

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos											
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	VAR	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (29/09/2017)	% 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 IRF-M TP ..	4,88%	0,57	1,45%	-0,02%	13,36%	30.011.694,49	6,35%	4.989.933.175,82	0,60%
BANESTES	BANESTES	BANESTES FI PREVIDENCIÁRIO RF ..	11,73%	1,28	2,44%	0,63%	13,21%	46.832.545,21	9,91%	243.113.997,72	19,26%
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI..	0,68%	0,12	0,71%	-0,03%	7,47%	11.086.288,98	2,35%	11.114.189.323,99	0,10%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IMAB TP RF LP ..	10,03%	1,10	0,02%	-0,00%	0,02%	1.550.321,98	0,33%	5.624.777.345,67	0,03%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IRFM 1 TP RF ..	0,67%	0,12	0,71%	-0,03%	8,98%	30.393.740,42	6,43%	14.886.805.108,28	0,20%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP RF LP ..	3,66%	0,43	0,99%	-0,01%	10,80%	103.526.910,24	21,91%	6.273.482.056,63	1,65%
BB	BB	BB RPPS RF IDKA 2 FI ..	2,92%	0,35	0,86%	133,63%	10,29%	41.267.685,07	8,73%	5.133.992.687,63	0,80%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF ..	8,64%	0,93	1,46%	-0,35%	7,83%	5.749.528,00	1,22%	384.139.658,30	1,50%
BANESTES	BANESTES	FUNDO DE INVESTIMENTO BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS-RENDA FIXA..	2,07%	0,26	0,95%	0,20%	9,61%	18.478.006,08	3,91%	95.273.681,95	19,39%
CEF	CEF	CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA..	4,46%	0,48	0,50%	-1,31%	2,65%	1.463.915,65	0,31%	3.189.415.210,95	0,05%
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII..	3,57%	0,42	0,88%	-0,94%	10,51%	3.741.531,42	0,79%	1.140.750.920,83	0,33%
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF ALOCACAO ATIVA FCFI..	5,25%	0,60	1,32%	0,01%	11,39%	40.238.285,27	8,51%	1.898.093.637,00	2,12%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - Fundos 100% TP (IMA ou IDkA)				0,54				334.340.452,81	70,75%		
Artigo 7º III, Alínea a - Fundos de Investimentos de Renda Fixa (IMA ou IDk)											
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF IMAB FI..	10,03%	1,10	1,84%	0,03%	13,20%	39.544.814,03	8,37%	1.309.486.949,77	3,02%
BANESTES	BANESTES	FI BANESTES INSTITUCIONAL RF ..	11,61%	1,27	2,54%	0,73%	13,32%	33.992.923,87	7,19%	223.865.330,83	15,18%
BB	BB	BB PREVID RF IMA-B 5 LP FIC DE FI..	3,67%	0,43	0,99%	-0,02%	10,84%	17.720.954,00	3,75%	1.993.423.540,77	0,89%
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a - Fundos de Investimentos de Renda Fixa (IMA ou IDk)				1,03				91.258.691,90	19,31%		
Artigo 7º IV, Alínea a - RF e REFERENCIAL LIVRE											
BANESTES	BANESTES	FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP ..	0,25%	0,07	0,63%	98,40%	8,11%	10.048.365,93	2,13%	432.066.830,42	2,33%
BANESTES	BANESTES	FI BANESTES INVESTIDOR CURTO PRAZO..	0,11%	0,04	0,41%	63,29%	1,25%	94.239,28	0,02%	324.321.844,31	0,03%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL REF DI LP ..	0,12%	0,06	0,63%	98,85%	8,06%	423.229,50	0,09%	5.872.213.177,84	0,01%
INFINITY	INFINITY	INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA ..	9,27%	1,01	0,68%	106,63%	9,30%	3.210.713,78	0,68%	97.184.412,42	3,30%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos											
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	VAR	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (29/09/2017)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
BB	BB	BB RPPS RF PERFIL FIC ..	0,11%	0,06	0,65%	101,29%	8,10%	66.089,96	0,01%	4.279.499.588,21	0,00%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS RF ..	4,01%	0,43	0,50%	-0,13%	6,43%	4.508.140,00	0,95%	1,36	330.729.862,93%
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI ..	6,50%	0,73	1,24%	0,62%	12,88%	8.361.664,81	1,77%	394.703.109,99	2,12%
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - RF e REFERENCIAL LIVRE				0,45				26.712.443,26	5,65%		
Artigo 7º VII, Alínea a - FIDC FECHADO											
CEF	CEF	FIDC CASAN SANEAMENTO SEN..	5,77%	0,58	-1,24%	-194,01%	-3,57%	4.853.790,76	1,03%	232.981.956,31	2,08%
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a - FIDC FECHADO				0,58				4.853.790,76	1,03%		
Sub-total Renda Fixa - FIDC FECHADO								457.165.378,73	96,74%		
Renda Variável											
Artigo 8º III - FUNDO DE AÇÃO											
GERAÇÃO FUTURO	GERAÇÃO FUTURO	GERAÇÃO FI EM AÇÕES ..	20,85%	2,22	4,00%	-0,88%	0,04%	1.545.700,20	0,33%	157.964.425,66	0,98%
VINCI	VINCI	FI DE FI EM AÇÕES CAIXA VALAOR DIVIDENDOS RPPS ..	18,91%	2,03	4,45%	-1,68%	18,24%	5.758.364,88	1,22%	421.402.170,14	1,37%
BANESTES	BANESTES	FIC BANESTES FIA BTG PACTUAL DIVIDENDOS..	15,34%	1,66	5,20%	-0,92%	23,43%	1.529.359,80	0,32%	6.135.033,03	24,93%
Sub-total Artigo 8º III - FUNDO DE AÇÃO				2,00				8.833.424,88	1,87%		
Artigo 8º V - FUNDO INVEST EM PARTICIPAÇÕES											
BRPP	BRPP	RIO BRAVO ENERGIA I FIP..	0,00%	0,00	0,16%	24,73%	-70,31%	478.863,24	0,10%	--	0,00%
Sub-total Artigo 8º V - FUNDO INVEST EM PARTICIPAÇÕES				0,00				478.863,24	0,10%		
Artigo 8º VI - FUNDO INVEST IMOBILIÁRIO											
REAL ESTATE	CEF	DOMO FII - DOMC11 FII ..	--%	--	0,33%	-6,25%	-0,96%	1.835.081,69	0,39%	160.569.648,30	1,14%
RIO BRAVO	RIO BRAVO	CAIXA RIO BRAVO FII ..	5,96%	0,64	4,78%	-1,80%	7,73%	2.297.658,09	0,49%	181.027.885,26	1,27%
RIO BRAVO	RIO BRAVO	BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO ..	5,46%	0,57	-10,26%	-16,84%	-7,52%	1.962.129,82	0,42%	101.540.218,02	1,93%
Sub-total Artigo 8º VI - FUNDO INVEST IMOBILIÁRIO				0,42				6.094.869,60	1,29%		
Sub-total Renda Variável								15.407.157,72	3,26%		
Total								472.572.536,45	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)	334.340.452,81	70,75%	0,00%	100,00%
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos de Investimentos de Renda Fixa (IMA ou IDk)	91.258.691,90	19,31%	0,00%	80,00%
Artigo 7º IV, Alínea a	RF e REFERENCIAL LIVRE	26.712.443,26	5,65%	0,00%	30,00%
Artigo 7º VII, Alínea a	FIDC FECHADO	4.853.790,76	1,03%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa		457.165.378,73	96,74%		
Renda Variável					
Artigo 8º III	FUNDO DE AÇÃO	8.833.424,88	1,87%	0,00%	15,00%
Artigo 8º V	FUNDO INVEST EM PARTICIPAÇÕES	478.863,24	0,10%	0,00%	5,00%
Artigo 8º VI	FUNDO INVEST IMOBILIARIO	6.094.869,60	1,29%	0,00%	5,00%
Total Renda Variável		15.407.157,72	3,26%		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)				
Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,22 190,9	11,02 137,0	-- --	-- --
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	1,93 301,5	12,81 159,2	-- --	-- --
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,81 126,9	9,40 116,8	-- --	-- --
Artigo 7º VII, Alínea a % do CDI	-1,24 -194,0	-3,57 -44,3	-- --	-- --
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p	4,53 -0,3	18,37 -5,0	-- --	-- --
Artigo 8º V Var. IBOVESPA p.p	0,00 -4,9	0,09 -23,3	-- --	-- --
Artigo 8º VI Var. IBOVESPA p.p	0,00 -4,9	-28,19 -51,5	-- --	-- --

Ganhos Financeiros	
Estratégia	Ganho Bruto (R\$)
Artigo 7º I, Alínea b	4.025.500,27
Artigo 7º III, Alínea a	1.734.108,09
Artigo 7º IV, Alínea a	200.685,55
Artigo 7º VII, Alínea a	-61.161,29
Artigo 8º III	391.196,23
Artigo 8º V	758,42
Artigo 8º VI	-113.621,97
Total	6.177.465,30

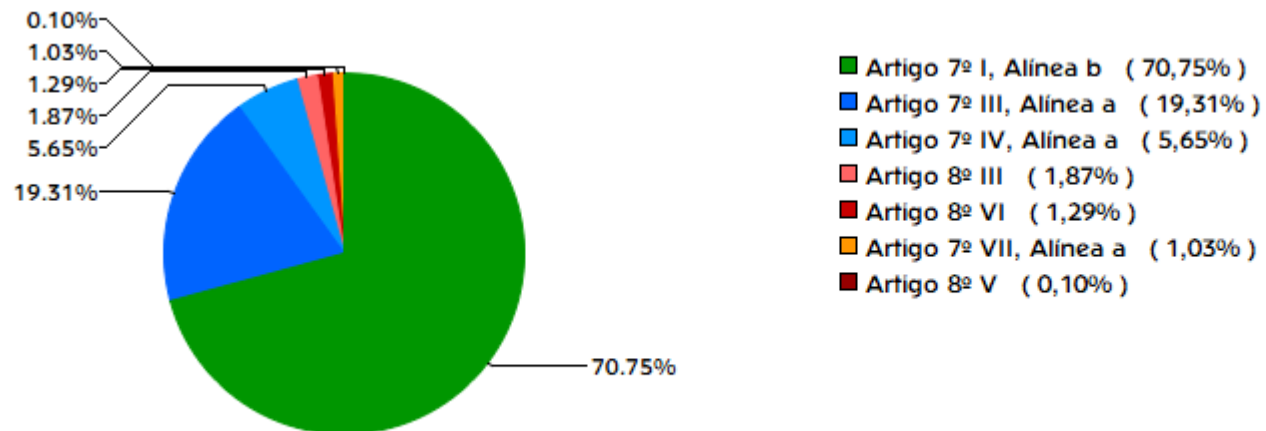
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise da Disponibilidade Financeira

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acum. Bruto (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	472.572.536,45	100	472.572.536,45	100

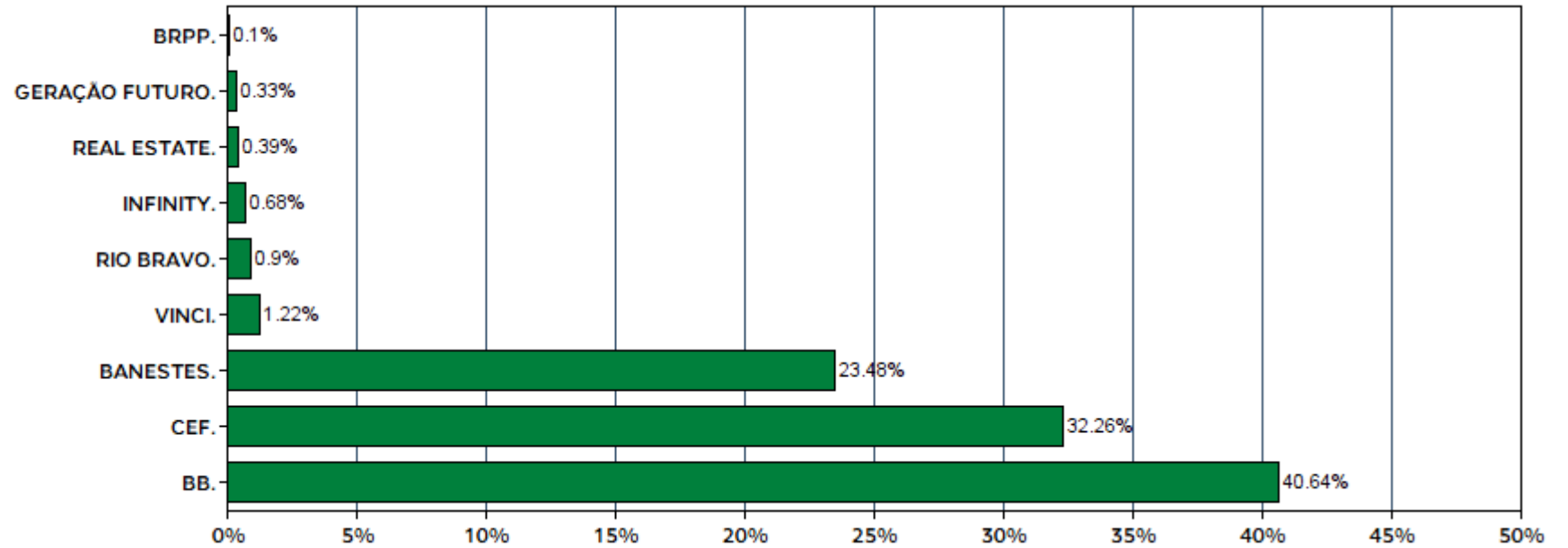
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor

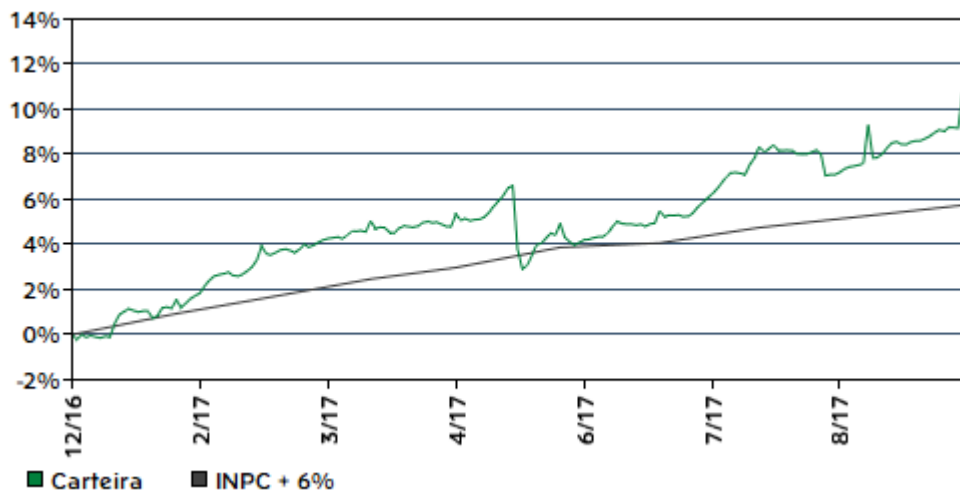


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

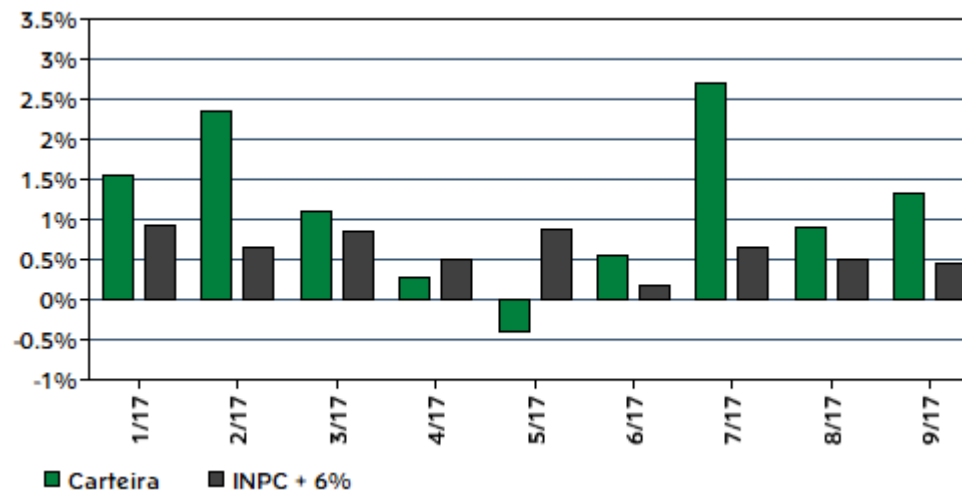
Rentabilidades da Carteira

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
2017	1,54	2,35	1,09	0,27	-0,39	0,55	2,69	0,89	1,33	--	--	--	10,77
INPC + 6%	0,93	0,66	0,85	0,50	0,87	0,19	0,66	0,50	0,44	--	--	--	5,74
p.p. Indx	0,61	1,69	0,24	-0,22	-1,26	0,36	2,04	0,39	0,89	--	--	--	5,03

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	77,8%
Meses abaixo do Benchmark	2	22,2%

	Rentab.	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,69%	jul/17
Menor rentabilidade da Carteira	-0,39%	mai/17

Período	Rentabilidade (%)			Volat. Anual
	Carteira	INPC + 6%	p.p. Indx.	
03 meses	4,99	1,61	3,4	0,000
06 meses	5,44	3,20	2,2	0,000
12 meses	--	--	--	--
24 meses	--	--	--	--
36 meses	--	--	--	--
Desde o início	10,77	5,74	5,0	0,000

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 VII.. % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,88 -0,94	10,51 -2,64	4,45 -2,85	5,97 0,11	12,92 -2,84	33,75 -14,84	-- --
BANESTES FI PREVIDENCIÁRIO RF .. % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,44 0,63	13,21 0,05	8,06 0,76	5,22 -0,64	15,95 0,19	51,91 3,32	60,13 2,84
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI.. % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,71 -0,03	8,94 -0,20	2,67 -0,05	5,37 -0,12	12,38 -0,27	29,13 -0,57	43,91 -1,23
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FCFI.. % do Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	1,32 0,01	11,39 -0,35	4,90 0,14	5,71 -0,39	14,30 -0,79	-- --	-- --
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M TP .. % do Var. IRF-M TOTAL p.p.	1,45 -0,02	13,36 -0,21	4,87 -0,05	7,06 -0,17	17,16 -0,29	43,01 -0,50	52,33 -1,14
BB RPPS RF IDKA 2 FI .. % do % do CDI	0,86 133,63	10,29 127,85	4,33 191,57	6,18 127,09	12,73 110,23	33,31 121,94	48,99 113,09
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA.. % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,50 -1,31	2,65 -10,51	0,07 -7,23	2,15 -3,71	4,86 -10,90	17,80 -30,79	-- --
CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP RF LP .. % do Var. IMA-B 5 p.p.	0,99 -0,01	10,80 -0,14	5,13 -0,05	6,49 -0,08	13,27 -0,18	34,14 -0,68	49,60 -1,33

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
CAIXA FI BRASIL IMAB TP RF LP .. % do Var. 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	47,62 -0,97	54,28 -3,01
CAIXA FI BRASIL IRFM 1 TP RF .. % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,71 -0,03	8,98 -0,15	2,67 -0,05	5,39 -0,09	12,45 -0,20	29,31 -0,39	44,35 -0,79
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF .. % do Var. 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	32,11 -16,48	31,12 -26,16
FUNDO DE INVESTIMENTO BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS-RENDA FIXA.. % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,95 0,20	9,61 0,48	3,29 0,58	5,52 0,03	13,30 0,65	30,69 0,98	-- --
BB PREVID RF IMA-B 5 LP FIC DE FI.. % do Var. IMA-B 5 p.p.	0,99 -0,02	10,84 -0,10	5,16 -0,03	6,53 -0,05	13,28 -0,17	34,30 -0,52	49,68 -1,25
BB PREVIDENCIARIO RF IMAB FI.. % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,84 0,03	13,20 0,05	7,34 0,03	5,84 -0,02	15,81 0,04	47,99 -0,60	56,51 -0,78
FI BANESTES INSTITUCIONAL RF .. % do Var. 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	51,91 3,32	59,74 2,45
FI BANESTES INVESTIDOR CURTO PRAZO.. % do % do CDI	0,41 63,29	5,70 70,81	1,50 66,24	3,34 68,72	8,34 72,18	20,06 73,43	31,26 72,15
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI .. % do Var. IPCA + 6% p.p.	1,24 0,62	12,88 6,58	6,74 4,65	7,03 3,27	15,31 6,67	43,57 18,65	53,23 8,24
BB RPPS RF PERFIL FIC .. % do % do CDI	0,65 101,29	8,10 100,65	2,27 100,20	4,86 99,94	11,65 100,87	27,28 99,87	43,65 100,77
CAIXA FI BRASIL REF DI LP .. % do % do CDI	0,63 98,85	8,06 100,13	2,23 98,54	4,86 99,80	11,56 100,07	27,32 100,00	43,47 100,34
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP .. % do % do CDI	0,63 98,40	8,11 100,83	2,23 98,53	4,91 100,86	11,89 102,94	27,35 100,11	42,91 99,05
FI CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS RF .. % do Var. IPCA + 6% p.p.	0,50 -0,13	6,43 0,12	1,86 -0,23	3,84 0,08	8,62 -0,02	18,53 -6,39	30,15 -14,84
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA .. % do % do CDI	0,68 106,63	9,30 115,59	2,25 99,38	5,56 114,38	13,12 113,57	31,15 114,04	48,49 111,93
FIDC CASAN SANEAMENTO SEN.. % do % do CDI	-1,24 -194,01	-3,57 -44,32	-3,63 -160,60	-3,69 -75,78	-3,73 -32,30	-3,45 -12,63	-3,55 -8,19

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 BANESTES FIA BTG PACTUAL DIVIDENDOS.. % do Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	5,20 -0,92	23,43 -4,12	16,80 -2,18	15,53 3,67	18,73 -23,29	42,95 -50,85	41,71 20,32
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALAOR DIVIDENDOS RPPS .. % do Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	4,45 -1,68	18,24 -9,31	13,17 -5,82	11,26 -0,60	17,68 -24,34	41,48 -52,32	31,90 10,51
GERAÇÃO FI EM AÇÕES .. % do Var. IBOVESPA p.p.	4,00 -0,88	5,13 -18,23	8,33 -9,79	0,52 -13,80	12,56 -14,73	12,54 -52,34	3,84 -33,44
RIO BRAVO ENERGIA I FIP.. % do % do CDI	0,16 24,73	-70,31 -873,77	-69,92 -3.093,15	-70,18 -1.442,49	-70,50 -610,37	-77,66 -284,30	-87,91 -202,92
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO .. % do Var. IFIX p.p.	-10,26 -16,84	-7,52 -26,67	-8,14 -15,23	-10,19 -19,50	-8,10 -30,40	-1,80 -60,44	-0,26 -56,55
CAIXA RIO BRAVO FII .. % do Var. IFIX p.p.	4,78 -1,80	7,73 -11,42	3,53 -3,55	2,59 -6,71	8,53 -13,77	24,73 -33,91	15,13 -41,16
DOMO FII - DOMC11 FII .. % do Var. IFIX p.p.	0,33 -6,25	-0,96 -20,11	0,29 -6,80	-2,88 -12,19	-9,10 -31,41	-16,04 -74,68	-5,41 -61,71
CDI	0,64	8,05	2,26	4,87	11,55	27,32	43,32
IBOVESPA	4,88	23,35	18,11	14,33	27,29	64,88	37,29
DOLAR COMERCIAL	0,66	-2,80	-4,24	-0,01	-2,41	-20,26	29,25
INPC + 6%	0,44	5,74	1,61	3,20	7,68	24,59	45,14
IPCA + 6%	0,62	6,30	2,09	3,77	8,64	24,92	44,98