

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA

84,70%

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (5,750000%)	1,52	0,04	0,83	5,60	588.036,28	0,22
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535 (6,250000%)	4,21	0,04	0,44	0,44	8.086.415,63	3,04
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,790000%)	1,36	0,04	0,83	5,62	10.219.634,65	3,84
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (5,820000%)	1,77	0,04	0,84	5,63	537.705,82	0,20
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150840 (6,030000%)	4,15	0,04	0,85	0,92	17.558,85	0,01
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (5,680000%)	0,80	0,04	0,83	5,56	10.815.080,24	4,06
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545 (6,030000%)	4,14	0,04	0,85	0,92	34.625,20	0,01
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,630000%)	3,94	0,04	0,82	3,94	2.065.095,72	0,78
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,640000%)	2,86	0,04	0,82	5,54	19.244.858,05	7,23
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,660000%)	2,87	0,04	0,83	5,55	8.362.079,90	3,14
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,670000%)	2,87	0,04	0,83	5,56	22.590.503,70	8,49
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,730000%)	3,99	0,04	0,83	2,82	5.874.681,53	2,21
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,770000%)	4,01	-0,02	0,83	2,67	7.596.378,87	2,85
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,820000%)	1,30	0,04	0,84	5,63	5.401.945,12	2,03
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (5,930000%)	3,23	0,04	0,85	5,69	6.474.643,95	2,43

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira
			Dia	Mês	Ano		
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,070000%)	4,17	0,04	0,86	0,92	1.708.487,44	0,64
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850 (6,320000%)	4,30	0,04	0,40	0,40	2.351.284,93	0,88
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,760000%)	0,64	0,04	0,83	5,60	43.401.775,08	16,30
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (5,790000%)	0,99	0,04	0,83	5,62	10.843.558,21	4,07
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150555 (6,070000%)	4,16	0,04	0,86	0,92	103.335,03	0,04
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea a</b>		<b>0,82</b>	<b>0,03</b>	<b>0,83</b>	<b>5,59</b>	<b>166.317.684,20</b>	<b>62,47</b>

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB PREV RF IMA-B 5 LP FIC FI	1,72	-0,18	0,37	3,20	10.894.015,26	4,09	4.972.766.310,86	0,22
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	1,72	-0,18	0,37	3,21	12.563.888,78	4,72	7.303.046.549,52	0,17
CAIXA DTVM	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,35	-0,02	0,61	4,48	18.452.502,47	6,93	7.877.165.450,51	0,23
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>1,11</b>	<b>-0,11</b>	<b>0,49</b>	<b>3,72</b>	<b>41.910.406,51</b>	<b>15,74</b>		

Artigo 7º III, Alínea a (Fundos Renda Fixa)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
BB	BB	BB PREV RF FLUXO FIC	0,06	0,04	0,71	4,71	39.389,03	0,01	5.048.562.747,13	0,00
BB	BB	BB PREV RF IMA-B	3,82	0,00	-1,25	-1,55	0,00	0,00	843.817.661,01	0,00
BB	BB	BB PREV RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,07	0,04	0,79	5,24	5.639.955,45	2,12	17.821.452.916,03	0,03
BRAM	BRADESCO	BRADESCO FIC FI RF ALOCACAO DINAMICA	1,91	-0,29	-0,20	1,81	10.256.266,44	3,85	683.118.622,81	1,50
<b>Sub-total Artigo 7º III, Alínea a</b>			<b>2,15</b>	<b>-0,17</b>	<b>-0,27</b>	<b>1,29</b>	<b>15.935.610,92</b>	<b>5,99</b>		

Artigo 7º V, Alínea a (FIDC Cota Sênior)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
GRAPHEN	CM CAPITAL	GBX PRIME I FUNDO INVESTIMENTO DIREITOS CREDITORIOS	4,78	-0,24	-0,24	-4,42	1.326.769,25	0,50	119.483.175,37	1,11
		<b>Sub-total Artigo 7º V, Alínea a</b>	<b>4,78</b>	<b>-0,24</b>	<b>-0,24</b>	<b>-4,42</b>	<b>1.326.769,25</b>	<b>0,50</b>		
		Renda Fixa	0,82	-0,01	0,63	4,60	225.490.470,88	84,70		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL

1,81%

Artigo 8º I (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FIC FIA CAIXA BRASIL ACOES LIVRE	15,59	-0,97	-0,11	-6,86	4.807.286,02	1,81	660.651.400,16	0,73
<b>Sub-total Artigo 8º I</b>			<b>15,59</b>	<b>-0,97</b>	<b>-0,11</b>	<b>-6,86</b>	<b>4.807.286,02</b>	<b>1,81</b>		
Renda Variável			15,37	-0,97	-0,11	-6,86	4.807.286,02	1,81		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

5,27%

Artigo 9º III (Fundos de Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	13,96	0,88	12,73	39,52	14.022.281,63	5,27	2.736.870.167,13	0,51
<b>Sub-total Artigo 9º III</b>			<b>13,96</b>	<b>0,88</b>	<b>12,73</b>	<b>39,52</b>	<b>14.022.281,63</b>	<b>5,27</b>		
Investimentos no Exterior			13,96	0,88	12,73	39,52	14.022.281,63	5,27		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

7,00%

Artigo 10º I (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
CAIXA DTVM	CEF	CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	11,06	-0,28	3,90	16,70	17.051.537,59	6,41	1.972.213.735,46	0,86
<b>Sub-total Artigo 10º I</b>			<b>11,06</b>	<b>-0,28</b>	<b>3,90</b>	<b>16,70</b>	<b>17.051.537,59</b>	<b>6,41</b>		

Artigo 10º II (Fundo de Participação)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
A5	PLANNER	W7 FIP MULTISTRATÉGIA	57,96	-0,13	-0,13	-44,18	1.586.985,98	0,60	68.445.600,86	2,32
<b>Sub-total Artigo 10º II</b>			<b>57,96</b>	<b>-0,13</b>	<b>-0,13</b>	<b>-44,18</b>	<b>1.586.985,98</b>	<b>0,60</b>		

<b>Investimentos Estruturados</b>			<b>11,48</b>	<b>-0,27</b>	<b>3,54</b>	<b>6,78</b>	<b>18.638.523,57</b>	<b>7,00</b>		
-----------------------------------	--	--	--------------	--------------	-------------	-------------	----------------------	-------------	--	--

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

FUNDOS IMOBILIÁRIOS

1,22%

Artigo 11º (Fundo de Investimento Imobiliário)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentabilidade (%)			Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
				Dia	Mês	Ano				
PLANNER	PLANNER	CARE11	45,22	1,18	-6,43	27,04	776.772,64	0,29	0,00	
LEGATUS	BTG PACTUAL	FI IMOBILIÁRIO MACAM SHOPPING	62,64	-0,02	-0,02	-10,13	2.482.319,21	0,93	653.246.216,70	0,38
<b>Sub-total Artigo 11º</b>			<b>48,58</b>	<b>0,26</b>	<b>-1,63</b>	<b>-3,32</b>	<b>3.259.091,85</b>	<b>1,22</b>		
Fundos Imobiliários			48,58	0,26	-1,63	-3,32	3.259.091,85	1,22		
Total			1,72	0,01	1,36	5,80	266.217.653,95	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos				
				Mínimo	Objetivo	Máximo	ALM	Limite Legal
<b>Renda Fixa</b>								
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	166.317.684,20	62,47	0,00	60,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	41.910.406,51	15,74	0,00	8,00	100,00	0,00	100,00
Artigo 7º III, Alínea a	Fundos Renda Fixa	15.935.610,92	5,99	0,00	10,00	60,00	0,00	60,00
Artigo 7º V, Alínea a	FIDC Cota Sênior	1.326.769,25	0,50	0,00	0,65	5,00	0,00	5,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>225.490.470,88</b>	<b>84,70</b>					100,00
<b>Renda Variável</b>								
Artigo 8º I	Fundos de Ações	4.807.286,02	1,81	0,00	2,50	30,00	0,00	30,00
	<b>Total Renda Variável</b>	<b>4.807.286,02</b>	<b>1,81</b>					30,00
<b>Investimentos no Exterior</b>								
Artigo 9º III	Fundos de Ações - BDR Nível I	14.022.281,63	5,27	0,00	5,00	10,00	0,00	10,00
	<b>Total Investimentos no Exterior</b>	<b>14.022.281,63</b>	<b>5,27</b>					10,00
<b>Investimentos Estruturados</b>								
Artigo 10º I	Fundos Multimercados	17.051.537,59	6,41	0,00	6,00	10,00	0,00	10,00
Artigo 10º II	Fundo de Participação	1.586.985,98	0,60	0,00	1,35	5,00	0,00	5,00
	<b>Total Investimentos Estruturados</b>	<b>18.638.523,57</b>	<b>7,00</b>					15,00
<b>Fundos Imobiliários</b>								
Artigo 11º	Fundo de Investimento Imobiliário	3.259.091,85	1,22	0,00	1,50	5,00	0,00	5,00
	<b>Total Fundos Imobiliários</b>	<b>3.259.091,85</b>	<b>1,22</b>					5,00
<b>Total</b>		<b>266.217.653,95</b>	<b>100,00</b>					