

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Posição de Ativos										
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (29/09/2017)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
<b>Renda Fixa</b>										
BANESTES DTVM	Banco BANESTES	FI BANESTES PREVIDENCIÁRIO RF	11,73%	2,44%	0,63%	7,00%	1.326.018,49	1,12%	243.113.997,72	0,55%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M 1 TP FIC FI	0,68%	0,71%	-0,03%	2,73%	21.846.179,03	18,40%	11.114.189.323,99	0,20%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI	10,03%	1,78%	-0,03%	12,94%	31.645.005,73	26,66%	5.381.819.828,66	0,59%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RF LP	10,03%	1,80%	-0,01%	12,99%	19.268.396,71	16,23%	5.624.777.345,67	0,34%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA II FI	3,02%	0,81%	0,25%	10,10%	3.026.556,57	2,55%	841.079.199,99	0,36%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 I TP RF	8,64%	1,46%	-0,35%	7,83%	1.174.211,90	0,99%	384.139.658,30	0,31%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2018 IV TP RF	4,44%	0,50%	-1,31%	2,65%	4.972.047,65	4,19%	280.835.924,00	1,77%
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - FI 100% Títulos do Tesouro Nacional</b>							<b>83.258.416,07</b>	<b>70,14%</b>		
BANESTES DTVM	Banco BANESTES	FI BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA	11,61%	2,54%	0,73%	13,32%	8.037.653,16	6,77%	223.865.330,83	3,59%
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a - FI Renda Fixa/Referenciados RF</b>							<b>8.037.653,16</b>	<b>6,77%</b>		
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC FI	0,11%	0,65%	101,29%	8,10%	13.761.113,01	11,59%	4.279.499.588,21	0,32%
CEF	CEF	FI CAIXA ALIANÇA TP RF	0,17%	0,63%	98,02%	7,98%	781.768,59	0,66%	335.901.735,94	0,23%
<b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - FI Renda Fixa</b>							<b>14.542.881,60</b>	<b>12,25%</b>		
<b>Sub-total Renda Fixa - FI Renda Fixa</b>							<b>105.838.950,83</b>	<b>89,17%</b>		
<b>Renda Variável</b>										
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	20,76%	4,79%	-0,09%	22,63%	1.704.116,00	1,44%	29.532.188,43	5,77%
<b>Sub-total Artigo 8º I - FI Ações Referenciados</b>							<b>1.704.116,00</b>	<b>1,44%</b>		
VINCI EQUITIES Gest Rec	CEF	FIC FIA CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	18,91%	4,45%	-0,44%	18,24%	9.748.817,75	8,21%	421.402.170,14	2,31%
<b>Sub-total Artigo 8º III - FI em Ações</b>							<b>9.748.817,75</b>	<b>8,21%</b>		
RIO BRAVO Invest	CEF	CAIXA RIO BRAVO FII	0,00%	8,73%	1.361,59%	15,32%	1.405.761,66	1,18%	181.027.885,26	0,78%
<b>Sub-total Artigo 8º VI - FI Imobiliários</b>							<b>1.405.761,66</b>	<b>1,18%</b>		
<b>Sub-total Renda Variável</b>							<b>12.858.695,41</b>	<b>10,83%</b>		
<b>Total</b>							<b>118.697.646,24</b>	<b>100%</b>		

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Enquadramento da Carteira**

Artigo	Classe	Valor(R\$)	% Carteira	Política Investimento	Limite Res. 3.922/10
<b>Renda Fixa</b>					
Artigo 7º I, Alínea b	FI 100% Títulos do Tesouro Nacional	83.258.416,07	70,14%	100,00%	100,00%
Artigo 7º III, Alínea a	FI Renda Fixa/Referenciados RF	8.037.653,16	6,77%	60,00%	80,00%
Artigo 7º IV, Alínea a	FI Renda Fixa	14.542.881,60	12,25%	20,00%	30,00%
<b>Total Renda Fixa</b>		<b>105.838.950,83</b>	<b>89,16%</b>		
<b>Renda Variável</b>					
Artigo 8º I	FI Ações Referenciados	1.704.116,00	1,44%	10,00%	20,00%
Artigo 8º III	FI em Ações	9.748.817,75	8,21%	15,00%	15,00%
Artigo 8º VI	FI Imobiliários	1.405.761,66	1,18%	2,00%	5,00%
<b>Total Renda Variável</b>		<b>12.858.695,41</b>	<b>10,83%</b>		

**Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)**

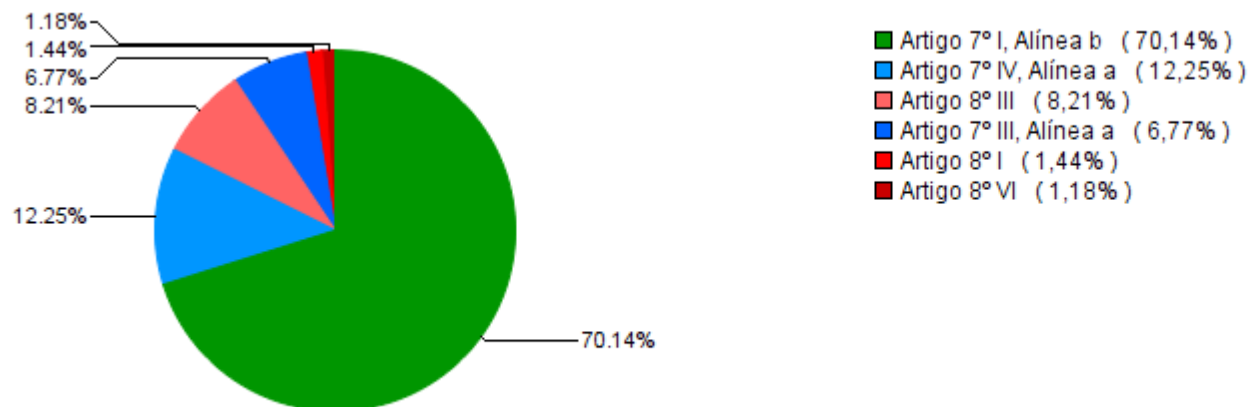
Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
<b>Artigo 7º I, Alínea b</b>	1,40	11,04	13,53	--
% do CDI	217,7	137,2	117,2	--
<b>Artigo 7º III, Alínea a</b>	2,54	13,32	16,72	--
% do CDI	395,4	165,5	144,7	--
<b>Artigo 7º IV, Alínea a</b>	0,65	8,10	11,65	--
% do CDI	101,2	100,7	100,9	--
<b>Artigo 8º I</b>	4,79	22,63	26,54	--
Var. IBOVESPA p.p	-0,1	-0,7	-0,7	--
<b>Artigo 8º III</b>	4,45	18,24	17,68	--
Var. IBOVESPA p.p	-0,4	-5,1	-9,6	--
<b>Artigo 8º VI</b>	8,73	15,32	21,82	--
Var. IBOVESPA p.p	3,9	-8,0	-5,5	--

**Ganhos Financeiros**

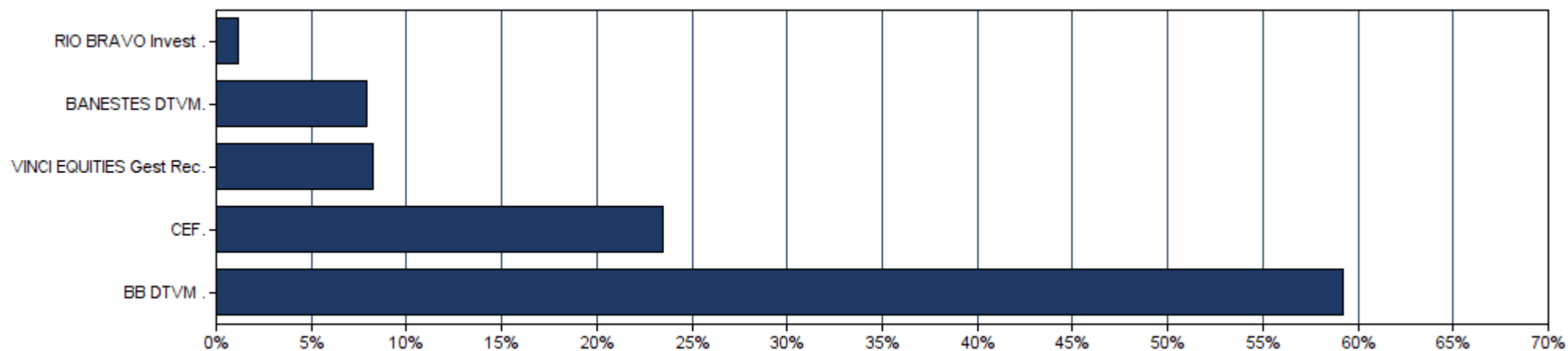
Estratégia	Ganho Bruto (R\$)
<b>Artigo 7º I, Alínea b</b>	1.147.497,99
<b>Artigo 7º III, Alínea a</b>	198.820,68
<b>Artigo 7º IV, Alínea a</b>	98.390,95
<b>Artigo 8º I</b>	77.872,00
<b>Artigo 8º III</b>	274.507,63
<b>Artigo 8º VI</b>	113.064,66
<b>Total</b>	<b>1.910.153,91</b>

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Alocação por Estratégia**



**Alocação por Gestor**

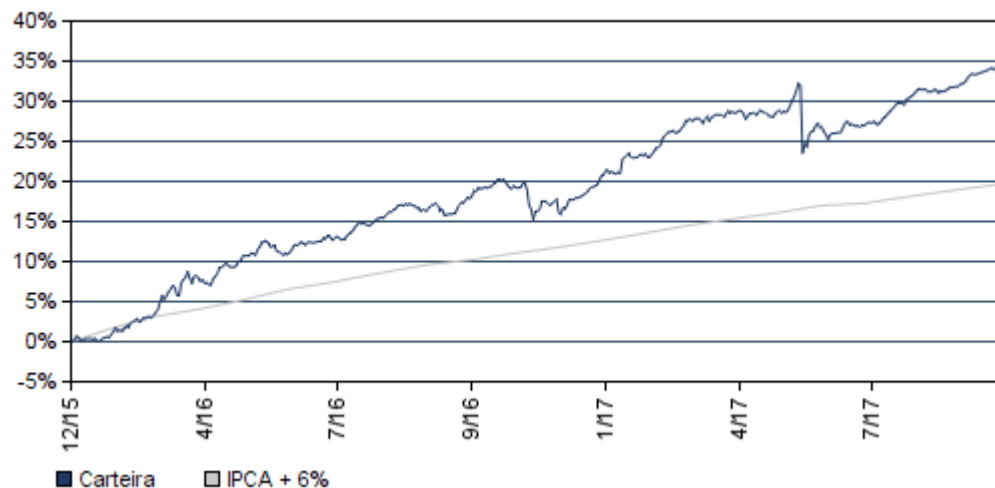


### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

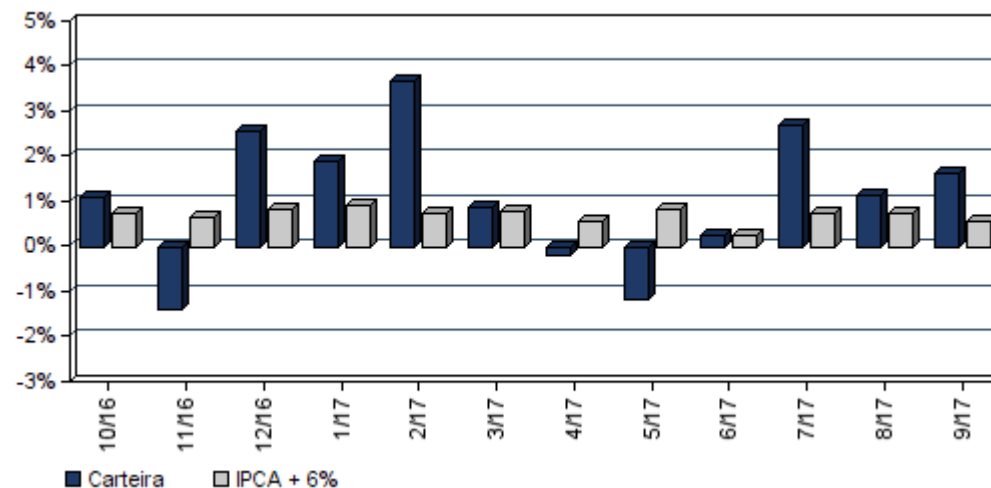
#### Rentabilidades da Carteira

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
<b>2016</b>	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
<b>IPCA + 6%</b>	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
<b>p.p. Indx</b>	-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
<b>2017</b>	1,89	3,69	0,85	-0,21	-1,20	0,24	2,68	1,13	1,62	--	--	--	11,11
<b>IPCA + 6%</b>	0,89	0,75	0,78	0,56	0,82	0,26	0,73	0,72	0,55	--	--	--	6,23
<b>p.p. Indx</b>	1,00	2,94	0,06	-0,77	-2,02	-0,02	1,95	0,41	1,07	--	--	--	4,88

#### Evolução da Rentabilidade



#### Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

#### Análise de Risco / Retorno da Carteira

	Qtd.	Perct.
Meses <b>acima</b> do Benchmark	14	66,7%
Meses <b>abaixo</b> do Benchmark	7	33,3%

	Rentab.	Mês
<b>Maior</b> rentabilidade da Carteira	4,09%	mar/16
<b>Menor</b> rentabilidade da Carteira	-1,39%	nov/16

Período	Rentabilidade (%)			Volat. Anual
	Carteira	IPCA + 6%	p.p. Indx.	
<b>03 meses</b>	5,53	2,02	3,5	2,064
<b>06 meses</b>	4,29	3,70	0,6	9,987
<b>12 meses</b>	13,62	8,56	5,1	8,168
<b>24 meses</b>	--	--	--	--
<b>36 meses</b>	--	--	--	--
<b>Desde o início</b>	34,18	19,66	14,5	6,937

#### 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 PREVIDENCIÁRIO RF Var. do IMA-B TOTAL p.p.	2,44 0,63	7,00 -0,57	8,06 0,76	5,22 -0,64	7,00 -0,57	7,00 -0,57	7,00 -0,57
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M 1 TP FIC FI Var. do IRF-M 1 p.p.	0,71 -0,03	2,73 -0,04	2,67 -0,05	2,73 -0,04	2,73 -0,04	2,73 -0,04	2,73 -0,04
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI Var. do IMA-B TOTAL p.p.	1,78 -0,03	12,94 -0,21	7,21 -0,10	5,71 -0,15	15,46 -0,30	40,63 -0,60	40,63 -0,60
FI CAIXA BRASIL IMA-B 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	15,63 -0,13	40,75 -0,49	40,75 -0,49
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA II FI Var. do IPCA + 6% p.p.	0,81 0,25	10,10 3,87	4,00 1,98	5,78 2,09	12,51 3,95	27,48 7,82	27,48 7,82
FI CAIXA BRASIL 2024 I TP RF Var. do IMA-B TOTAL p.p.	1,46 -0,35	7,83 -5,33	4,38 -2,92	4,22 -1,64	9,81 -5,96	25,58 -15,65	25,58 -15,65
FI CAIXA BRASIL 2018 IV TP RF Var. do IMA-B TOTAL p.p.	0,50 -1,31	2,65 -10,50	0,08 -7,22	2,16 -3,70	4,93 -10,84	11,82 -29,41	11,82 -29,41
FI BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA Var. do IMA-B TOTAL p.p.	2,54 0,73	13,32 0,16	8,01 0,71	5,19 -0,67	16,72 0,95	43,22 1,99	43,22 1,99

**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 PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC FI % do CDI	0,65 101,29	8,10 100,65	2,27 100,20	4,86 99,94	11,65 100,87	23,10 99,69	23,10 99,69
FI CAIXA ALIANÇA TP RF % do CDI	0,63 98,02	7,98 99,18	2,26 100,09	4,75 97,63	11,43 98,98	23,10 99,66	23,10 99,66
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA Var. do IBOVESPA p.p.	4,79 -0,09	22,63 -0,73	17,81 -0,30	13,97 -0,36	26,54 -0,74	69,42 -1,96	69,42 -1,96
FIC FIA CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. do IBOVESPA p.p.	4,45 -0,44	18,24 -5,12	13,17 -4,95	11,26 -3,07	17,68 -9,61	32,87 -38,51	32,87 -38,51
CAIXA RIO BRAVO FII % do CDI	8,73 1.361,59	15,32 190,37	5,03 222,62	9,48 194,91	21,82 188,91	64,92 280,13	64,92 280,13
CDI	0,64	8,05	2,26	4,87	11,55	27,32	43,32
IMA-B 5	1,01	10,94	5,18	6,58	13,45	34,82	50,93
IMA-B 5+	2,40	14,62	8,64	5,79	17,29	57,99	62,59
IMA-B TOTAL	1,81	13,16	7,30	5,86	15,76	48,59	57,28
IMA-GERAL TOTAL	1,33	11,68	4,82	5,99	14,81	40,15	51,22
IRF-M 1	0,74	9,14	2,72	5,49	12,65	29,70	45,13
IRF-M 1+	1,73	15,17	5,69	7,83	19,22	51,80	57,39
IRF-M TOTAL	1,48	13,57	4,92	7,23	17,44	43,51	53,47
IBOVESPA	4,88	23,35	18,11	14,33	27,29	64,88	37,29
IFIX	6,57	19,15	7,09	9,30	22,30	58,64	56,30

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Análise dos Fundos & Ativos da Carteira**

**Rentabilidades em Períodos Fechados (%)**

<b>Fundo / Indexador</b>	<b>No Mês</b>	<b>No Ano</b>	<b>3 meses</b>	<b>6 meses</b>	<b>12 meses</b>	<b>24 meses</b>	<b>36 meses</b>
<i>SMALL CAP</i>	--	37,68	--	--	--	--	--
<i>INPC + 6%</i>	0,46	5,76	1,63	3,22	7,70	24,61	45,17
<i>IPCA + 6%</i>	0,55	6,23	2,02	3,70	8,56	24,83	44,88