

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Posição de Ativos										
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (30/06/2017)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
<b>Renda Fixa</b>										
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M TP FI	4,91%	1,32%	-0,03%	8,09%	233.717,75	0,35%	4.997.389.247,97	0,00%
Banco ITAÚ UNIBANCO	Banco ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM-1 FI	0,66%	0,90%	0,01%	6,11%	3.641.728,36	5,44%	250.918.961,01	1,45%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP	6,55%	1,49%	-0,02%	8,81%	9.379.465,94	14,01%	1.284.596.920,50	0,73%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TP RF LP	4,93%	1,34%	-0,01%	8,13%	6.122.395,72	9,15%	2.655.605.223,75	0,23%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IX FI	1,88%	0,57%	0,31%	5,48%	76.210,19	0,11%	354.678.229,47	0,02%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	0,66%	0,87%	-0,02%	6,15%	13.259.335,59	19,81%	13.298.673.360,80	0,10%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP RF LP	3,60%	0,51%	-0,01%	5,40%	1.765.258,23	2,64%	5.947.290.865,39	0,03%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	2,90%	0,61%	75,33%	5,71%	348.117,54	0,52%	5.093.378.217,18	0,01%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP RF LP	13,10%	-0,07%	-0,02%	-2,02%	241.061,00	0,36%	1.604.031.069,76	0,02%
Banco ITAÚ UNIBANCO	Banco ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ INSTITUCIONAL RF INFLAÇÃO FIC FI	10,01%	0,16%	0,00%	5,22%	2.503.029,13	3,74%	496.656.571,00	0,50%
Banco ITAÚ UNIBANCO	Banco ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ INSTITUCIONAL RF PRÉ FIXADO LP FIC	4,88%	1,33%	-0,02%	8,01%	1.492.682,36	2,23%	301.764.116,98	0,49%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M 1 TP FIC FI	0,66%	0,87%	-0,02%	6,11%	2.841.019,72	4,24%	10.382.616.485,50	0,03%
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - FI 100% Títulos do Tesouro Nacional</b>							<b>41.904.021,52</b>	<b>62,60%</b>		
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B FI	10,04%	0,19%	0,02%	5,47%	4.429.631,80	6,62%	1.139.569.590,12	0,39%
CEF	CEF	CAIXA NOVO BRASIL FIC IMA-B RF LP	9,58%	0,12%	-0,05%	5,27%	7.117.349,10	10,63%	2.463.499.971,03	0,29%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP FIC FI	3,61%	0,51%	-0,02%	5,41%	1.113.908,64	1,66%	1.849.394.391,35	0,06%
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a - FI Renda Fixa/Referenciados RF</b>							<b>12.660.889,54</b>	<b>18,91%</b>		
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,07%	0,74%	91,32%	5,23%	202.352,34	0,30%	341.407.283,69	0,06%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LP	0,09%	0,82%	101,57%	5,70%	7.818.652,61	11,68%	5.738.556.973,46	0,14%
Banco ITAÚ UNIBANCO	Banco ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ INSTITUCIONAL RF REF DI - FI	0,08%	0,80%	98,90%	5,66%	2.076.704,06	3,10%	1.300.843.461,77	0,16%
<b>Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - FI Renda Fixa</b>							<b>10.097.709,01</b>	<b>15,08%</b>		
PETRA CTVM	PETRA CTVM	FIDC PREMIUM - COTA SÊNIOR	9,41%	-0,63%	-0,40%	-3,09%	795.345,65	1,19%	103.256.045,90	0,77%
BRASIL PLURAL Gest Rec	CITIBANK DTVM	FIDC MULTISSETORIAL MASTER III SEN	82,70%	0,14%	17,39%	-62,62%	4.603,74	0,01%	2.195.394,28	0,21%

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Posição de Ativos										
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (30/06/2017)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
VILA RICA Gest Rec	BRL TRUST DTVM	FIDC MULTISSETORIAL ITALIA COTA SENIOR	121,56%	22,20%	2.735,02%	8,50%	110.436,05	0,16%	25.690.489,16	0,43%
<b>Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a - FI em Direitos Creditórios - Fechado - Cota Sênior</b>							<b>910.385,44</b>	<b>1,36%</b>		
<b>Sub-total Renda Fixa - FI em Direitos Creditórios - Fechado - Cota Sênior</b>							<b>65.573.005,51</b>	<b>97,96%</b>		
<b>Renda Variável</b>										
CEF	CEF	FI AÇÕES CAIXA BRASIL IBX-50	21,94%	0,10%	-0,39%	3,28%	842.477,14	1,26%	70.948.750,25	1,19%
Banco ITAÚ UNIBANCO	Banco ITAÚ UNIBANCO	ITAU INST IBRX ATIVO AÇÕES FICFI	22,00%	0,73%	0,43%	4,45%	524.315,95	0,78%	1.847.085,74	28,39%
<b>Sub-total Artigo 8º I - FI Ações Referenciados</b>							<b>1.366.793,09</b>	<b>2,04%</b>		
<b>Sub-total Renda Variável</b>							<b>1.366.793,09</b>	<b>2,04%</b>		
<b>Total</b>							<b>66.939.798,60</b>	<b>100%</b>		

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

#### Enquadramento da Carteira

Artigo	Classe	Valor(R\$)	% Carteira	Política Investimento	Limite Res. 3.922/10
<b>Renda Fixa</b>					
Artigo 7º I, Alínea b	FI 100% Títulos do Tesouro Nacional	41.904.021,52	62,60%	100,00%	100,00%
Artigo 7º III, Alínea a	FI Renda Fixa/Referenciados RF	12.660.889,54	18,91%	30,00%	80,00%
Artigo 7º IV, Alínea a	FI Renda Fixa	10.097.709,01	15,08%	30,00%	30,00%
Artigo 7º VII, Alínea a	FI em Direitos Creditórios - Fechado - Cota Sênior	910.385,44	1,36%	5,00%	5,00%
<b>Total Renda Fixa</b>		<b>65.573.005,51</b>	<b>97,95%</b>		
<b>Renda Variável</b>					
Artigo 8º I	FI Ações Referenciados	1.366.793,09	2,04%	7,00%	20,00%
<b>Total Renda Variável</b>		<b>1.366.793,09</b>	<b>2,04%</b>		

#### Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)

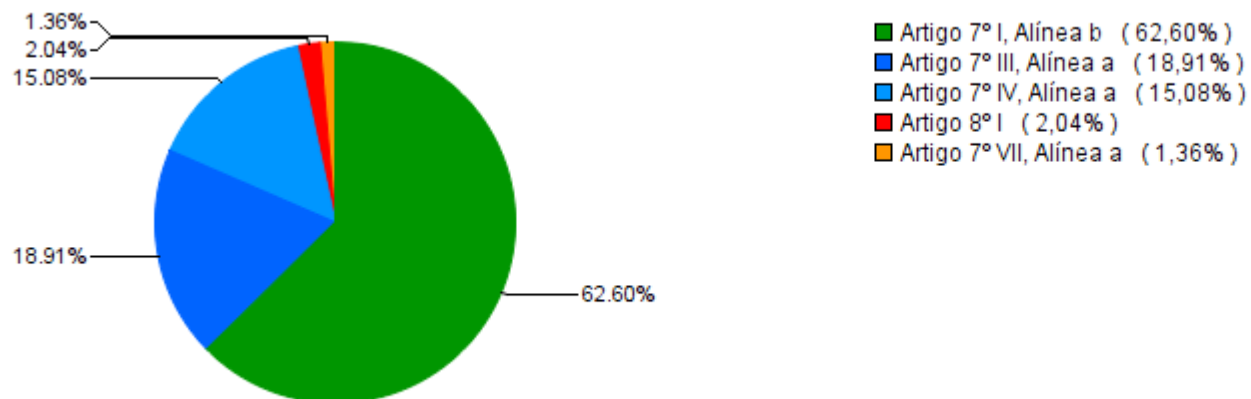
Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
<b>Artigo 7º I, Alínea b</b>	1,03	6,93	--	--
% do CDI	127,0	122,5	--	--
<b>Artigo 7º III, Alínea a</b>	0,18	5,36	--	--
% do CDI	21,7	94,7	--	--
<b>Artigo 7º IV, Alínea a</b>	0,82	5,66	--	--
% do CDI	100,8	100,0	--	--
<b>Artigo 7º VII, Alínea a</b>	2,40	-0,06	--	--
% do CDI	296,3	-1,1	--	--
<b>Artigo 8º I</b>	0,34	3,72	--	--
Var. IBOVESPA p.p	0,0	-0,7	--	--

#### Ganhos Financeiros

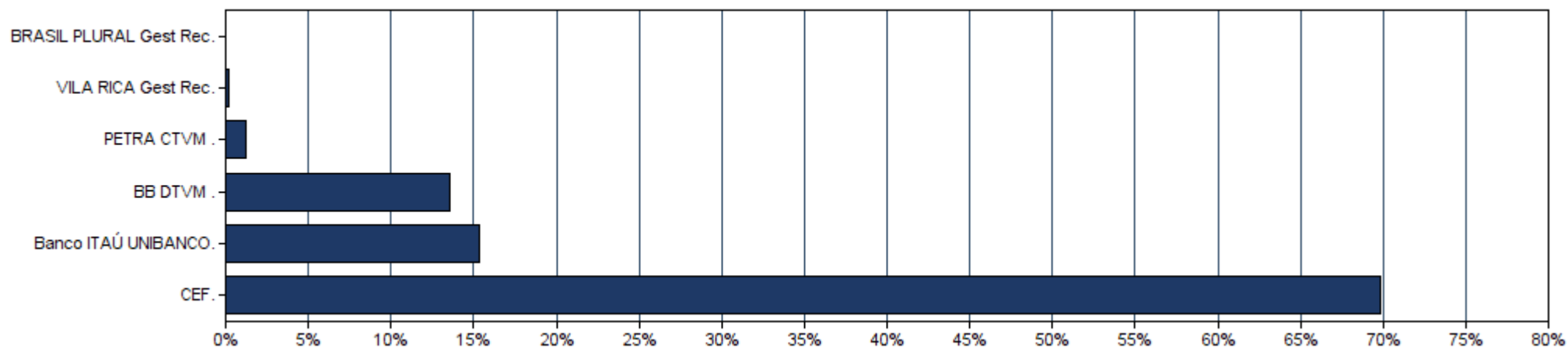
Estratégia	Ganho Bruto (R\$)
<b>Artigo 7º I, Alínea b</b>	423.880,95
<b>Artigo 7º III, Alínea a</b>	22.223,94
<b>Artigo 7º IV, Alínea a</b>	83.060,42
<b>Artigo 7º VII, Alínea a</b>	21.537,06
<b>Artigo 8º I</b>	4.677,80
<b>Total</b>	<b>555.380,18</b>

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Alocação por Estratégia**



**Alocação por Gestor**

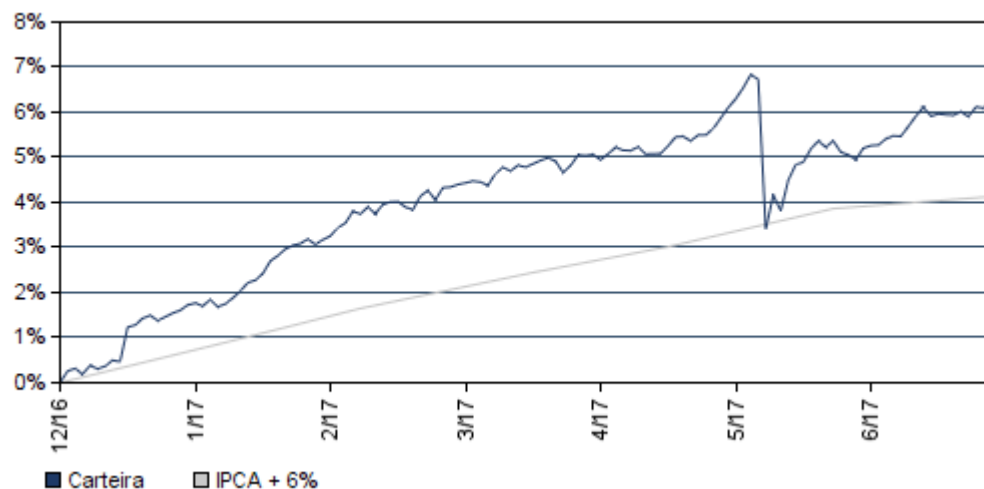


### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

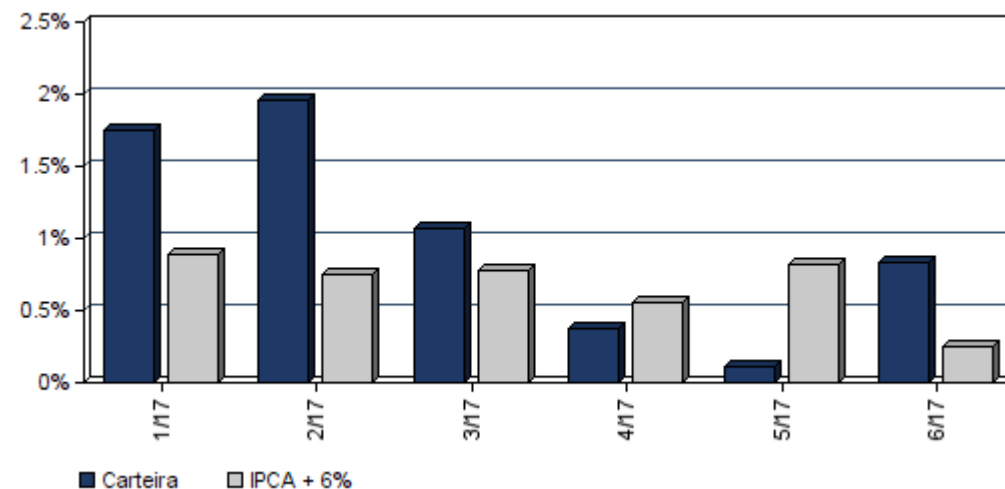
#### Rentabilidades da Carteira

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
<b>2017</b>	1,75	1,96	1,07	0,38	0,10	0,84	--	--	--	--	--	--	6,25
<b>IPCA + 6%</b>	0,89	0,75	0,78	0,56	0,82	0,26	--	--	--	--	--	--	4,13
<b>p.p. Indx</b>	0,85	1,22	0,28	-0,18	-0,72	0,58	--	--	--	--	--	--	2,12

#### Evolução da Rentabilidade



#### Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

#### Análise de Risco / Retorno da Carteira

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

	Rentab.	Mês
<b>Maior</b> rentabilidade da Carteira	1,96%	fev/17
<b>Menor</b> rentabilidade da Carteira	0,10%	mai/17

Período	Rentabilidade (%)			Volat. Anual
	Carteira	IPCA + 6%	p.p. Indx.	
<b>03 meses</b>	1,33	1,64	-0,3	7,042
<b>06 meses</b>	6,25	4,13	2,1	5,210
<b>12 meses</b>	--	--	--	--
<b>24 meses</b>	--	--	--	--
<b>36 meses</b>	--	--	--	--
<b>Desde o início</b>	6,25	4,13	2,1	5,210

#### 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 RF IRF-M TP FI Var. do IRF-M TOTAL p.p.	1,32 -0,03	8,09 -0,15	2,08 -0,12	8,09 -0,15	8,09 -0,15	8,09 -0,15	8,09 -0,15
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM-1 FI Var. do IRF-M 1 p.p.	0,90 0,01	6,11 -0,14	2,65 -0,04	6,11 -0,14	6,11 -0,14	6,11 -0,14	6,11 -0,14
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP Var. do IRF-M 1+ p.p.	1,49 -0,02	8,81 -0,16	1,92 -0,10	8,81 -0,16	8,81 -0,16	8,81 -0,16	8,81 -0,16
FI CAIXA BRASIL IRF-M TP RF LP Var. do IRF-M TOTAL p.p.	1,34 -0,01	8,13 -0,11	2,13 -0,07	8,13 -0,11	8,13 -0,11	8,13 -0,11	8,13 -0,11
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IX FI Var. do IPCA + 6% p.p.	0,57 0,31	5,48 1,35	2,08 0,43	5,48 1,35	5,48 1,35	5,48 1,35	5,48 1,35
FI CAIXA BRASIL IRF-M 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
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP RF LP Var. do IMA-B 5 p.p.	0,51 -0,01	5,40 -0,08	1,30 -0,03	5,40 -0,08	5,40 -0,08	5,40 -0,08	5,40 -0,08
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 % do CDI	0,61 75,33	5,71 100,91	1,78 69,72	5,71 100,91	5,71 100,91	5,71 100,91	5,71 100,91

**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
FI CAIXA 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
ITAÚ INSTITUCIONAL RF INFLAÇÃO FIC FI Var. do IMA-B TOTAL p.p.	0,16 0,00	5,22 -0,23	-1,45 -0,10	5,22 -0,23	5,22 -0,23	5,22 -0,23	5,22 -0,23
ITAÚ INSTITUCIONAL RF PRÉ FIXADO LP FIC Var. do IRF-M TOTAL p.p.	1,33 -0,02	8,01 -0,23	2,09 -0,11	8,01 -0,23	8,01 -0,23	8,01 -0,23	8,01 -0,23
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M 1 TP FIC FI Var. do IRF-M 1 p.p.	0,87 -0,02	6,11 -0,14	2,63 -0,06	6,11 -0,14	6,11 -0,14	6,11 -0,14	6,11 -0,14
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B FI Var. do IMA-B TOTAL p.p.	0,19 0,02	5,47 0,01	-1,39 -0,05	5,47 0,01	5,47 0,01	5,47 0,01	5,47 0,01
CAIXA NOVO BRASIL FIC IMA-B RF LP Var. do IMA-B TOTAL p.p.	0,12 -0,05	5,27 -0,18	-1,37 -0,03	5,27 -0,18	5,27 -0,18	5,27 -0,18	5,27 -0,18
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. do IMA-B 5 p.p.	0,51 -0,02	5,41 -0,06	1,30 -0,02	5,41 -0,06	5,41 -0,06	5,41 -0,06	5,41 -0,06
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI	0,74 91,32	5,23 92,36	2,34 91,87	5,23 92,36	5,23 92,36	5,23 92,36	5,23 92,36
FI CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,82 101,57	5,70 100,78	2,57 100,93	5,70 100,78	5,70 100,78	5,70 100,78	5,70 100,78
ITAÚ INSTITUCIONAL RF REF DI - FI % do CDI	0,80 98,90	5,66 100,08	2,54 99,78	5,66 100,08	5,66 100,08	5,66 100,08	5,66 100,08
FIDC PREMIUM - COTA SÊNIOR Var. do IPCA p.p.	-0,63 -0,40	-3,09 -4,28	-1,80 -2,02	-3,09 -4,28	-3,09 -4,28	-3,09 -4,28	-3,09 -4,28
FIDC MULTISSETORIAL MASTER III SEN % do CDI	0,14 17,39	-62,62 -1.106,55	-3,05 -119,81	-62,62 -1.106,55	-62,62 -1.106,55	-62,62 -1.106,55	-62,62 -1.106,55
FIDC MULTISSETORIAL ITALIA COTA SENIOR % do CDI	22,20 2.735,02	8,50 150,23	14,48 568,41	8,50 150,23	8,50 150,23	8,50 150,23	8,50 150,23
FI AÇÕES CAIXA BRASIL IBX-50 Var. do IBRX 50 p.p.	0,10 -0,39	3,28 -1,33	-3,68 -0,74	3,28 -1,33	3,28 -1,33	3,28 -1,33	3,28 -1,33
ITAÚ INST IBRX ATIVO AÇÕES FICFI Var. do IBRX 100 p.p.	0,73 0,43	4,45 -0,96	-3,03 -0,51	4,45 -0,96	4,45 -0,96	4,45 -0,96	4,45 -0,96

**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
CDI	0,81	5,66	2,55	5,66	12,87	28,77	43,97
IMA-B 5	0,52	5,47	1,32	5,47	11,91	30,87	46,68
IMA-B 5+	-0,06	5,50	-2,63	5,50	14,42	34,03	53,29
IMA-B TOTAL	0,16	5,46	-1,34	5,46	13,32	32,28	49,89
IMA-GERAL TOTAL	0,82	6,55	1,12	6,55	14,23	32,35	47,44
IRF-M 1	0,89	6,25	2,69	6,25	13,46	30,44	45,00
IRF-M 1+	1,51	8,97	2,02	8,97	18,13	39,00	51,35
IRF-M TOTAL	1,35	8,24	2,20	8,24	16,77	36,01	49,18
IBOVESPA	0,30	4,44	-3,21	4,44	22,07	18,50	18,30
IFIX	0,88	11,27	2,07	11,27	26,62	42,05	49,53
SMALL CAP	0,38	19,24	2,71	19,24	33,53	30,90	4,25
INPC + 6%	0,49	4,38	1,87	4,38	9,01	26,52	46,64
IPCA + 6%	0,26	4,13	1,64	4,13	9,15	25,94	45,40