

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Posição de Ativos | | | | | | | | | | |
|--|----------------|--------------------------------------|--------|--------|----------|--------|----------------------------|---------------|------------------|------------------|
| Gestor | Administrador | Ativos | Vol* | Mês | % Índice | Ano | Valor(R\$) (30/11/2016) | % Carteira | PL do Fundo | % no PL do Fundo |
| Renda Fixa | | | | | | | | | | |
| BB DTVM | BB DTVM | BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI | 7,06% | -1,26% | -121,22% | 21,02% | 58.388.192,80 | 60,55% | 5.331.505.245,58 | 1,10% |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RF LP | 7,04% | -1,17% | 0,05% | 21,08% | 14.298.516,83 | 14,83% | 4.695.513.366,94 | 0,30% |
| BB DTVM | BB DTVM | BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA II FI | 2,86% | 0,40% | 0,22% | 14,24% | 2.868.117,10 | 2,97% | 797.048.155,00 | 0,36% |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL 2024 I TP RF | 8,38% | -0,20% | 1,02% | 14,44% | 1.070.032,99 | 1,11% | 350.058.036,54 | 0,31% |
| CEF | CEF | FI CAIXA BRASIL 2018 IV TP RF | 4,91% | 0,68% | 1,90% | 7,72% | 4.789.672,13 | 4,97% | 270.534.648,07 | 1,77% |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - FUNDOS 100% TP (IMA ou IDkA) | | | | | | | 81.414.531,84 | 84,42% | | |
| BANESTES DTVM | BANESTES BANCO | FI BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA | 7,92% | -1,52% | -0,30% | 21,87% | 6.206.418,06 | 6,44% | 151.435.495,04 | 4,10% |
| Sub-total Artigo 7º III, Alínea a - FUNDOS DE INVEST RENDA FIXA REF (IMA ou IDkA) | | | | | | | 6.206.418,06 | 6,44% | | |
| BB DTVM | BB DTVM | BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC FI | 0,17% | 1,05% | 101,14% | 12,60% | 2.070.528,22 | 2,15% | 5.299.475.881,27 | 0,04% |
| Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - RF e REFERENCIAL LIVRE | | | | | | | 2.070.528,22 | 2,15% | | |
| Sub-total Renda Fixa - RF e REFERENCIAL LIVRE | | | | | | | 89.691.478,12 | 93,01% | | |
| Renda Variável | | | | | | | | | | |
| CEF | CEF | FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA | 30,46% | -4,41% | 0,24% | 41,99% | 1.428.152,00 | 1,48% | 28.076.783,63 | 5,09% |
| Sub-total Artigo 8º I - FIA INDEXADO IBOV. IBX OU IBX-50 | | | | | | | 1.428.152,00 | 1,48% | | |
| VINCI EQUITIES | CEF | FIC FIA CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS | 16,84% | -6,08% | -1,44% | 12,97% | 3.973.467,95 | 4,12% | 347.898.932,29 | 1,14% |
| Sub-total Artigo 8º III - FUNDO DE AÇÃO | | | | | | | 3.973.467,95 | 4,12% | | |
| RIO BRAVO INVEST | CEF | CAIXA RIO BRAVO FII_exc | 8,98% | -3,07% | -296,09% | 15,04% | 1.343.091,16 | 1,39% | 165.601.668,62 | 0,81% |
| Sub-total Artigo 8º VI - FUNDO INVEST IMOBILIÁRIO | | | | | | | 1.343.091,16 | 1,39% | | |
| Sub-total Renda Variável | | | | | | | 6.744.711,11 | 6,99% | | |
| Total | | | | | | | 96.436.189,22 | 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) | 81.414.531,84 | 84,42% | 95,00% | 100,00% |
| Artigo 7º III, Alínea a | FUNDOS DE INVEST RENDA FIXA REF (IMA ou IDKA) | 6.206.418,06 | 6,44% | 15,00% | 80,00% |
| Artigo 7º IV, Alínea a | RF e REFERENCIAL LIVRE | 2.070.528,22 | 2,15% | 25,00% | 30,00% |
| Total Renda Fixa | | 89.691.478,12 | 93,01% | | |
| Renda Variável | | | | | |
| Artigo 8º I | FIA INDEXADO IBOV. IBX OU IBX-50 | 1.428.152,00 | 1,48% | 10,00% | 20,00% |
| Artigo 8º III | FUNDO DE AÇÃO | 3.973.467,95 | 4,12% | 10,00% | 15,00% |
| Artigo 8º VI | FUNDO INVEST IMOBILIÁRIO | 1.343.091,16 | 1,39% | 3,00% | 5,00% |
| Total Renda Variável | | 6.744.711,11 | 6,99% | | |

Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)

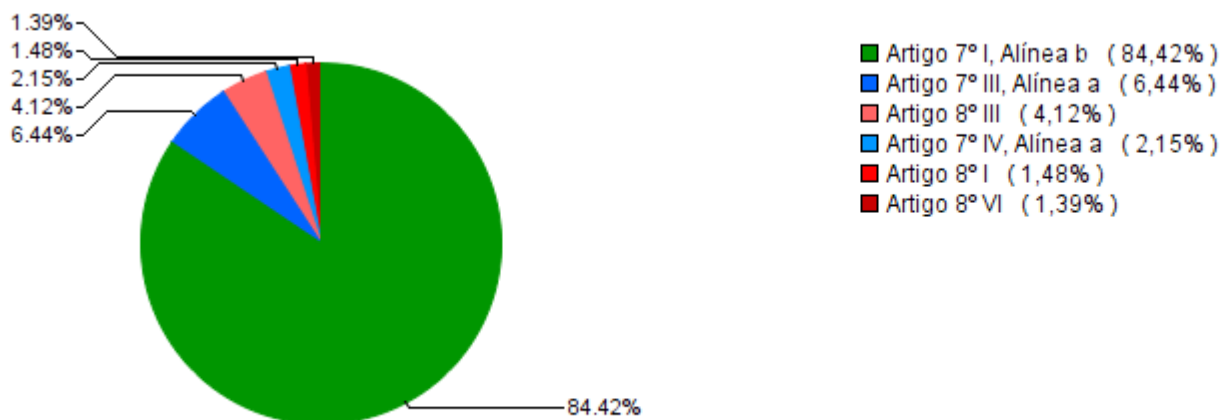
| Estratégia | No Mês | No Ano | 12 meses | 24 meses |
|--------------------------------|--------|--------|----------|----------|
| Artigo 7º I, Alínea b | -1,06 | 19,73 | 19,73 | -- |
| % do CDI | -101,8 | 154,9 | 154,9 | -- |
| Artigo 7º III, Alínea a | -1,52 | 19,70 | 19,70 | -- |
| % do CDI | -146,3 | 154,7 | 154,7 | -- |
| Artigo 7º IV, Alínea a | 1,05 | 12,66 | 12,66 | -- |
| % do CDI | 101,1 | 99,4 | 99,4 | -- |
| Artigo 8º I | -4,41 | 41,99 | 41,99 | -- |
| Var. IBOVESPA p.p | 0,2 | -0,8 | -0,8 | -- |
| Artigo 8º III | -6,08 | 12,97 | 12,97 | -- |
| Var. IBOVESPA p.p | -1,4 | -29,8 | -29,8 | -- |
| Artigo 8º VI | -1,64 | 39,28 | 39,28 | -- |
| Var. IBOVESPA p.p | 3,0 | -3,5 | -3,5 | -- |

Ganhos Financeiros

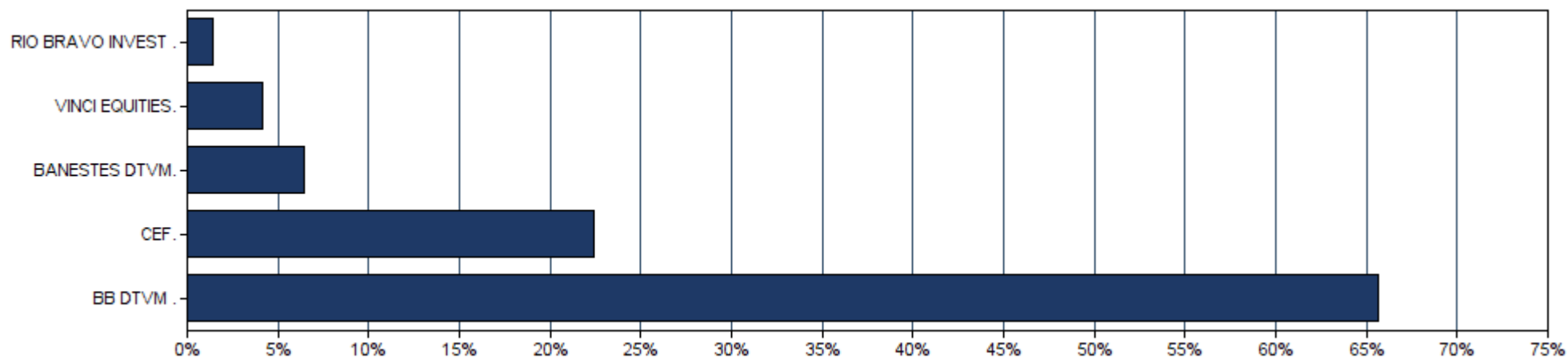
| Estratégia | Ganho Bruto (R\$) |
|--------------------------------|----------------------|
| Artigo 7º I, Alínea b | -858.062,93 |
| Artigo 7º III, Alínea a | -93.911,75 |
| Artigo 7º IV, Alínea a | 21.509,75 |
| Artigo 8º I | -65.824,00 |
| Artigo 8º III | -257.450,57 |
| Artigo 8º VI | -32.316,49 |
| Total | -1.286.055,99 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia



Alocação por Gestor

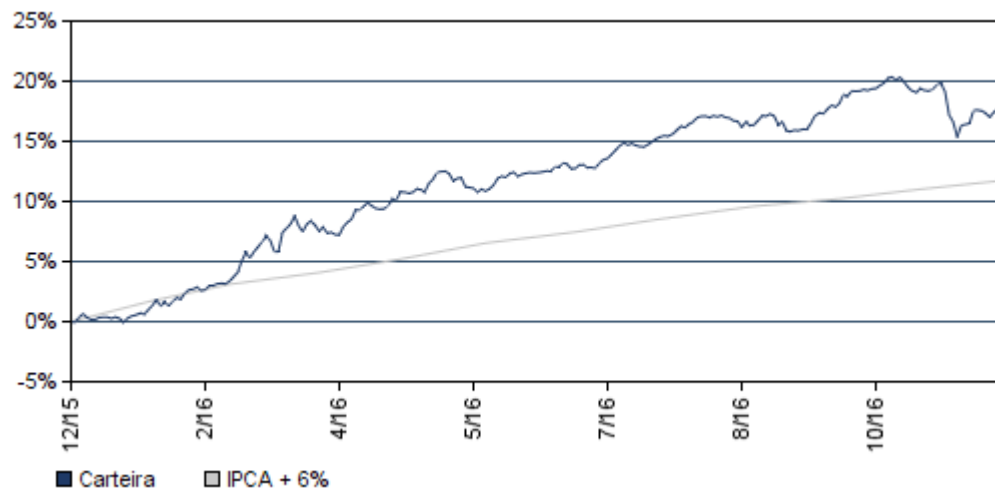


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

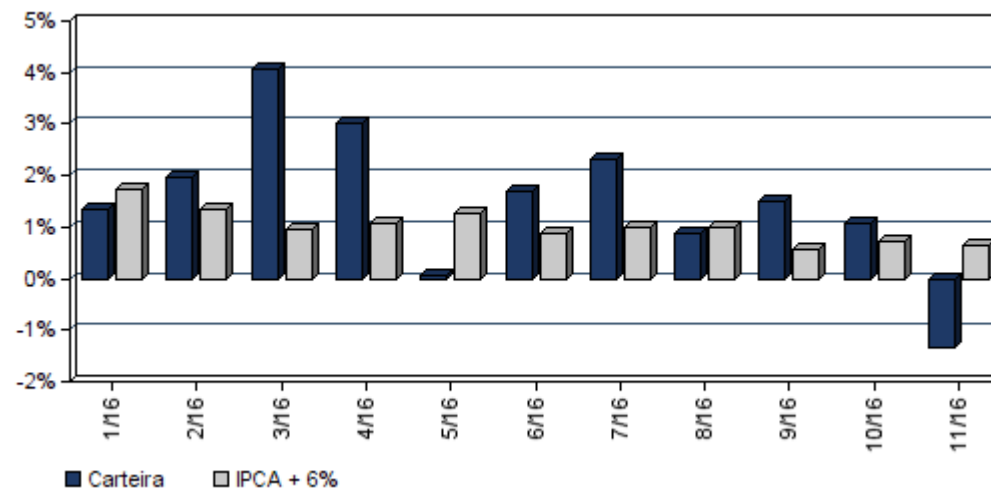
Rentabilidades da Carteira

| Ano | Jan | Fev | Mar | Abr | Mai | Jun | Jul | Ago | Set | Out | Nov | Dez | Rent.Ano |
|------------------|-------|------|------|------|-------|------|------|-------|------|------|-------|-----|----------|
| 2016 | 1,34 | 1,97 | 4,06 | 3,03 | 0,07 | 1,69 | 2,33 | 0,88 | 1,50 | 1,07 | -1,32 | -- | 17,81 |
| IPCA + 6% | 1,74 | 1,34 | 0,94 | 1,08 | 1,27 | 0,86 | 1,01 | 0,98 | 0,57 | 0,72 | 0,64 | -- | 11,73 |
| p.p. Indx | -0,40 | 0,63 | 3,12 | 1,95 | -1,20 | 0,83 | 1,32 | -0,10 | 0,93 | 0,34 | -1,96 | -- | 6,08 |

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 | 63,6% |
| Meses abaixo do Benchmark | 4 | 36,4% |

| | Rentab. | Mês |
|--|---------|--------|
| Maior rentabilidade da Carteira | 4,06% | mar/16 |
| Menor rentabilidade da Carteira | -1,32% | nov/16 |

| Período | Rentabilidade (%) | | | Volat. Anual |
|-----------------------|-------------------|-----------|------------|--------------|
| | Carteira | IPCA + 6% | p.p. Indx. | |
| 03 meses | 1,23 | 1,95 | -0,7 | 6,245 |
| 06 meses | 6,26 | 4,88 | 1,4 | 4,829 |
| 12 meses | 17,81 | 11,73 | 6,1 | 5,294 |
| 24 meses | -- | -- | -- | -- |
| 36 meses | -- | -- | -- | -- |
| Desde o início | 17,81 | 11,73 | 6,1 | 5,294 |

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 % do CDI | -1,26 -121,22 | 21,02 165,03 | 0,91 28,27 | 6,35 92,47 | 21,02 165,03 | 21,02 165,03 | 21,02 165,03 |
| FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RF LP Var. do IMA-B TOTAL p.p. | -1,17 0,05 | 21,08 -0,21 | 1,05 0,07 | 6,42 -0,02 | 21,08 -0,21 | 21,08 -0,21 | 21,08 -0,21 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA II FI Var. do IPCA p.p. | 0,40 0,22 | 14,24 8,27 | 2,25 1,73 | 5,57 3,73 | 14,24 8,27 | 14,24 8,27 | 14,24 8,27 |
| FI CAIXA BRASIL 2024 I TP RF Var. do IMA-B TOTAL p.p. | -0,20 1,02 | 14,44 -6,84 | 1,19 0,22 | 2,80 -3,64 | 14,44 -6,84 | 14,44 -6,84 | 14,44 -6,84 |
| FI CAIXA BRASIL 2018 IV TP RF Var. do IMA-B TOTAL p.p. | 0,68 1,90 | 7,72 -13,57 | 2,43 1,46 | 2,73 -3,71 | 7,72 -13,57 | 7,72 -13,57 | 7,72 -13,57 |
| FI BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA Var. do IMA-B TOTAL p.p. | -1,52 -0,30 | 21,87 0,59 | 0,90 -0,08 | 6,69 0,25 | 21,87 0,59 | 21,87 0,59 | 21,87 0,59 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC FI % do CDI | 1,05 101,14 | 12,60 98,96 | 3,27 101,20 | 6,87 100,09 | 12,60 98,96 | 12,60 98,96 | 12,60 98,96 |
| FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA Var. do IBOVESPA p.p. | -4,41 0,24 | 41,99 -0,82 | 7,05 0,13 | 27,11 -0,61 | 41,99 -0,82 | 41,99 -0,82 | 41,99 -0,82 |

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. | -6,08 -1,44 | 12,97 -29,84 | 0,07 -6,84 | 8,76 -18,96 | 12,97 -29,84 | 12,97 -29,84 | 12,97 -29,84 |
| CAIXA RIO BRAVO FII_exc % do CDI | -3,07 -296,09 | 15,04 118,07 | 1,80 55,83 | 5,86 85,34 | 15,04 118,07 | 15,04 118,07 | 15,04 118,07 |
| CDI | 1,04 | 12,74 | 3,23 | 6,86 | 14,04 | 28,87 | 42,55 |
| IMA-B 5 | 0,40 | 13,89 | 2,28 | 5,63 | 16,31 | 31,55 | 48,52 |
| IMA-B 5+ | -2,04 | 26,35 | 0,31 | 7,26 | 27,77 | 29,61 | 57,92 |
| IMA-B TOTAL | -1,22 | 21,28 | 0,97 | 6,44 | 23,13 | 29,54 | 53,24 |
| IMA-GERAL TOTAL | -0,00 | 18,76 | 2,45 | 7,13 | 19,96 | 29,09 | 47,30 |
| IRF-M 1 | 1,05 | 13,36 | 3,22 | 6,67 | 14,70 | 29,27 | 42,82 |
| IRF-M 1+ | 0,03 | 26,95 | 3,73 | 8,99 | 27,16 | 30,46 | 47,92 |
| IRF-M TOTAL | 0,32 | 21,14 | 3,53 | 8,19 | 21,83 | 29,69 | 45,78 |
| IBOVESPA | -4,65 | 42,81 | 6,92 | 27,72 | 37,20 | 13,12 | 17,96 |
| IFIX | -2,55 | 30,38 | 3,96 | 13,96 | 26,52 | 34,97 | 30,19 |
| SMALL CAP | -8,44 | 32,46 | -1,93 | 22,86 | 25,48 | -4,53 | -16,07 |
| INPC + 6% | 0,46 | 12,14 | 1,67 | 4,71 | 13,73 | 33,71 | 50,71 |
| IPCA + 6% | 0,64 | 11,73 | 1,95 | 4,88 | 13,38 | 32,71 | 49,90 |