

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos										
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (24/02/2017)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
Renda Fixa										
BANESTES DTVM	BANESTES DTVM	FI BANESTES PREVIDENCIARIO RF	8,85%	1,16%	0,60%	1,16%	633.394,95	0,59%	198.258.535,18	0,32%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI	7,38%	3,85%	-0,00%	5,76%	64.324.353,90	60,06%	6.008.152.260,65	1,07%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RF LP	7,37%	3,83%	-0,02%	5,74%	16.880.873,71	15,76%	5.631.232.992,31	0,30%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA II FI	2,63%	1,42%	1,09%	2,55%	2.897.191,81	2,71%	805.127.934,70	0,36%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 I TP RF	8,55%	0,47%	-3,38%	2,25%	1.113.456,66	1,04%	364.263.924,83	0,31%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2018 IV TP RF	4,60%	-1,82%	-5,66%	-0,83%	4.803.388,45	4,49%	271.309.506,94	1,77%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - FUNDOS 100% TP (IMA ou IDKa)							90.652.659,48	84,65%		
BANESTES DTVM	BANESTES BANCO	FI BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA	8,53%	4,96%	1,12%	7,10%	7.146.843,77	6,67%	179.991.782,50	3,97%
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a - FUNDOS DE INVEST RENDA FIXA REF (IMA ou IDKA)							7.146.843,77	6,67%		
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC FI	0,17%	0,89%	102,90%	2,00%	2.135.862,58	1,99%	4.816.396.409,15	0,04%
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - RF e REFERENCIAL LIVRE							2.135.862,58	1,99%		
Sub-total Renda Fixa - RF e REFERENCIAL LIVRE							99.935.365,84	93,31%		
Renda Variável										
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	25,49%	3,09%	0,01%	10,48%	1.535.320,00	1,43%	26.786.046,16	5,73%
Sub-total Artigo 8º I - FIA INDEXADO IBOV. IBX OU IBX-50							1.535.320,00	1,43%		
VINCI EQUITIES	CEF	FIC FIA CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	15,33%	4,44%	1,36%	7,39%	4.244.299,02	3,96%	371.611.684,93	1,14%
Sub-total Artigo 8º III - FUNDOS DE AÇÕES							4.244.299,02	3,96%		
RIO BRAVO INVEST	CEF	CAIXA RIO BRAVO FII	0,00%	5,67%	654,65%	7,58%	1.380.240,00	1,29%	177.821.712,93	0,78%
Sub-total Artigo 8º VI - FUNDO INVEST IMOBILIÁRIO							1.380.240,00	1,29%		
Sub-total Renda Variável							7.159.859,02	6,69%		
Total							107.095.224,86	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)	90.652.659,48	84,65%	95,00%	100,00%
Artigo 7º III, Alínea a	FUNDOS DE INVEST RENDA FIXA REF (IMA ou IDKA)	7.146.843,77	6,67%	15,00%	80,00%
Artigo 7º IV, Alínea a	RF e REFERENCIAL LIVRE	2.135.862,58	1,99%	25,00%	30,00%
Total Renda Fixa		99.935.365,84	93,31%		
Renda Variável					
Artigo 8º I	FIA INDEXADO IBOV. IBX OU IBX-50	1.535.320,00	1,43%	10,00%	20,00%
Artigo 8º III	FUNDOS DE AÇÕES	4.244.299,02	3,96%	10,00%	15,00%
Artigo 8º VI	FUNDO INVEST IMOBILIÁRIO	1.380.240,00	1,29%	3,00%	5,00%
Total Renda Variável		7.159.859,02	6,68%		

Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)

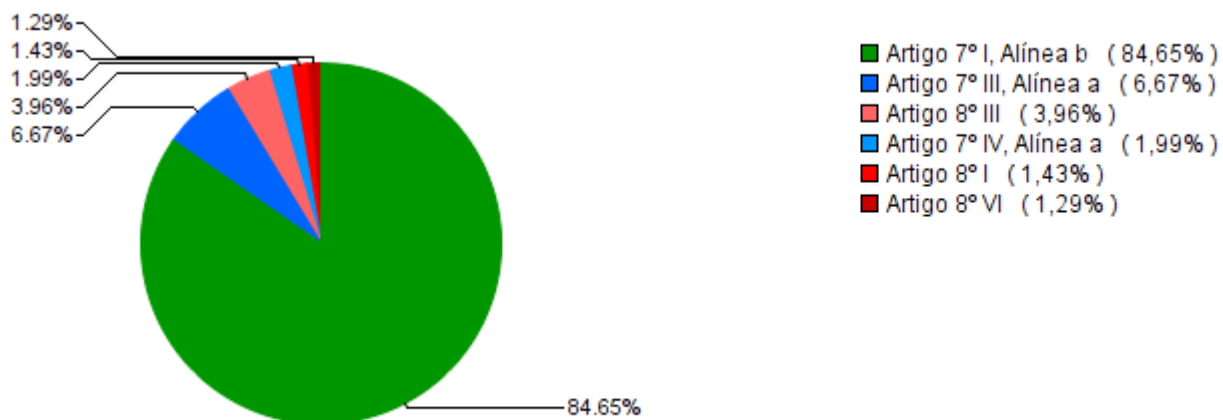
Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
Artigo 7º I, Alínea b	3,40	5,23	24,28	--
% do CDI	392,9	266,6	174,9	--
Artigo 7º III, Alínea a	4,96	7,10	27,92	--
% do CDI	572,9	361,7	201,1	--
Artigo 7º IV, Alínea a	0,89	2,00	13,88	--
% do CDI	102,9	101,8	99,9	--
Artigo 8º I	3,09	10,48	54,76	--
Var. IBOVESPA p.p	0,0	-0,2	-1,0	--
Artigo 8º III	4,44	7,39	20,71	--
Var. IBOVESPA p.p	1,4	-3,3	-35,1	--
Artigo 8º VI	5,67	7,58	62,94	--
Var. IBOVESPA p.p	2,6	-3,1	7,2	--

Ganhos Financeiros

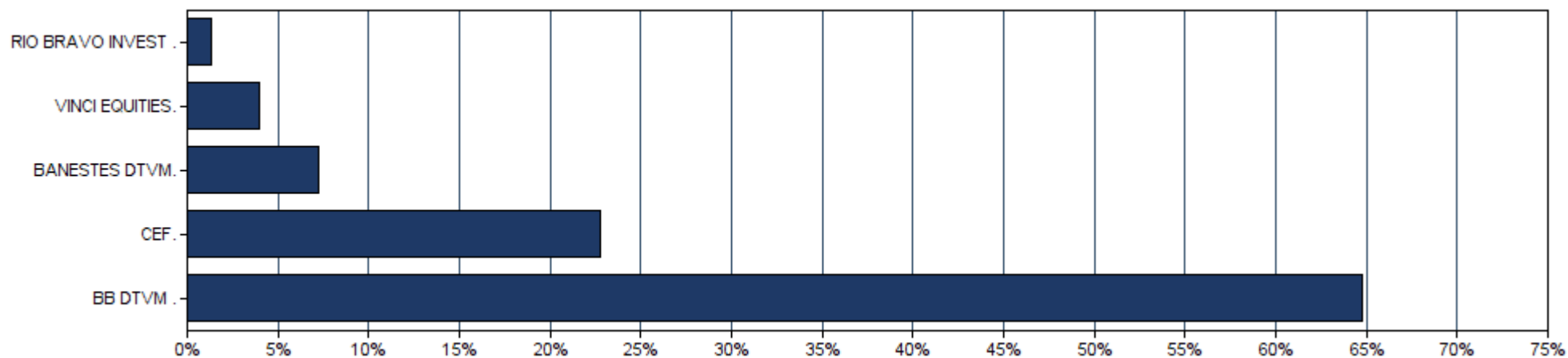
Estratégia	Ganho Bruto (R\$)
Artigo 7º I, Alínea b	2.962.149,51
Artigo 7º III, Alínea a	335.203,40
Artigo 7º IV, Alínea a	18.875,08
Artigo 8º I	46.032,00
Artigo 8º III	180.364,03
Artigo 8º VI	74.136,78
Total	3.616.760,81

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia



Alocação por Gestor

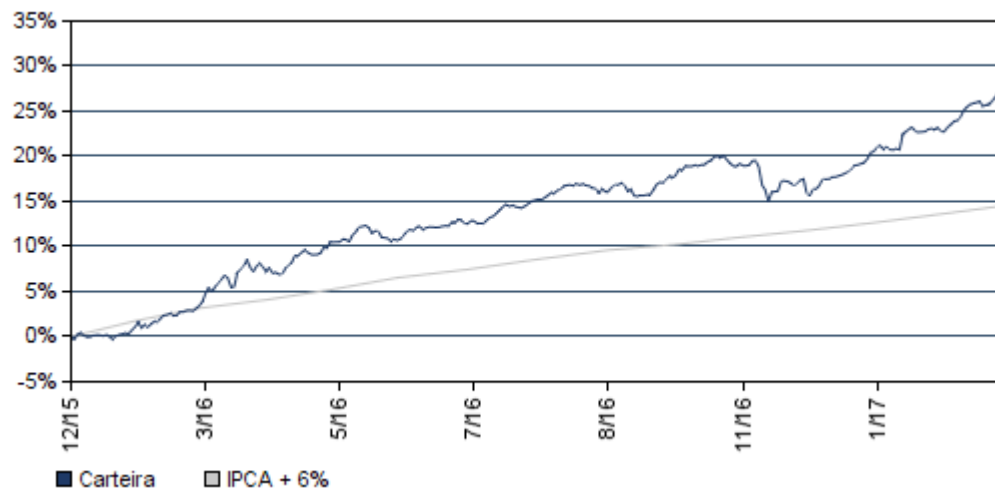


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

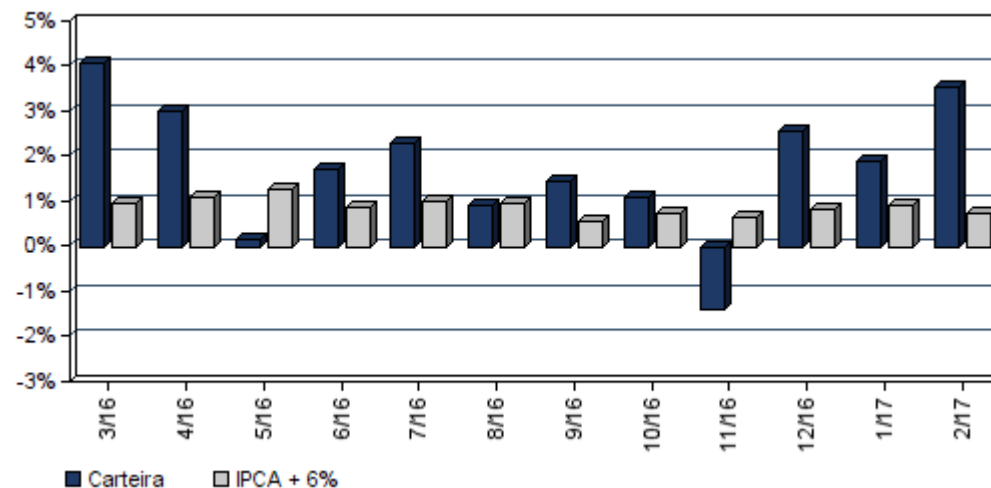
Rentabilidades da Carteira

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	2,51	20,77
IPCA + 6%	1,74	1,34	0,94	1,08	1,27	0,86	1,01	0,98	0,57	0,72	0,64	0,81	12,64
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	1,70	8,13
2017	1,89	3,52	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	5,48
IPCA + 6%	0,89	0,75	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	1,65
p.p. Indx	1,00	2,77	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	3,83

Evolução da Rentabilidade



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



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	10	71,4%					
Meses abaixo do Benchmark	4	28,6%					
	Rentab.	Mês					
Maior rentabilidade da Carteira	4,09%	mar/16	03 meses	8,19	2,47	5,7	5,458
Menor rentabilidade da Carteira	-1,39%	nov/16	06 meses	9,44	4,47	5,0	5,946
			12 meses	23,36	11,04	12,3	5,552
			24 meses	--	--	--	--
			36 meses	--	--	--	--
			Desde o início	27,12	14,49	12,6	5,360

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
FI BANESTES PREVIDENCIARIO RF Var. do IMA-B TOTAL p.p.	1,16 0,60	1,16 0,60	1,16 0,60	1,16 0,60	1,16 0,60	1,16 0,60	1,16 0,60
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI Var. do IMA-B TOTAL p.p.	3,85 -0,00	5,76 -0,03	8,82 -0,04	9,81 -0,11	26,50 -0,20	31,69 -0,34	31,69 -0,34
FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RF LP Var. do IMA-B TOTAL p.p.	3,83 -0,02	5,74 -0,05	8,78 -0,08	9,92 -0,00	26,54 -0,15	31,71 -0,32	31,71 -0,32
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA II FI Var. do IPCA p.p.	1,42 1,09	2,55 1,84	3,94 2,93	6,28 4,74	13,40 8,64	18,74 11,70	18,74 11,70
FI CAIXA BRASIL 2024 I TP RF Var. do IMA-B TOTAL p.p.	0,47 -3,38	2,25 -3,54	4,06 -4,81	5,30 -4,63	16,38 -10,31	19,08 -12,95	19,08 -12,95
FI CAIXA BRASIL 2018 IV TP RF Var. do IMA-B TOTAL p.p.	-1,82 -5,66	-0,83 -6,62	0,29 -8,58	2,73 -7,20	6,18 -20,52	8,03 -24,01	8,03 -24,01
FI BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA Var. do IMA-B TOTAL p.p.	4,96 1,12	7,10 1,31	11,07 2,21	12,07 2,15	30,24 3,54	35,36 3,33	35,36 3,33
BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC FI % do CDI	0,89 102,90	2,00 101,84	3,16 101,53	6,52 101,39	13,85 99,72	16,16 99,49	16,16 99,49

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
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA Var. do IBOVESPA p.p.	3,09 0,01	10,48 -0,20	7,50 -0,18	15,08 -0,05	54,76 -1,02	52,64 -1,14	52,64 -1,14
FIC FIA CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. do IBOVESPA p.p.	4,44 1,36	7,39 -3,30	6,82 -0,87	6,89 -8,24	20,71 -35,07	20,67 -33,11	20,67 -33,11
CAIXA RIO BRAVO FII % do CDI	5,67 654,65	7,58 385,99	13,47 433,30	15,62 242,75	62,94 453,33	53,85 331,60	53,85 331,60
CDI	0,87	1,96	3,11	6,43	13,89	29,35	43,51
IMA-B 5	1,49	2,67	4,10	6,47	13,40	32,51	49,75
IMA-B 5+	5,06	7,41	11,40	11,75	35,35	43,21	70,82
IMA-B TOTAL	3,85	5,79	8,86	9,92	26,69	38,66	61,80
IMA-GERAL TOTAL	2,26	4,11	6,07	8,66	21,43	34,20	51,93
IRF-M 1	1,01	2,31	3,53	6,86	14,23	30,27	44,56
IRF-M 1+	2,37	5,09	7,31	11,32	28,78	37,63	53,85
IRF-M TOTAL	2,01	4,34	6,27	10,02	23,33	35,09	50,62
IBOVESPA	3,08	10,68	7,68	15,13	55,78	29,23	41,55
IFIX	4,86	8,80	10,40	14,77	49,01	48,14	52,48
SMALL CAP	5,73	17,81	17,17	14,91	62,13	29,70	10,46
INPC + 6%	0,66	1,60	2,26	4,04	10,98	30,61	49,00

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
IPCA + 6%	0,75	1,65	2,47	4,47	11,04	29,84	48,16