

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos										
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (30/12/2016)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
Renda Fixa										
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M1 TP FIC FI	0,35%	1,17%	-0,03%	14,48%	4.449.013,13	10,87%	9.911.816.256,66	0,04%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI	7,34%	2,89%	257,46%	24,52%	8.733.857,65	21,34%	5.032.983.260,77	0,17%
BRAM	BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B TP	7,35%	2,89%	-0,02%	7,71%	2.671.875,53	6,53%	578.599.195,71	0,46%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RF LP	7,33%	2,88%	-0,03%	2,99%	6.952.906,74	16,99%	4.724.619.896,78	0,15%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	0,35%	1,18%	-0,02%	14,58%	7.659.379,23	18,72%	12.149.877.506,14	0,06%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP RF LP	2,60%	1,38%	-0,02%	15,19%	5.977.921,91	14,61%	5.450.485.822,27	0,11%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - FUNDOS 100% TP (IMA ou IDKa)							36.444.954,19	89,06%		
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,61%	1,36%	-0,03%	15,28%	3.477.693,96	8,50%	1.970.956.693,10	0,18%
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a - FUNDOS DE INVEST RENDA FIXA REF (IMA ou IDKA)							3.477.693,96	8,50%		
ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ INSTITUCIONAL RF REF DI - FI	0,02%	1,12%	99,96%	11,65%	302.159,88	0,74%	1.395.642.571,67	0,02%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC FI	0,17%	1,13%	100,97%	13,88%	641.932,59	1,57%	5.308.112.355,87	0,01%
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - RF e REFERENCIAL LIVRE							944.092,47	2,31%		
PETRA CTVM	PETRA CTVM	FIDC PREMIUM SEN I	9,65%	-0,21%	-1,02%	-13,49%	52.867,75	0,13%	106.550.697,80	0,05%
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a - FIDC FECHADO							52.867,75	0,13%		
Sub-total							40.919.608,37	100,00%		
Total							40.919.608,37	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	FUNDOS 100% TP (IMA ou IDkA)	36.444.954,19	89,06%	95,00%	100,00%
Artigo 7º III, Alínea a	FUNDOS DE INVEST RENDA FIXA REF (IMA ou IDKA)	3.477.693,96	8,50%	30,00%	80,00%
Artigo 7º IV, Alínea a	RF e REFERENCIAL LIVRE	944.092,47	2,31%	30,00%	30,00%
Artigo 7º VII, Alínea a	FIDC FECHADO	52.867,75	0,13%	3,00%	5,00%
Total Renda Fixa		40.919.608,37	100,00%		

Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)

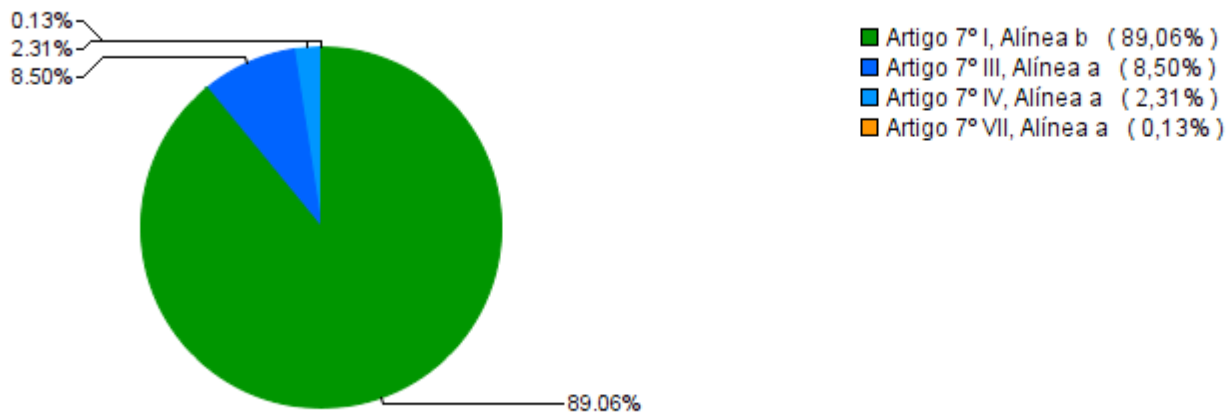
Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
Artigo 7º I, Alínea b	2,05	14,91	14,91	--
% do CDI	182,5	106,5	106,5	--
Artigo 7º III, Alínea a	1,36	15,28	15,28	--
% do CDI	121,2	109,1	109,1	--
Artigo 7º IV, Alínea a	1,13	13,91	13,91	--
% do CDI	100,5	99,4	99,4	--
Artigo 7º VII, Alínea a	-0,13	-5,31	-5,31	--
% do CDI	-11,3	-37,9	-37,9	--

Ganhos Financeiros

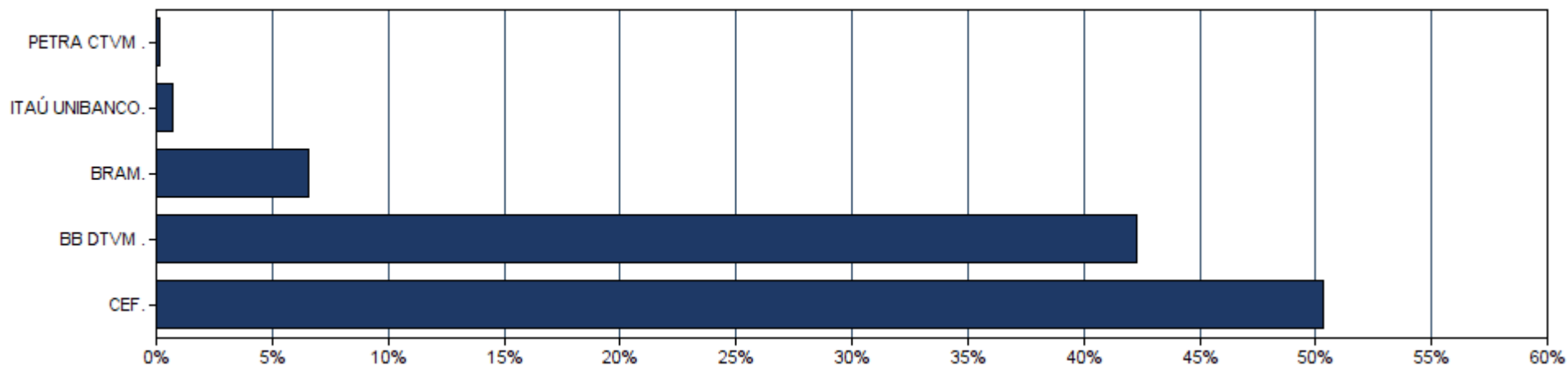
Estratégia	Ganho Bruto (R\$)
Artigo 7º I, Alínea b	722.096,62
Artigo 7º III, Alínea a	46.685,57
Artigo 7º IV, Alínea a	11.845,68
Artigo 7º VII, Alínea a	-66,93
Total	780.560,95

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia



Alocação por Gestor

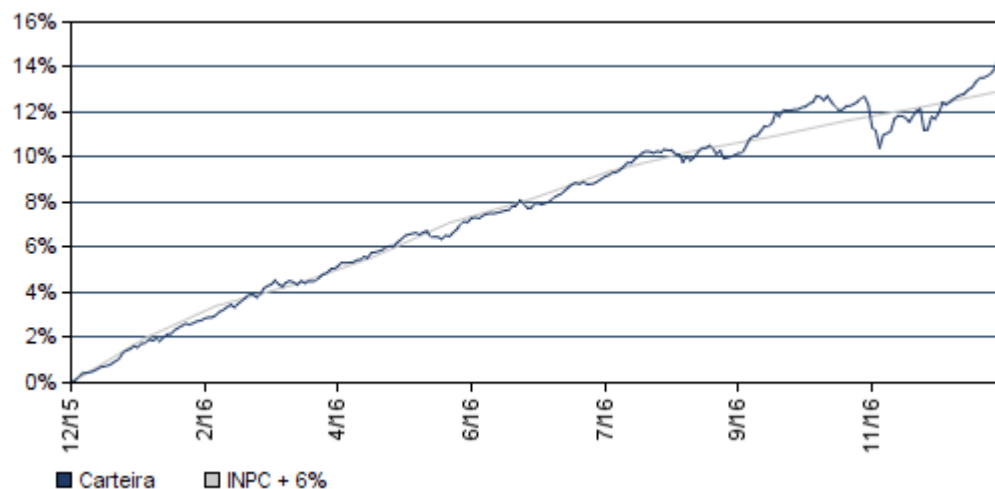


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

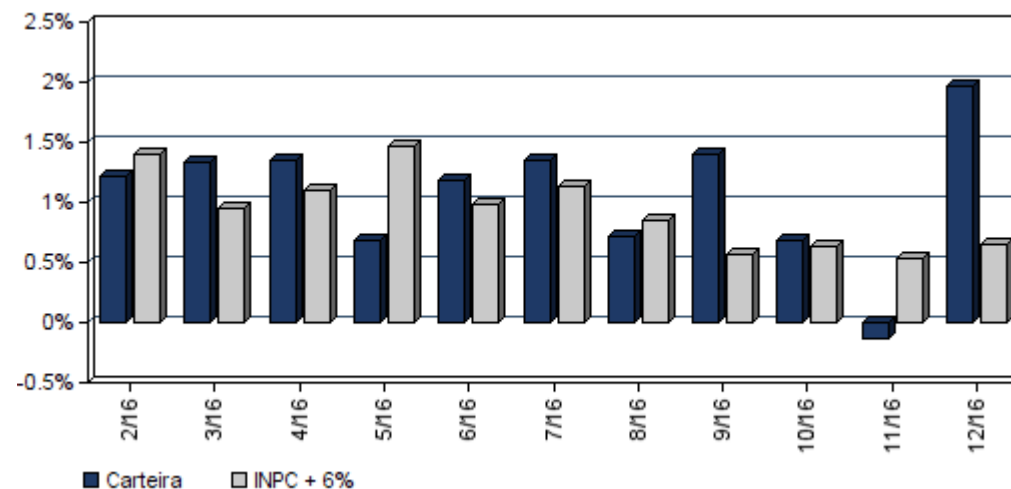
Rentabilidades da Carteira

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
2016	1,75	1,22	1,33	1,36	0,69	1,18	1,35	0,71	1,39	0,68	-0,13	1,96	14,34
INPC + 6%	1,98	1,39	0,95	1,11	1,47	0,98	1,13	0,84	0,57	0,63	0,53	0,65	12,95
p.p. Indx	-0,23	-0,18	0,38	0,25	-0,79	0,19	0,22	-0,13	0,83	0,05	-0,66	1,31	1,39

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	58,3%
Meses abaixo do Benchmark	5	41,7%

	Rentab.	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,96%	dez/16
Menor rentabilidade da Carteira	-0,13%	nov/16

Período	Rentabilidade (%)			Volat. Anual
	Carteira	INPC + 6%	p.p. Indx.	
03 meses	2,53	1,83	0,7	4,009
06 meses	6,11	4,44	1,7	3,095
12 meses	14,34	12,95	1,4	2,412
24 meses	--	--	--	--
36 meses	--	--	--	--
Desde o início	14,34	12,95	1,4	2,412

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-M1 TP FIC FI Var. do IRF-M 1 p.p.	1,17 -0,03	14,48 -0,24	3,16 -0,06	6,66 -0,14	14,48 -0,24	14,48 -0,24	14,48 -0,24
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI % do CDI	2,89 257,46	24,52 175,10	2,23 68,79	7,37 108,09	24,52 175,10	24,52 175,10	24,52 175,10
BRADESCO INST FIC FI RF IMA-B TP Var. do IMA-B TOTAL p.p.	2,89 -0,02	7,71 -0,17	2,31 0,01	7,44 -0,03	7,71 -0,17	7,71 -0,17	7,71 -0,17
FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RF LP Var. do IMA-B TOTAL p.p.	2,88 -0,03	2,99 0,02	2,33 0,03	2,99 0,02	2,99 0,02	2,99 0,02	2,99 0,02
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF Var. do IRF-M 1 p.p.	1,18 -0,02	14,58 -0,14	3,18 -0,04	6,71 -0,09	14,58 -0,14	14,58 -0,14	14,58 -0,14
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP RF LP Var. do IMA-B 5 p.p.	1,38 -0,02	15,19 -0,29	2,23 -0,04	6,01 -0,10	15,19 -0,29	15,19 -0,29	15,19 -0,29
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. do IMA-B 5 p.p.	1,36 -0,03	15,28 -0,20	2,20 -0,07	6,01 -0,10	15,28 -0,20	15,28 -0,20	15,28 -0,20
ITAÚ INSTITUCIONAL RF REF DI - FI % do CDI	1,12 99,96	11,65 100,65	3,25 100,27	6,86 100,54	11,65 100,65	11,65 100,65	11,65 100,65

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 PERFIL FIC FI % do CDI	1,13 100,97	13,88 99,13	3,28 101,31	6,94 101,74	13,88 99,13	13,88 99,13	13,88 99,13
FIDC PREMIUM SEN I Var. do IPCA + 6% p.p.	-0,21 -1,02	-13,49 -26,13	-2,49 -4,68	-9,98 -14,80	-13,49 -26,13	-13,49 -26,13	-13,49 -26,13
CDI	1,12	14,00	3,24	6,82	14,00	29,08	43,03
IMA-B 5	1,39	15,48	2,27	6,11	15,48	33,33	48,85
IMA-B 5+	3,71	31,04	2,33	8,46	31,04	38,52	61,52
IMA-B TOTAL	2,91	24,81	2,30	7,46	24,81	35,90	55,66
IMA-GERAL TOTAL	1,88	21,00	2,80	7,20	21,00	32,27	48,61
IRF-M 1	1,20	14,72	3,22	6,79	14,72	29,64	43,35
IRF-M 1+	2,11	29,64	3,51	8,41	29,64	33,87	49,77
IRF-M TOTAL	1,84	23,37	3,41	7,88	23,37	32,16	47,23
IBOVESPA	-2,71	38,94	3,19	16,89	38,94	20,44	16,93
IFIX	1,47	32,29	2,64	13,80	32,29	39,52	35,66
SMALL CAP	-0,54	31,75	-2,54	11,98	31,75	2,30	-15,05
INPC + 6%	0,65	12,95	1,83	4,44	12,95	33,16	49,98
IPCA + 6%	0,81	12,64	2,20	4,83	12,64	32,08	49,01