

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 - 4604 - Fundos 100% Títulos Públicos - Referenciado											
CEF	CEF	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA..	6,31%	0,68	0,57%	0,41%	3,21%	757.526,89	0,40%	921.117.370,58	0,08%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - 4604 - Fundos 100% Títulos Públicos - Referenciado				0,68				757.526,89	0,40%		
Artigo 7º I, Alínea b - Fundos 100% TP (IMA ou IDkA)											
BANESTES	BANESTES	BANESTES FI PREVIDENCIÁRIO RF ..	11,75%	1,26	0,34%	0,17%	4,76%	41.353.615,77	21,76%	217.932.489,12	18,98%
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF IMA-B TP ..	10,04%	1,09	0,15%	-0,02%	5,35%	16.980.748,67	8,94%	5.587.585.622,96	0,30%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IMAB TP RF LP ..	10,02%	1,09	0,15%	-0,01%	5,36%	38.992.987,11	20,52%	5.524.451.010,52	0,71%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IRF M 1+ TP RF LP..	6,55%	0,75	1,49%	-0,02%	8,81%	1.553.314,54	0,82%	1.284.596.920,50	0,12%
CEF	CEF	CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA..	4,56%	0,49	0,57%	0,40%	2,57%	2.630.788,46	1,38%	3.187.083.473,21	0,08%
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI..	6,25%	0,70	0,34%	0,18%	6,00%	3.363.114,21	1,77%	483.300.331,93	0,70%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - Fundos 100% TP (IMA ou IDkA)				1,13				104.874.568,76	55,19%		
Artigo 7º III, Alínea a - Fundos de Investimentos de Renda Fixa (IMA ou IDk)											
BANESTES	BANESTES	FI BANESTES INSTITUCIONAL RF ..	11,63%	1,26	0,33%	0,17%	4,91%	34.202.808,74	18,00%	179.016.647,50	19,11%
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a - Fundos de Investimentos de Renda Fixa (IMA ou IDk)				1,26				34.202.808,74	18,00%		
Artigo 7º IV, Alínea a - RF e REFERENCIAL LIVRE											
BANESTES	BANESTES	FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP ..	0,25%	0,08	0,88%	108,83%	5,76%	15.401.069,45	8,11%	414.403.541,56	3,72%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL TP RF LP ..	0,14%	0,06	0,81%	100,10%	5,61%	952.051,62	0,50%	1.989.412.823,69	0,05%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL REF DI LP ..	0,09%	0,06	0,82%	101,57%	5,70%	7.195.576,09	3,79%	5.738.556.973,46	0,13%
BB	BB	BB RPPS RF PERFIL FIC ..	0,09%	0,06	0,81%	100,26%	5,71%	24.713.825,17	13,01%	4.588.439.004,22	0,54%
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - RF e REFERENCIAL LIVRE				0,06				48.262.522,33	25,40%		
Sub-total Renda Fixa				0,88				188.097.426,72	98,99%		
Renda Variável											
Artigo 8º II, Alínea a - 4604 - Fundos de Ações											
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALAOR DIVIDENDOS RPPS ..	19,05%	2,03	-0,12%	1,09%	4,48%	1.913.934,56	1,01%	361.558.148,65	0,53%

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
		Sub-total Artigo 8º II, Alínea a - 4604 - Fundos de Ações		2,03				1.913.934,56	1,01%		
		Sub-total Renda Variável		2,03				1.913.934,56	1,01%		
Total								190.011.361,28	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 - 4604	Fundos 100% Títulos Públicos - Referenciado	757.526,89	0,40%	0,00%	100,00%
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% TP (IMA ou IDkA)	104.874.568,76	55,19%	0,00%	100,00%
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos de Investimentos de Renda Fixa (IMA ou IDk)	34.202.808,74	18,00%	0,00%	80,00%
Artigo 7º IV, Alínea a	RF e REFERENCIAL LIVRE	48.262.522,33	25,40%	0,00%	30,00%
Total Renda Fixa		188.097.426,72	98,99%		
Renda Variável					
Artigo 8º II, Alínea a - 4604	Fundos de Ações	1.913.934,56	1,01%	0,00%	20,00%
Total Renda Variável		1.913.934,56	1,01%		

Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)				
Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,26 31,9	5,12 90,4	-- --	-- --
Artigo 7º I, Alínea b - 4604 % do CDI	0,57 70,5	3,21 56,7	-- --	-- --
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,33 40,7	4,91 86,8	-- --	-- --
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,84 103,1	5,72 101,1	-- --	-- --
Artigo 8º II, Alínea a - 4604 Var. IBOVESPA p.p	-0,12 -0,4	4,48 0,0	-- --	-- --

Ganhos Financeiros	
Estratégia	No Mês(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b - 4604	4.311,85
Artigo 7º I, Alínea b	270.750,01
Artigo 7º III, Alínea a	112.586,19
Artigo 7º IV, Alínea a	381.113,49
Artigo 8º II, Alínea a - 4604	-2.387,61
Total	766.373,93

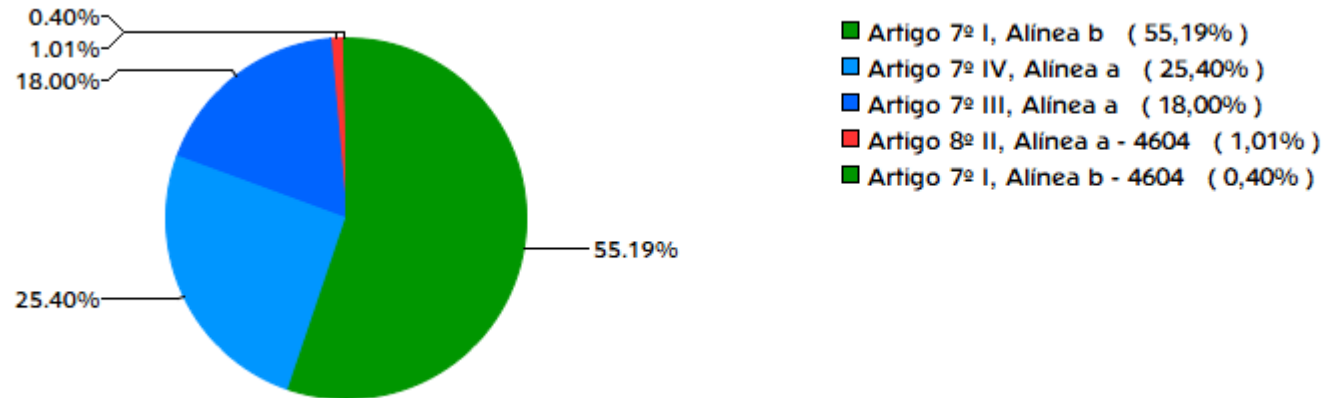
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise da Disponibilidade Financeira

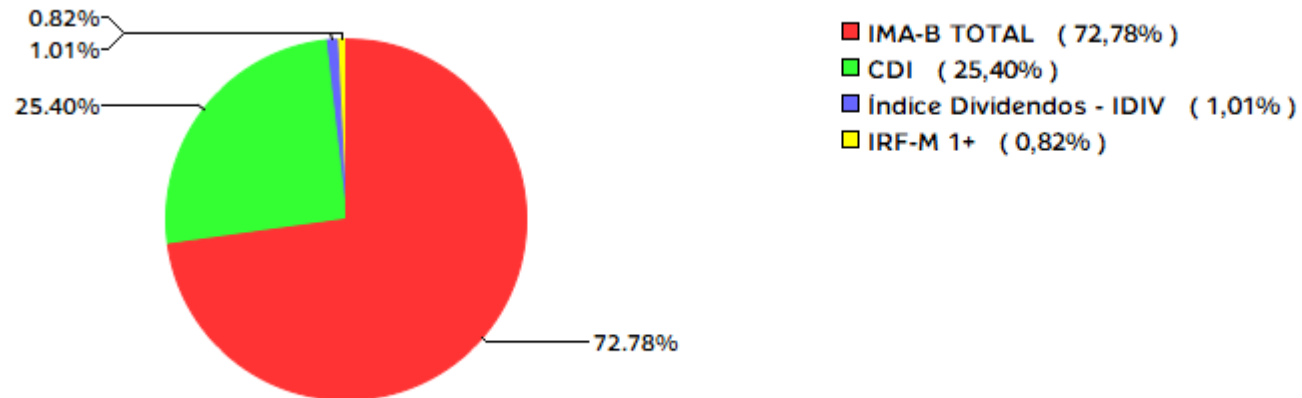
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acum. Bruto (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	190.011.361,28	100	190.011.361,28	100

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia

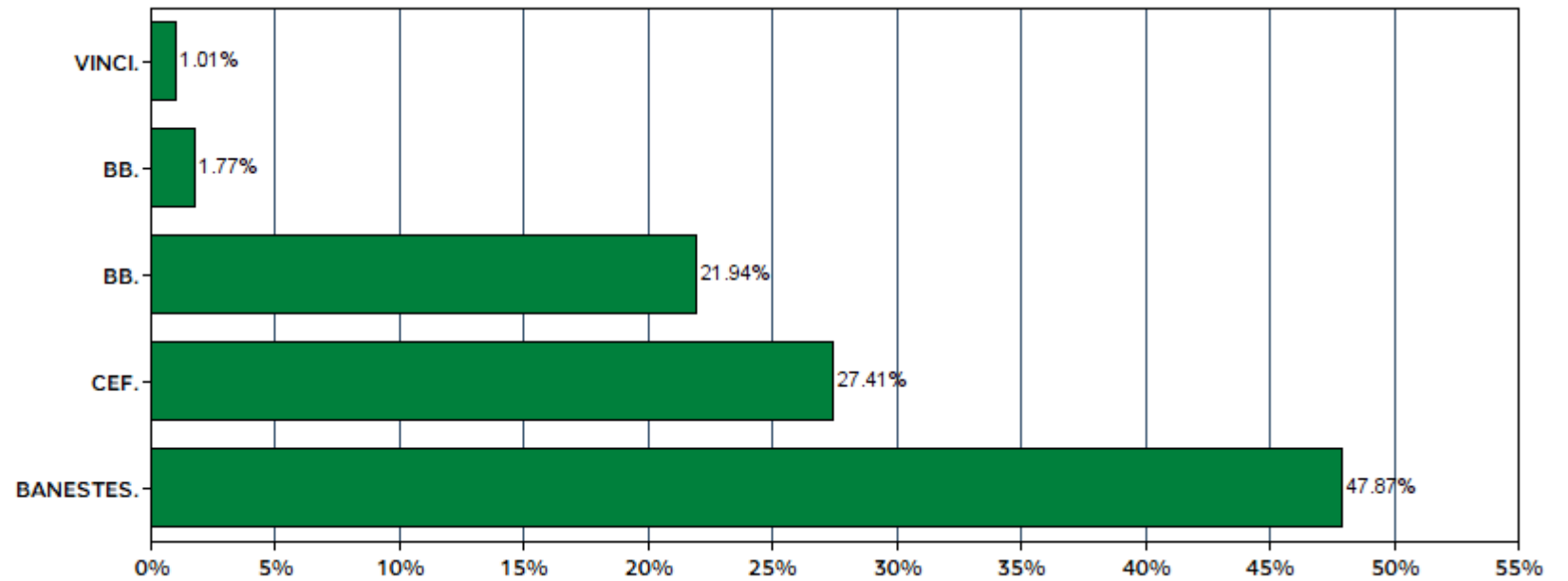


Indexadores



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor

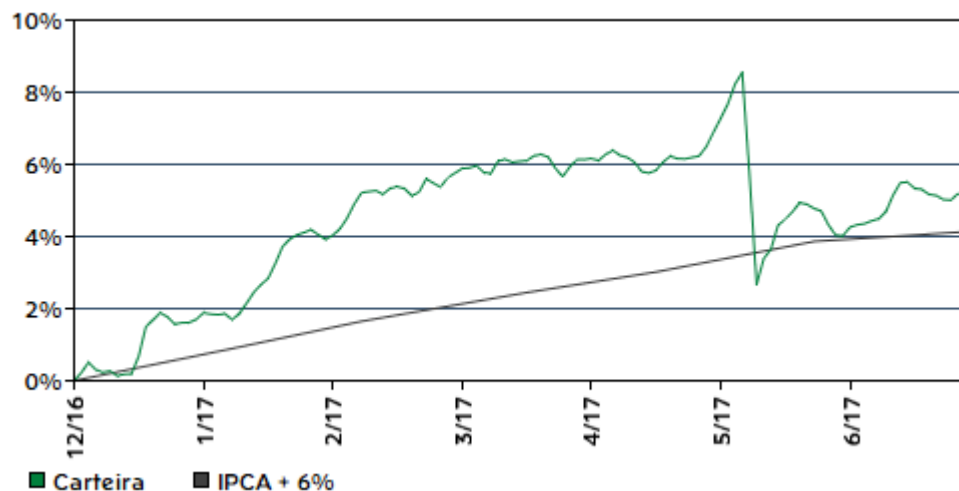


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

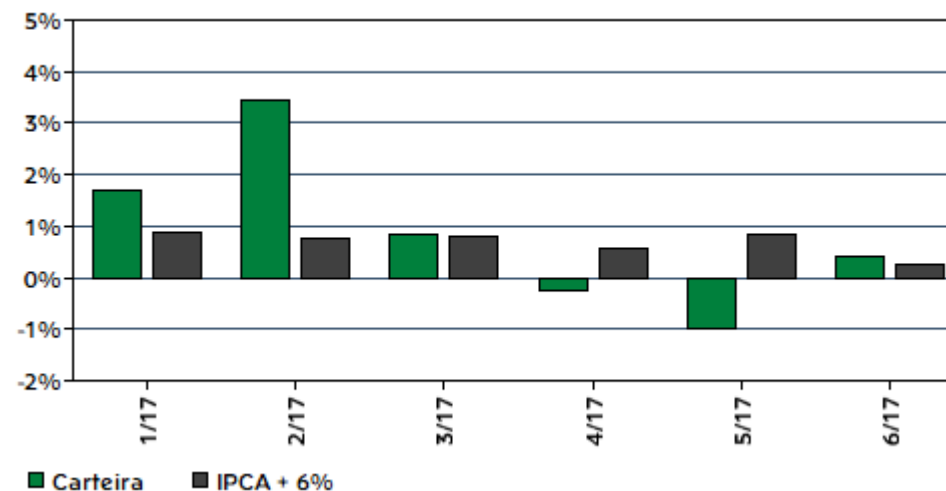
Rentabilidades da Carteira

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
2017	1,70	3,46	0,84	-0,26	-0,99	0,41	-	-	-	-	-	-	5,21
IPCA + 6%	0,89	0,75	0,78	0,56	0,82	0,26	-	-	-	-	-	-	4,13
p.p. Indx	0,80	2,71	0,06	-0,81	-1,82	0,15	-	-	-	-	-	-	1,08

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	3,46%	fev/17
Menor rentabilidade da Carteira	-0,99%	mai/17

Período	Rentabilidade (%)			Volat. Anual
	Carteira	IPCA + 6%	p.p. Indx.	
03 meses	-0,84	1,64	-2,5	8,675
06 meses	5,21	4,13	1,1	6,507
12 meses	--	--	--	--
24 meses	--	--	--	--
36 meses	--	--	--	--
Desde o início	5,21	4,13	1,1	6,507

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
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA.. % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,57 0,41	3,21 -2,25	1,30 2,65	3,21 -2,25	6,67 -6,65	-- --	-- --
BANESTES FI PREVIDENCIÁRIO RF .. % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,34 0,17	4,76 -0,69	-2,63 -1,28	4,76 -0,69	12,86 -0,46	31,64 -0,64	49,96 0,08
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP .. % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,15 -0,02	5,35 -0,10	-1,39 -0,05	5,35 -0,10	13,12 -0,20	31,49 -0,80	48,68 -1,21
BB PREVIDENCIÁRIO RF TIT PUB X FI.. % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,34 0,18	6,00 0,54	0,41 1,76	6,00 0,54	13,17 -0,16	-- --	-- --
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA.. % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,57 0,40	2,57 -2,89	2,08 3,42	2,57 -2,89	5,52 -7,80	15,76 -16,52	-- --
CAIXA FI BRASIL IMAB TP RF LP .. % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,15 -0,01	5,36 -0,10	-1,38 -0,04	5,36 -0,10	13,17 -0,15	30,39 -1,89	47,16 -2,72
CAIXA FI BRASIL IRF M 1+ TP RF LP.. % do Var. IRF-M 1+ p.p.	1,49 -0,02	8,81 -0,16	1,92 -0,10	8,81 -0,16	17,98 -0,15	38,93 -0,07	50,87 -0,48
FI BANESTES INSTITUCIONAL RF .. % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,33 0,17	4,91 -0,54	-2,62 -1,27	4,91 -0,54	13,73 0,41	32,30 0,02	50,34 0,45

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 RPPS RF PERFIL FIC .. % do % do CDI	0,81 100,26	5,71 100,83	2,54 99,71	5,71 100,83	13,04 101,36	28,78 100,04	44,33 100,82
CAIXA FI BRASIL REF DI LP .. % do % do CDI	0,82 101,57	5,70 100,78	2,57 100,93	5,70 100,78	12,90 100,28	28,87 100,36	44,19 100,49
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP .. % do % do CDI	0,88 108,83	5,76 101,77	2,62 102,92	5,76 101,77	13,37 103,94	28,73 99,85	43,42 98,74
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALAOR DIVIDENDOS RPPS .. % do Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,12 1,09	4,48 -2,72	-1,69 4,30	4,48 -2,72	10,28 -26,41	13,57 -17,60	13,03 11,57
CAIXA FI BRASIL TP RF LP .. % do % do CDI	0,81 100,10	5,61 99,06	2,44 95,95	5,61 99,06	12,72 98,89	28,40 98,72	43,22 98,30
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