

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos										
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (29/09/2017)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
Renda Fixa										
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M TP FI	4,88%	1,45%	-0,02%	13,36%	40.680,51	0,06%	4.989.933.175,82	0,00%
Banco ITAÚ UNIBANCO	Banco ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM-1 FI	0,67%	0,72%	-0,03%	8,95%	3.339.340,36	4,74%	276.276.409,85	1,21%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M TP RF LP	4,91%	1,44%	-0,04%	13,36%	6.937.626,28	9,85%	3.093.607.731,13	0,22%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IX FI	1,89%	0,50%	-0,13%	8,48%	76.212,66	0,11%	354.689.992,86	0,02%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP RF LP	3,66%	0,99%	-0,01%	10,80%	1.855.821,67	2,63%	6.273.482.056,63	0,03%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	2,92%	0,86%	133,63%	10,29%	363.192,21	0,52%	5.133.992.687,63	0,01%
Banco ITAÚ UNIBANCO	Banco ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ INSTITUCIONAL RF INFLAÇÃO FIC FI	10,01%	1,78%	-0,03%	12,76%	2.892.038,83	4,11%	496.630.228,98	0,58%
Banco ITAÚ UNIBANCO	Banco ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ INSTITUCIONAL RF PRÉ FIXADO LP FIC	4,85%	1,44%	-0,04%	13,20%	1.185.382,10	1,68%	314.276.672,10	0,38%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M 1 TP FIC FI	0,68%	0,71%	-0,03%	8,94%	2.916.800,87	4,14%	11.114.189.323,99	0,03%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP RF LP	13,08%	2,37%	-0,03%	6,33%	576.961,15	0,82%	1.313.093.474,85	0,04%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP	6,47%	1,68%	-0,05%	14,89%	10.656.447,54	15,13%	1.484.880.123,56	0,72%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	0,67%	0,71%	-0,03%	8,98%	13.613.389,19	19,33%	14.886.805.108,28	0,09%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - FI 100% Títulos do Tesouro Nacional							44.453.893,36	63,11%		
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP FIC FI	3,67%	0,99%	-0,02%	10,84%	1.171.377,19	1,66%	1.993.423.540,77	0,06%
CEF	CEF	CAIXA NOVO BRASIL FIC IMA-B RF LP	9,57%	1,79%	-0,02%	12,71%	6.882.782,26	9,77%	2.698.829.713,03	0,26%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B FI	10,03%	1,84%	0,03%	13,20%	5.173.842,60	7,35%	1.309.486.949,77	0,40%
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a - FI Renda Fixa/Referenciados RF							13.228.002,05	18,78%		
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,11%	0,57%	89,48%	7,37%	206.483,59	0,29%	345.108.142,83	0,06%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LP	0,12%	0,63%	98,85%	8,06%	7.989.361,85	11,34%	5.872.213.177,84	0,14%
Banco ITAÚ UNIBANCO	Banco ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ INSTITUCIONAL RF REF DI - FI	0,11%	0,63%	97,98%	8,01%	2.693.924,40	3,82%	1.402.646.780,34	0,19%
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - FI Renda Fixa							10.889.769,84	15,46%		
PETRA CTVM	PETRA CTVM	FIDC PREMIUM - COTA SÊNIOR	1,84%	-0,51%	-0,67%	-5,76%	773.429,34	1,10%	100.410.753,80	0,77%
BRPP	GERAÇÃO FUTURO CV	FIDC MULTISSETORIAL MASTER III SEN	233,40%	-84,28%	-13.140,79%	-65,54%	4.244,43	0,01%	2.024.046,75	0,21%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos										
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (29/09/2017)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
VILA RICA Gest Rec	BRL TRUST DTVM	FIDC MULTISSETORIAL ITALIA COTA SENIOR	0,00%	-3,15%	-490,35%	-20,22%	81.203,20	0,12%	18.890.116,71	0,43%
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a - FI em Direitos Creditórios - Fechado - Cota Sênior							858.876,97	1,22%		
Sub-total Renda Fixa - FI em Direitos Creditórios - Fechado - Cota Sênior							69.430.542,23	98,57%		
Renda Variável										
CEF	CEF	FI AÇÕES CAIXA BRASIL IBX-50	20,91%	6,13%	1,25%	23,38%	1.006.464,34	1,43%	83.077.555,79	1,21%
Sub-total Artigo 8º I - FI Ações Referenciados							1.006.464,34	1,43%		
Sub-total Renda Variável							1.006.464,34	1,43%		
Total							70.437.006,57	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	44.453.893,36	63,11%	100,00%	100,00%
Artigo 7º III, Alínea a	FI Renda Fixa/Referenciados RF	13.228.002,05	18,78%	30,00%	80,00%
Artigo 7º IV, Alínea a	FI Renda Fixa	10.889.769,84	15,46%	30,00%	30,00%
Artigo 7º VII, Alínea a	FI em Direitos Creditórios - Fechado - Cota Sênior	858.876,97	1,22%	5,00%	5,00%
Total Renda Fixa		69.430.542,23	98,57%		
Renda Variável					
Artigo 8º I	FI Ações Referenciados	1.006.464,34	1,43%	7,00%	20,00%
Total Renda Variável		1.006.464,34	1,43%		

Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)

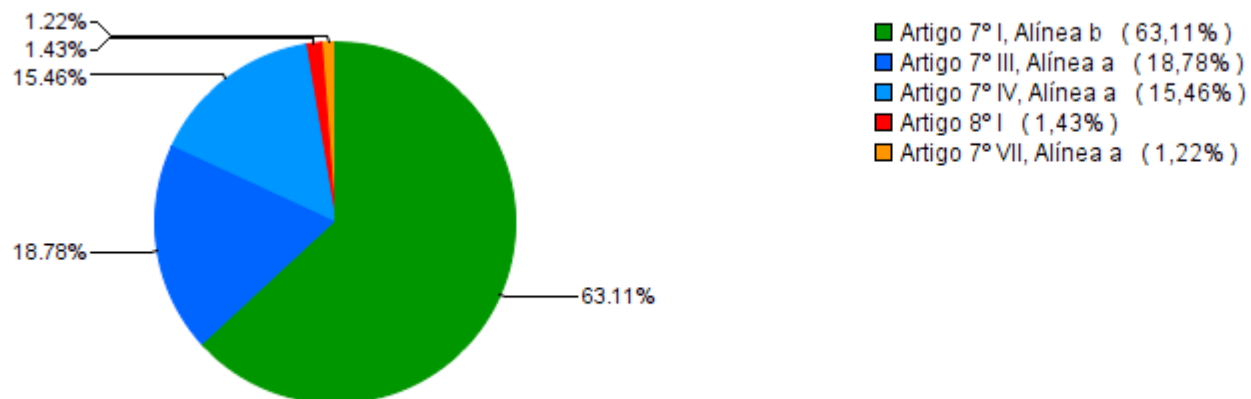
Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
Artigo 7º I, Alínea b	1,17	11,39	--	--
% do CDI	182,7	141,6	--	--
Artigo 7º III, Alínea a	1,74	12,72	--	--
% do CDI	271,3	158,1	--	--
Artigo 7º IV, Alínea a	0,63	8,01	--	--
% do CDI	98,4	99,5	--	--
Artigo 7º VII, Alínea a	-3,13	-2,11	--	--
% do CDI	-487,6	-26,2	--	--
Artigo 8º I	6,13	23,76	--	--
Var. IBOVESPA p.p	1,2	0,4	--	--

Ganhos Financeiros

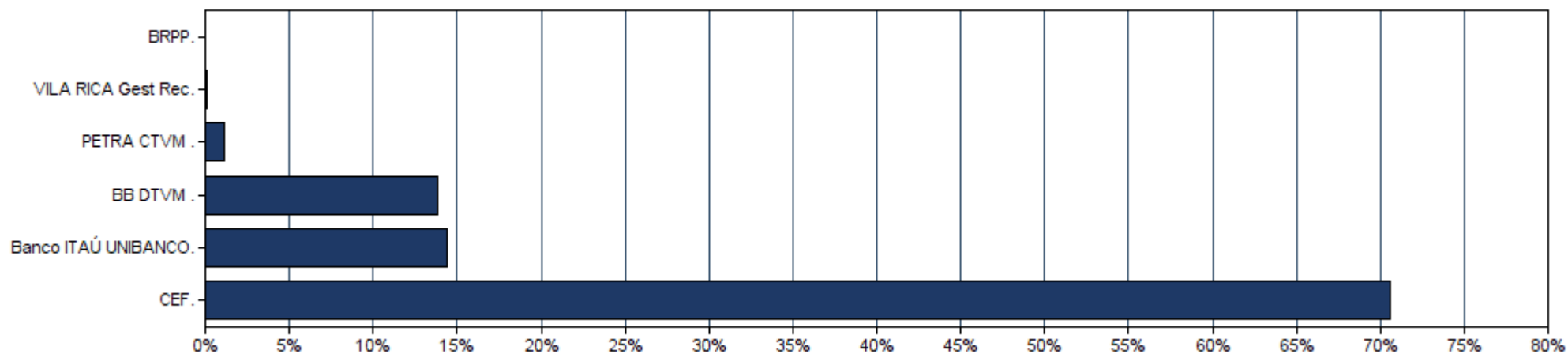
Estratégia	Ganho Bruto (R\$)
Artigo 7º I, Alínea b	512.448,87
Artigo 7º III, Alínea a	226.275,47
Artigo 7º IV, Alínea a	69.407,12
Artigo 7º VII, Alínea a	-27.778,39
Artigo 8º I	58.114,09
Total	838.467,15

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia



Alocação por Gestor

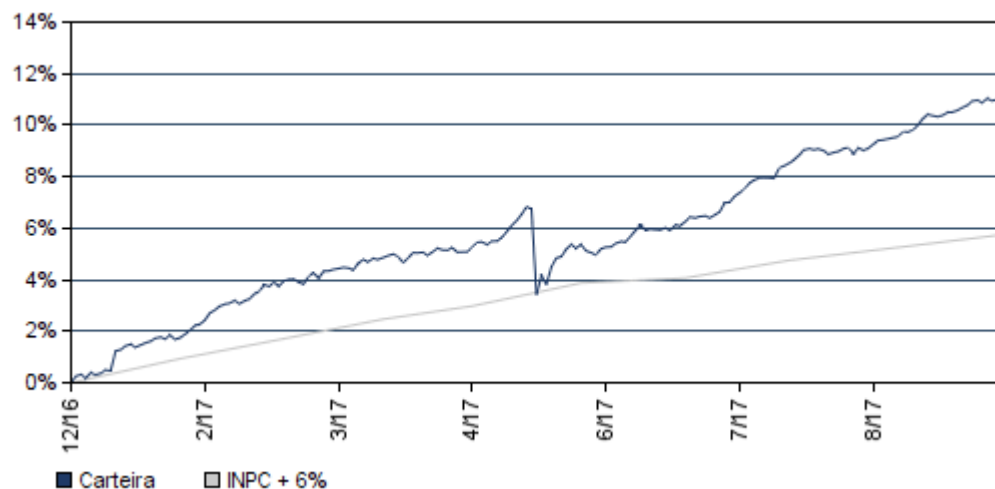


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

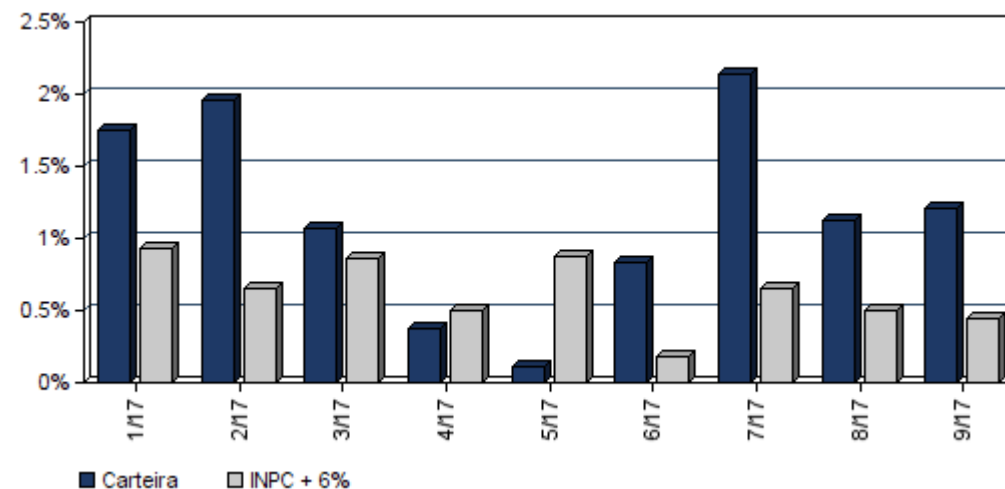
Rentabilidades da Carteira

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
2017	1,75	1,96	1,07	0,38	0,10	0,84	2,14	1,13	1,21	--	--	--	11,07
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	0,81	1,31	0,21	-0,12	-0,77	0,65	1,48	0,63	0,76	--	--	--	5,33

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	2,14%	jul/17
Menor rentabilidade da Carteira	0,10%	mai/17

Período	Rentabilidade (%)			Volat. Anual
	Carteira	INPC + 6%	p.p. Indx.	
03 meses	4,54	1,61	2,9	1,632
06 meses	5,93	3,20	2,7	5,068
12 meses	--	--	--	--
24 meses	--	--	--	--
36 meses	--	--	--	--
Desde o início	11,07	5,74	5,3	4,339

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.	1,45 -0,02	13,36 -0,21	4,87 -0,05	7,06 -0,17	13,36 -0,21	13,36 -0,21	13,36 -0,21
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM-1 FI Var. do IRF-M 1 p.p.	0,72 -0,03	8,95 -0,18	2,68 -0,04	5,40 -0,08	8,95 -0,18	8,95 -0,18	8,95 -0,18
FI CAIXA BRASIL IRF-M TP RF LP Var. do IRF-M TOTAL p.p.	1,44 -0,04	13,36 -0,21	4,83 -0,08	7,06 -0,16	13,36 -0,21	13,36 -0,21	13,36 -0,21
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IX FI Var. do IPCA + 6% p.p.	0,50 -0,13	8,48 2,18	2,84 0,75	4,98 1,21	8,48 2,18	8,48 2,18	8,48 2,18
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP RF LP Var. do IMA-B 5 p.p.	0,99 -0,01	10,80 -0,14	5,13 -0,05	6,49 -0,08	10,80 -0,14	10,80 -0,14	10,80 -0,14
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 % do CDI	0,86 133,63	10,29 127,85	4,33 191,57	6,18 127,09	10,29 127,85	10,29 127,85	10,29 127,85
ITAÚ INSTITUCIONAL RF INFLAÇÃO FIC FI Var. do IMA-B TOTAL p.p.	1,78 -0,03	12,76 -0,39	7,17 -0,14	5,61 -0,25	12,76 -0,39	12,76 -0,39	12,76 -0,39
ITAÚ INSTITUCIONAL RF PRÉ FIXADO LP FIC Var. do IRF-M TOTAL p.p.	1,44 -0,04	13,20 -0,37	4,80 -0,11	6,99 -0,23	13,20 -0,37	13,20 -0,37	13,20 -0,37

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 PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M 1 TP FIC FI Var. do IRF-M 1 p.p.	0,71 -0,03	8,94 -0,20	2,67 -0,05	5,37 -0,12	8,94 -0,20	8,94 -0,20	8,94 -0,20
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP RF LP Var. do IMA-B 5+ p.p.	2,37 -0,03	6,33 -0,05	8,52 -0,13	5,75 -0,03	6,33 -0,05	6,33 -0,05	6,33 -0,05
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP Var. do IRF-M 1+ p.p.	1,68 -0,05	14,89 -0,28	5,59 -0,10	7,62 -0,21	14,89 -0,28	14,89 -0,28	14,89 -0,28
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF Var. do IRF-M 1 p.p.	0,71 -0,03	8,98 -0,15	2,67 -0,05	5,39 -0,09	8,98 -0,15	8,98 -0,15	8,98 -0,15
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. do IMA-B 5 p.p.	0,99 -0,02	10,84 -0,10	5,16 -0,03	6,53 -0,05	10,84 -0,10	10,84 -0,10	10,84 -0,10
CAIXA NOVO BRASIL FIC IMA-B RF LP Var. do IMA-B TOTAL p.p.	1,79 -0,02	12,71 -0,44	7,07 -0,24	5,60 -0,26	12,71 -0,44	12,71 -0,44	12,71 -0,44
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B FI Var. do IMA-B TOTAL p.p.	1,84 0,03	13,20 0,05	7,34 0,03	5,84 -0,02	13,20 0,05	13,20 0,05	13,20 0,05
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI	0,57 89,48	7,37 91,65	2,04 90,32	4,43 91,05	7,37 91,65	7,37 91,65	7,37 91,65
FI CAIXA BRASIL REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,63 98,85	8,06 100,13	2,23 98,54	4,86 99,80	8,06 100,13	8,06 100,13	8,06 100,13
ITAÚ INSTITUCIONAL RF REF DI - FI % do CDI	0,63 97,98	8,01 99,56	2,22 98,32	4,82 99,09	8,01 99,56	8,01 99,56	8,01 99,56
FIDC PREMIUM - COTA SÊNIOR Var. do IPCA p.p.	-0,51 -0,67	-5,76 -7,55	-2,76 -3,35	-4,50 -5,32	-5,76 -7,55	-5,76 -7,55	-5,76 -7,55
FIDC MULTISSETORIAL MASTER III SEN % do CDI	-84,28 -13.140,79	-65,54 -814,39	-7,80 -345,29	-10,62 -218,25	-65,54 -814,39	-65,54 -814,39	-65,54 -814,39
FIDC MULTISSETORIAL ITALIA COTA SENIOR % do CDI	-3,15 -490,35	-20,22 -251,26	-26,47 -1.171,05	-15,82 -325,23	-20,22 -251,26	-20,22 -251,26	-20,22 -251,26
FI AÇÕES CAIXA BRASIL IBX-50 Var. do IBOVESPA p.p.	6,13 1,25	23,38 0,03	19,46 1,35	15,07 0,75	23,38 0,03	23,38 0,03	23,38 0,03
CDI	0,64	8,05	2,26	4,87	11,55	27,32	43,32

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
IMA-B 5	1,01	10,94	5,18	6,58	13,45	34,82	50,93
IMA-B 5+	2,40	14,62	8,64	5,79	17,29	57,99	62,59
IMA-B TOTAL	1,81	13,16	7,30	5,86	15,76	48,59	57,28
IMA-GERAL TOTAL	1,33	11,68	4,82	5,99	14,81	40,15	51,22
IRF-M 1	0,74	9,14	2,72	5,49	12,65	29,70	45,13
IRF-M 1+	1,73	15,17	5,69	7,83	19,22	51,80	57,39
IRF-M TOTAL	1,48	13,57	4,92	7,23	17,44	43,51	53,47
IBOVESPA	4,88	23,35	18,11	14,33	27,29	64,88	37,29
IFIX	6,57	19,15	7,09	9,30	22,30	58,64	56,30
SMALL CAP	--	37,68	--	--	--	--	--
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