

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos											
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	VAR	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (30/06/2017)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
Renda Fixa											
Artigo 7º I, Alínea b - FUNDOS 100% TP (IMA ou IDkA)											
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF IMA-B TP ..	10,04%	1,09	0,15%	-0,02%	5,35%	863.066,69	2,26%	5.587.585.622,96	0,02%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IMAB TP RF LP ..	10,02%	1,09	0,15%	-0,01%	5,36%	11.879.334,02	31,11%	5.524.451.010,52	0,22%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IRFM 1 TP RF ..	0,66%	0,12	0,87%	-0,02%	6,15%	7.262.798,98	19,02%	13.298.673.360,80	0,05%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IMA GERAL RF LP ..	4,82%	0,55	0,82%	0,00%	6,55%	198.146,82	0,52%	1.305.893.504,92	0,02%
ITAU UNIBANCO	ITAU UNIBANCO	ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI ..	13,27%	1,43	-0,09%	-0,03%	5,18%	656.781,02	1,72%	321.083.024,49	0,20%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IMA B 5+ TP RF LP..	13,10%	1,41	-0,07%	-0,02%	-2,02%	3.476.458,59	9,10%	1.604.031.069,76	0,22%
CEF	CEF	CAIXA BRASIL IDkA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RJ LP ..	2,82%	0,34	0,62%	0,46%	5,73%	2.272.607,26	5,95%	3.563.955.579,01	0,06%
CEF	CEF	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 II TP RF..	12,59%	1,33	0,30%	0,13%	2,50%	1.403.985,00	3,68%	51.685.264,30	2,72%
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IX..	1,88%	0,24	0,57%	0,04%	5,48%	83.624,16	0,22%	354.678.229,47	0,02%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - FUNDOS 100% TP (IMA ou IDkA)				0,83				28.096.802,54	73,58%		
Artigo 7º III, Alínea a - FUNDOS DE INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA (IMA ou IDkA)											
BRABESCO	BRABESCO	BRABESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA – B 5..	3,89%	0,45	0,48%	-0,04%	5,52%	5.334.536,37	13,97%	280.251.405,74	1,90%
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a - FUNDOS DE INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA (IMA ou IDkA)				0,45				5.334.536,37	13,97%		
Artigo 7º IV, Alínea a - RF e REFERENCIAL LIVRE											
BRABESCO	BRABESCO	BRABESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM ..	0,10%	0,06	0,83%	102,61%	5,83%	635.881,78	1,67%	8.862.305.548,42	0,01%
CEF	CEF	FI CAIXA MEGA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO ..	0,09%	0,06	0,82%	101,43%	5,69%	1.104.332,48	2,89%	8.954.313.320,30	0,01%
BB	BB	BB RPPS RF PERFIL FIC ..	0,09%	0,06	0,81%	100,26%	5,71%	2.526.282,59	6,62%	4.588.439.004,22	0,06%
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - RF e REFERENCIAL LIVRE				0,06				4.266.496,85	11,17%		
Artigo 7º VII, Alínea b - RF e REF. CRÉDITO PRIVADO											
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV..	0,09%	0,06	0,82%	100,41%	5,75%	116.766,28	0,31%	5.486.819.516,59	0,00%
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b - RF e REF. CRÉDITO PRIVADO				0,06				116.766,28	0,31%		
Sub-total Renda Fixa - RF e REF. CRÉDITO PRIVADO								37.814.602,04	99,02%		
Renda Variável											

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos											
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	VAR	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (30/06/2017)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
Artigo 8º III - FUNDO DE AÇÃO											
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES..	15,03%	1,70	2,32%	2,02%	9,46%	109.460,60	0,29%	37.665.820,03	0,29%
GERAÇÃO FUTURO	GERAÇÃO FUTURO	GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES ..	20,84%	2,21	0,25%	-0,05%	-2,23%	49.232,33	0,13%	174.061.920,85	0,03%
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FI DE AÇÕES ..	17,40%	1,85	2,08%	1,78%	10,81%	60.088,31	0,16%	326.868.304,63	0,02%
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES..	9,43%	1,07	0,73%	0,43%	0,95%	153.661,67	0,40%	499.809.164,39	0,03%
Sub-total Artigo 8º III - FUNDO DE AÇÃO				1,53				372.442,91	0,98%		
Sub-total Renda Variável								372.442,91	0,98%		
Total								38.187.044,95	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 b	FUNDOS 100% TP (IMA ou IDkA)	28.096.802,54	73,58%	68,00%	100,00%
Artigo 7º III, Alínea a	FUNDOS DE INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA (IMA ou IDkA)	5.334.536,37	13,97%	20,00%	80,00%
Artigo 7º IV, Alínea a	RF e REFERENCIAL LIVRE	4.266.496,85	11,17%	5,00%	30,00%
Artigo 7º VII, Alínea b	RF e REF. CRÉDITO PRIVADO	116.766,28	0,31%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa		37.814.602,04	99,03%		
Renda Variável					
Artigo 8º III	FUNDO DE AÇÃO	372.442,91	0,98%	5,00%	15,00%
Total Renda Variável		372.442,91	0,98%		

Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)				
Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,34 41,3	4,72 83,5	-- --	-- --
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,48 59,2	5,85 103,3	-- --	-- --
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,82 101,0	5,70 100,8	-- --	-- --
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,82 100,4	5,75 101,6	-- --	-- --
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p	1,34 1,0	8,95 4,5	-- --	-- --

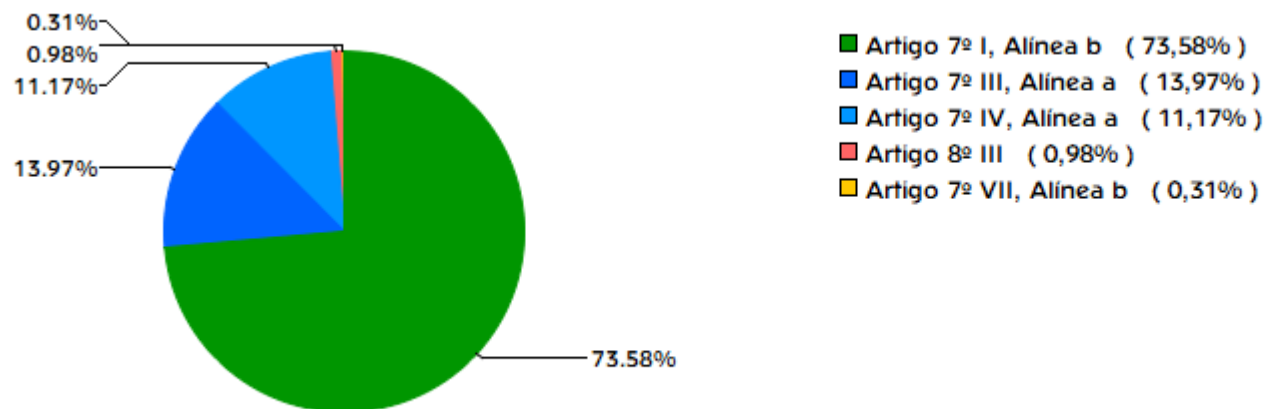
Ganhos Financeiros	
Estratégia	Ganho Bruto (R\$)
Artigo 7º I, Alínea b	91.683,65
Artigo 7º III, Alínea a	23.108,33
Artigo 7º IV, Alínea a	39.562,68
Artigo 7º VII, Alínea b	943,98
Artigo 8º III	4.942,26
Total	160.240,90

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**Análise da Disponibilidade Financeira**

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acum. Bruto (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	38.104.158,70	100	38.104.158,70	100
acima de 365 dias	83.624,16	0	38.187.782,86	100

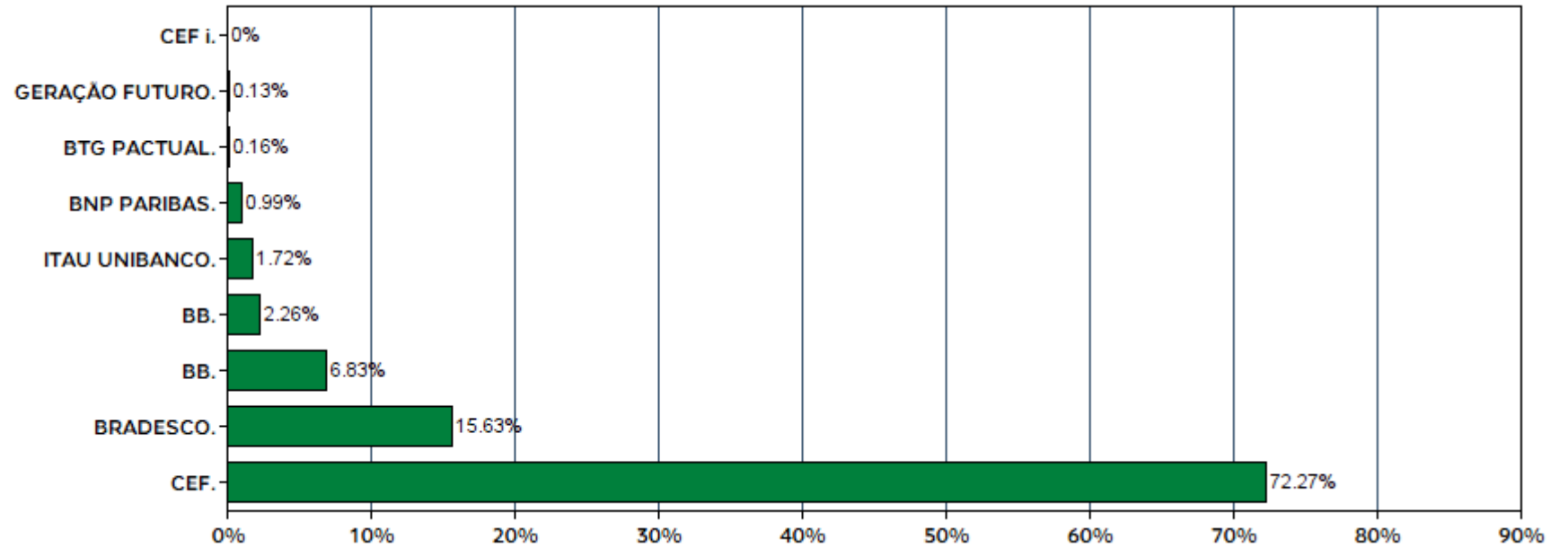
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor

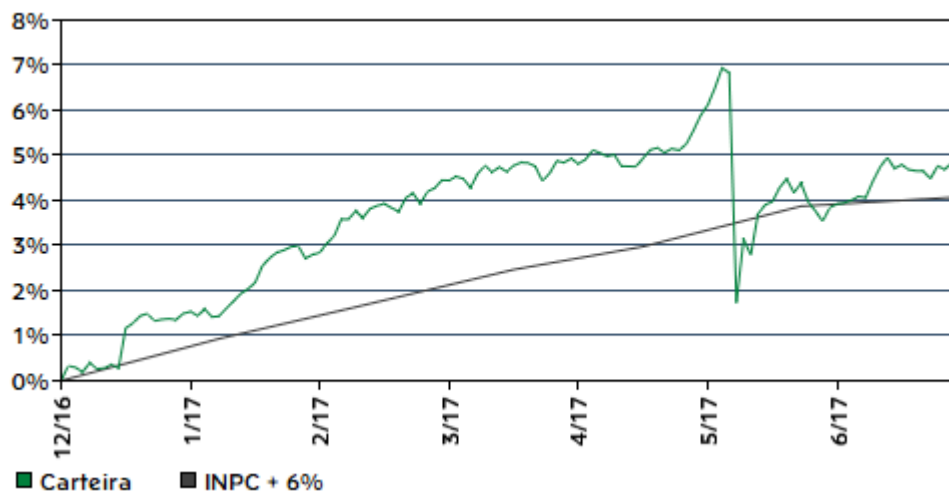


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

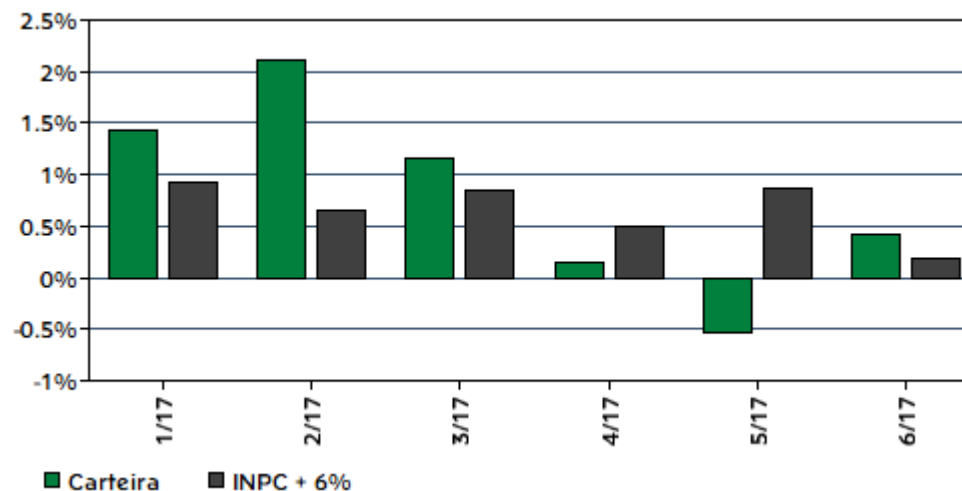
Rentabilidades da Carteira

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
2017	1,43	2,12	1,15	0,15	-0,53	0,43	-	-	-	-	-	-	4,83
INPC + 6%	0,93	0,66	0,85	0,50	0,87	0,19	-	-	-	-	-	-	4,06
p.p. Indx	0,50	1,46	0,29	-0,34	-1,40	0,24	-	-	-	-	-	-	0,76

Evolução da Rentabilidade



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco / Retorno da Carteira

	Qtd.	Perct.
Meses acima do Benchmark	4	66,7%
Meses abaixo do Benchmark	2	33,3%

	Rentab.	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,12%	fev/17
Menor rentabilidade da Carteira	-0,53%	mai/17

Período	Rentabilidade (%)			Volat. Anual
	Carteira	INPC + 6%	p.p. Indx.	
03 meses	0,05	1,56	-1,5	10,705
06 meses	4,83	4,06	0,8	7,782
12 meses	--	--	--	--
24 meses	--	--	--	--
36 meses	--	--	--	--
Desde o início	4,83	4,06	0,8	7,782

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 RF IMA-B TP .. Var. do IMA-B TOTAL p.p.	0,15 -0,02	5,35 -0,10	-1,39 -0,05	5,35 -0,10	5,35 -0,10	5,35 -0,10	5,35 -0,10
CAIXA FI BRASIL IMAB TP RF LP .. Var. do IMA-B TOTAL p.p.	0,15 -0,01	5,36 -0,10	-1,38 -0,04	5,36 -0,10	5,36 -0,10	5,36 -0,10	5,36 -0,10
CAIXA FI BRASIL IRFM 1 TP RF .. Var. do IRF-M 1 p.p.	0,87 -0,02	6,15 -0,10	2,65 -0,04	6,15 -0,10	6,15 -0,10	6,15 -0,10	6,15 -0,10
CAIXA FI BRASIL IMA GERAL RF LP .. Var. do IMA-GERAL TOTAL p.p.	0,82 0,00	6,55 -0,01	1,21 0,10	6,55 -0,01	6,55 -0,01	6,55 -0,01	6,55 -0,01
ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI .. Var. do IMA-B 5+ p.p.	-0,09 -0,03	5,18 -0,31	-2,78 -0,15	5,18 -0,31	5,18 -0,31	5,18 -0,31	5,18 -0,31
CAIXA FI BRASIL IMA B 5+ TP RF LP.. Var. do IMA-B 5+ p.p.	-0,07 -0,02	-2,02 0,07	-2,55 0,08	-2,02 0,07	-2,02 0,07	-2,02 0,07	-2,02 0,07
CAIXA BRASIL IDKa IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RJ LP .. Var. do IMA-B TOTAL p.p.	0,62 0,46	5,73 0,27	1,84 3,18	5,73 0,27	5,73 0,27	5,73 0,27	5,73 0,27
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 II TP RF.. Var. do IMA-B TOTAL p.p.	0,30 0,13	2,50 -2,96	-2,26 -0,92	2,50 -2,96	2,50 -2,96	2,50 -2,96	2,50 -2,96

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 RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IX.. Var. do IMA-B 5 p.p.	0,57 0,04	5,48 0,01	2,08 0,75	5,48 0,01	5,48 0,01	5,48 0,01	5,48 0,01
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA – B 5.. Var. do IMA-B 5 p.p.	0,48 -0,04	5,52 0,05	1,19 -0,14	5,52 0,05	5,52 0,05	5,52 0,05	5,52 0,05
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM .. % do CDI	0,83 102,61	5,83 102,99	2,70 105,89	5,83 102,99	5,83 102,99	5,83 102,99	5,83 102,99
FI CAIXA MEGA REFERENCIADO DI LONGO PRAZO .. % do CDI	0,82 101,43	5,69 100,47	2,56 100,39	5,69 100,47	5,69 100,47	5,69 100,47	5,69 100,47
BB RPPS RF PERFIL FIC .. % do CDI	0,81 100,26	5,71 100,83	2,54 99,71	5,71 100,83	5,71 100,83	5,71 100,83	5,71 100,83
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV.. % do CDI	0,82 100,41	5,75 101,59	2,58 101,19	5,75 101,59	5,75 101,59	5,75 101,59	5,75 101,59
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES.. Var. do IBOVESPA p.p.	2,32 2,02	9,46 11,65	7,25 10,46	9,46 11,65	9,46 11,65	9,46 11,65	9,46 11,65
GERAÇÃO FUTURO DIVIDENDOS FI AÇÕES .. Var. do IBOVESPA p.p.	0,25 -0,05	-2,23 -6,67	-6,42 -3,21	-2,23 -6,67	-2,23 -6,67	-2,23 -6,67	-2,23 -6,67
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FI DE AÇÕES .. Var. do IBOVESPA p.p.	2,08 1,78	10,81 6,37	2,34 5,55	10,81 6,37	10,81 6,37	10,81 6,37	10,81 6,37
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES.. Var. do IBOVESPA p.p.	0,73 0,43	0,95 7,03	1,60 4,81	0,95 7,03	0,95 7,03	0,95 7,03	0,95 7,03
CDI	0,81	5,66	2,55	5,66	12,87	28,77	43,97
IBOVESPA	0,30	4,44	-3,21	4,44	22,07	18,50	18,30
DOLAR COMERCIAL	1,99	1,51	4,41	1,51	3,07	6,63	50,20
INPC + 6%	0,19	4,06	1,56	4,06	8,68	26,14	46,20
IPCA + 6%	0,26	4,13	1,64	4,13	9,15	25,94	45,40