

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos

Gestor	CNPJ	Ativos	Vol*	VAR	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (31/01/2018)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
Renda Fixa											
Artigo 7º I, Alínea b - FUNDOS 100% TP (IMA ou IDkA)											
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	11.328.882/0001-35	BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,65%	0,11	0,59%	-0,01%	0,59%	8.570.534,24	21,41%	12.260.945.818,60	0,07%
CEF	10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,65%	0,11	0,57%	-0,02%	0,57%	8.544.784,09	21,35%	17.470.086.690,73	0,05%
CEF	11.060.913/0001-10	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,46%	0,41	1,31%	-0,03%	1,31%	5.995.869,76	14,98%	6.740.982.774,06	0,09%
SANTANDER	14.504.578/0001-90	SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP	9,35%	1,02	3,38%	-0,02%	3,38%	1.678.743,78	4,19%	771.283.283,69	0,22%
CEF	14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,64%	0,32	0,95%	0,19%	0,95%	2.617.609,23	6,54%	4.436.820.202,65	0,06%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - FUNDOS 100% TP (IMA ou IDkA)								27.407.541,10	68,47%		
Artigo 7º III, Alínea a - FUNDOS DE RENDA FIXA (IMA ou IDkA)											
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	08.702.798/0001-25	BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	9,48%	1,04	3,39%	-0,02%	3,39%	1.712.889,13	4,28%	1.445.928.639,25	0,12%
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a - FUNDOS DE RENDA FIXA (IMA ou IDkA)								1.712.889,13	4,28%		
Artigo 7º IV, Alínea a - RF e REFERENCIAL LIVRE											
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	03.399.411/0001-90	BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,14%	0,05	0,57%	98,46%	0,57%	5.733.072,10	14,32%	9.348.518.776,52	0,06%
CEF	03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,13%	0,05	0,57%	97,37%	0,57%	5.177.224,76	12,93%	6.349.465.352,27	0,08%
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - RF e REFERENCIAL LIVRE								10.910.296,86	27,25%		
Sub-total Renda Fixa								40.030.727,09	100,00%		
Total								40.030.727,09	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)	27.407.541,10	68,47%	100,00%	100,00%
Artigo 7º III, Alínea a	FUNDOS DE RENDA FIXA (IMA ou IDkA)	1.712.889,13	4,28%	80,00%	80,00%
Artigo 7º IV, Alínea a	RF e REFERENCIAL LIVRE	10.910.296,86	27,25%	30,00%	30,00%
Total Renda Fixa		40.030.727,09	100,00%		

Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)

Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,94 160,5	0,94 160,5	-- --	-- --
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	3,39 580,3	3,39 580,3	-- --	-- --
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,57 97,9	0,57 97,9	-- --	-- --

Ganhos Financeiros

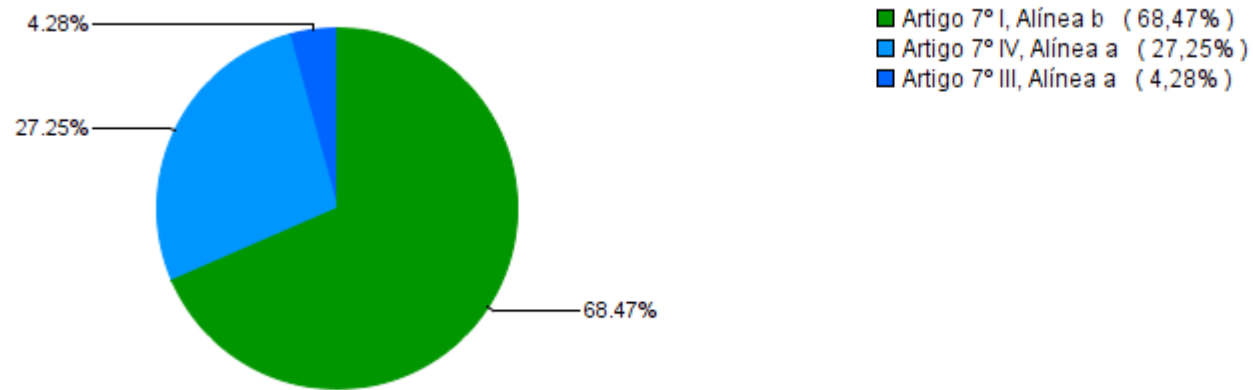
Estratégia	Ganho Bruto (R\$)
Artigo 7º I, Alínea b	256.596,91
Artigo 7º III, Alínea a	56.085,94
Artigo 7º IV, Alínea a	61.986,31
Total	374.669,16

Análise da Disponibilidade Financeira

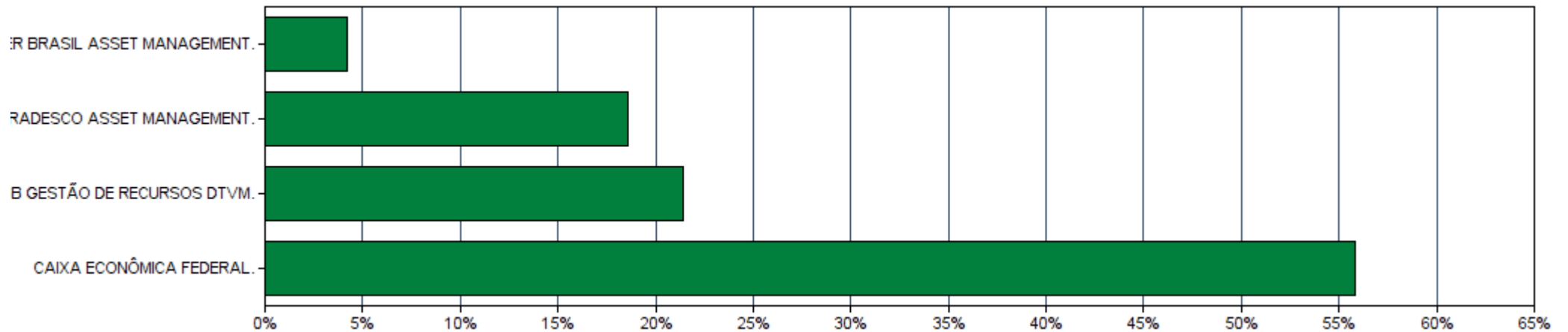
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acum. Bruto (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	40.030.727,09	100	40.030.727,09	100

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia



Alocação por Gestor

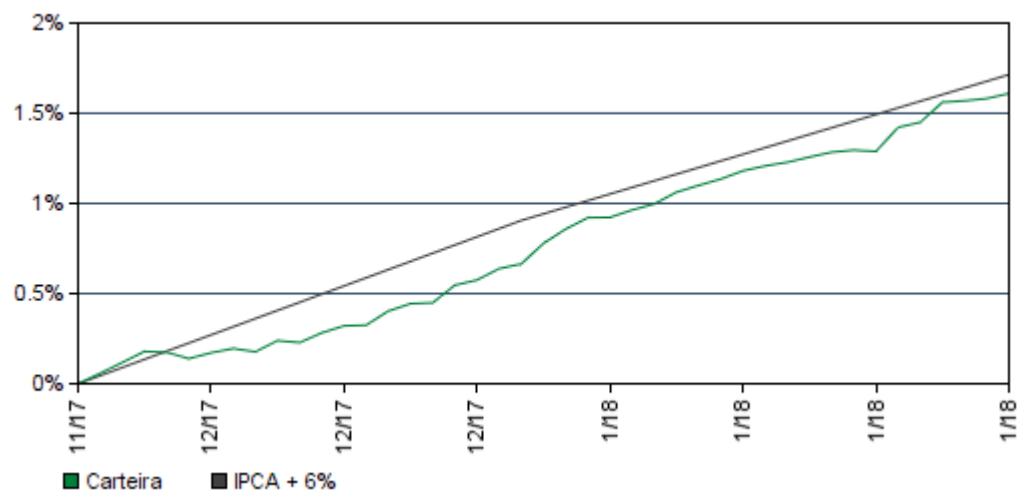


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

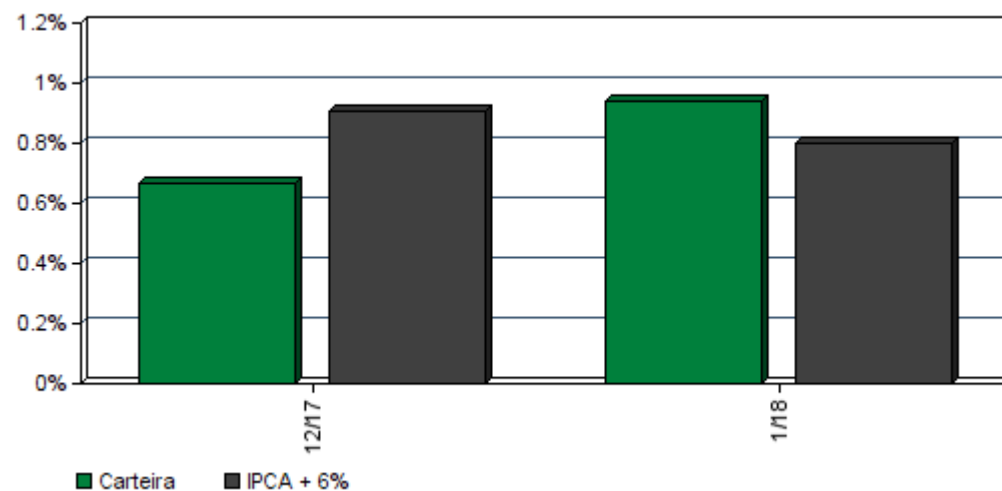
Rentabilidades da Carteira

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
2017													
IPCA + 6%	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	0,66	0,66
p.p. Indx												-0,24	-0,24
2018													
IPCA + 6%	0,94	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	0,94
p.p. Indx	0,80												0,80
	0,14												0,14

Evolução da Rentabilidade



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco / Retorno da Carteira

	Qtd.	Perct.
Meses acima do Benchmark	1	50,0%
Meses abaixo do Benchmark	1	50,0%

	Rentab.	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	0,94%	jan/18
Menor rentabilidade da Carteira	0,66%	dez/17

Período	Rentabilidade (%)			Volat. Anual
	Carteira	IPCA + 6%	p.p. Indx.	
03 meses	--	--	--	--
06 meses	--	--	--	--
12 meses	--	--	--	--
24 meses	--	--	--	--
36 meses	--	--	--	--
Desde o início	1,61	1,71	-0,1	0,568

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 IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO Var. do IRF-M 1 p.p.	0,59 -0,01	0,59 -0,01	1,15 -0,01	1,15 -0,01	1,15 -0,01	1,15 -0,01	1,15 -0,01
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA Var. do IRF-M 1 p.p.	0,57 -0,02	0,57 -0,02	1,14 -0,02	1,14 -0,02	1,14 -0,02	1,14 -0,02	1,14 -0,02
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP Var. do IMA-B 5 p.p.	1,31 -0,03	1,31 -0,03	2,19 -0,04	2,19 -0,04	2,19 -0,04	2,19 -0,04	2,19 -0,04
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP Var. do IMA-B TOTAL p.p.	3,38 -0,02	3,38 -0,02	4,21 -0,04	4,21 -0,04	4,21 -0,04	4,21 -0,04	4,21 -0,04
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP Var. do IDKA 2 p.p.	0,95 0,19	0,95 0,19	1,83 -0,11	1,83 -0,11	1,83 -0,11	1,83 -0,11	1,83 -0,11
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA Var. do IMA-B TOTAL p.p.	3,39 -0,02	3,39 -0,02	4,26 0,00	4,26 0,00	4,26 0,00	4,26 0,00	4,26 0,00
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI % do CDI	0,57 98,46	0,57 98,46	1,11 98,42	1,11 98,42	1,11 98,42	1,11 98,42	1,11 98,42
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,57 97,37	0,57 97,37	1,09 97,21	1,09 97,21	1,09 97,21	1,09 97,21	1,09 97,21

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	0,58	0,58	1,70	3,84	9,40	24,76	41,44
IBOVESPA	11,14	11,14	14,27	28,81	31,30	110,15	81,02
DOLAR COMERCIAL	-4,40	-4,40	-3,49	1,01	1,13	-21,78	18,78
INPC + 6%	0,51	0,51	1,89	3,74	7,66	20,35	41,91
IPCA + 6%	0,80	0,80	2,47	4,80	8,95	21,70	42,71