 1,56 % | | |
| Aplicação Nº: 049 | Tipo de Ativo: FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, "b" | |
| Segmento: Renda Fixa | | |
| Data da Posição Atual: 30/12/2016 | | |
| Instituição Financeira: CAIXA ECONÔMICA FEDERAL | CNPJ da Instituição Financeira: 00.360.305/0001-04 | |
| Fundo: CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RF LP | CNPJ do Fundo: 14.386.926/0001-71 | |
| Quantidade de Cotas: 9.883.542,7276330000 | Valor Atual da Cota: 1,6252340000 | Valor Total Atual: 16.063.069,68 |
| Índice de Referência: IDkA | | % do Patrimônio Líquido do Fundo: 0,43 % |
| Patrimônio Líquido do Fundo: 3.698.518.947,20 | | |
| % dos Recursos do RPPS: 1,13 % | | |

| | | |
|---|--|---|
| Aplicação Nº: 050 | Tipo de Ativo: FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, "b" | |
| Segmento: Renda Fixa | | |
| Data da Posição Atual: 30/12/2016 | | |
| Instituição Financeira: BANCO SANTANDER (BRASIL) S.A. | | CNPJ da Instituição Financeira: 90.400.888/0001-42 |
| Fundo: SANTANDER FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTO IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RENDA | | CNPJ do Fundo: 13.455.117/0001-01 |
| Quantidade de Cotas: 1.368.229,5119170000 | Valor Atual da Cota: 18,2516587000 | Valor Total Atual: 24.972.458,07 |
| Índice de Referência: IMA | | |
| Patrimônio Líquido do Fundo: 1.331.262.149,96 | | |
| % dos Recursos do RPPS: 1,76 % | | % do Patrimônio Líquido do Fundo: 1,88 % |
| Aplicação Nº: 051 | Tipo de Ativo: FI Multimercado - aberto - Art. 8º, IV | |
| Segmento: Renda Variável | | |
| Data da Posição Atual: 30/12/2016 | | |
| Instituição Financeira: BNY Mellon Serviços Financeiros DTVM S.A | | CNPJ da Instituição Financeira: 02.201.501/0001-61 |
| Fundo: XP Long Short FIM | | CNPJ do Fundo: 11.616.403/0001-86 |
| Quantidade de Cotas: 3.284.000,0061047500 | Valor Atual da Cota: 2,4400580700 | Valor Total Atual: 8.013.150,72 |
| Patrimônio Líquido do Fundo: 633.744.084,66 | | |
| % dos Recursos do RPPS: 0,57 % | | % do Patrimônio Líquido do Fundo: 1,26 % |
| Aplicação Nº: 052 | Tipo de Ativo: FI 100% títulos TN - Art. 7º, I, "b" | |
| Segmento: Renda Fixa | | |
| Data da Posição Atual: 30/12/2016 | | |
| Instituição Financeira: WESTERN ASSET MANAGEMENT COMPANY DTVM LTDA | | CNPJ da Instituição Financeira: 07.437.241/0001-41 |
| Fundo: WESTERN ASSET IMAB5 ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA | | CNPJ do Fundo: 17.517.577/0001-78 |
| Quantidade de Cotas: 8.174.087,3527574000 | Valor Atual da Cota: 1,5043637000 | Valor Total Atual: 12.296.800,29 |
| Índice de Referência: IMA | | |
| Patrimônio Líquido do Fundo: 133.306.469,91 | | |
| % dos Recursos do RPPS: 0,87 % | | % do Patrimônio Líquido do Fundo: 9,22 % |
| Aplicação Nº: 053 | Tipo de Ativo: FI em Ações - Art. 8º, III | |
| Segmento: Renda Variável | | |
| Data da Posição Atual: 30/12/2016 | | |
| Instituição Financeira: BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A | | CNPJ da Instituição Financeira: 30.822.936/0001-69 |
| Fundo: BB PREV AÇÕES ALOCAÇÕES FIC FI | | CNPJ do Fundo: 18.270.783/0001-99 |
| Quantidade de Cotas: 3.435.678,7976670000 | Valor Atual da Cota: 1,1657853730 | Valor Total Atual: 4.005.264,09 |
| Patrimônio Líquido do Fundo: 38.346.600,69 | | |
| % dos Recursos do RPPS: 0,28 % | | % do Patrimônio Líquido do Fundo: 10,44 % |

| | | | |
|--|---|---|---|
| Aplicação Nº: 054 | Segmento: Renda Variável | Tipo de Ativo: FI em Ações - Art. 8º, III | |
| Data da Posição Atual: 30/12/2016 | | | |
| Instituição Financeira: BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A | | | CNPJ da Instituição Financeira: 30.822.936/0001-69 |
| Fundo: BB PREV AÇÕES GOVERNANÇA FI | | | CNPJ do Fundo: 10.418.335/0001-88 |
| Quantidade de Cotas: 3.146.193,1067810000 | | Valor Atual da Cota: 1,5694019580 | Valor Total Atual: 4.937.641,62 |
| Patrimônio Líquido do Fundo: 107.926.008,07 | | | % do Patrimônio Líquido do Fundo: 4,58 % |
| % dos Recursos do RPPS: 0,35 % | | | |
| Aplicação Nº: 055 | Segmento: Renda Fixa | Tipo de Ativo: FI de Renda Fixa - Art. 7º, IV, a | |
| Data da Posição Atual: 30/12/2016 | | | |
| Instituição Financeira: WESTERN ASSET MANAGEMENT COMPANY DTVM LTDA | | | CNPJ da Instituição Financeira: 07.437.241/0001-41 |
| Fundo: WESTERN ASSET RENDA FIXA ATIVO FI | | | CNPJ do Fundo: 03.499.367/0001-90 |
| Quantidade de Cotas: 1.452,8052437000 | | Valor Atual da Cota: 10.222,5906145000 | Valor Total Atual: 14.851.433,25 |
| Índice de Referência: CDI | | | |
| Patrimônio Líquido do Fundo: 1.053.669.045,48 | | | % do Patrimônio Líquido do Fundo: 1,41 % |
| % dos Recursos do RPPS: 1,05 % | | | |
| Aplicação Nº: 056 | Segmento: Renda Fixa | Tipo de Ativo: FI de Renda Fixa - Art. 7º, IV, a | |
| Data da Posição Atual: 30/12/2016 | | | |
| Instituição Financeira: BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A | | | CNPJ da Instituição Financeira: 30.822.936/0001-69 |
| Fundo: BB PRVIDENCIÁRIO RENDA FIXA FLUXO FUNDO DE INVESTIMENTOS EM COTAS DE FUNDOS DE INVESTIMENTOS | | | CNPJ do Fundo: 13.077.415/0001-05 |
| Quantidade de Cotas: 768.501,6012870000 | | Valor Atual da Cota: 1,7313073470 | Valor Total Atual: 1.330.512,47 |
| Índice de Referência: CDI | | | |
| Patrimônio Líquido do Fundo: 1.345.651.611,08 | | | % do Patrimônio Líquido do Fundo: 0,10 % |
| % dos Recursos do RPPS: 0,09 % | | | |
| Aplicação Nº: 057 | Segmento: Disponibilidades Financeiras | | |
| Saldo: 0,00 | | | |

| | | | |
|--|--|--|---|
| Aplicação Nº: 058 | | | Tipo de Ativo: FI em Direitos Creditórios - Aberto - Cota Sênior - Art. 7º, VI |
| Segmento: Renda Fixa | | | |
| Data da Posição Atual: 30/12/2016 | | | |
| Instituição Financeira: SOCIEDADE CORRETORA PAULISTA - SOCOPA S.A | | | CNPJ da Instituição Financeira: 62.285.390/0001-40 |
| Fundo: FIDC MULTISSETORIAL INVEST DUNAS LP SENIOR | | | CNPJ do Fundo: 13.633.964/0001-19 |
| Quantidade de Cotas: 3.321,8376260000 | Valor Atual da Cota: 1.540,1798900000 | Valor Total Atual: 5.116.227,51 | |
| Patrimônio Líquido do Fundo: 61.906.954,91 | | | % do Patrimônio Líquido do Fundo: 8,26 % |
| % dos Recursos do RPPS: 0,36 % | | | |
| Taxa de Performance: | | | |
| Nível de Risco: BAIXO | Agência de Risco: Austin | | |
| Total de Aplicações no Bimestre: 1.415.523.750,67 | Total de Disponibilidades Financeiras no Bimestre: 0,00 | Total Geral: 1.415.523.750,67 | |