

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos											
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	VAR	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (31/01/2017)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
Renda Fixa											
Artigo 7º I, Alínea a - TÍTULOS DO TESOIRO NACIONAL											
TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824	0,00%	0,00	1,79%	-0,08%	1,79%	34.533.727,61	12,02%	--	--
TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	NTN-C 010421	0,00%	0,00	1,90%	-0,39%	1,90%	16.333.984,55	5,68%	--	--
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a - TÍTULOS DO TESOIRO NACIONAL								50.867.712,16	17,70%		
Artigo 7º I, Alínea b - FUNDOS 100% TP (IMA ou IDkA)											
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,32%	0,09	1,26%	-0,03%	1,26%	56.800.235,36	19,76%	9.858.676.263,64	0,58%
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF IMA-B TP	7,49%	0,86	1,84%	-0,02%	1,84%	0,00	0,00%	5.093.308.228,35	0,00%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IMAB TP RF LP	7,47%	0,86	1,84%	-0,02%	1,84%	68.685.047,59	23,90%	5.218.065.279,62	1,32%
CEF	CEF	CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4,84%	0,53	1,01%	-0,86%	1,01%	5.169.900,49	1,80%	3.138.476.566,99	0,16%
BB	BB	BB Previdenciario XI Títulos Públicos	--%	--	1,21%	0,05%	1,21%	5.452.599,69	1,90%	168.106.895,01	3,24%
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF ALOCACAO ATIVA FCFI	--%	--	1,81%	0,04%	1,81%	27.570.013,93	9,59%	791.053.337,17	3,49%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - FUNDOS 100% TP (IMA ou IDkA)								163.677.797,06	56,96%		
Artigo 7º III, Alínea a - FUNDOS DE INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA (IMA ou IDkA)											
BRADESCO	BRADESCO	BRAD INST FI RF B VERTICE 2019	6,99%	0,74	1,13%	-0,73%	1,13%	5.623.147,65	1,96%	74.604.751,32	7,54%
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a - FUNDOS DE INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA (IMA ou IDkA)								5.623.147,65	1,96%		
Artigo 7º IV, Alínea a - RF e REFERENCIAL LIVRE											
BANCO SANTANDER (BRASIL) AS	BANCO SANTANDER (BRASIL) AS	SANTANDER FIC CORPORATE REFERENCIADO DI	0,02%	0,05	1,10%	100,81%	1,10%	47.866.007,83	16,66%	5.818.541.400,39	0,82%
BRADESCO	BRADESCO	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	0,05%	0,06	1,09%	100,59%	1,09%	19.344.725,33	6,73%	7.240.763.781,97	0,27%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL REF DI LP	0,05%	0,06	1,07%	98,82%	1,07%	0,00	0,00%	6.956.798.953,60	0,00%
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF FLUXO FC FI	0,08%	0,06	0,40%	93,05%	0,40%	0,00	0,00%	1.188.136.929,74	0,00%
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - RF e REFERENCIAL LIVRE								67.210.733,16	23,39%		
Sub-total Renda Fixa								287.379.390,02	100,00%		
Total								287.379.390,02	100%		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Classe	Valor(R\$)	% Carteira	Politica Investimento	Límite Res. 3.922/10
Renda Fixa					
Artigo 7º I, Alínea a	TÍTULOS DO TESOURO NACIONAL	50.867.712,16	17,70%	18,00%	100,00%
Artigo 7º I, Alínea b	FUNDOS 100% TP (IMA ou IDkA)	163.677.797,06	56,96%	70,00%	100,00%
Artigo 7º III, Alínea a	FUNDOS DE INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA (IMA ou IDkA)	5.623.147,65	1,96%	5,00%	80,00%
Artigo 7º IV, Alínea a	RF e REFERENCIAL LIVRE	67.210.733,16	23,39%	30,00%	30,00%
Total Renda Fixa		287.379.390,02	100,01%		

Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)

Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	1,82 167,8	1,82 167,8	-- --	-- --
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,87 172,2	1,87 172,2	-- --	-- --
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,13 104,1	1,13 104,1	-- --	-- --
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	1,09 100,7	1,09 100,7	-- --	-- --

Ganhos Financeiros

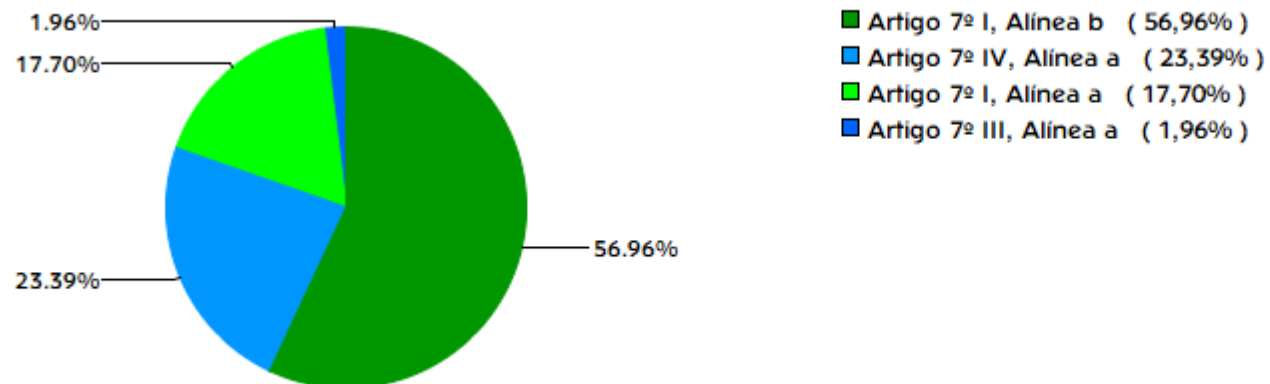
Estratégia	Ganho Bruto (R\$)
Artigo 7º I, Alínea a	911.248,97
Artigo 7º I, Alínea b	3.000.675,40
Artigo 7º III, Alínea a	62.949,99
Artigo 7º IV, Alínea a	741.796,01
Total	4.716.670,36

Análise da Disponibilidade Financeira

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acum. Bruto (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	220.269.126,91	77	220.269.126,91	77
acima de 365 dias	67.113.359,99	23	287.382.486,90	100

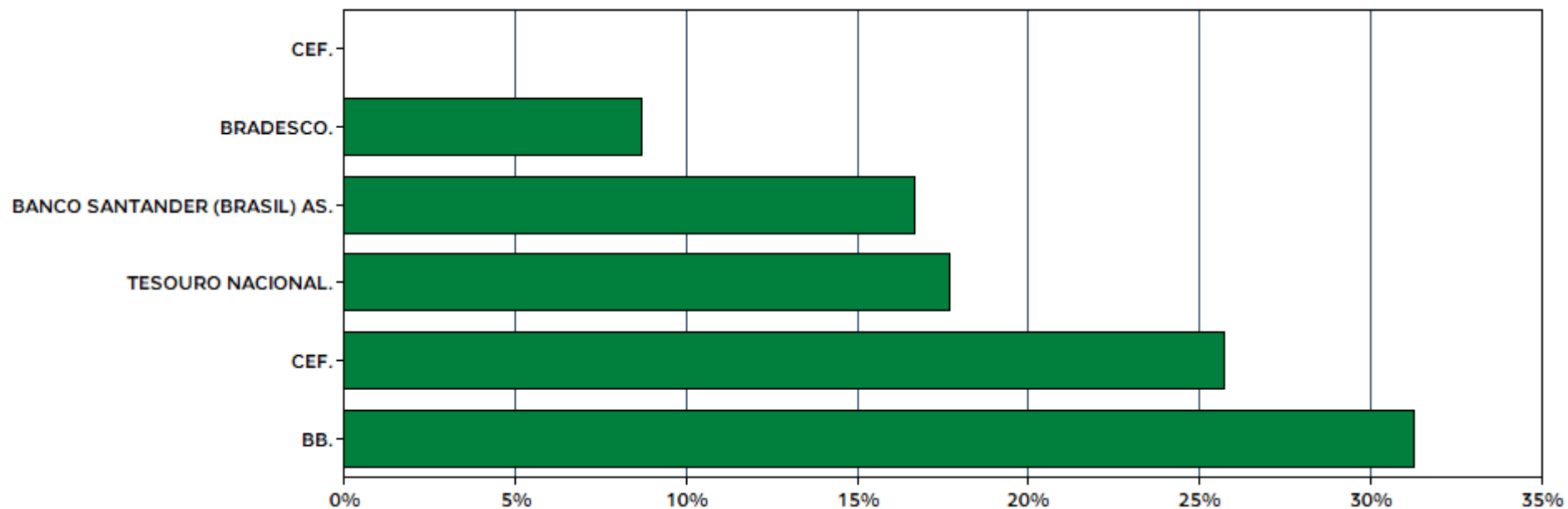
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor

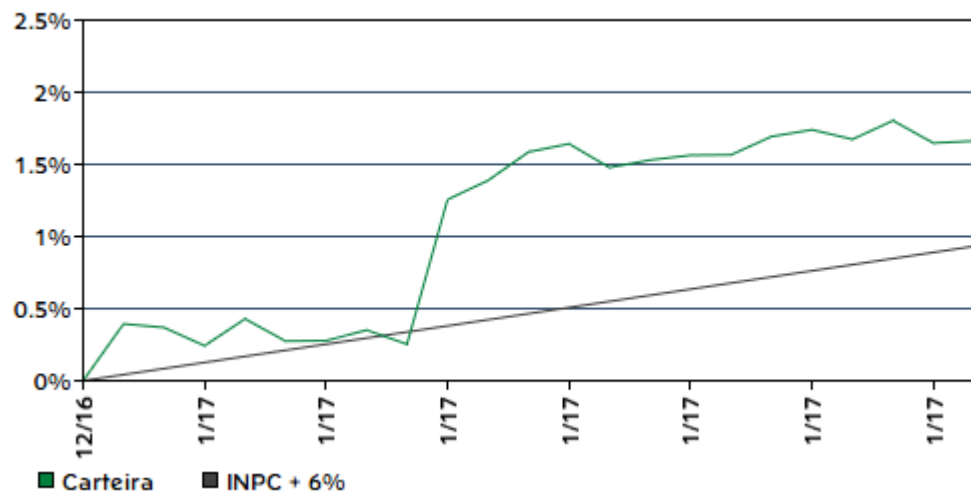


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

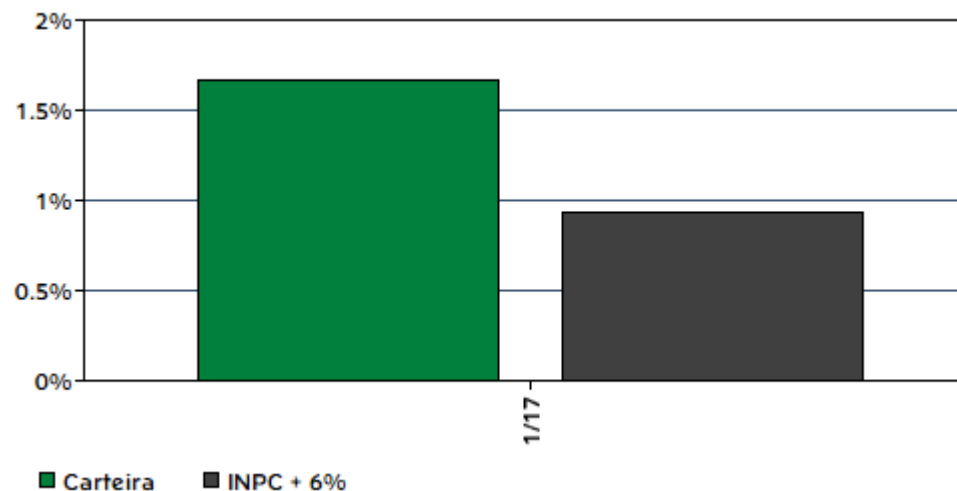
Rentabilidades da Carteira

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
2017	1,66	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	1,66
INPC + 6%	0,93	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	0,93
p.p. Indx	0,73	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	0,73

Evolução da Rentabilidade



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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
BRAD INST FI RF B VERTICE 2019 Var. do IMA-B TOTAL p.p.	1,13 -0,73	1,13 -0,73	1,13 -0,73	1,13 -0,73	1,13 -0,73	1,13 -0,73	1,13 -0,73
SANTANDER FIC CORPORATE REFERENCIADO DI % do CDI	1,10 100,81	1,10 100,81	1,10 100,81	1,10 100,81	1,10 100,81	1,10 100,81	1,10 100,81
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	1,09 100,59	1,09 100,59	1,09 100,59	1,09 100,59	1,09 100,59	1,09 100,59	1,09 100,59
CAIXA FI BRASIL REF DI LP % do CDI	1,07 98,82	1,07 98,82	1,07 98,82	1,07 98,82	1,07 98,82	1,07 98,82	1,07 98,82
BB PREVIDENCIARIO RF FLUXO FC FI % do CDI	0,40 93,05	0,40 93,05	0,40 93,05	0,40 93,05	0,40 93,05	0,40 93,05	0,40 93,05
CDI	1,09	1,09	3,28	6,80	14,04	29,29	43,39
IBOVESPA	7,38	7,38	-0,39	12,85	60,05	37,87	35,75
DOLAR COMERCIAL	-4,05	-4,05	-1,70	-3,46	-22,65	17,45	28,88
INPC + 6%	0,93	0,93	2,13	4,24	11,79	31,80	49,67
IPCA + 6%	0,89	0,89	2,37	4,70	11,70	30,99	48,76