

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos											
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	VAR	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (31/08/2017)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
Renda Fixa											
Artigo 7º I, Alínea b - 4604 - Fundos 100% Títulos Públicos - Referenciado											
CEF	CEF	FI BRASIL 2018 III TP RF..	4,44%	0,48	-2,03%	-3,38%	2,14%	2.374.346,00	1,63%	143.766.702,23	1,65%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - 4604 - Fundos 100% Títulos Públicos - Referenciado				0,48				2.374.346,00	1,63%		
Artigo 7º I, Alínea b - Fundos 100% TP (IMA ou IDkA)											
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF IRF-M TP ..	4,91%	0,57	1,04%	-0,02%	11,73%	3.908.283,28	2,68%	5.019.690.527,82	0,08%
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI..	0,68%	0,12	0,88%	-0,02%	8,17%	18.135.776,02	12,43%	11.122.551.728,48	0,16%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IRFM 1 TP RF ..	0,67%	0,12	0,89%	-0,01%	8,21%	31.491.374,43	21,58%	14.566.700.618,37	0,22%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP RF LP ..	3,66%	0,43	1,24%	-0,01%	9,71%	34.310.617,35	23,52%	6.296.856.629,93	0,54%
CEF	CEF	CAIXA BRASIL IDkA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RJ LP ..	2,84%	0,34	0,96%	-0,38%	9,32%	7.935.594,61	5,44%	3.689.627.968,97	0,22%
BANESTES	BANESTES	FUNDO DE INVESTIMENTO BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS-RENDA FIXA..	2,06%	0,27	0,94%	0,04%	8,58%	742.127,51	0,51%	90.215.840,25	0,82%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - Fundos 100% TP (IMA ou IDkA)				0,27				96.523.773,20	66,16%		
Artigo 7º III, Alínea a - Fundos de Investimentos de Renda Fixa (IMA ou IDk)											
BB	BB	BB PREVID RF IMA-B 5 LP FIC DE FI..	3,67%	0,43	1,24%	-0,01%	9,76%	21.574.684,05	14,79%	1.913.155.812,65	1,13%
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a - Fundos de Investimentos de Renda Fixa (IMA ou IDk)				0,43				21.574.684,05	14,79%		
Artigo 7º IV, Alínea a - RF e REFERENCIAL LIVRE											
BANESTES	BANESTES	FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP ..	0,26%	0,07	0,79%	98,54%	7,44%	3.053.192,22	2,09%	416.892.880,27	0,73%
CEF	CEF	CAIXA FI ALIANÇA RF ..	0,16%	0,06	0,80%	99,92%	7,31%	3.350.161,54	2,30%	334.217.421,26	1,00%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL REF DI LP ..	0,11%	0,06	0,79%	98,78%	7,38%	8.741.373,03	5,99%	5.867.232.539,99	0,15%
BB	BB	BB RPPS RF PERFIL FIC ..	0,11%	0,06	0,79%	98,93%	7,40%	1.217.232,46	0,83%	4.261.850.027,31	0,03%
BANESTES	BANESTES	BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI..	0,18%	0,07	0,85%	105,86%	7,85%	1.639.642,87	1,12%	729.623.043,62	0,22%
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - RF e REFERENCIAL LIVRE				0,06				18.001.602,12	12,34%		
Artigo 7º VII, Alínea b - RF e REF. CRÉDITO PRIVADO											
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IPCA XVI RF CRED PRIV..	1,60%	0,21	0,58%	-0,14%	7,20%	2.040.793,50	1,40%	222.860.425,07	0,92%
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b - RF e REF. CRÉDITO PRIVADO				0,21				2.040.793,50	1,40%		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos											
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	VAR	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (31/08/2017)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
Sub-total Renda Fixa				0,27				140.515.198,87	96,31%		
Renda Variável											
Artigo 8º II, Alínea a - 4604 - Fundos de Ações											
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALAOR DIVIDENDOS RPPS ..	18,95%	2,01	6,51%	-0,45%	13,21%	2.545.714,85	1,74%	393.089.207,90	0,65%
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a - 4604 - Fundos de Ações				2,01				2.545.714,85	1,74%		
Artigo 8º III - FUNDO DE AÇÃO											
BANESTES	BANESTES	FIC BANESTES FIA BTG PACTUAL DIVIDENDOS..	15,73%	1,67	6,17%	-0,80%	17,32%	1.381.955,96	0,95%	6.670.634,10	20,72%
Sub-total Artigo 8º III - FUNDO DE AÇÃO				1,67				1.381.955,96	0,95%		
Artigo 8º VI - FUNDO INVEST IMOBILIÁRIO											
CEF i	CEF i	CXCE11B..	0,00%	0,00	-5,37%	-12,82%	-4,59%	904.492,00	0,62%	154.884.533,25	0,58%
RIO BRAVO	RIO BRAVO	RBRD11..	0,00%	0,00	-2,58%	-10,03%	15,25%	556.207,70	0,38%	138.454.849,67	0,40%
Sub-total Artigo 8º VI - FUNDO INVEST IMOBILIÁRIO				0,00				1.460.699,70	1,00%		
Sub-total Renda Variável				1,38				5.388.370,51	3,69%		
Total								145.903.569,38	100%		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira					
Artigo	Classe	Valor(R\$)	% Carteira	Politica Investimento	Limite Res. 3.922/10
Renda Fixa					
Artigo 7º I, Alínea b - 4604	Fundos 100% Títulos Públicos - Referenciado	2.374.346,00	1,63%	0,00%	100,00%
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% TP (IMA ou IDkA)	96.523.773,20	66,16%	59,50%	100,00%
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos de Investimentos de Renda Fixa (IMA ou IDk)	21.574.684,05	14,79%	16,00%	80,00%
Artigo 7º IV, Alínea a	RF e REFERENCIAL LIVRE	18.001.602,12	12,34%	17,00%	30,00%
Artigo 7º VII, Alínea b	RF e REF. CRÉDITO PRIVADO	2.040.793,50	1,40%	2,00%	5,00%
Total Renda Fixa		140.515.198,87	96,32%		
Renda Variável					
Artigo 8º II, Alínea a - 4604	Fundos de Ações	2.545.714,85	1,74%	0,00%	20,00%
Artigo 8º III	FUNDO DE AÇÃO	1.381.955,96	0,95%	3,00%	15,00%
Artigo 8º VI	FUNDO INVEST IMOBILIÁRIO	1.460.699,70	1,00%	1,50%	5,00%
Total Renda Variável		5.388.370,51	3,69%		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)				
Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,03 127,9	8,91 121,1	-- --	-- --
Artigo 7º I, Alínea b - 4604 % do CDI	-2,03 -253,6	2,14 29,1	-- --	-- --
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,24 155,2	9,76 132,6	-- --	-- --
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,80 99,6	7,42 100,8	-- --	-- --
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,58 72,4	7,20 97,9	-- --	-- --
Artigo 8º II, Alínea a - 4604 Var. IBOVESPA p.p	6,51 -0,9	13,21 -4,4	-- --	-- --
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p	6,17 -1,3	17,32 -0,3	-- --	-- --
Artigo 8º VI Var. IBOVESPA p.p	0,00 -7,5	0,00 -9,5	-- --	-- --

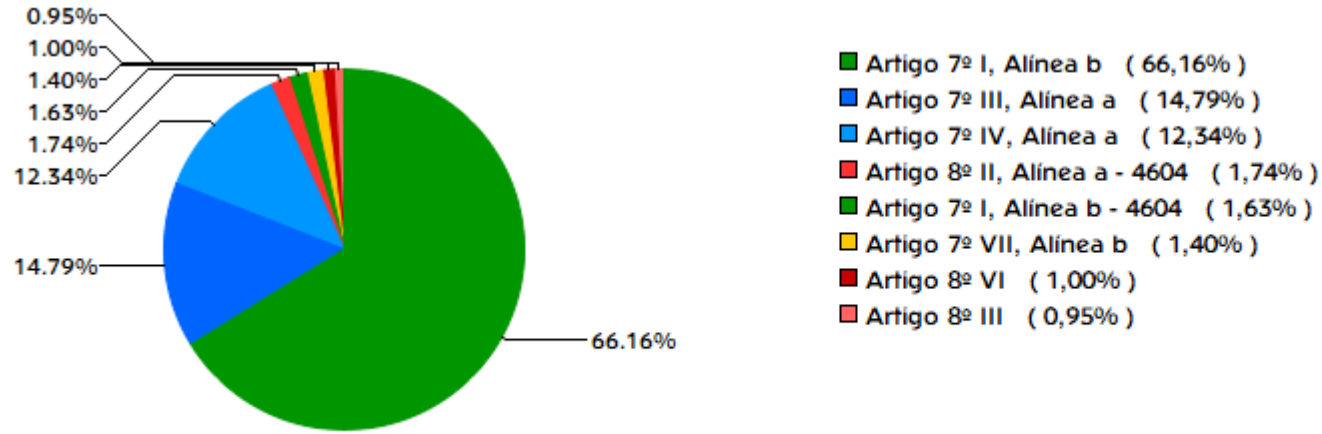
Ganhos Financeiros	
Estratégia	No Mês(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b - 4604	-49.260,00
Artigo 7º I, Alínea b	981.234,66
Artigo 7º III, Alínea a	265.123,24
Artigo 7º IV, Alínea a	145.221,03
Artigo 7º VII, Alínea b	11.772,00
Artigo 8º II, Alínea a - 4604	155.541,32
Artigo 8º III	80.253,41
Artigo 8º VI	-66.014,28
Total	1.523.871,37

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**Análise da Disponibilidade Financeira**

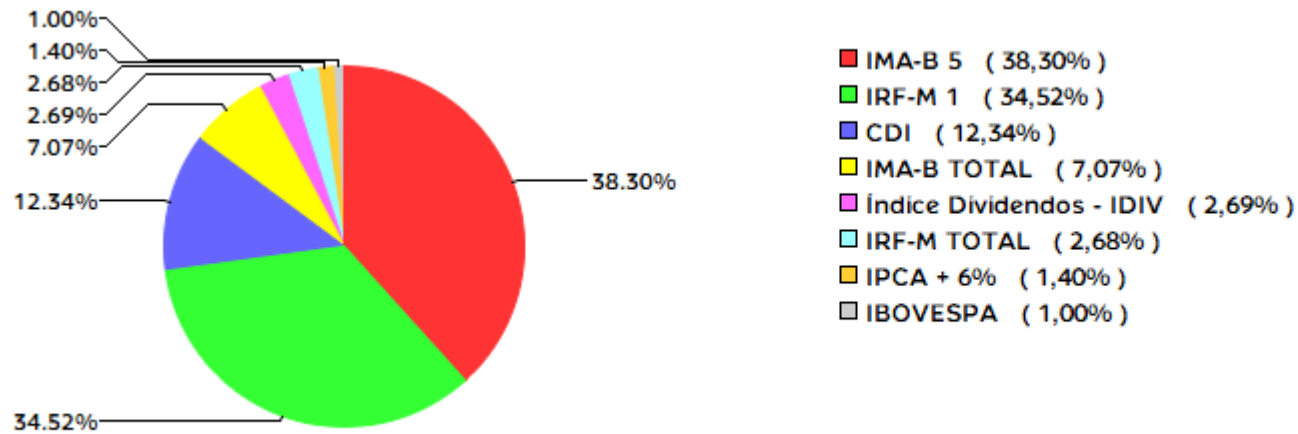
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acum. Bruto (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	145.903.569,38	100	145.903.569,38	100

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia

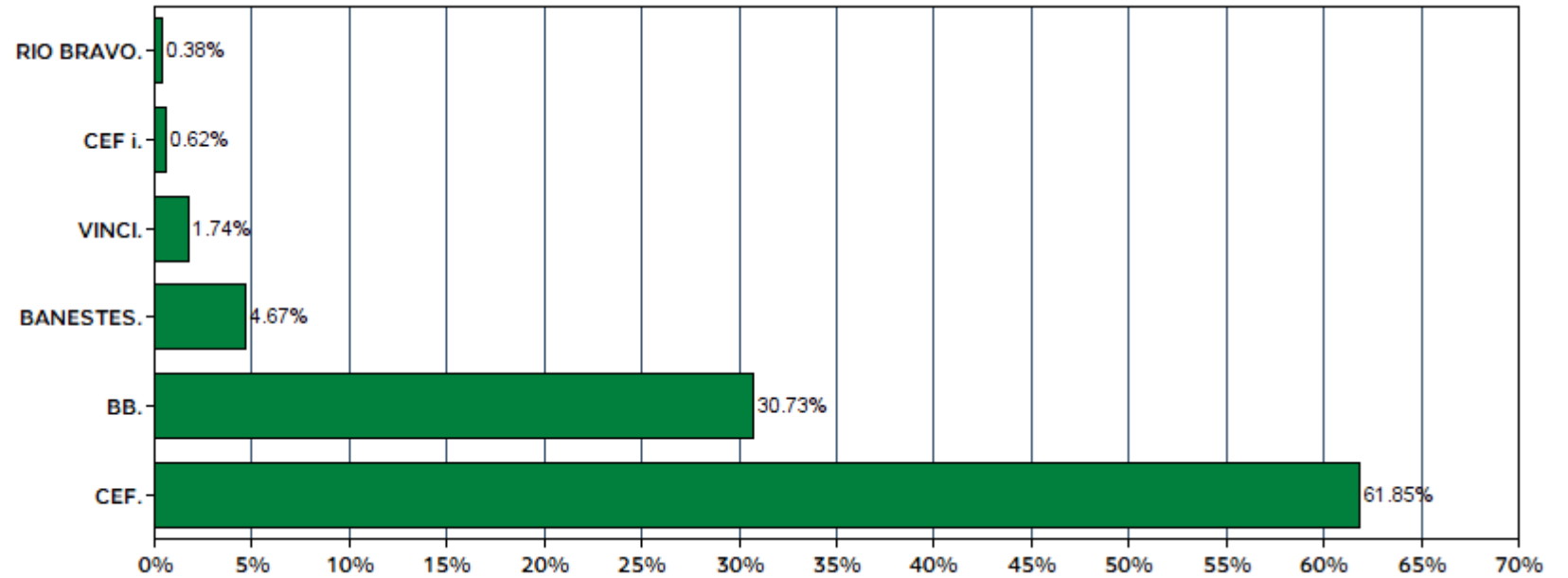


Indexadores



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor

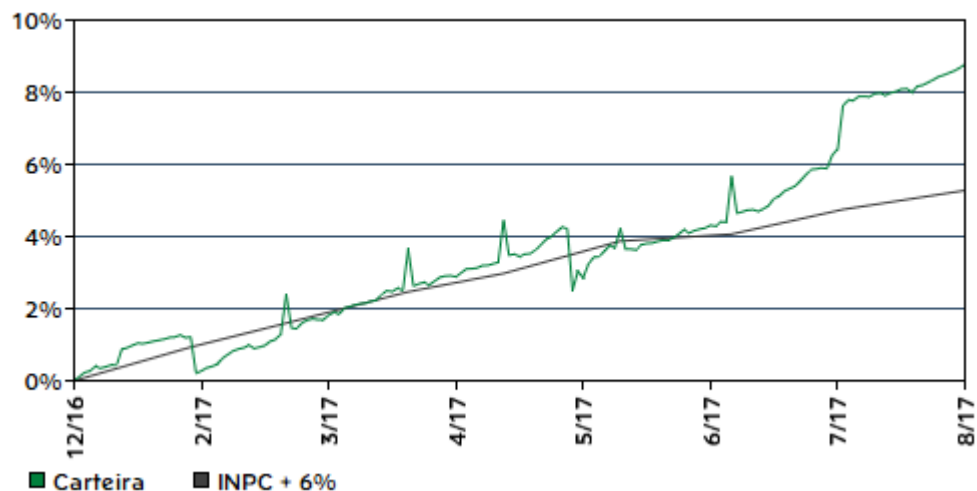


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

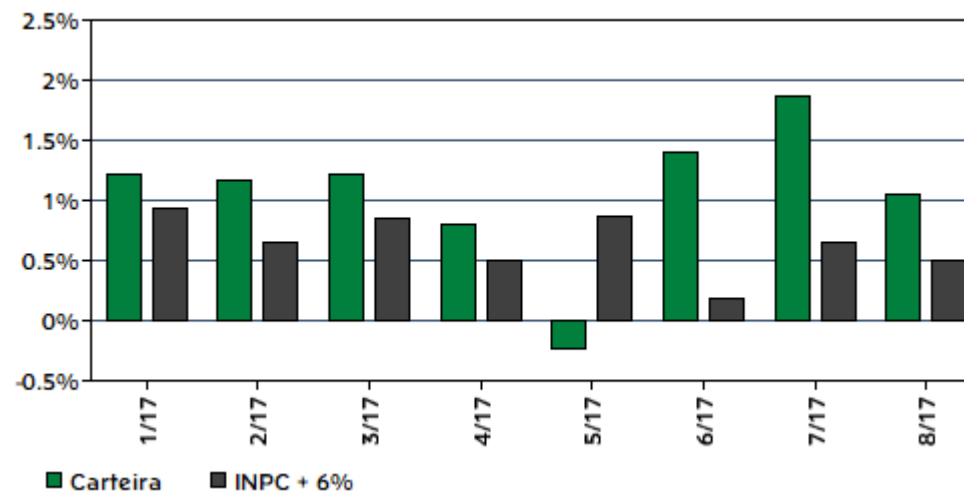
Rentabilidades da Carteira

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
2017	1,21	1,17	1,22	0,80	-0,24	1,39	1,86	1,05	--	--	--	--	8,77
INPC + 6%	0,93	0,66	0,85	0,50	0,87	0,19	0,66	0,50	--	--	--	--	5,28
p.p. Indx	0,28	0,51	0,36	0,30	-1,11	1,21	1,20	0,55	--	--	--	--	3,49

Evolução da Rentabilidade



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco / Retorno da Carteira

	Qtd.	Perct.
Meses acima do Benchmark	7	87,5%
Meses abaixo do Benchmark	1	12,5%

	Rentab.	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,86%	jul/17
Menor rentabilidade da Carteira	-0,24%	mai/17

Período	Rentabilidade (%)			Volat. Anual
	Carteira	INPC + 6%	p.p. Indx.	
03 meses	4,36	1,35	3,0	4,152
06 meses	6,22	3,62	2,6	5,306
12 meses	--	--	--	--
24 meses	--	--	--	--
36 meses	--	--	--	--
Desde o início	8,77	5,28	3,5	4,846

Análise dos Fundos & Ativos da Carteira

Rentabilidades em Períodos Fechados (%)

Fundo / Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
CDI	0,80	7,36	2,43	5,29	12,07	27,90	43,69
IBOVESPA	7,46	17,61	12,95	6,26	22,34	51,92	15,58
DOLAR COMERCIAL	0,52	-3,44	-2,98	1,54	-2,88	-13,70	40,52
INPC + 6%	0,50	5,28	1,35	3,62	7,81	25,28	45,95
IPCA + 6%	0,72	5,65	1,72	3,93	8,58	25,42	45,65