

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Posição de Ativos | | | | | | | | | | | |
|--|---------------|--|--------|------|-------|----------|-------|----------------------------|------------|------------------|---------------------|
| Gestor | Administrador | 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 - 4604 - Fundos 100% Títulos Públicos - Referenciado | | | | | | | | | | | |
| BANESTES | BANESTES | BANESTES FI PREVIDENCIÁRIO RF | 10,88% | 1,18 | 4,67% | 1,27% | 4,67% | 49.687.403,01 | 22,86% | 246.268.759,44 | 20,18% |
| BB | BB | BB PREVIDENCIARIO RF IMA-B TP | 9,34% | 1,02 | 3,38% | -0,02% | 3,38% | 20.032.971,23 | 9,21% | 4.728.171.648,25 | 0,42% |
| CEF | CEF | CAIXA FI BRASIL IMAB TP RF LP | 9,35% | 1,02 | 3,37% | -0,03% | 3,37% | 44.165.277,13 | 20,32% | 4.249.583.705,83 | 1,04% |
| CEF | CEF | CAIXA FI BRASIL IRF M 1+ TP RF LP | 5,97% | 0,68 | 1,66% | 0,11% | 1,66% | 1.685.550,52 | 0,78% | 1.463.146.464,67 | 0,12% |
| CEF | CEF | CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 4,36% | 0,47 | 1,05% | -2,36% | 1,05% | 2.702.182,83 | 1,24% | 3.273.575.281,08 | 0,08% |
| CEF | CEF | FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA | 5,59% | 0,61 | 1,01% | -2,39% | 1,01% | 796.340,71 | 0,37% | 968.313.216,75 | 0,08% |
| BB | BB | BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI | 5,61% | 0,63 | 2,00% | -1,40% | 2,00% | 3.580.005,68 | 1,65% | 514.468.961,19 | 0,70% |
| Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - 4604 - Fundos 100% Títulos Públicos - Referenciado | | | | 1,06 | | | | 122.649.731,11 | 56,42% | | |
| Artigo 7º III, Alínea a - 4604 - Fundos Renda Fixa Referenciados | | | | | | | | | | | |
| BANESTES | BANESTES | FI BANESTES INSTITUCIONAL RF | 10,76% | 1,17 | 4,31% | 0,91% | 4,31% | 38.193.718,29 | 17,57% | 222.406.307,29 | 17,17% |
| Sub-total Artigo 7º III, Alínea a - 4604 - Fundos Renda Fixa Referenciados | | | | 1,17 | | | | 38.193.718,29 | 17,57% | | |
| Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Renda Fixa | | | | | | | | | | | |
| BANESTES | BANESTES | FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP | 0,14% | 0,05 | 0,58% | 99,45% | 0,58% | 18.791.746,72 | 8,64% | 455.525.532,22 | 4,13% |
| CEF | CEF | CAIXA FI BRASIL TP RF LP | 0,16% | 0,05 | 0,57% | 97,51% | 0,57% | 996.518,90 | 0,46% | 1.997.975.385,75 | 0,05% |
| CEF | CEF | CAIXA FI BRASIL REF DI LP | 0,13% | 0,05 | 0,57% | 97,37% | 0,57% | 8.043.411,06 | 3,70% | 6.349.465.352,27 | 0,13% |
| BB | BB | BB RPPS RF PERFIL FIC | 0,13% | 0,05 | 0,57% | 97,88% | 0,57% | 26.404.169,01 | 12,15% | 4.094.151.480,10 | 0,64% |
| Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Renda Fixa | | | | 0,05 | | | | 54.235.845,69 | 24,95% | | |
| Sub-total Renda Fixa | | | | 0,82 | | | | 215.079.295,09 | 98,93% | | |
| Renda Variável | | | | | | | | | | | |
| Artigo 8º II, Alínea a - 4604 - Fundos de Ações | | | | | | | | | | | |
| VINCI | CEF | FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALAOR DIVIDENDOS RPPS | 17,46% | 1,90 | 5,71% | -4,16% | 5,71% | 2.318.240,72 | 1,07% | 364.884.519,37 | 0,64% |
| Sub-total Artigo 8º II, Alínea a - 4604 - Fundos de Ações | | | | 1,90 | | | | 2.318.240,72 | 1,07% | | |
| Sub-total Renda Variável | | | | 1,90 | | | | 2.318.240,72 | 1,07% | | |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

| Posição de Ativos | | | | | | | | | | | |
|-------------------|---------------|--------|------|-----|-----|----------|-----|----------------------------|------------|-------------|---------------------|
| Gestor | Administrador | Ativos | Vol* | VAR | Mês | % Índice | Ano | Valor(R\$) (31/01/2018) | % Carteira | PL do Fundo | % no PL do Fundo |
| Total | | | | | | | | 217.397.535,81 | 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 - 4604 | Fundos 100% Títulos Públicos - Referenciado | 122.649.731,11 | 56,42% | 58,00% | 100,00% |
| Artigo 7º III, Alínea a - 4604 | Fundos Renda Fixa Referenciados | 38.193.718,29 | 17,57% | 14,00% | 60,00% |
| Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 | Fundos de Renda Fixa | 54.235.845,69 | 24,95% | 24,00% | 40,00% |
| Total Renda Fixa | | 215.079.295,09 | 98,94% | | |
| Renda Variável | | | | | |
| Artigo 8º II, Alínea a - 4604 | Fundos de Ações | 2.318.240,72 | 1,07% | 2,00% | 20,00% |
| Total Renda Variável | | 2.318.240,72 | 1,07% | | |

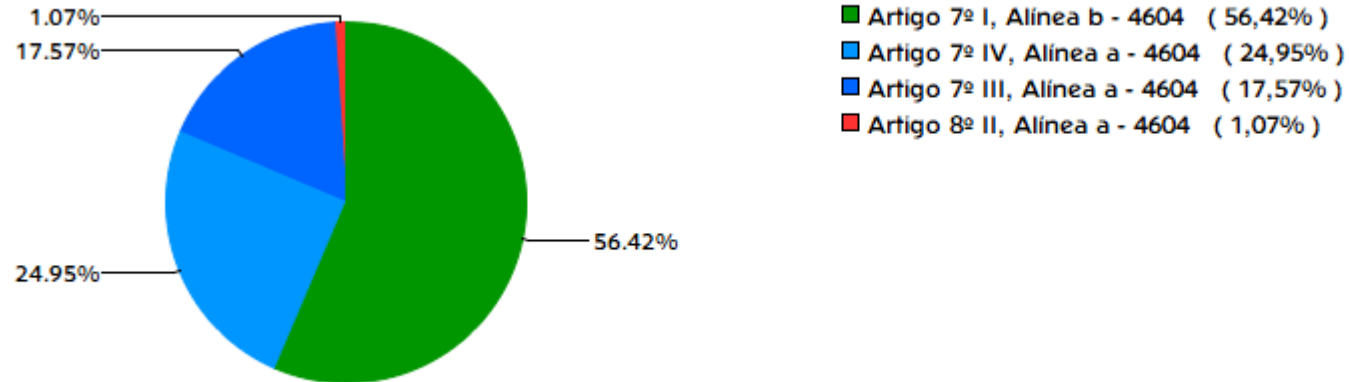
| Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%) | | | | |
|--|---------------|---------------|----------|----------|
| Estratégia | No Mês | No Ano | 12 meses | 24 meses |
| Artigo 7º I, Alínea b - 4604 % do CDI | 3,76 645,2 | 3,76 645,2 | -- -- | -- -- |
| Artigo 7º III, Alínea a - 4604 % do CDI | 4,31 738,4 | 4,31 738,4 | -- -- | -- -- |
| Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 % do CDI | 0,57 98,3 | 0,57 98,3 | -- -- | -- -- |
| Artigo 8º II, Alínea a - 4604 Var. IBOVESPA p.p | 5,71 -5,4 | 5,71 -5,4 | -- -- | -- -- |

| Ganhos Financeiros | |
|--------------------------------|--------------|
| Estratégia | No Mês(R\$) |
| Artigo 7º I, Alínea b - 4604 | 4.443.757,13 |
| Artigo 7º III, Alínea a - 4604 | 1.577.234,21 |
| Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 | 307.267,77 |
| Artigo 8º II, Alínea a - 4604 | 125.280,43 |
| Total | 6.453.539,54 |

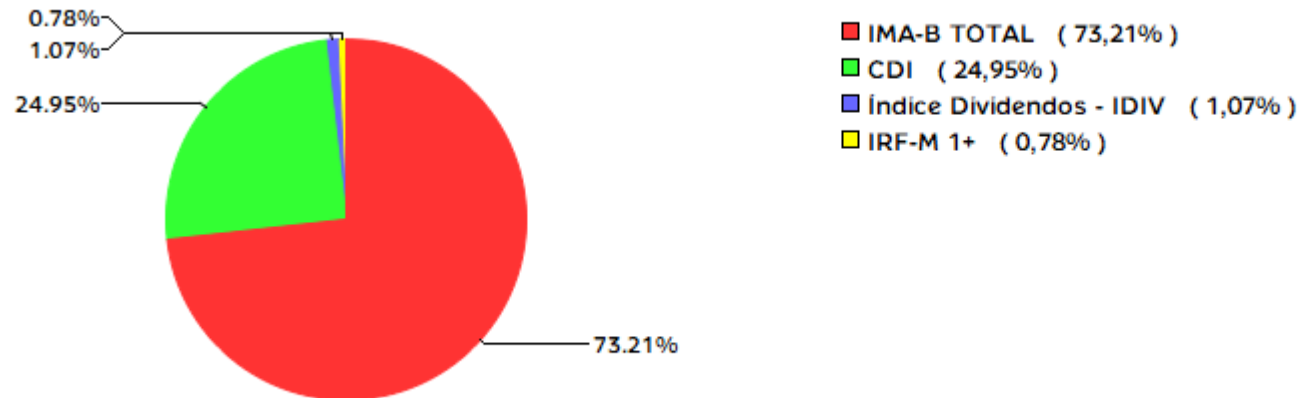
| Análise da Disponibilidade Financeira | | | | |
|---------------------------------------|----------------|-----|-------------------------|-----------|
| Período | Valor (R\$) | (%) | Valor Acum. Bruto (R\$) | (%) Acum. |
| de 0 a 30 dias | 210.319.006,59 | 97 | 210.319.006,59 | 97 |
| de 31 a 364 dias | 2.702.182,83 | 1 | 213.021.189,42 | 98 |
| acima de 365 dias | 4.376.346,39 | 2 | 217.397.535,81 | 100 |

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia

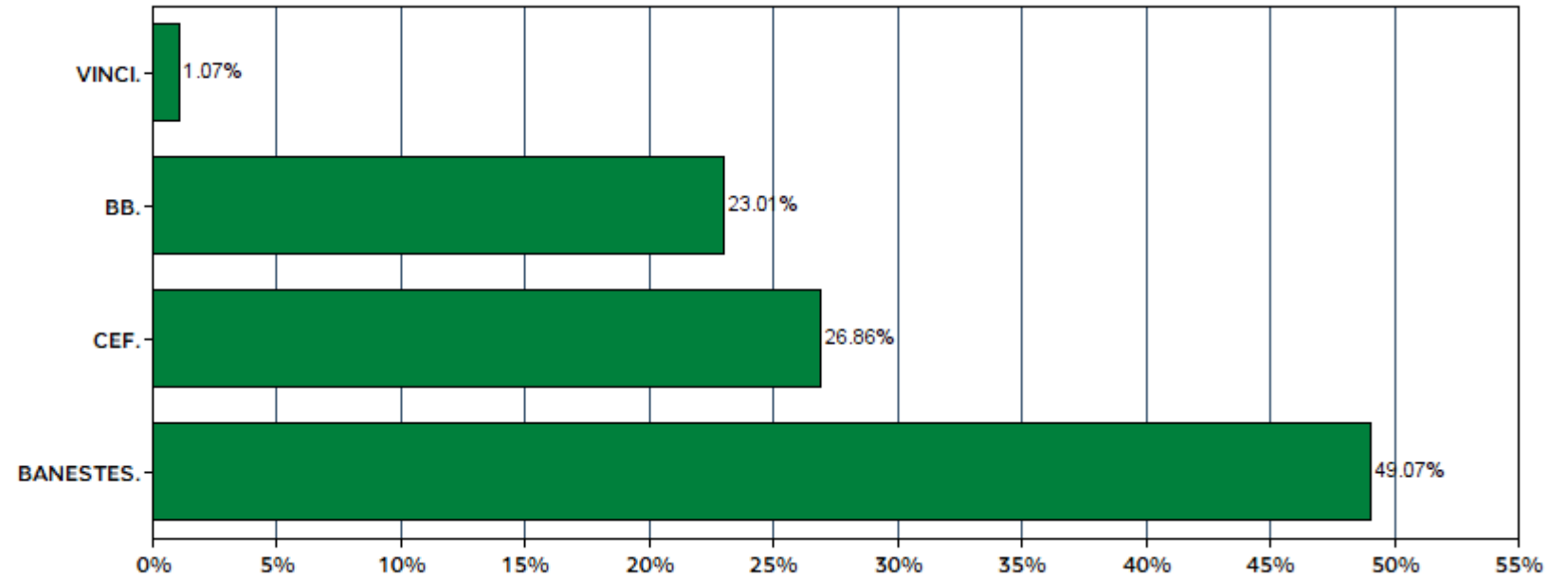


Indexadores



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor

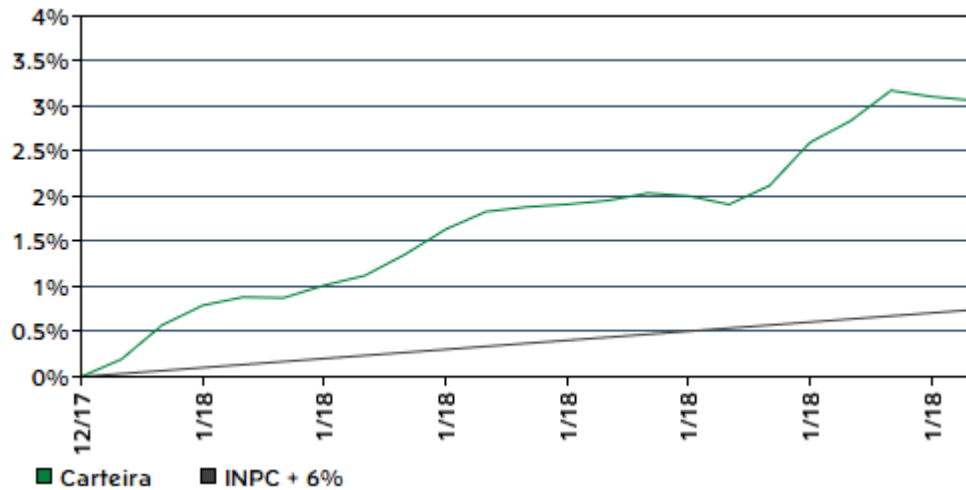


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

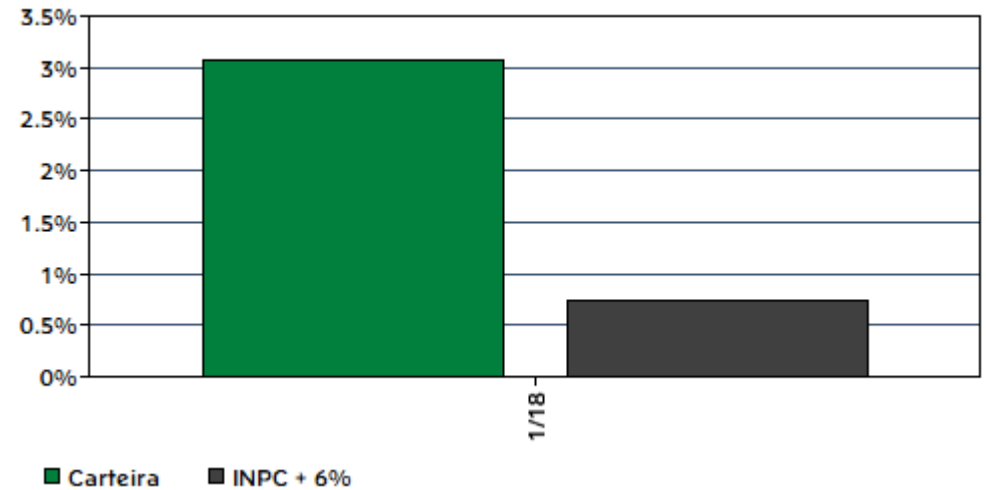
Rentabilidades da Carteira

| Ano | Jan | Fev | Mar | Abr | Mai | Jun | Jul | Ago | Set | Out | Nov | Dez | Rent.Ano |
|-----------|------|-----|-----|-----|-----|-----|-----|-----|-----|-----|-----|-----|----------|
| 2018 | 3,06 | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | 3,06 |
| INPC + 6% | 0,74 | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | 0,74 |
| p.p. Indx | 2,32 | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | -- | 2,32 |

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 | 100,0% |
| Meses abaixo do Benchmark | 0 | 0,0% |

| | Rentab. | Mês |
|---------------------------------|---------|--------|
| Maior rentabilidade da Carteira | 3,06% | jan/18 |
| Menor rentabilidade da Carteira | 3,06% | jan/18 |

| Período | Rentabilidade (%) | | | Volat. Anual |
|----------------|-------------------|-----------|------------|--------------|
| | Carteira | INPC + 6% | p.p. Indx. | |
| 03 meses | -- | -- | -- | -- |
| 06 meses | -- | -- | -- | -- |
| 12 meses | -- | -- | -- | -- |
| 24 meses | -- | -- | -- | -- |
| 36 meses | -- | -- | -- | -- |
| Desde o início | 3,06 | 0,74 | 2,3 | 2,359 |

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 |
|--|---------------|---------------|---------------|---------------|----------------|-----------------|----------------|
| BANESTES FI PREVIDENCIÁRIO RF % do Var. IMA-B TOTAL p.p. | 4,67 1,27 | 4,67 1,27 | 4,20 0,73 | 7,22 0,88 | 14,95 0,45 | 46,05 3,21 | 56,05 2,34 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP % do Var. IMA-B TOTAL p.p. | 3,38 -0,02 | 3,38 -0,02 | 3,41 -0,05 | 6,22 -0,13 | 14,22 -0,27 | 42,25 -0,59 | 52,53 -1,18 |
| BB PREVIDENCIÁRIO RF TIT PUB X FI % do Var. IMA-B TOTAL p.p. | 2,00 -1,40 | 2,00 -1,40 | 2,56 -0,90 | 5,56 -0,79 | 14,27 -0,23 | 36,80 -6,03 | -- -- |
| CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA % do Var. IMA-B TOTAL p.p. | 1,05 -2,36 | 1,05 -2,36 | 1,61 -1,85 | 1,04 -5,30 | 4,30 -10,19 | 10,82 -32,02 | -- -- |
| CAIXA FI BRASIL IMAB TP RF LP % do Var. IMA-B TOTAL p.p. | 3,37 -0,03 | 3,37 -0,03 | 3,39 -0,07 | 6,21 -0,13 | 14,24 -0,25 | 42,39 -0,45 | 50,85 -2,85 |
| CAIXA FI BRASIL IRF M 1+ TP RF LP % do Var. IRF-M 1+ p.p. | 1,66 0,11 | 1,66 0,11 | 2,98 0,04 | 5,59 -0,22 | 14,97 -0,43 | 47,80 -0,18 | 54,59 -0,63 |
| FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA % do Var. IMA-B TOTAL p.p. | 1,01 -2,39 | 1,01 -2,39 | 2,02 -1,45 | 2,11 -4,23 | 7,18 -7,31 | 16,70 -26,14 | -- -- |
| FI BANESTES INSTITUCIONAL RF % do Var. IMA-B TOTAL p.p. | 4,31 0,91 | 4,31 0,91 | 4,02 0,56 | 7,30 0,95 | 14,82 0,32 | 45,93 3,09 | 55,92 2,21 |

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 |
|--|---------------|---------------|----------------|----------------|----------------|-----------------|-----------------|
| BB RPPS RF PERFIL FIC % do % do CDI | 0,57 97,88 | 0,57 97,88 | 1,73 101,51 | 3,90 101,49 | 9,51 101,09 | 24,76 99,99 | 41,71 100,64 |
| CAIXA FI BRASIL REF DI LP % do % do CDI | 0,57 97,37 | 0,57 97,37 | 1,66 97,37 | 3,78 98,57 | 9,39 99,84 | 24,73 99,88 | 41,51 100,16 |
| CAIXA FI BRASIL TP RF LP % do % do CDI | 0,57 97,51 | 0,57 97,51 | 1,69 99,43 | 3,82 99,56 | 9,33 99,25 | 24,61 99,40 | 40,83 98,52 |
| FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP % do % do CDI | 0,58 99,45 | 0,58 99,45 | 1,64 96,33 | 3,73 97,19 | 9,39 99,81 | 24,89 100,50 | 41,00 98,93 |
| FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALAOR DIVIDENDOS RPPS % do Var. Índice Dividendos - IDIV p.p. | 5,71 -4,16 | 5,71 -4,16 | 7,79 0,16 | 19,06 -3,44 | 23,08 -3,70 | 46,62 -97,59 | 46,02 -34,46 |
| 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% | 0,74 | 0,74 | 2,13 | 3,98 | 7,91 | 20,63 | 42,23 |
| IPCA + 6% | 0,80 | 0,80 | 2,47 | 4,80 | 8,95 | 21,70 | 42,71 |