

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos										
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (31/03/2017)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
Renda Fixa										
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M TP FI	3,26%	1,47%	-0,03%	5,89%	228.944,47	0,35%	4.952.567.108,47	0,00%
Banco ITAÚ UNIBANCO	Banco ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM-1 FI	0,29%	1,09%	-0,04%	3,37%	3.547.671,83	5,46%	230.634.246,41	1,54%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP	4,65%	1,52%	-0,11%	6,76%	9.202.429,75	14,17%	1.297.239.916,17	0,71%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TP RF LP	3,28%	1,43%	-0,08%	5,88%	5.994.844,68	9,23%	2.763.416.568,18	0,22%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IX FI	1,20%	1,32%	0,54%	3,33%	74.659,14	0,11%	347.459.720,34	0,02%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	0,29%	1,11%	-0,01%	3,41%	9.485.510,67	14,60%	11.724.254.123,84	0,08%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP RF LP	2,16%	1,38%	-0,01%	4,05%	1.742.644,77	2,68%	5.761.023.230,35	0,03%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	1,94%	1,41%	134,06%	3,87%	342.042,85	0,53%	5.325.721.550,34	0,01%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP RF LP	8,48%	0,54%	-0,02%	0,54%	247.362,22	0,38%	1.587.678.235,35	0,02%
Banco ITAÚ UNIBANCO	Banco ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ INSTITUCIONAL RF INFLAÇÃO FIC FI	6,15%	1,01%	-0,04%	6,77%	2.539.821,29	3,91%	631.250.573,53	0,40%
Banco ITAÚ UNIBANCO	Banco ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ INSTITUCIONAL RF PRÉ FIXADO LP FIC	3,26%	1,46%	-0,05%	5,80%	1.462.115,48	2,25%	336.746.664,51	0,43%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M 1 TP FIC FI	0,30%	1,10%	-0,02%	3,39%	1.541.772,73	2,37%	9.030.435.490,32	0,02%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - FI 100% Títulos do Tesouro Nacional							36.409.819,88	56,05%		
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B FI	6,14%	1,05%	0,00%	6,96%	4.492.283,54	6,92%	1.303.474.709,01	0,34%
CEF	CEF	CAIXA NOVO BRASIL FIC IMA-B RF LP	5,84%	0,95%	-0,10%	6,74%	8.958.075,40	13,79%	2.562.643.492,65	0,35%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,16%	1,38%	-0,01%	4,05%	1.099.572,81	1,69%	1.981.038.461,24	0,06%
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a - FI Renda Fixa/Referenciados RF							14.549.931,75	22,40%		
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,04%	0,97%	92,64%	2,82%	1.536.159,21	2,36%	333.512.929,87	0,46%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LP	0,06%	1,07%	101,71%	3,05%	7.588.472,99	11,68%	6.226.798.118,69	0,12%
Banco ITAÚ UNIBANCO	Banco ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ INSTITUCIONAL RF REF DI - FI	0,05%	1,06%	100,97%	3,04%	2.543.376,35	3,92%	1.354.867.802,08	0,19%
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - FI Renda Fixa							11.668.008,55	17,96%		
PETRA CTVM	PETRA CTVM	FIDC PREMIUM - COTA SÊNIOR	9,38%	-0,45%	-0,70%	-1,32%	809.904,96	1,25%	105.146.214,40	0,77%
BRASIL PLURAL Gest Rec	CITIBANK DTVM	FIDC MULTISSETORIAL MASTER III SEN	82,44%	-2,94%	-280,29%	-61,44%	4.748,68	0,01%	2.264.509,68	0,21%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos										
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (31/03/2017)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
VILA RICA Gest Rec	BRL TRUST DTVM	FIDC MULTISSETORIAL ITALIA COTA SENIOR	118,59%	-2,84%	-270,33%	-5,22%	96.467,93	0,15%	22.441.115,32	0,43%
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a - FI em Direitos Creditórios - Fechado - Cota Sênior							911.121,56	1,40%		
Sub-total Renda Fixa - FI em Direitos Creditórios - Fechado - Cota Sênior							63.538.881,75	97,82%		
Renda Variável										
CEF	CEF	FI AÇÕES CAIXA BRASIL IBX-50	21,98%	-2,34%	-0,17%	7,22%	874.646,60	1,35%	80.319.259,51	1,09%
Banco ITAÚ UNIBANCO	Banco ITAÚ UNIBANCO	ITAU INST IBRX ATIVO AÇÕES FICFI	21,50%	-2,74%	-0,39%	7,72%	540.726,07	0,83%	6.036.012,62	8,96%
Sub-total Artigo 8º I - FI Ações Referenciados							1.415.372,67	2,18%		
Sub-total Renda Variável							1.415.372,67	2,18%		
Total							64.954.254,42	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	FI 100% Títulos do Tesouro Nacional	36.409.819,88	56,05%	100,00%	100,00%
Artigo 7º III, Alínea a	FI Renda Fixa/Referenciados RF	14.549.931,75	22,40%	30,00%	80,00%
Artigo 7º IV, Alínea a	FI Renda Fixa	11.668.008,55	17,96%	30,00%	30,00%
Artigo 7º VII, Alínea a	FI em Direitos Creditórios - Fechado - Cota Sênior	911.121,56	1,40%	5,00%	5,00%
Total Renda Fixa		63.538.881,75	97,81%		
Renda Variável					
Artigo 8º I	FI Ações Referenciados	1.415.372,67	2,18%	7,00%	20,00%
Total Renda Variável		1.415.372,67	2,18%		

Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)

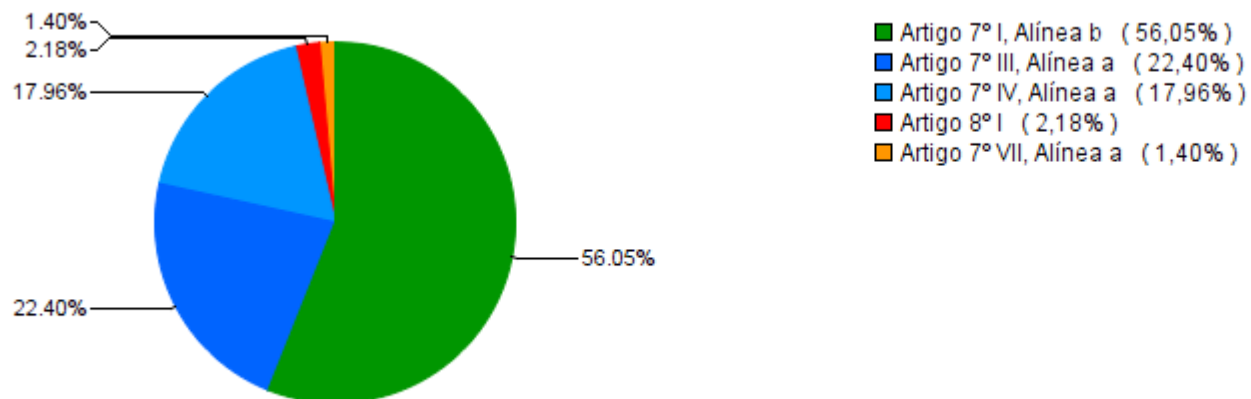
Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
Artigo 7º I, Alínea b	1,28	4,82	--	--
% do CDI	121,5	158,9	--	--
Artigo 7º III, Alínea a	1,01	6,60	--	--
% do CDI	96,3	217,6	--	--
Artigo 7º IV, Alínea a	1,05	3,03	--	--
% do CDI	100,3	99,7	--	--
Artigo 7º VII, Alínea a	-0,31	-0,69	--	--
% do CDI	-29,8	-22,9	--	--
Artigo 8º I	-2,49	7,41	--	--
Var. IBOVESPA p.p	0,0	-0,5	--	--

Ganhos Financeiros

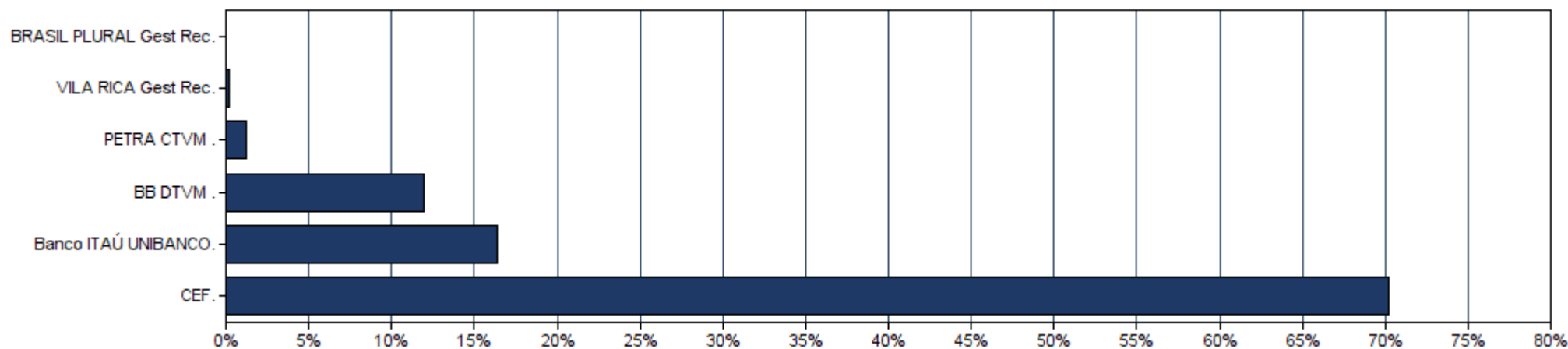
Estratégia	Ganho Bruto (R\$)
Artigo 7º I, Alínea b	459.671,46
Artigo 7º III, Alínea a	145.697,08
Artigo 7º IV, Alínea a	122.920,65
Artigo 7º VII, Alínea a	-2.866,00
Artigo 8º I	-36.203,80
Total	689.219,38

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia



Alocação por Gestor

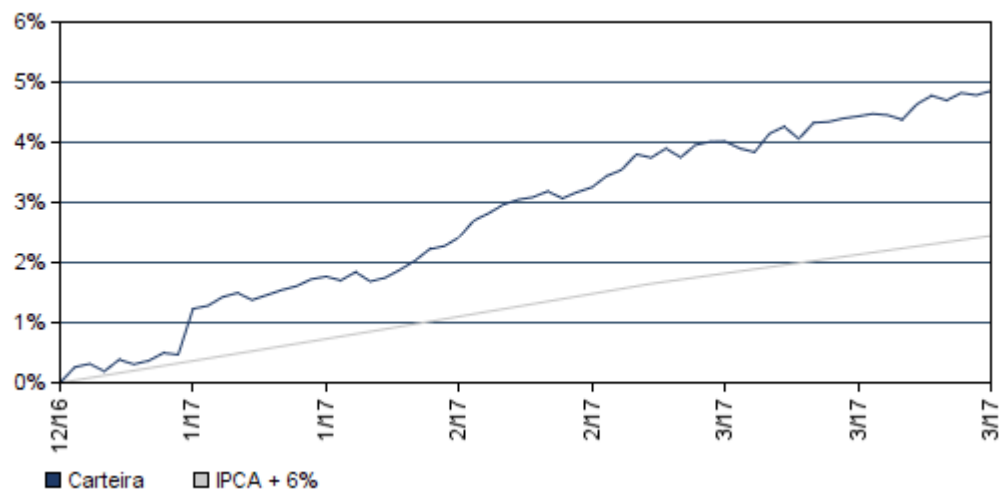


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

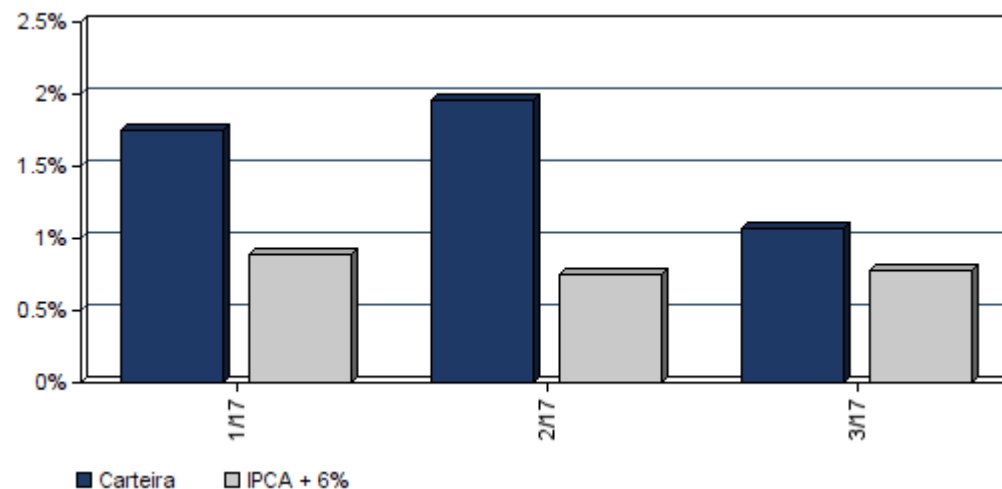
Rentabilidades da Carteira

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
2017	1,75	1,96	1,07	--	--	--	--	--	--	--	--	--	4,85
IPCA + 6%	0,89	0,75	0,78	--	--	--	--	--	--	--	--	--	2,44
p.p. Indx	0,85	1,22	0,28	--	--	--	--	--	--	--	--	--	2,41

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
CDI	1,05	3,03	3,03	6,37	13,76	29,37	43,92
IMA-B 5	1,39	4,09	4,09	6,45	14,11	32,99	50,47
IMA-B 5+	0,88	8,35	8,35	10,88	26,07	45,95	71,37
IMA-B TOTAL	1,04	6,89	6,89	9,36	21,56	40,51	62,34
IMA-GERAL TOTAL	1,22	5,37	5,37	8,32	18,84	35,77	52,72
IRF-M 1	1,12	3,46	3,46	6,79	14,08	30,52	45,05
IRF-M 1+	1,63	6,81	6,81	10,56	24,40	40,68	55,52
IRF-M TOTAL	1,50	5,91	5,91	9,53	21,05	37,17	51,93
IBOVESPA	-2,52	7,90	7,90	11,34	29,83	27,05	28,90
IFIX	0,20	9,01	9,01	11,89	36,84	50,85	52,10
SMALL CAP	-1,45	16,10	16,10	13,15	43,44	26,69	4,37
INPC + 6%	0,85	2,46	2,46	4,34	10,87	29,10	48,40
IPCA + 6%	0,78	2,44	2,44	4,69	10,87	28,50	47,31