

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Posição de Ativos | | | | | | | | | | | |
|--|-----------------------------|---|--------|------|-------|----------|--------|----------------------------|------------|-------------------|------------------|
| Gestor | Administrador | Ativos | Vol* | VAR | Mês | % Índice | Ano | Valor(R\$) (29/09/2017) | % 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 | 1,48% | -0,33% | 13,94% | 36.572.177,50 | 11,70% | -- | -- |
| TESOURO NACIONAL | TESOURO NACIONAL | NTN-C 010421 | 0,00% | 0,00 | 1,60% | 0,12% | 8,78% | 16.950.542,05 | 5,42% | -- | -- |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea a - TÍTULOS DO TESOIRO NACIONAL | | | | | | | | 53.522.719,55 | 17,12% | | |
| Artigo 7º I, Alínea b - FUNDOS 100% TP (IMA ou IDkA) | | | | | | | | | | | |
| BB | BB | BB PREVIDENCIARIO RF IRF-M TP | 4,88% | 0,57 | 1,45% | -0,02% | 9,40% | 32.904.630,25 | 10,52% | 4.989.933.175,82 | 0,66% |
| CEF | CEF | CAIXA FI BRASIL IMAB TP RF LP | 10,03% | 1,10 | 1,80% | -0,01% | 12,99% | 45.645.745,43 | 14,60% | 5.624.777.345,67 | 0,81% |
| BB | BB | BB RPPS RF IMA B5+ FI | 13,18% | 1,43 | 2,32% | 1,32% | 5,59% | 4.156.165,06 | 1,33% | 1.599.601.676,42 | 0,26% |
| BANCO SANTANDER (BRASIL) AS | BANCO SANTANDER (BRASIL) AS | SANTANDER FIC IMA-B 5 TITULOS PÚBLICOS RF | 3,66% | 0,43 | 0,99% | -0,01% | 8,49% | 50.559.073,31 | 16,17% | 1.302.582.730,64 | 3,88% |
| CEF | CEF | CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 4,46% | 0,48 | 0,50% | -1,31% | 2,65% | 5.253.809,58 | 1,68% | 3.189.415.210,95 | 0,16% |
| BRADESCO | BRADESCO | BRAD INST FI RF B VERTICE 2019 | 6,96% | 0,74 | 0,73% | -1,08% | 7,36% | 5.969.277,37 | 1,91% | 79.197.004,37 | 7,54% |
| BB | BB | BB Previdenciario XI Títulos Públicos | 6,34% | 0,71 | 1,22% | 0,22% | 12,68% | 5.748.869,48 | 1,84% | 177.241.068,93 | 3,24% |
| BB | BB | BB PREVIDENCIARIO RF ALOCACAO ATIVA FCFI | 5,25% | 0,60 | 1,32% | 0,01% | 11,39% | 41.109.961,83 | 13,15% | 1.898.093.637,00 | 2,17% |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - FUNDOS 100% TP (IMA ou IDkA) | | | | | | | | 191.347.532,31 | 61,20% | | |
| Artigo 7º IV, Alínea a - RF e REFERENCIAL LIVRE | | | | | | | | | | | |
| BANCO SANTANDER (BRASIL) AS | BANCO SANTANDER (BRASIL) AS | SANTANDER FIC CORPORATE REFERENCIADO DI | 0,11% | 0,06 | 0,65% | 102,11% | 8,20% | 1.607.749,77 | 0,51% | 6.857.988.274,06 | 0,02% |
| BRADESCO | BRADESCO | BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM | 0,13% | 0,06 | 0,67% | 104,15% | 8,46% | 17.074.986,14 | 5,46% | 11.514.086.382,12 | 0,15% |
| CEF | CEF | CAIXA FI BRASIL REF DI LP | 0,12% | 0,06 | 0,63% | 98,85% | 8,06% | 16.752.183,18 | 5,36% | 5.872.213.177,84 | 0,29% |
| BB | BB | BB RPPS RF PERFIL FIC | 0,11% | 0,06 | 0,65% | 101,29% | 2,81% | 15.740.731,20 | 5,03% | 4.279.499.588,21 | 0,37% |
| CEF | CEF | CAIXA FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF | --% | -- | 0,81% | 0,72% | 1,38% | 15.139.919,10 | 4,84% | 459.849.824,74 | 3,29% |
| BANCO SANTANDER (BRASIL) AS | BANCO SANTANDER (BRASIL) AS | SANTANDER RENDA FIXA ATIVO FIC FI | --% | -- | 0,62% | 96,51% | 1,91% | 1.451.364,77 | 0,46% | 20.589.780,79 | 7,05% |
| Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - RF e REFERENCIAL LIVRE | | | | | | | | 67.766.934,16 | 21,68% | | |
| Sub-total Renda Fixa | | | | | | | | 312.637.186,02 | 100,00% | | |
| Total | | | | | | | | 312.637.186,02 | 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 | 53.522.719,55 | 17,12% | 18,00% | 100,00% |
| Artigo 7º I, Alínea b | FUNDOS 100% TP (IMA ou IDkA) | 191.347.532,31 | 61,20% | 70,00% | 100,00% |
| Artigo 7º IV, Alínea a | RF e REFERENCIAL LIVRE | 67.766.934,16 | 21,68% | 30,00% | 30,00% |
| Total Renda Fixa | | 312.637.186,02 | 100,00% | | |

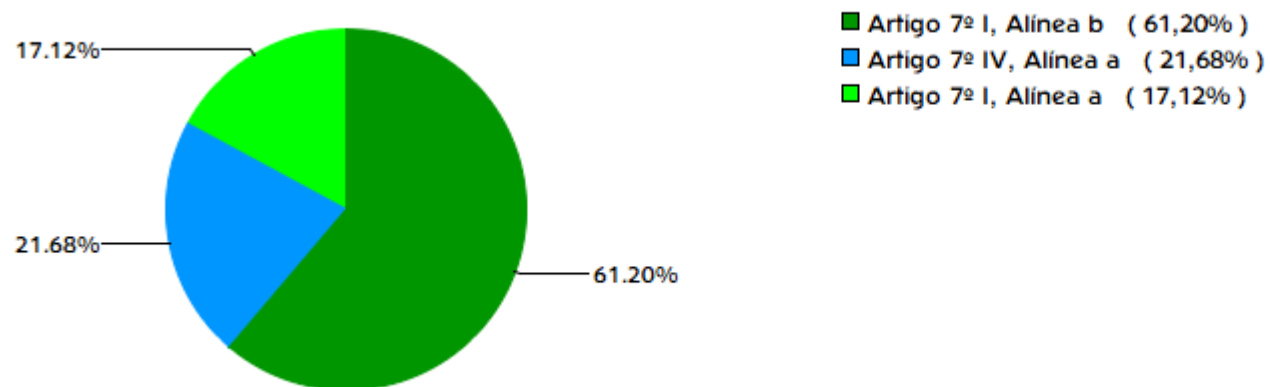
| Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%) | | | | |
|--|---------------|----------------|----------|----------|
| Estratégia | No Mês | No Ano | 12 meses | 24 meses |
| Artigo 7º I, Alínea a % do CDI | 1,52 236,4 | 12,28 152,6 | -- -- | -- -- |
| Artigo 7º I, Alínea b % do CDI | 1,35 210,1 | 11,45 142,3 | -- -- | -- -- |
| Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI | 0,68 106,7 | 8,28 102,9 | -- -- | -- -- |

| Ganhos Financeiros | |
|------------------------|-------------------|
| Estratégia | Ganho Bruto (R\$) |
| Artigo 7º I, Alínea a | 799.413,79 |
| Artigo 7º I, Alínea b | 2.543.161,10 |
| Artigo 7º IV, Alínea a | 467.205,02 |
| Total | 3.809.779,91 |

| Análise da Disponibilidade Financeira | | | | |
|---------------------------------------|----------------|-----|-------------------------|-----------|
| Período | Valor (R\$) | (%) | Valor Acum. Bruto (R\$) | (%) Acum. |
| de 0 a 30 dias | 242.149.023,09 | 77 | 242.149.023,09 | 77 |
| de 31 a 364 dias | 5.253.809,58 | 2 | 247.402.832,67 | 79 |
| acima de 365 dias | 65.240.866,40 | 21 | 312.643.699,07 | 100 |

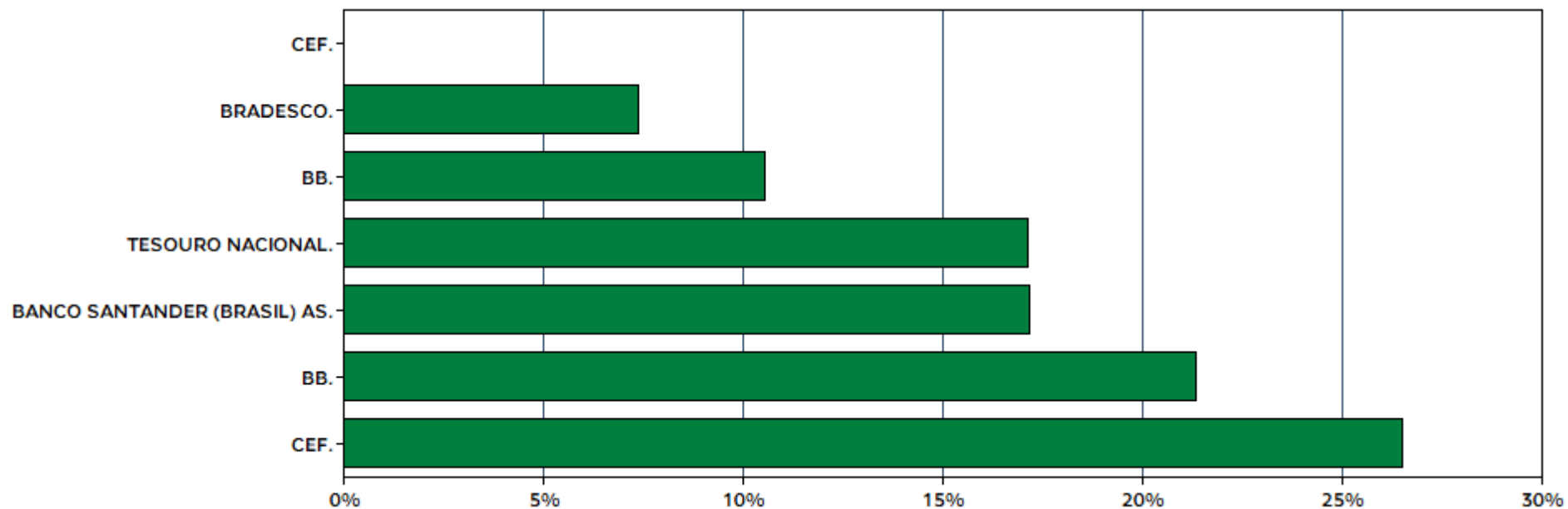
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor

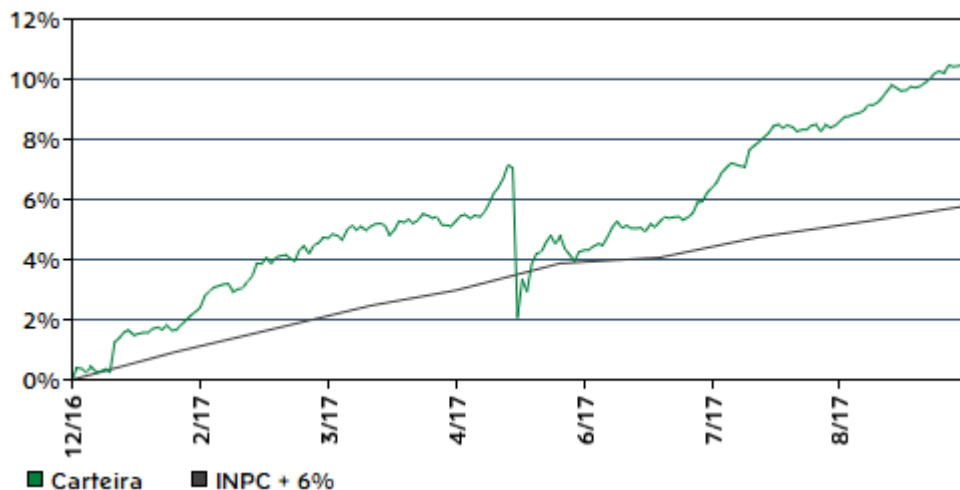


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

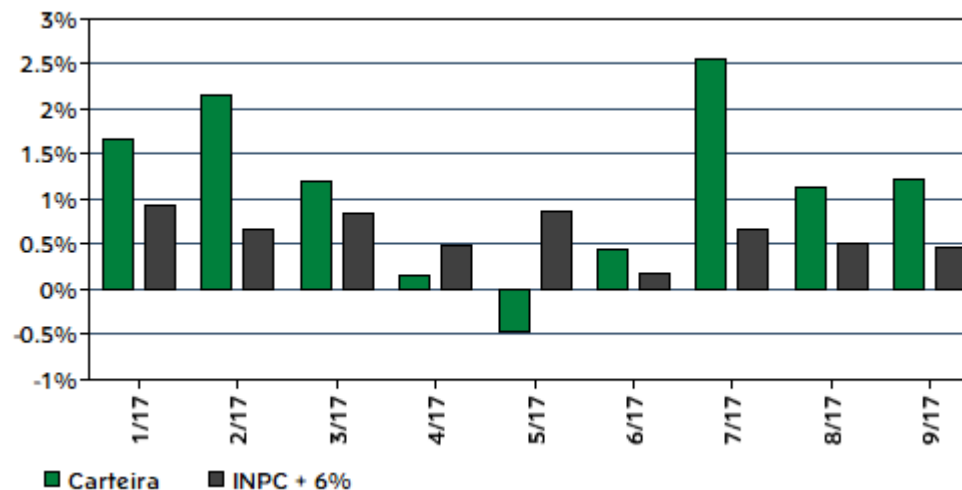
Rentabilidades da Carteira

| 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 | 1,13 | 1,23 | -- | -- | -- | 10,49 |
| INPC + 6% | 0,93 | 0,66 | 0,85 | 0,50 | 0,87 | 0,19 | 0,66 | 0,50 | 0,46 | -- | -- | -- | 5,76 |
| p.p. Indx | 0,73 | 1,50 | 0,34 | -0,33 | -1,35 | 0,26 | 1,89 | 0,63 | 0,77 | -- | -- | -- | 4,72 |

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 | 77,8% |
| Meses abaixo do Benchmark | 2 | 22,2% |

| | 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 | 4,98 | 1,63 | 3,3 | 1,964 |
| 06 meses | 5,13 | 3,22 | 1,9 | 7,392 |
| 12 meses | -- | -- | -- | -- |
| 24 meses | -- | -- | -- | -- |
| 36 meses | -- | -- | -- | -- |
| Desde o início | 10,49 | 5,76 | 4,7 | 6,284 |

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. | 1,48 -0,33 | 13,94 0,78 | 7,22 -0,08 | 7,12 1,26 | 16,09 0,33 | 48,29 -0,30 | 56,45 -0,84 |
| NTN-C 010421 Var. do IRF-M TOTAL p.p. | 1,60 0,12 | 8,78 -4,79 | 5,54 0,62 | 3,19 -4,04 | 8,45 -9,00 | 35,85 -7,66 | 45,94 -7,53 |
| BB PREVIDENCIARIO RF IRF-M TP Var. do IRF-M TOTAL p.p. | 1,45 -0,02 | 9,40 -0,21 | 4,87 -0,05 | 7,06 -0,17 | 9,40 -0,21 | 9,40 -0,21 | 9,40 -0,21 |
| CAIXA FI BRASIL IMAB TP RF LP Var. do IMA-B TOTAL p.p. | 1,80 -0,01 | 12,99 -0,16 | 7,25 -0,05 | 5,77 -0,09 | 12,99 -0,16 | 12,99 -0,16 | 12,99 -0,16 |
| BB RPPS RF IMA B5+ FI Var. do IMA-B 5 p.p. | 2,32 1,32 | 5,59 -1,36 | 8,56 3,38 | 5,48 -1,10 | 5,59 -1,36 | 5,59 -1,36 | 5,59 -1,36 |
| SANTANDER FIC IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF Var. do IMA-B 5 p.p. | 0,99 -0,01 | 8,49 -0,14 | 5,13 -0,06 | 6,45 -0,12 | 8,49 -0,14 | 8,49 -0,14 | 8,49 -0,14 |
| CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA Var. do IMA-B TOTAL p.p. | 0,50 -1,31 | 2,65 -10,51 | 0,07 -7,23 | 2,15 -3,71 | 2,65 -10,51 | 2,65 -10,51 | 2,65 -10,51 |
| BRAD INST FI RF B VERTICE 2019 Var. do IMA-B TOTAL p.p. | 0,73 -1,08 | 7,36 -5,80 | 3,93 -3,37 | 3,14 -2,72 | 7,36 -5,80 | 7,36 -5,80 | 7,36 -5,80 |

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 |
|---|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|----------------|
| BB Previdenciario XI Títulos Públicos Var. do IMA-B 5 p.p. | 1,22 0,22 | 12,68 1,74 | 6,59 1,41 | 6,94 0,36 | 12,68 1,74 | 12,68 1,74 | 12,68 1,74 |
| BB PREVIDENCIARIO RF ALOCACAO ATIVA FCFI Var. do IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p. | 1,32 0,01 | 11,39 -0,35 | 4,90 0,14 | 5,71 -0,39 | 11,39 -0,35 | 11,39 -0,35 | 11,39 -0,35 |
| SANTANDER FIC CORPORATE REFERENCIADO DI % do CDI | 0,65 102,11 | 8,20 101,90 | 2,31 102,22 | 4,98 102,43 | 8,20 101,90 | 8,20 101,90 | 8,20 101,90 |
| BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI | 0,67 104,15 | 8,46 105,11 | 2,49 109,95 | 5,25 107,90 | 8,46 105,11 | 8,46 105,11 | 8,46 105,11 |
| CAIXA FI BRASIL REF DI LP % do CDI | 0,63 98,85 | 8,06 100,13 | 2,23 98,54 | 4,86 99,80 | 8,06 100,13 | 8,06 100,13 | 8,06 100,13 |
| BB RPPS RF PERFIL FIC % do CDI | 0,65 101,29 | 2,81 99,99 | 2,27 100,20 | 2,81 99,99 | 2,81 99,99 | 2,81 99,99 | 2,81 99,99 |
| CAIXA FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF Var. do IPCA p.p. | 0,81 0,72 | 1,38 1,22 | 1,38 1,22 | 1,38 1,22 | 1,38 1,22 | 1,38 1,22 | 1,38 1,22 |
| SANTANDER RENDA FIXA ATIVO FIC FI % do CDI | 0,62 96,51 | 1,91 96,24 | 1,91 96,24 | 1,91 96,24 | 1,91 96,24 | 1,91 96,24 | 1,91 96,24 |
| CDI | 0,64 | 8,05 | 2,26 | 4,87 | 11,55 | 27,32 | 43,32 |
| IBOVESPA | 4,88 | 23,35 | 18,11 | 14,33 | 27,29 | 64,88 | 37,29 |
| DOLAR COMERCIAL | 0,66 | -2,80 | -4,24 | -0,01 | -2,41 | -20,26 | 29,25 |
| INPC + 6% | 0,46 | 5,76 | 1,63 | 3,22 | 7,70 | 24,61 | 45,17 |
| IPCA + 6% | 0,55 | 6,23 | 2,02 | 3,70 | 8,56 | 24,83 | 44,88 |