

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos										
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (31/01/2017)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
Renda Fixa										
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI	7,49%	1,84%	-0,02%	1,84%	61.941.774,53	60,39%	5.093.308.228,35	1,22%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RF LP	7,47%	1,84%	-0,02%	1,84%	15.963.096,93	15,56%	5.218.065.279,62	0,31%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA II FI	2,77%	1,12%	0,63%	1,12%	2.939.289,16	2,87%	816.826.831,52	0,36%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 I TP RF	8,58%	1,77%	-0,10%	1,77%	1.108.221,90	1,08%	362.551.374,08	0,31%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2018 IV TP RF	4,69%	1,01%	-0,86%	1,01%	4.892.227,95	4,77%	276.327.368,21	1,77%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - FUNDOS 100% TP (IMA ou IDKa)							86.844.610,47	84,67%		
BANESTES DTVM	BANESTES BANCO	FI BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA	8,58%	2,04%	0,17%	2,04%	6.734.690,37	6,57%	167.584.408,27	4,02%
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a - FUNDOS DE INVEST RENDA FIXA REF (IMA ou IDKa)							6.734.690,37	6,57%		
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC FI	0,17%	1,10%	100,98%	1,10%	2.116.987,50	2,06%	5.358.441.715,87	0,04%
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - RF e REFERENCIAL LIVRE							2.116.987,50	2,06%		
Sub-total Renda Fixa - RF e REFERENCIAL LIVRE							95.696.288,34	93,30%		
Renda Variável										
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	26,82%	7,17%	-0,21%	7,17%	1.489.288,00	1,45%	25.982.954,05	5,73%
Sub-total Artigo 8º I - FIA INDEXADO IBOV. IBX OU IBX-50							1.489.288,00	1,45%		
VINCI EQUITIES	CEF	FIC FIA CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	15,61%	2,82%	-4,55%	2,82%	4.063.934,99	3,96%	355.819.825,11	1,14%
Sub-total Artigo 8º III - FUNDO DE AÇÕES							4.063.934,99	3,96%		
RIO BRAVO INVEST	CEF	CAIXA RIO BRAVO FII	0,00%	1,80%	165,82%	1,80%	1.316.327,22	1,28%	168.037.440,33	0,78%
Sub-total Artigo 8º VI - FUNDO INVEST IMOBILIÁRIO							1.316.327,22	1,28%		
Sub-total Renda Variável							6.869.550,21	6,70%		
Total							102.565.838,55	100%		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Classe	Valor(R\$)	% Carteira	Política Investimento	Limite Res. 3.922/10
Renda Fixa					
Artigo 7º I, Alínea b	FUNDOS 100% TP (IMA ou IDKA)	86.844.610,47	84,67%	95,00%	100,00%
Artigo 7º III, Alínea a	FUNDOS DE INVEST RENDA FIXA REF (IMA ou IDKA)	6.734.690,37	6,57%	15,00%	80,00%
Artigo 7º IV, Alínea a	RF e REFERENCIAL LIVRE	2.116.987,51	2,06%	25,00%	30,00%
Total Renda Fixa		95.696.288,34	93,30%		
Renda Variável					
Artigo 8º I	FIA INDEXADO IBOV. IBX OU IBX-50	1.489.288,00	1,45%	10,00%	20,00%
Artigo 8º III	FUNDO DE AÇÕES	4.063.934,99	3,96%	10,00%	15,00%
Artigo 8º VI	FUNDO INVEST IMOBILIÁRIO	1.316.327,22	1,28%	3,00%	5,00%
Total Renda Variável		6.869.550,21	6,69%		

Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)

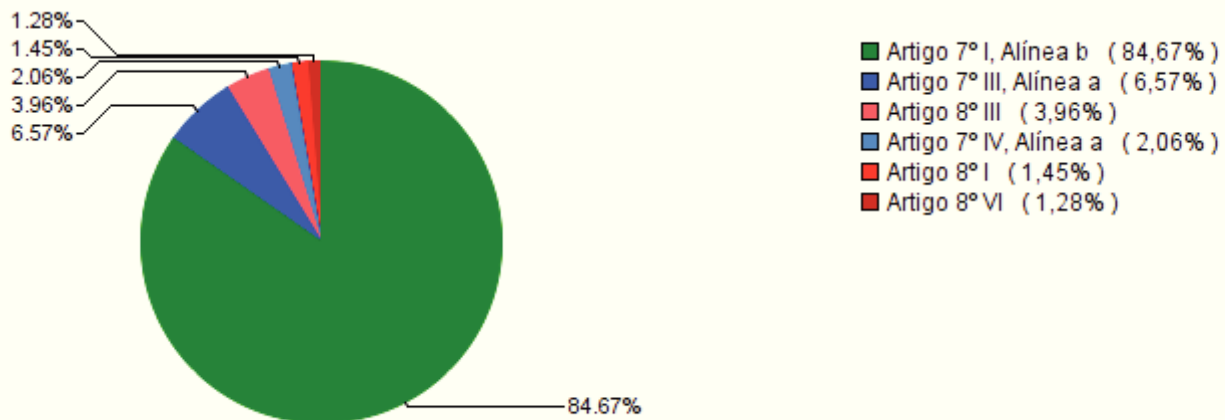
Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
Artigo 7º I, Alínea b	1,77	1,77	22,68	--
% do CDI	162,8	162,8	161,6	--
Artigo 7º III, Alínea a	2,04	2,04	24,84	--
% do CDI	187,2	187,2	176,9	--
Artigo 7º IV, Alínea a	1,10	1,10	13,97	--
% do CDI	101,0	101,0	99,5	--
Artigo 8º I	7,17	7,17	58,62	--
Var. IBOVESPA p.p	-0,2	-0,2	-1,4	--
Artigo 8º III	2,82	2,82	19,13	--
Var. IBOVESPA p.p	-4,6	-4,6	-40,9	--
Artigo 8º VI	1,80	1,80	60,14	--
Var. IBOVESPA p.p	-5,6	-5,6	0,1	--

Ganhos Financeiros

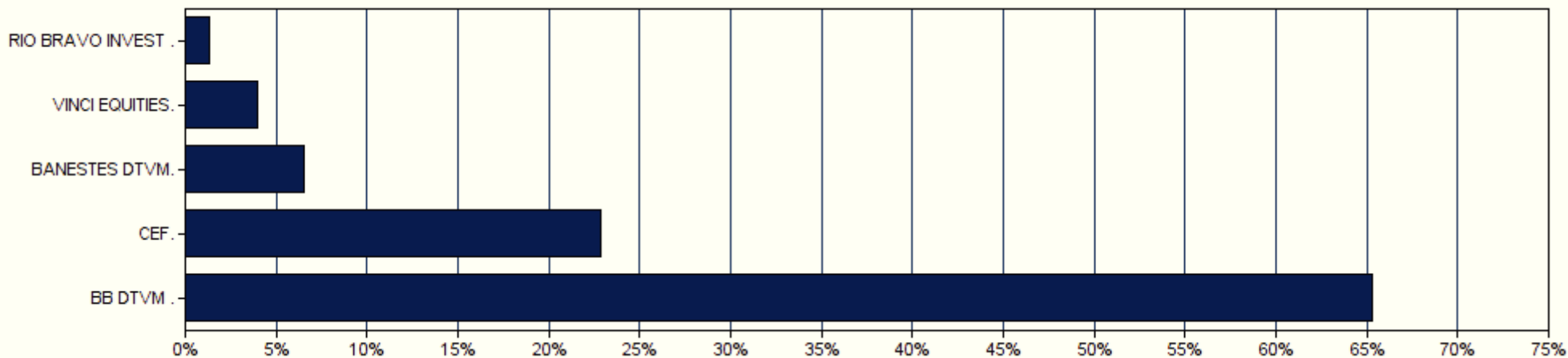
Estratégia	Ganho Bruto (R\$)
Artigo 7º I, Alínea b	1.496.704,76
Artigo 7º III, Alínea a	132.277,18
Artigo 7º IV, Alínea a	22.989,07
Artigo 8º I	99.606,00
Artigo 8º III	111.576,49
Artigo 8º VI	23.497,67
Total	1.886.651,16

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia



Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco / Retorno da Carteira

	Qtd.	Perct.	Período	Rentabilidade (%)			Volat. Anual
				Carteira	IPCA + 6%	p.p. Indx.	
Meses acima do Benchmark	9	69,2%					
Meses abaixo do Benchmark	4	30,8%					
	Rentab.	Mês					
Maior rentabilidade da Carteira	4,09%	mar/16	03 meses	3,06	2,48	0,6	7,233
Menor rentabilidade da Carteira	-1,39%	nov/16	06 meses	6,66	4,82	1,8	5,763
			12 meses	21,50	11,82	9,7	5,574
			24 meses	--	--	--	--
			36 meses	--	--	--	--
			Desde o início	22,80	13,77	9,0	5,443

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 PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI Var. do IMA-B TOTAL p.p.	1,84 -0,02	1,84 -0,02	3,47 -0,08	6,69 -0,10	24,54 -0,22	26,81 -0,33	26,81 -0,33
FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RF LP Var. do IMA-B TOTAL p.p.	1,84 -0,02	1,84 -0,02	3,55 0,00	6,75 -0,04	24,64 -0,12	26,86 -0,29	26,86 -0,29
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA II FI Var. do IPCA p.p.	1,12 0,63	1,12 0,63	2,90 1,92	5,89 4,13	13,74 8,27	17,08 10,27	17,08 10,27
FI CAIXA BRASIL 2024 I TP RF Var. do IMA-B TOTAL p.p.	1,77 -0,10	1,77 -0,10	3,37 -0,18	3,39 -3,40	16,67 -8,09	18,52 -8,62	18,52 -8,62
FI CAIXA BRASIL 2018 IV TP RF Var. do IMA-B TOTAL p.p.	1,01 -0,86	1,01 -0,86	2,83 -0,72	3,05 -3,73	6,56 -18,20	10,02 -17,12	10,02 -17,12
FI BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA Var. do IMA-B TOTAL p.p.	2,04 0,17	2,04 0,17	4,21 0,66	7,44 0,66	27,10 2,34	28,96 1,82	28,96 1,82
BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC FI % do CDI	1,10 100,98	1,10 100,98	3,32 101,04	6,91 101,55	13,93 99,23	15,13 99,27	15,13 99,27
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA Var. do IBOVESPA p.p.	7,17 -0,21	7,17 -0,21	-0,31 0,08	12,51 -0,33	58,62 -1,44	48,06 -1,12	48,06 -1,12

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
FIC FIA CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. do IBOVESPA p.p.	2,82 -4,55	2,82 -4,55	-3,95 -3,56	3,24 -9,61	19,13 -40,93	15,55 -33,64	15,55 -33,64
CAIXA RIO BRAVO FII % do CDI	1,80 165,82	1,80 165,82	0,50 15,22	13,22 194,44	60,14 428,45	45,59 299,14	45,59 299,14
CDI	1,09	1,09	3,28	6,80	14,04	29,29	43,39
IMA-B 5	1,16	1,16	2,97	6,05	13,45	32,16	51,77
IMA-B 5+	2,24	2,24	3,87	7,30	32,37	36,55	71,69
IMA-B TOTAL	1,87	1,87	3,55	6,79	24,76	34,25	62,72
IMA-GERAL TOTAL	1,80	1,80	3,72	7,35	20,74	31,83	52,64
IRF-M 1	1,29	1,29	3,58	7,06	14,32	29,93	44,63
IRF-M 1+	2,66	2,66	4,86	9,69	28,23	34,50	54,57
IRF-M TOTAL	2,28	2,28	4,50	8,90	22,76	32,81	50,86
IBOVESPA	7,38	7,38	-0,39	12,85	60,05	37,87	35,75
IFIX	3,76	3,76	2,60	11,47	46,29	40,96	50,86
SMALL CAP	11,42	11,42	1,47	8,88	60,49	29,60	3,42
INPC + 6%	0,51	0,51	1,70	3,80	11,32	31,25	49,04
IPCA + 6%	1,00	1,00	2,48	4,82	11,82	31,13	48,92