

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos											
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	VAR	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (31/07/2017)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
Renda Fixa											
Artigo 7º I, Alínea a - TÍTULOS DO TESOUREO NACIONAL											
TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824	0,00%	0,00	3,84%	-0,15%	10,35%	36.403.930,63	11,92%	--	--
TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	NTN-C 010421	0,00%	0,00	2,53%	0,22%	5,67%	16.466.915,57	5,39%	--	--
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a - TÍTULOS DO TESOUREO NACIONAL								52.870.846,20	17,31%		
Artigo 7º I, Alínea b - FUNDOS 100% TP (IMA ou IDkA)											
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF IRF-M TP	4,91%	0,57	2,31%	-0,00%	6,72%	32.100.139,16	10,51%	5.042.823.951,08	0,64%
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF IMA-B TP	10,08%	1,10	3,96%	-0,04%	9,52%	0,00	0,00%	5.551.082.158,75	0,00%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IMAB TP RF LP	10,06%	1,10	3,97%	-0,02%	9,54%	44.251.543,60	14,49%	5.621.155.898,48	0,79%
BB	BB	BB RPPS RF IMA B5+ FI	13,23%	1,43	4,70%	1,85%	1,83%	4.008.106,81	1,31%	1.910.642.646,02	0,21%
BANCO SANTANDER (BRASIL) AS	BANCO SANTANDER (BRASIL) AS	SANTANDER FIC IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,67%	0,43	2,82%	-0,02%	6,11%	49.305.935,07	16,14%	1.335.400.262,97	3,69%
CEF	CEF	CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4,56%	0,50	1,66%	-2,34%	4,27%	5.336.886,63	1,75%	3.239.848.879,40	0,16%
BRADESCO	BRADESCO	BRAD INST FI RF B VERTICE 2019	6,99%	0,74	2,29%	-1,70%	5,66%	5.875.141,99	1,92%	77.948.071,00	7,54%
BB	BB	BB Previdenciario XI Títulos Públicos	6,42%	0,72	3,68%	0,83%	9,60%	5.743.829,94	1,88%	177.085.697,20	3,24%
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF ALOCACAO ATIVA FCFI	5,48%	0,62	2,43%	0,11%	8,77%	40.141.718,73	13,14%	1.490.936.609,90	2,69%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - FUNDOS 100% TP (IMA ou IDkA)								186.763.301,94	61,15%		
Artigo 7º IV, Alínea a - RF e REFERENCIAL LIVRE											
BANCO SANTANDER (BRASIL) AS	BANCO SANTANDER (BRASIL) AS	SANTANDER FIC CORPORATE REFERENCIADO DI	0,08%	0,06	0,80%	100,00%	6,60%	1.535.732,72	0,50%	6.203.106.318,52	0,02%
BRADESCO	BRADESCO	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	0,11%	0,06	0,81%	101,06%	6,68%	16.795.745,82	5,50%	9.674.874.982,91	0,17%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL REF DI LP	0,10%	0,06	0,79%	98,08%	6,53%	30.272.167,32	9,91%	5.671.875.018,97	0,53%
BB	BB	BB RPPS RF PERFIL FIC	0,10%	0,06	0,81%	100,60%	1,34%	15.363.645,71	5,03%	4.144.723.536,71	0,37%
BANCO SANTANDER (BRASIL) AS	BANCO SANTANDER (BRASIL) AS	SANTANDER RENDA FIXA ATIVO FIC FI	--%	--	0,52%	97,20%	0,52%	1.839.856,04	0,60%	18.742.680,00	9,82%
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - RF e REFERENCIAL LIVRE								65.807.147,61	21,54%		
Sub-total Renda Fixa								305.441.295,75	100,00%		
Total								305.441.295,75	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	52.870.846,20	17,31%	18,00%	100,00%
Artigo 7º I, Alínea b	FUNDOS 100% TP (IMA ou IDkA)	186.763.301,94	61,15%	70,00%	100,00%
Artigo 7º IV, Alínea a	RF e REFERENCIAL LIVRE	65.807.147,61	21,54%	30,00%	30,00%
Total Renda Fixa		305.441.295,75	100,00%		

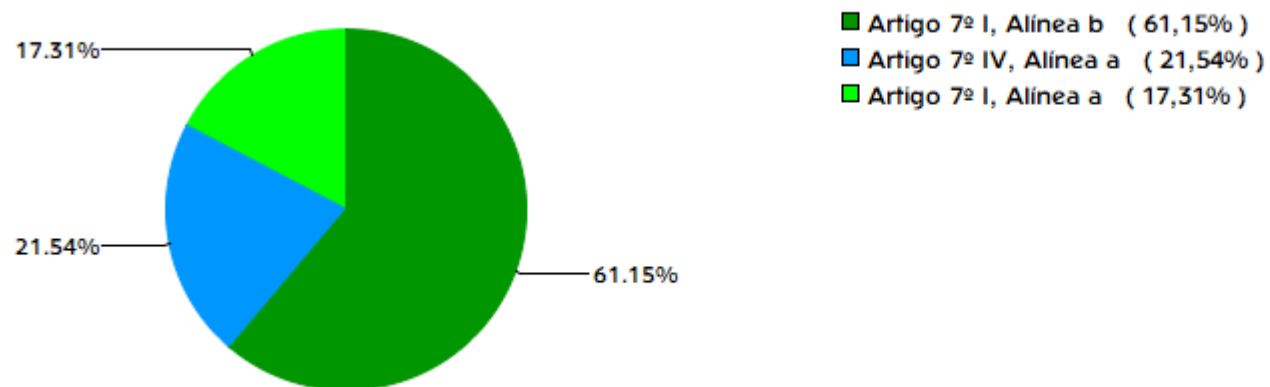
Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)				
Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	3,43 428,4	8,85 136,0	-- --	-- --
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	2,92 365,1	8,78 135,0	-- --	-- --
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,80 99,5	6,62 101,8	-- --	-- --

Ganhos Financeiros	
Estratégia	Ganho Bruto (R\$)
Artigo 7º I, Alínea a	1.753.521,99
Artigo 7º I, Alínea b	5.368.745,60
Artigo 7º IV, Alínea a	478.822,62
Total	7.601.090,21

Análise da Disponibilidade Financeira				
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acum. Bruto (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	235.621.104,03	77	235.621.104,03	77
acima de 365 dias	69.826.704,77	23	305.447.808,80	100

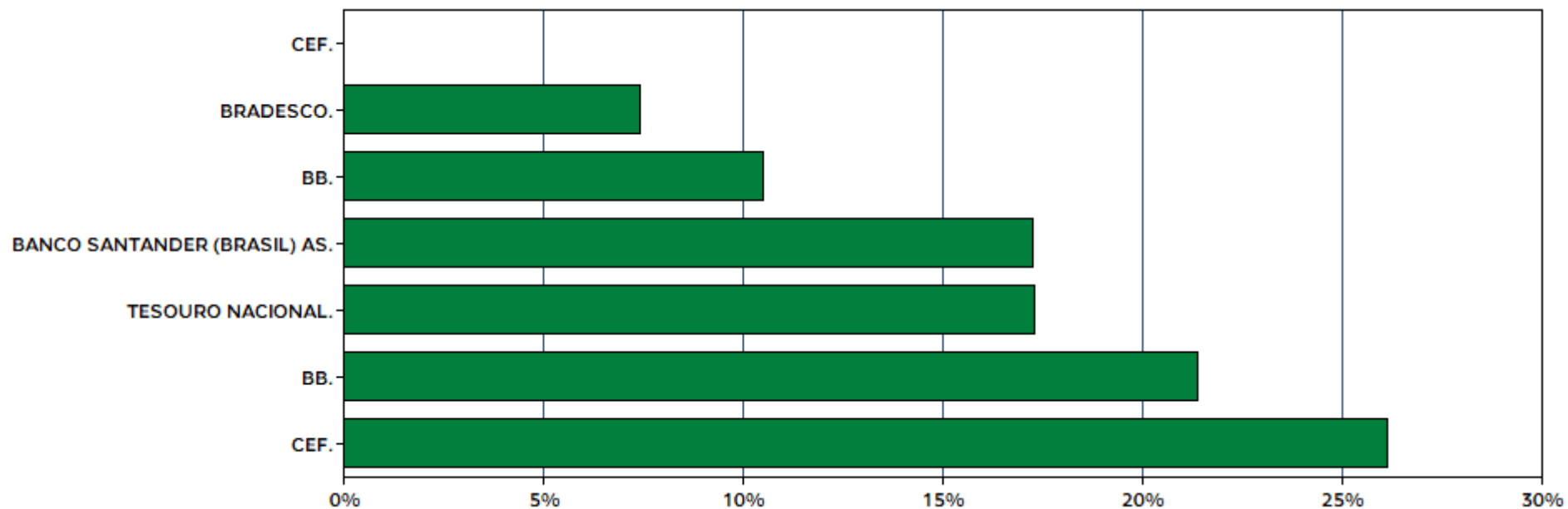
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor

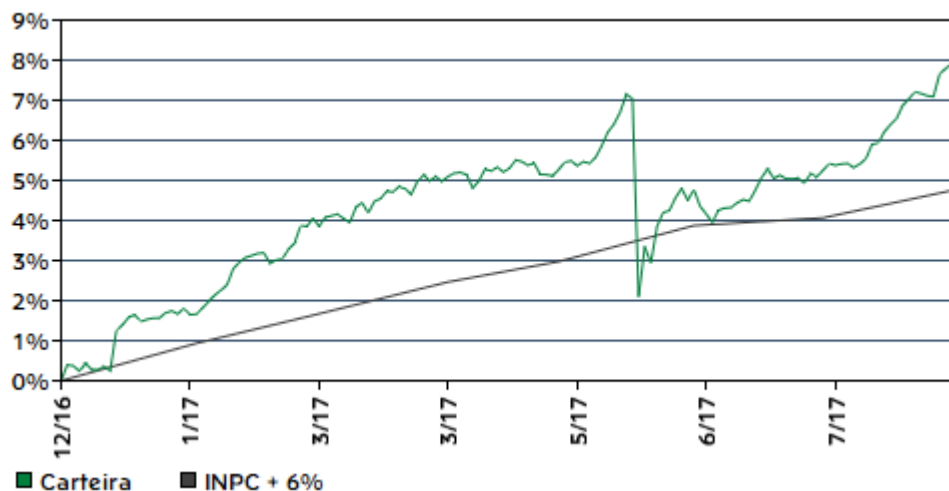


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

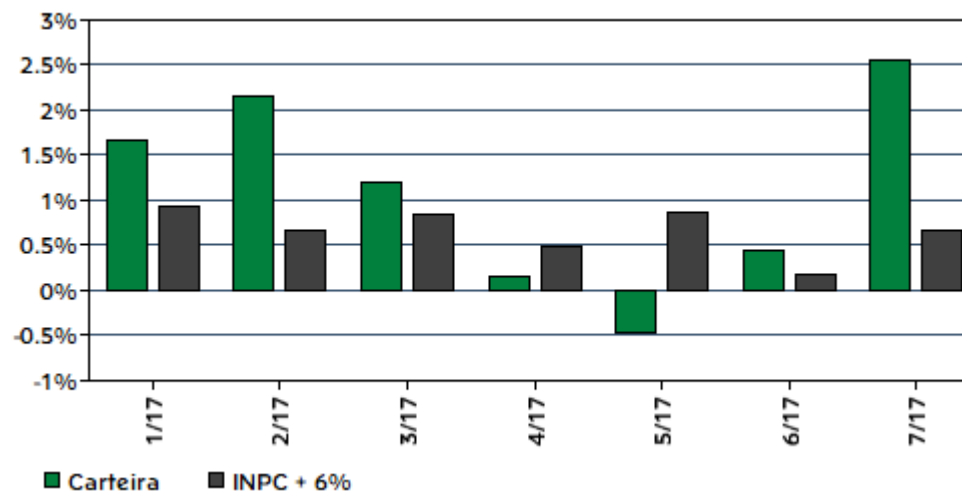
Rentabilidades da Carteira

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
2017	1,66	2,15	1,20	0,17	-0,47	0,45	2,55	-	-	-	-	-	7,92
INPC + 6%	0,93	0,66	0,85	0,50	0,87	0,19	0,66	-	-	-	-	-	4,75
p.p. Indx	0,73	1,50	0,34	-0,33	-1,35	0,26	1,89	-	-	-	-	-	3,17

Evolução da Rentabilidade



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco / Retorno da Carteira

	Qtd.	Perct.
Meses acima do Benchmark	5	71,4%
Meses abaixo do Benchmark	2	28,6%

	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	2,52	1,72	0,8	10,165
06 meses	6,16	3,78	2,4	7,536
12 meses	--	--	--	--
24 meses	--	--	--	--
36 meses	--	--	--	--
Desde o início	7,92	4,75	3,2	7,100

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 Var. do IMA-B TOTAL p.p.	3,84 -0,15	10,35 0,68	3,64 0,71	8,41 0,75	15,31 0,34	38,74 0,17	54,26 0,11
NTN-C 010421 Var. do IRF-M TOTAL p.p.	2,53 0,22	5,67 -5,07	1,02 -2,99	3,71 -4,56	6,87 -11,04	30,87 -6,58	43,56 -7,35
BB PREVIDENCIARIO RF IRF-M TP Var. do IRF-M TOTAL p.p.	2,31 -0,00	6,72 -0,16	3,92 -0,08	6,72 -0,16	6,72 -0,16	6,72 -0,16	6,72 -0,16
BB PREVIDENCIARIO RF IMA-B TP Var. do IMA-B TOTAL p.p.	3,96 -0,04	9,52 -0,15	2,86 -0,07	7,54 -0,13	9,52 -0,15	9,52 -0,15	9,52 -0,15
CAIXA FI BRASIL IMAB TP RF LP Var. do IMA-B TOTAL p.p.	3,97 -0,02	9,54 -0,13	2,89 -0,04	7,56 -0,10	9,54 -0,13	9,54 -0,13	9,54 -0,13
BB RPPS RF IMA B5+ FI Var. do IMA-B 5 p.p.	4,70 1,85	1,83 -2,75	2,58 -0,89	1,83 -2,75	1,83 -2,75	1,83 -2,75	1,83 -2,75
SANTANDER FIC IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. do IMA-B 5 p.p.	2,82 -0,02	6,11 -0,11	3,40 -0,07	6,11 -0,11	6,11 -0,11	6,11 -0,11	6,11 -0,11
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA Var. do IMA-B TOTAL p.p.	1,66 -2,34	4,27 -5,40	2,95 0,02	3,23 -4,43	4,27 -5,40	4,27 -5,40	4,27 -5,40

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.	2,29 -1,70	5,66 -4,01	0,63 -2,31	4,48 -3,18	5,66 -4,01	5,66 -4,01	5,66 -4,01
BB Previdenciario XI Títulos Públicos Var. do IMA-B 5 p.p.	3,68 0,83	9,60 1,13	3,69 0,21	8,29 1,06	9,60 1,13	9,60 1,13	9,60 1,13
BB PREVIDENCIARIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FCFI Var. do IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	2,43 0,11	8,77 -0,37	2,87 -0,40	6,84 -0,40	8,77 -0,37	8,77 -0,37	8,77 -0,37
SANTANDER FIC CORPORATE REFERENCIADO DI % do CDI	0,80 100,00	6,60 101,51	2,62 102,35	5,45 101,64	6,60 101,51	6,60 101,51	6,60 101,51
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	0,81 101,06	6,68 102,76	2,60 101,42	5,53 103,19	6,68 102,76	6,68 102,76	6,68 102,76
CAIXA FI BRASIL REF DI LP % do CDI	0,79 98,08	6,53 100,44	2,56 100,15	5,40 100,77	6,53 100,44	6,53 100,44	6,53 100,44
BB RPPS RF PERFIL FIC % do CDI	0,81 100,60	1,34 100,00	1,34 100,00	1,34 100,00	1,34 100,00	1,34 100,00	1,34 100,00
SANTANDER RENDA FIXA ATIVO FIC FI % do CDI	0,52 97,20	0,52 97,20	0,52 97,20	0,52 97,20	0,52 97,20	0,52 97,20	0,52 97,20
CDI	0,80	6,50	2,56	5,36	12,53	28,29	43,77
IBOVESPA	4,80	9,45	0,79	1,93	15,03	29,60	18,07
DOLAR COMERCIAL	-5,37	-3,94	-2,12	0,12	-3,34	-7,76	38,07
INPC + 6%	0,66	4,75	1,72	3,78	8,18	25,57	46,19
IPCA + 6%	0,73	4,89	1,82	3,96	8,85	25,40	45,67