

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 IMA-B TP	10,08%	1,10	3,96%	-0,04%	9,52%	1.034.297.809,68	43,03%	5.551.082.158,75	18,63%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IRFM 1 TP RF	0,66%	0,12	1,04%	-0,01%	7,25%	242.591.583,20	10,09%	14.011.053.988,09	1,73%
CEF	CEF	CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8,88%	0,95	3,82%	-0,17%	7,22%	4.818.530,75	0,20%	987.581.456,96	0,49%
CEF	CEF	CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4,56%	0,50	1,66%	-2,34%	4,27%	526.398.130,40	21,90%	3.239.848.879,40	16,25%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - FUNDOS 100% TP (IMA ou IDkA)								1.808.106.054,03	75,22%		
Artigo 7º III, Alínea a - FUNDOS DE INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA (IMA ou IDkA)											
BRZ	BNY MELLON SERVICOS FINANCEIRO	FI RECUPERACAO BR RENDA FIXA LONGO PRAZO	4,88%	0,55	2,03%	-1,97%	6,56%	49.075.583,25	2,04%	175.433.311,68	27,97%
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a - FUNDOS DE INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA (IMA ou IDkA)								49.075.583,25	2,04%		
Artigo 7º IV, Alínea a - RF e REFERENCIAL LIVRE											
BB	BB	BB RF DI TP FI LP-FP	0,08%	0,05	0,80%	100,05%	6,51%	496.297.381,24	20,65%	4.239.155.024,10	11,71%
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - RF e REFERENCIAL LIVRE								496.297.381,24	20,65%		
Artigo 7º VI - FIDC ABERTO											
BRPP	BANCO SANTANDER (BRASIL) AS	BBIF MASTER FIDC LP	660,43%	70,80	-38,05%	-4.751,96%	-99,98%	6.951,02	0,00%	28.319,10	24,55%
Sub-total Artigo 7º VI - FIDC ABERTO								6.951,02	0,00%		
Sub-total Renda Fixa - FIDC ABERTO								2.353.485.969,54	97,91%		
Renda Variável											
Artigo 8º III - FUNDO DE AÇÃO											
VINCI GESTORA DE RECURSOS LTDA	CEF	FI FI EM AÇÕES CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS	18,18%	1,90	4,90%	0,09%	13,55%	4.289.736,55	0,18%	100.901.077,19	4,25%
Sub-total Artigo 8º III - FUNDO DE AÇÃO								4.289.736,55	0,18%		
Artigo 8º V - FUNDO INVEST EM PARTICIPAÇÕES											
ATICO	BNY MELLON SERVICOS FINANCEIRO	ÁTICO GERAÇÃO DE ENERGIA FI EM PARTICIPAÇÕES	0,01%	-0,01	-0,13%	-0,86%	-0,89%	45.940.336,75	1,91%	337.501.317,21	13,61%
Sub-total Artigo 8º V - FUNDO INVEST EM PARTICIPAÇÕES								45.940.336,75	1,91%		
Sub-total Renda Variável								50.230.073,30	2,09%		

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
Total								2.403.716.042,84	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	FUNDOS 100% TP (IMA ou IDkA)	1.808.106.054,03	75,22%	85,00%	100,00%
Artigo 7º III, Alínea a	FUNDOS DE INVESTIMENTOS DE RENDA FIXA (IMA ou IDkA)	49.075.583,25	2,04%	5,00%	80,00%
Artigo 7º IV, Alínea a	RF e REFERENCIAL LIVRE	496.297.381,24	20,65%	30,00%	30,00%
Artigo 7º VI	FIDC ABERTO	6.951,02	0,00%	5,00%	15,00%
Total Renda Fixa		2.353.485.969,54	97,91%		
Renda Variável					
Artigo 8º III	FUNDO DE AÇÃO	4.289.736,55	0,18%	0,50%	15,00%
Artigo 8º V	FUNDO INVEST EM PARTICIPAÇÕES	45.940.336,75	1,91%	3,00%	5,00%
Total Renda Variável		50.230.073,30	2,09%		

Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)

Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	2,88 359,7	7,52 115,7	-- --	-- --
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	2,03 253,4	6,56 100,8	-- --	-- --
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,80 100,1	6,48 99,6	-- --	-- --
Artigo 7º VI % do CDI	-38,06 -4.752,1	-99,98 -1.537,0	-- --	-- --
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p	4,90 0,1	13,55 4,1	-- --	-- --
Artigo 8º V Var. IBOVESPA p.p	-0,13 -4,9	-0,89 -10,3	-- --	-- --

Ganhos Financeiros

Estratégia	Ganho Bruto (R\$)
Artigo 7º I, Alínea b	50.462.883,75
Artigo 7º III, Alínea a	976.176,16
Artigo 7º IV, Alínea a	3.895.721,32
Artigo 7º VI	-4.270,11
Artigo 8º III	200.295,59
Artigo 8º V	-60.115,50
Total	55.470.691,21

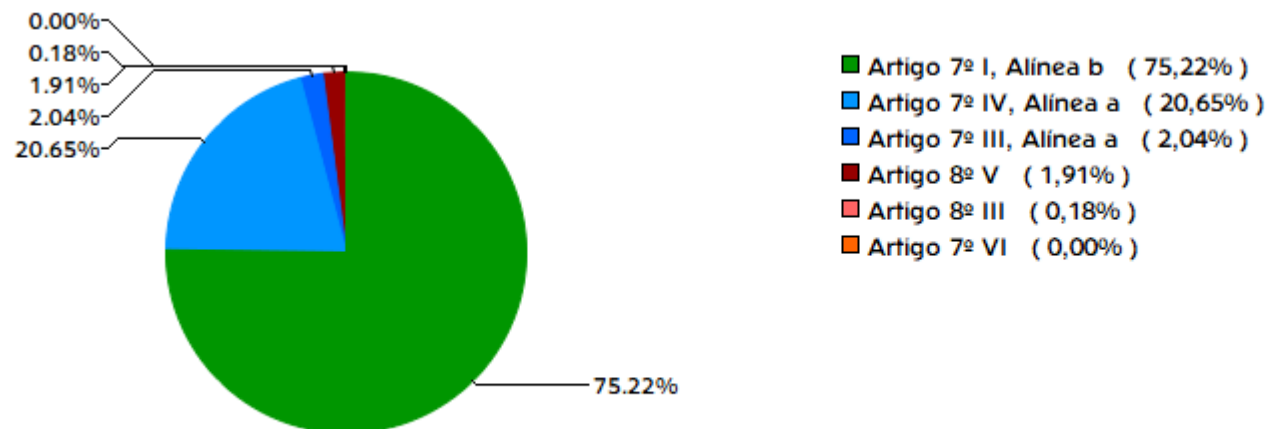
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise da Disponibilidade Financeira

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acum. Bruto (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	1.832.900.943,09	76	1.832.900.943,09	76
de 31 a 364 dias	45.947.287,77	2	1.878.848.230,86	78
acima de 365 dias	526.398.130,40	22	2.405.246.361,26	100

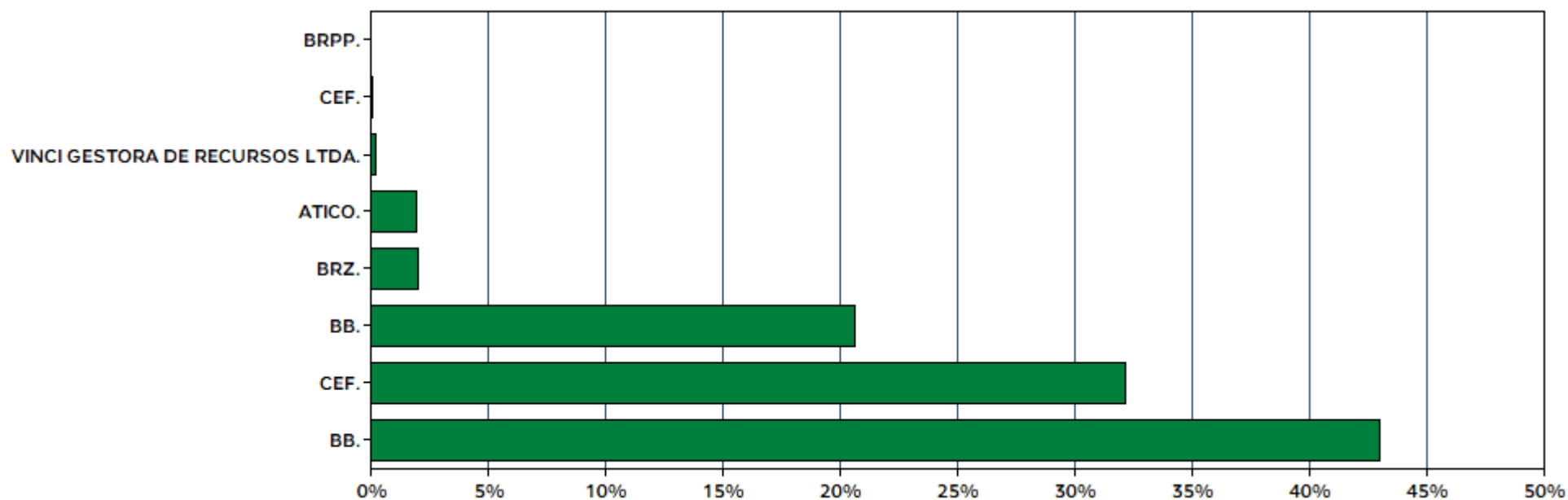
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor

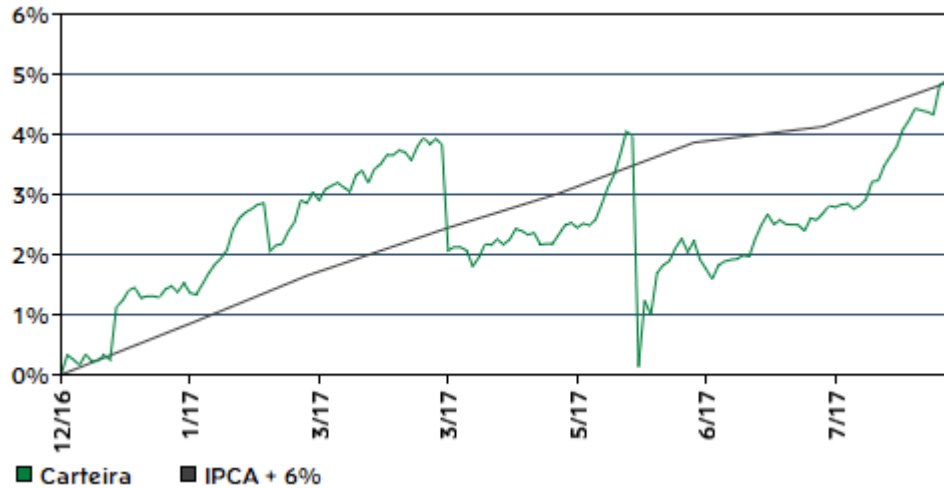


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

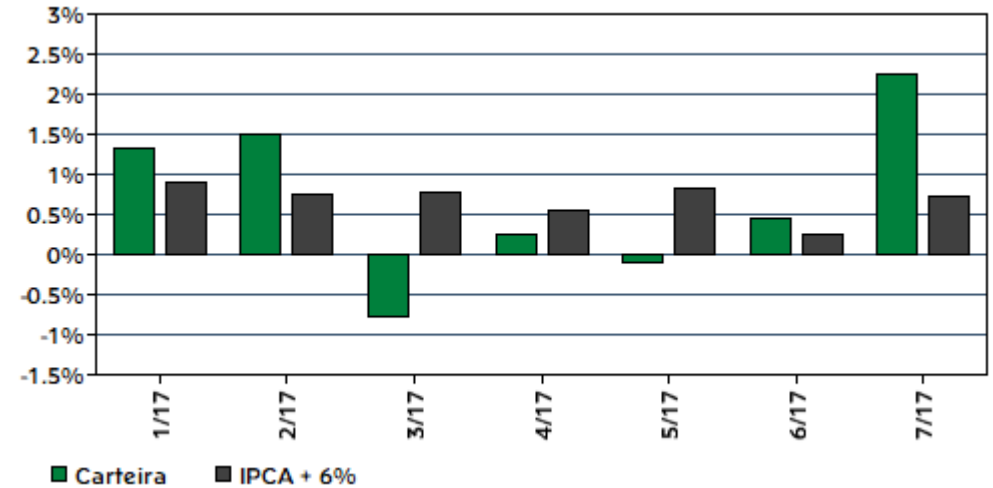
Rentabilidades da Carteira

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
2017	1,33	1,50	-0,76	0,26	-0,11	0,45	2,24	-	-	-	-	-	4,99
IPCA + 6%	0,89	0,75	0,78	0,56	0,82	0,26	0,73	-	-	-	-	-	4,89
p.p. Indx	0,44	0,75	-1,55	-0,30	-0,93	0,20	1,51	-	-	-	-	-	0,10

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	57,1%
Meses abaixo do Benchmark	3	42,9%

	Rentab.	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,24%	jul/17
Menor rentabilidade da Carteira	-0,76%	mar/17

Período	Rentabilidade (%)			Volat. Anual
	Carteira	IPCA + 6%	p.p. Indx.	
03 meses	2,60	1,82	0,8	8,144
06 meses	3,61	3,96	-0,4	6,631
12 meses	--	--	--	--
24 meses	--	--	--	--
36 meses	--	--	--	--
Desde o início	4,99	4,89	0,1	6,253

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 PREVIDENCIARIO RF IMA-B TP Var. do IMA-B TOTAL p.p.	3,96 -0,04	9,52 -0,15	2,86 -0,07	7,54 -0,13	9,52 -0,15	9,52 -0,15	9,52 -0,15
CAIXA FI BRASIL IRFM 1 TP RF Var. do IRF-M 1 p.p.	1,04 -0,01	7,25 -0,11	2,84 -0,04	5,92 -0,07	7,25 -0,11	7,25 -0,11	7,25 -0,11
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA Var. do IMA-B TOTAL p.p.	3,82 -0,17	7,22 -2,45	3,58 0,65	5,36 -2,30	7,22 -2,45	7,22 -2,45	7,22 -2,45
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA Var. do IMA-B TOTAL p.p.	1,66 -2,34	4,27 -5,40	2,95 0,02	3,23 -4,43	4,27 -5,40	4,27 -5,40	4,27 -5,40
FI RECUPERACAO BR RENDA FIXA LONGO PRAZO Var. do IMA-B TOTAL p.p.	2,03 -1,97	6,56 -3,12	2,82 -0,11	4,87 -2,79	6,56 -3,12	6,56 -3,12	6,56 -3,12
BB RF DI TP FI LP-FP % do CDI	0,80 100,05	6,51 100,11	2,59 101,34	5,38 100,35	6,51 100,11	6,51 100,11	6,51 100,11
BBIF MASTER FIDC LP % do CDI	-38,05 -4.751,96	-99,98 -1.537,04	-92,76 -3.623,99	-99,98 -1.865,55	-99,98 -1.537,04	-99,98 -1.537,04	-99,98 -1.537,04
FIC FI EM AÇÕES CAIXA VALOR SMALL CAP RPPS Var. do IBOVESPA p.p.	4,90 0,09	13,55 4,10	2,28 1,49	8,29 6,35	13,55 4,10	13,55 4,10	13,55 4,10

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
ÁTICO GERAÇÃO DE ENERGIA FI EM PARTICIPAÇÕES Var. do IPCA + 6% p.p.	-0,13 -0,86	-0,89 -5,77	-0,39 -2,21	-0,75 -4,71	-0,89 -5,77	-0,89 -5,77	-0,89 -5,77
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