

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos											
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	VAR	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (31/01/2018)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
Renda Fixa											
Artigo 7º I, Alínea a - Títulos do Tesouro Nacional											
TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824..	0,00%	0,00	3,07%	-0,33%	3,07%	37.572.183,95	11,70%	-	0,00%
TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	NTN-C 010421..	0,00%	0,00	1,93%	0,63%	1,93%	17.144.634,83	5,34%	-	0,00%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a - Títulos do Tesouro Nacional				0,00				54.716.818,78	17,03%		
Artigo 7º I, Alínea b - 4604 - Fundos 100% Títulos Públicos - Referenciado											
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF IRF-M TP	4,55%	0,52	1,29%	-0,01%	1,29%	33.784.267,26	10,52%	4.729.358.053,62	0,71%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IMAB TP RF LP	9,35%	1,02	3,37%	-0,03%	3,37%	47.000.419,90	14,63%	4.249.583.705,83	1,11%
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,46%	0,41	1,31%	-0,02%	1,31%	51.749.034,53	16,11%	1.237.352.988,20	4,18%
CEF	CEF	CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4,36%	0,47	1,05%	-2,36%	1,05%	5.392.444,48	1,68%	3.273.575.281,08	0,16%
BRADESCO	BRADESCO	BRAD INST FI RF B VERTICE 2019	4,59%	0,50	0,78%	-2,62%	0,78%	5.987.096,16	1,86%	79.433.415,74	7,54%
BB	BB	BB Previdenciario XI Títulos Públicos	5,72%	0,65	1,78%	0,45%	1,78%	5.906.500,57	1,84%	182.100.929,42	3,24%
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF ALOCACAO ATIVA FCFI	4,92%	0,56	1,72%	0,04%	1,72%	42.144.545,30	13,12%	2.168.161.038,35	1,94%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - 4604 - Fundos 100% Títulos Públicos - Referenciado				0,62				191.964.308,20	59,76%		
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Renda Fixa											
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,13%	0,05	0,16%	98,27%	0,16%	3.680.571,86	1,15%	5.575.075.065,03	0,07%
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC CORPORATE REFERENCIADO DI	0,12%	0,05	0,58%	99,89%	0,58%	0,00	0,00%	6.788.321.803,70	0,00%
BRADESCO	BRADESCO	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	0,14%	0,05	0,57%	98,46%	0,57%	17.473.250,37	5,44%	9.348.518.776,52	0,19%
BB	BB	BB RPPS RF PERFIL FIC	0,13%	0,05	0,57%	97,88%	0,57%	20.221.045,30	6,29%	4.094.151.480,10	0,49%
CEF	CEF	CAIXA FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	4,31%	0,49	1,01%	0,72%	1,01%	33.168.642,87	10,33%	819.367.399,02	4,05%
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Renda Fixa				0,25				74.543.510,40	23,21%		
Sub-total Renda Fixa								321.224.637,38	100,00%		
Total								321.224.637,38	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 a	Títulos do Tesouro Nacional	54.716.818,78	17,03%	17,00%	100,00%
Artigo 7º I, Alínea b - 4604	Fundos 100% Títulos Públicos - Referenciado	191.964.308,20	59,76%	62,00%	100,00%
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604	Fundos de Renda Fixa	74.543.510,40	23,21%	15,00%	40,00%
Total Renda Fixa		321.224.637,38	100,00%		

Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)

Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	2,71 464,5	2,71 464,5	13,70 145,7	-- --
Artigo 7º I, Alínea b - 4604 % do CDI	1,89 323,2	1,89 323,2	-- --	-- --
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,66 122,8	10,04 100,9	10,04 100,9	-- --
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 % do CDI	0,76 130,7	0,76 130,7	-- --	-- --

Ganhos Financeiros

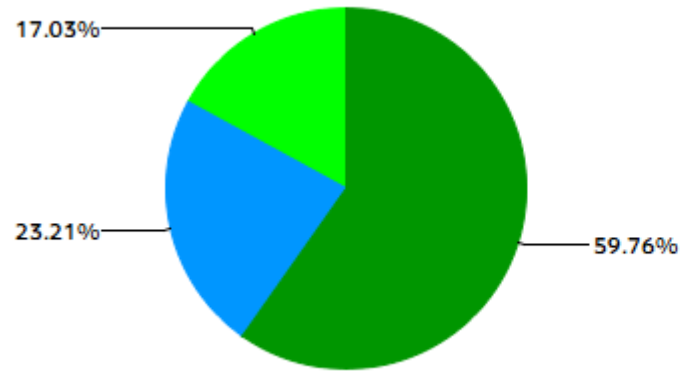
Estratégia	Ganho Bruto (R\$)
Artigo 7º I, Alínea a	1.443.657,16
Artigo 7º I, Alínea b - 4604	3.552.605,57
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604	574.987,05
Total	5.571.249,78

Análise da Disponibilidade Financeira

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acum. Bruto (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	303.938.596,17	95	303.938.596,17	95
de 31 a 364 dias	5.392.444,48	2	309.331.040,65	96
acima de 365 dias	11.893.596,73	4	321.224.637,38	100

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

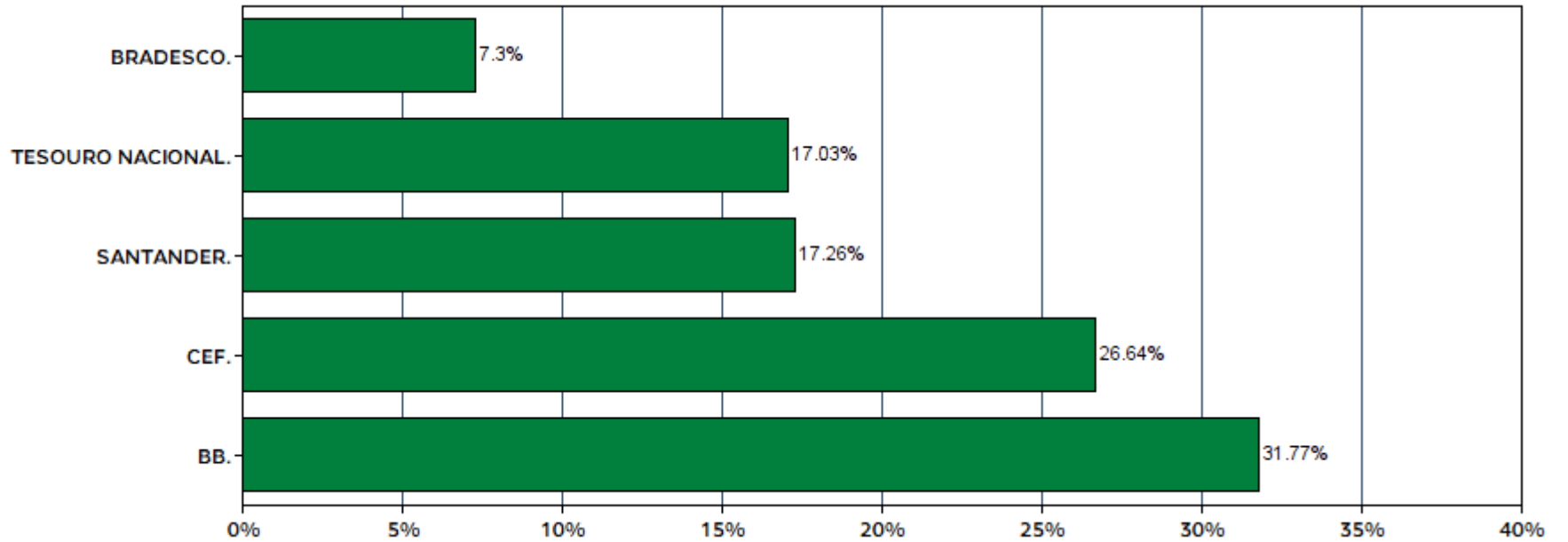
Alocação por Estratégia



- Artigo 7º I, Alínea b - 4604 (59,76%)
- Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 (23,21%)
- Artigo 7º I, Alínea a (17,03%)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

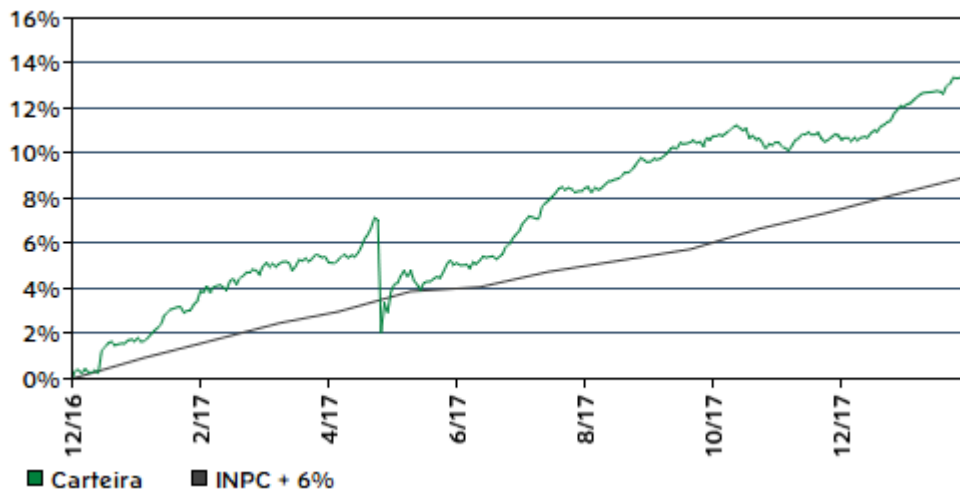
Alocação por Gestor



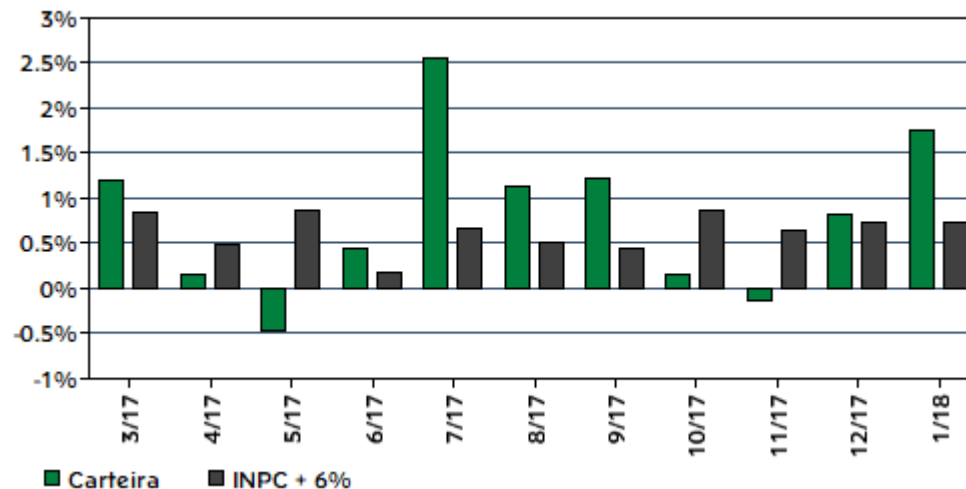
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira													
Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
2017	1,66	2,15	1,20	0,17	-0,47	0,45	2,55	1,13	1,23	0,17	-0,14	0,83	11,43
INPC + 6%	0,93	0,66	0,85	0,50	0,87	0,19	0,66	0,50	0,44	0,86	0,64	0,72	8,12
p.p. Indx	0,73	1,50	0,34	-0,33	-1,35	0,26	1,89	0,63	0,79	-0,69	-0,78	0,10	3,31
2018	1,76	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	1,76
INPC + 6%	0,74	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	0,74
p.p. Indx	1,02	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	1,02

Evolução da Rentabilidade



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco / Retorno da Carteira

	Qtd.	Perct.
Meses acima do Benchmark	9	69,2%
Meses abaixo do Benchmark	4	30,8%

	Rentab.	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,55%	jul/17
Menor rentabilidade da Carteira	-0,47%	mai/17

Período	Rentabilidade (%)			Volat. Anual
	Carteira	INPC + 6%	p.p. Indx.	
03 meses	2,46	2,13	0,3	1,945
06 meses	5,07	3,98	1,1	1,887
12 meses	11,53	7,91	3,6	5,464
24 meses	--	--	--	--
36 meses	--	--	--	--
Desde o início	13,39	8,92	4,5	5,351

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
NTN-B 150824.. % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	3,07 -0,33	3,07 -0,33	2,83 -0,64	3,21 -3,14	8,80 -5,69	26,92 -15,91	28,00 -25,71
NTN-C 010421.. % do Var. IRF-M TOTAL p.p.	1,93 0,63	1,93 0,63	3,72 1,07	4,12 -1,26	4,96 -9,13	14,45 -25,60	21,31 -30,21
BB PREVIDENCIARIO RF ALOCACAO ATIVA FCFI % do Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	1,72 0,04	1,72 0,04	2,51 -0,07	4,99 -0,19	12,17 -0,62	-- --	-- --
BB PREVIDENCIARIO RF IRF-M TP % do Var. IRF-M TOTAL p.p.	1,29 -0,01	1,29 -0,01	2,59 -0,05	5,25 -0,13	13,78 -0,31	39,58 -0,47	50,47 -1,05
BB Previdenciario XI Títulos Públicos % do Var. IMA-B 5 p.p.	1,78 0,45	1,78 0,45	2,73 0,40	5,63 0,46	14,39 1,62	-- --	-- --
BRAD INST FI RF B VERTICE 2019 % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,78 -2,62	0,78 -2,62	-0,59 -4,06	1,91 -4,44	6,47 -8,02	11,28 -31,55	-- --
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,05 -2,36	1,05 -2,36	1,61 -1,85	1,04 -5,30	4,30 -10,19	10,82 -32,02	-- --
CAIXA FI BRASIL IMAB TP RF LP % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	3,37 -0,03	3,37 -0,03	3,39 -0,07	6,21 -0,13	14,24 -0,25	42,39 -0,45	50,85 -2,85

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
SANTANDER FIC IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF % do Var. IMA-B 5 p.p.	1,31 -0,02	1,31 -0,02	2,31 -0,03	5,09 -0,08	12,57 -0,20	27,47 -0,47	48,23 -0,81
BB RPPS RF PERFIL FIC % do % do CDI	0,57 97,88	0,57 97,88	1,73 101,51	3,90 101,49	9,51 101,09	24,76 99,99	41,71 100,64
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM % do % do CDI	0,57 98,46	0,57 98,46	1,67 98,33	4,03 105,08	9,79 104,07	25,49 102,94	42,40 102,31
CAIXA FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF % do Var. IPCA p.p.	1,01 0,72	1,01 0,72	2,09 1,07	4,46 2,66	11,06 8,20	-- --	-- --
SANTANDER FIC CORPORATE REFERENCIADO DI % do % do CDI	0,58 99,89	0,58 99,89	1,69 99,23	3,88 101,00	9,54 101,40	24,97 100,85	41,85 100,97
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI % do % do CDI	0,58 99,89	0,58 99,89	1,68 99,12	3,89 101,25	9,59 102,02	25,18 101,69	42,21 101,84
CDI	0,58	0,58	1,70	3,84	9,40	24,76	41,44
IBOVESPA	11,14	11,14	14,27	28,81	31,30	110,15	81,02
DOLAR COMERCIAL	-4,40	-4,40	-3,49	1,01	1,13	-21,78	18,78
INPC + 6%	0,74	0,74	2,13	3,98	7,91	20,63	42,23
IPCA + 6%	0,80	0,80	2,47	4,80	8,95	21,70	42,71