

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos											
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	VAR	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (31/07/2017)	% 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	4,91%	0,57	2,31%	-0,00%	3,92%	28.784.842,04	6,31%	5.042.823.951,08	0,57%
BANESTES	BANESTES	BANESTES FI PREVIDENCIARIO RF	11,77%	1,28	4,27%	0,27%	2,53%	45.346.344,66	9,94%	226.177.317,11	20,05%
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RENDA FIXA IRF-M1 TITULOS PUBLICOS FIC FI	0,67%	0,12	1,06%	0,01%	2,83%	10.885.110,83	2,39%	10.836.512.634,60	0,10%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IRFM 1 TP RF	0,66%	0,12	1,04%	-0,01%	2,84%	29.346.500,66	6,43%	14.011.053.988,09	0,21%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP RF LP	3,67%	0,43	2,82%	-0,02%	3,44%	99.753.445,99	21,86%	6.028.101.250,89	1,65%
BB	BB	BB RPPS RF IDKA 2 FI	2,94%	0,36	2,44%	304,12%	3,47%	40.518.151,60	8,88%	5.139.489.796,18	0,79%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 I TITULOS PUBLICOS RF	8,82%	0,95	3,82%	-0,18%	3,58%	5.718.928,00	1,25%	382.095.355,03	1,50%
BANESTES	BANESTES	FUNDO DE INVESTIMENTO BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 TITULOS PUBLICOS-RENTA FIXA	2,05%	0,27	1,38%	0,33%	2,73%	18.134.845,71	3,97%	78.691.280,66	23,05%
CEF	CEF	CAIXA BRASIL 2018 II TITULOS PUBLICOS FI RENDA FIXA	4,56%	0,50	1,66%	-2,34%	2,95%	1.487.064,15	0,33%	3.239.848.879,40	0,05%
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RENDA FIXA TITULOS PUBLICOS VII	3,62%	0,43	2,53%	-1,47%	3,33%	3.776.859,63	0,83%	1.151.522.097,36	0,33%
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF ALOCACAO ATIVA FCFI	5,48%	0,62	2,43%	0,11%	2,87%	39.290.572,36	8,61%	1.490.936.609,90	2,64%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - FUNDOS 100% TP (IMA ou IDKa)								323.042.665,63	70,79%		
Artigo 7º III, Alínea a - FUNDOS DE INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA (IMA ou IDKa)											
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF IMAB FI	10,08%	1,10	4,01%	0,01%	2,91%	38.318.573,14	8,40%	1.170.018.377,76	3,28%
BANESTES	BANESTES	FI BANESTES INSTITUCIONAL RF	11,65%	1,27	4,07%	0,08%	2,25%	33.374.881,86	7,31%	215.663.426,39	15,48%
BB	BB	BB PREVID RF IMA-B 5 LP FIC DE FI	3,68%	0,43	2,85%	0,00%	3,47%	16.200.309,80	3,55%	1.804.319.993,14	0,90%
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a - FUNDOS DE INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA (IMA ou IDKa)								87.893.764,79	19,26%		
Artigo 7º IV, Alínea a - RF e REFERENCIAL LIVRE											
BANESTES	BANESTES	FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP	0,25%	0,08	0,79%	98,66%	2,63%	6.520.088,38	1,43%	421.650.954,76	1,55%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL REF DI LP	0,10%	0,06	0,79%	98,08%	2,56%	141.497,08	0,03%	5.671.875.018,97	0,00%
INFINITY ASSET	INFINITY ASSET	INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	9,38%	1,03	0,64%	80,01%	2,75%	3.160.291,25	0,69%	90.532.380,11	3,49%
BB	BB	BB RPPS RF PERFIL FIC	0,10%	0,06	0,81%	100,60%	2,56%	1.072.894,76	0,24%	4.144.723.536,71	0,03%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2018 I TITULOS PUBLICOS RF	3,98%	0,43	0,40%	-0,33%	1,73%	4.570.716,50	1,00%	1.309.423.684,51	0,35%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos											
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	VAR	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (31/07/2017)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF TITULOS PUBLICOS IPCA I FI	6,58%	0,74	3,77%	3,04%	3,74%	8.349.404,12	1,83%	394.124.353,63	2,12%
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - RF e REFERENCIAL LIVRE								23.814.892,09	5,22%		
Artigo 7º VII, Alínea a - FIDC FECHADO											
CEF	CEF	FIDC CASAN SANEAMENTO SEN	5,21%	0,53	-1,51%	-188,30%	-1,33%	4.960.683,91	1,09%	238.112.827,69	2,08%
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a - FIDC FECHADO								4.960.683,91	1,09%		
Sub-total Renda Fixa - FIDC FECHADO								439.712.006,43	96,36%		
Renda Variável											
Artigo 8º III - FUNDO DE AÇÃO											
GERAÇÃO FUTURO	GERAÇÃO FUTURO	GERAÇÃO FI EM AÇÕES	24,17%	2,55	2,68%	-2,13%	-5,18%	1.465.910,07	0,32%	114.803.841,02	1,28%
VINCI GESTORA DE RECURSOS LTDA	VINCI GESTORA DE RECURSOS LTDA	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALAOR DIVIDENDOS RPPS	19,06%	2,01	1,73%	-3,09%	-1,76%	5.176.360,07	1,13%	367.814.976,56	1,41%
BANESTES	BANESTES	FIC BANESTES FIA BTG PACTUAL DIVIDENDOS	15,90%	1,66	4,58%	-0,24%	1,56%	2.159.613,00	0,47%	7.225.182,51	29,89%
Sub-total Artigo 8º III - FUNDO DE AÇÃO								8.801.883,14	1,93%		
Artigo 8º V - FUNDO INVEST EM PARTICIPAÇÕES											
BRASIL PLURAL GESTAO DE RECURS	BRASIL PLURAL GESTAO DE RECURS	RIO BRAVO ENERGIA I FIP	1,01%	0,10	0,15%	18,14%	-0,17%	1.594.146,45	0,35%	218.318.356,67	0,73%
Sub-total Artigo 8º V - FUNDO INVEST EM PARTICIPAÇÕES								1.594.146,45	0,35%		
Artigo 8º VI - FUNDO INVEST IMOBILIÁRIO											
REAL ESTATE ADM E GESTAO DE IN	REAL ESTATE ADM E GESTAO DE IN	DOMO FII - DOMC11 FII	-%	-	0,31%	0,70%	-3,59%	1.835.570,81	0,40%	160.612.446,65	1,14%
RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA	RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA	CAIXA RIO BRAVO FII	7,22%	0,78	-1,11%	-0,72%	-1,14%	2.194.660,29	0,48%	172.912.894,52	1,27%
RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA	RIO BRAVO INVESTIMENTOS LTDA	BB RECEBIVEIS IMOBILIARIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	5,37%	0,57	2,31%	2,69%	0,17%	2.185.381,12	0,48%	113.093.472,92	1,93%
Sub-total Artigo 8º VI - FUNDO INVEST IMOBILIÁRIO								6.215.612,22	1,36%		
Sub-total Renda Variável								16.611.641,81	3,64%		
Total								456.323.648,23	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, Alinea b	FUNDOS 100% TP (IMA ou IDkA)	323.042.665,63	70,79%	60,00%	100,00%
Artigo 7º III, Alinea a	FUNDOS DE INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA (IMA ou IDkA)	87.893.764,79	19,26%	25,00%	80,00%
Artigo 7º IV, Alinea a	RF e REFERENCIAL LIVRE	23.814.892,09	5,22%	5,00%	30,00%
Artigo 7º VII, Alinea a	FIDC FECHADO	4.960.683,91	1,09%	2,00%	5,00%
Total Renda Fixa		439.712.006,43	96,36%		
Renda Variável					
Artigo 8º III	FUNDO DE AÇÃO	8.801.883,14	1,93%	2,00%	15,00%
Artigo 8º V	FUNDO INVEST EM PARTICIPAÇÕES	1.594.146,45	0,35%	0,50%	5,00%
Artigo 8º VI	FUNDO INVEST IMOBILIÁRIO	6.215.612,22	1,36%	2,00%	5,00%
Total Renda Variável		16.611.641,81	3,64%		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)				
Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
Artigo 7º I, Alinea b % do CDI	2,58 322,4	3,17 123,7	-	-
Artigo 7º III, Alinea a % do CDI	3,82 476,7	2,76 107,8	-	-
Artigo 7º IV, Alinea a % do CDI	1,72 214,5	2,67 104,3	-	-
Artigo 7º VII, Alinea a % do CDI	-1,51 -188,3	-1,33 -51,8	-	-
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p	2,57 -2,2	-1,05 -1,8	-	-
Artigo 8º V Var. IBOVESPA p.p	0,15 -4,7	-0,17 -1,0	-	-
Artigo 8º VI Var. IBOVESPA p.p	0,49 -4,3	-1,42 -2,2	-	-

Ganhos Financeiros	
Estratégia	Ganho Bruto (R\$)
Artigo 7º I, Alinea b	8.129.429,03
Artigo 7º III, Alinea a	3.232.031,90
Artigo 7º IV, Alinea a	402.141,95
Artigo 7º VII, Alinea a	-75.949,47
Artigo 8º III	220.781,27
Artigo 8º V	2.312,81
Artigo 8º VI	30.459,49
Total	11.941.207,00

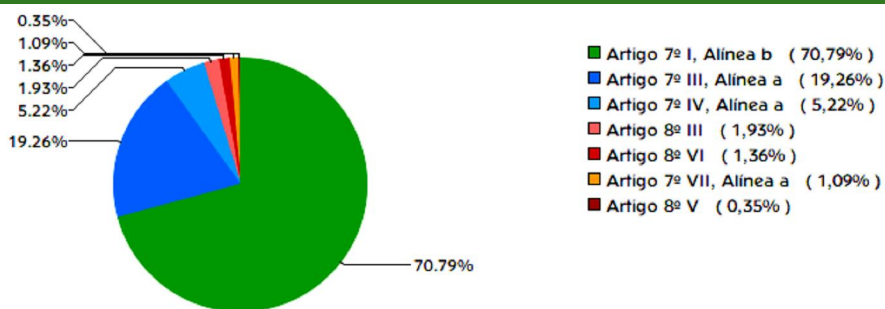
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise da Disponibilidade Financeira

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acum. Bruto (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	425.865.845,47	93	425.865.845,47	93
acima de 365 dias	30.457.802,76	7	456.323.648,23	100

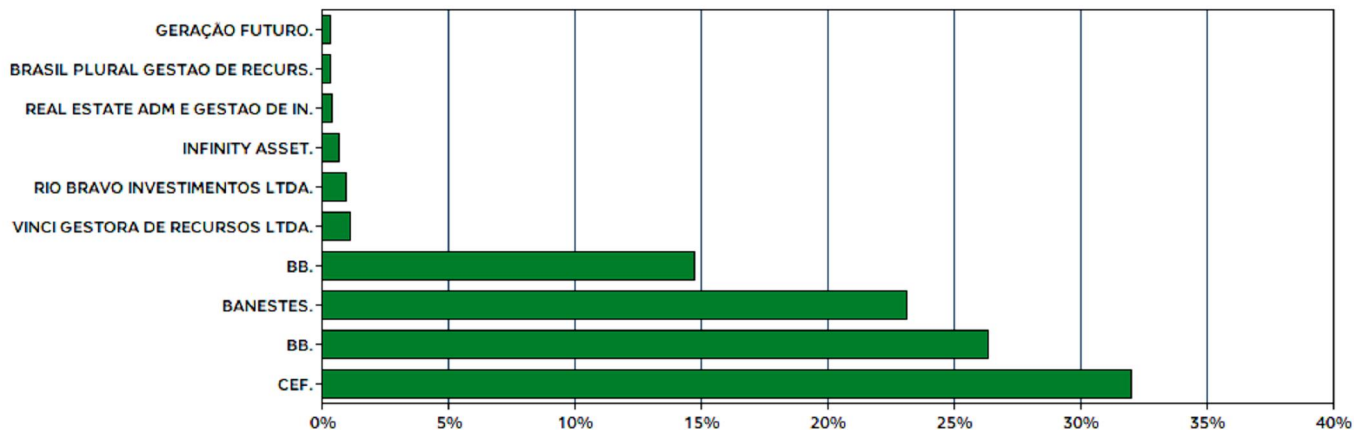
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor

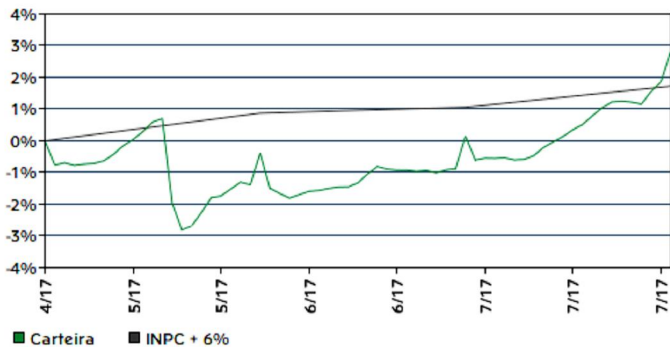


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

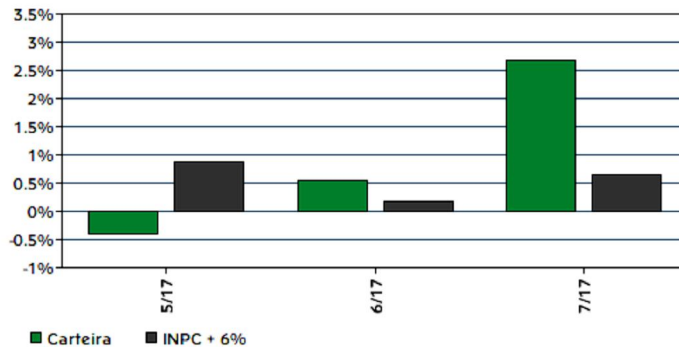
Rentabilidades da Carteira

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent. Ano
2017	--	--	--	--	-0,39	0,55	2,69	--	--	--	--	--	2,84
INPC + 6%	--	--	--	--	0,87	0,19	0,66	--	--	--	--	--	1,72
p.p. Índx	--	--	--	--	-1,26	0,36	2,03	--	--	--	--	--	1,12

Evolução da Rentabilidade



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



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 Var. do Índice Dividendos - IDIV p.p.	4,58 -0,24	1,56 3,91	1,56 3,91	1,56 3,91	1,56 3,91	1,56 3,91	1,56 3,91
RIO BRAVO ENERGIA I FIP % do CDI	0,15 18,14	-0,17 -6,71	-0,17 -6,71	-0,17 -6,71	-0,17 -6,71	-0,17 -6,71	-0,17 -6,71
DOMO FII - DOMC11 FII Var. do Índice Fundos Imobiliários - IFIX p.p.	0,31 0,70	-3,59 -5,11	-3,59 -5,11	-3,59 -5,11	-3,59 -5,11	-3,59 -5,11	-3,59 -5,11
CAIXA RIO BRAVO FII Var. do Índice Fundos Imobiliários - IFIX p.p.	-1,11 -0,72	-1,14 -2,66	-1,14 -2,66	-1,14 -2,66	-1,14 -2,66	-1,14 -2,66	-1,14 -2,66
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO Var. do Índice Fundos Imobiliários - IFIX p.p.	2,31 2,69	0,17 -1,35	0,17 -1,35	0,17 -1,35	0,17 -1,35	0,17 -1,35	0,17 -1,35
CDI	0,80	6,50	2,56	5,36	12,53	28,29	43,77
IBOVESPA	4,80	9,45	0,79	1,93	15,03	29,60	18,07
DOLAR COMERCIAL	-5,37	-3,94	-2,12	0,12	-3,34	-7,76	38,07
INPC + 6%	0,66	4,75	1,72	3,78	8,18	25,57	46,19
IPCA + 6%	0,73	4,89	1,82	3,96	8,85	25,40	45,67