

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos											
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	VAR	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (29/06/2018)	% 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	6,35%	0,68	-1,29%	-0,97%	-1,72%	11.063.204,06	5,06%	181.240.682,13	6,10%
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,51%	0,08	0,50%	-0,05%	0,51%	10.137.295,50	4,64%	11.461.270.746,53	0,09%
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP	4,54%	0,50	-0,35%	-0,03%	1,04%	11.159.871,66	5,11%	3.747.694.315,14	0,30%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IMAB TP RF LP	4,56%	0,50	-0,36%	-0,04%	1,03%	19.863.088,88	9,09%	3.529.035.541,89	0,56%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IRFM 1 TP RF	0,50%	0,08	0,50%	-0,05%	0,51%	23.187.201,09	10,61%	16.953.571.238,51	0,14%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP RF LP	2,66%	0,31	0,75%	-0,02%	0,75%	7.556.514,59	3,46%	7.668.949.035,88	0,10%
CEF	CEF	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	4,31%	0,47	0,10%	0,42%	0,90%	795.450,59	0,36%	967.230.865,50	0,08%
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TIT PUB X FI	3,75%	0,43	0,14%	0,46%	2,43%	3.501.770,52	1,60%	491.063.496,51	0,71%
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCACAO ATIVA FCFI	2,47%	0,29	0,19%	0,09%	-0,02%	7.232.501,26	3,31%	2.829.191.536,13	0,26%
BB	BB	BB IDKA 2 TP FI RF PREV	2,11%	0,26	1,59%	404,62%	1,59%	5.087.013,53	2,33%	6.108.970.608,51	0,08%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IRF M 1+ TP RF LP	3,78%	0,43	-0,15%	-0,00%	2,00%	1.691.235,55	0,77%	1.850.158.266,97	0,09%
CEF	CEF	CAIXA BRASIL IDKa IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RJ LP	2,13%	0,26	0,48%	-0,31%	0,48%	7.535.666,67	3,45%	4.897.194.284,25	0,15%
BB	BB	BB IMA-B 5 FIC RF PREVIDENCIÁRIO LP	2,66%	0,31	1,81%	-0,03%	1,81%	5.090.585,12	2,33%	2.255.256.718,31	0,23%
BANESTES	BANESTES	FUNDO DE INVESTIMENTO BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS-RENDA FIXA	0,99%	0,14	0,29%	-0,25%	0,47%	17.129.887,75	7,84%	130.092.502,78	13,17%
CEF	CEF	CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3,95%	0,42	1,13%	1,45%	1,50%	2.714.274,18	1,24%	3.288.223.579,63	0,08%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - 4604 - Fundos 100% Títulos Públicos - Referenciado				0,31				133.745.560,95	61,19%		
Artigo 7º III, Alínea a - 4604 - Fundos Renda Fixa Referenciados											
BANESTES	BANESTES	FI BANESTES INSTITUCIONAL RF	5,84%	0,63	-1,22%	-0,90%	-1,61%	11.245.339,63	5,14%	168.758.186,90	6,66%
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a - 4604 - Fundos Renda Fixa Referenciados				0,63				11.245.339,63	5,14%		
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Renda Fixa											
BANESTES	BANESTES	FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP	0,08%	0,04	0,50%	97,47%	3,16%	28.554.274,96	13,06%	464.563.409,81	6,15%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL TP RF LP	0,10%	0,04	0,49%	94,32%	3,02%	1.020.835,87	0,47%	2.544.759.472,74	0,04%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL REF DI LP	0,08%	0,04	0,50%	96,79%	3,07%	13.013.951,48	5,95%	7.788.517.695,73	0,17%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos											
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	VAR	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (29/06/2018)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
BB	BB	BB RPPS RF PERFIL FIC	0,09%	0,04	0,50%	96,82%	3,15%	26.659.328,97	12,20%	4.659.952.242,12	0,57%
CEF	CEF	CAIXA FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	1,69%	0,21	0,45%	-0,81%	-0,47%	995.269,51	0,46%	1.823.013.314,56	0,05%
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Renda Fixa				0,04				70.243.660,79	32,14%		
Sub-total Renda Fixa				0,24				215.234.561,37	98,47%		
Renda Variável											
Artigo 8º II, Alínea a - 4604 - Fundos de Ações											
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALAOR DIVIDENDOS RPPS	16,22%	1,70	-5,34%	-1,01%	-10,19%	1.969.416,82	0,90%	387.954.203,90	0,51%
BANESTES	BANESTES	BANESTES FIC DE FI ACOES BTG ABSOL. INST	15,77%	1,69	-1,82%	2,51%	-8,91%	1.366.407,97	0,63%	15.056.263,05	9,08%
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a - 4604 - Fundos de Ações				1,70				3.335.824,79	1,53%		
Sub-total Renda Variável				1,70				3.335.824,79	1,53%		
Total								218.570.386,16	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	133.745.560,95	61,19%	58,00%	100,00%
Artigo 7º III, Alínea a - 4604	Fundos Renda Fixa Referenciados	11.245.339,63	5,14%	14,00%	60,00%
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604	Fundos de Renda Fixa	70.243.660,79	32,14%	24,00%	40,00%
Total Renda Fixa		215.234.561,37	98,47%		
Renda Variável					
Artigo 8º II, Alínea a - 4604	Fundos de Ações	3.335.824,79	1,53%	2,00%	20,00%
Total Renda Variável		3.335.824,79	1,53%		

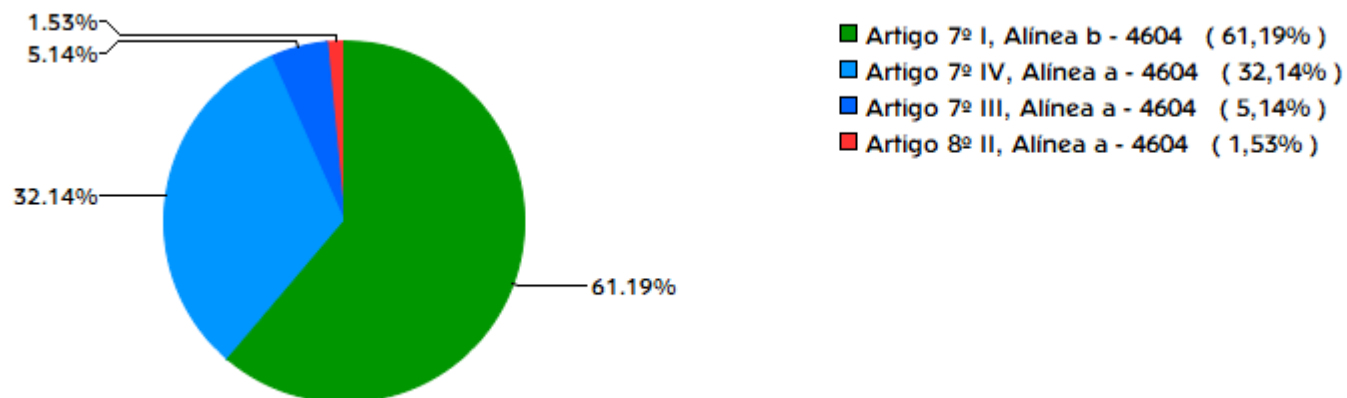
Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)				
Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
Artigo 7º I, Alínea b - 4604 % do CDI	-0,15 -29,7	1,73 54,3	-- --	-- --
Artigo 7º III, Alínea a - 4604 % do CDI	-1,22 -236,5	-1,61 -50,8	-- --	-- --
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 % do CDI	0,50 96,7	3,10 97,7	-- --	-- --
Artigo 8º II, Alínea a - 4604 Var. IBOVESPA p.p	-3,93 1,3	-8,77 -4,0	-- --	-- --

Ganhos Financeiros	
Estratégia	No Mês(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b - 4604	-181.358,77
Artigo 7º III, Alínea a - 4604	-139.342,20
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604	347.851,94
Artigo 8º II, Alínea a - 4604	-136.306,81
Total	-109.155,84

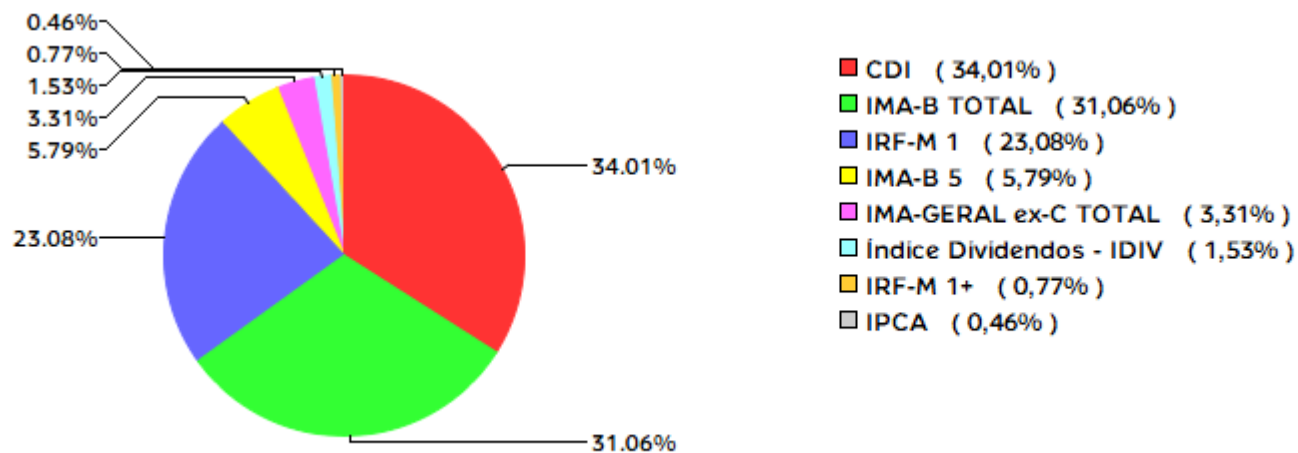
Análise da Disponibilidade Financeira				
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acum. Bruto (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	211.558.890,87	97	211.558.890,87	97
de 31 a 364 dias	2.714.274,18	1	214.273.165,05	98
acima de 365 dias	4.297.221,11	2	218.570.386,16	100

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia

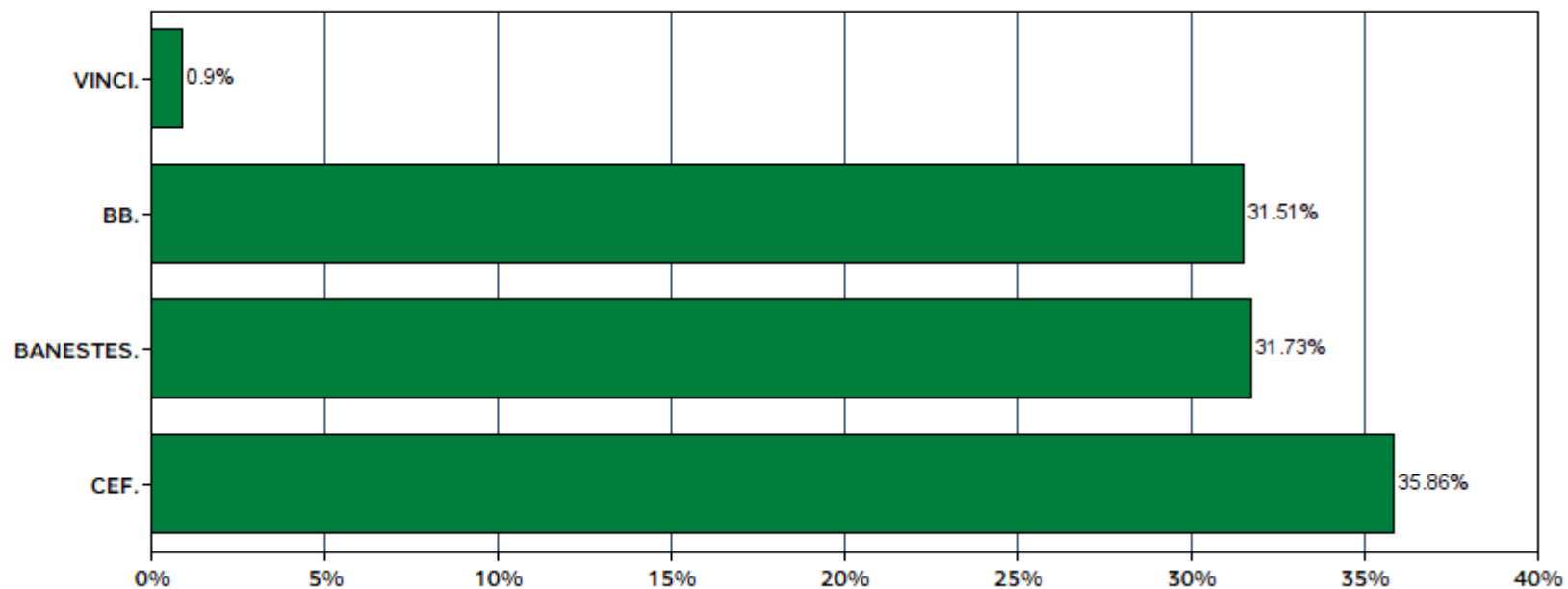


Indexadores



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor

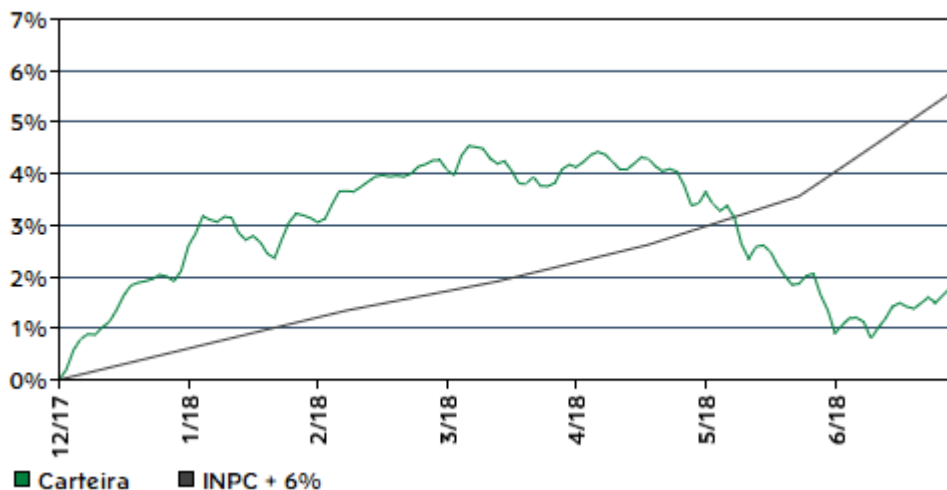


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

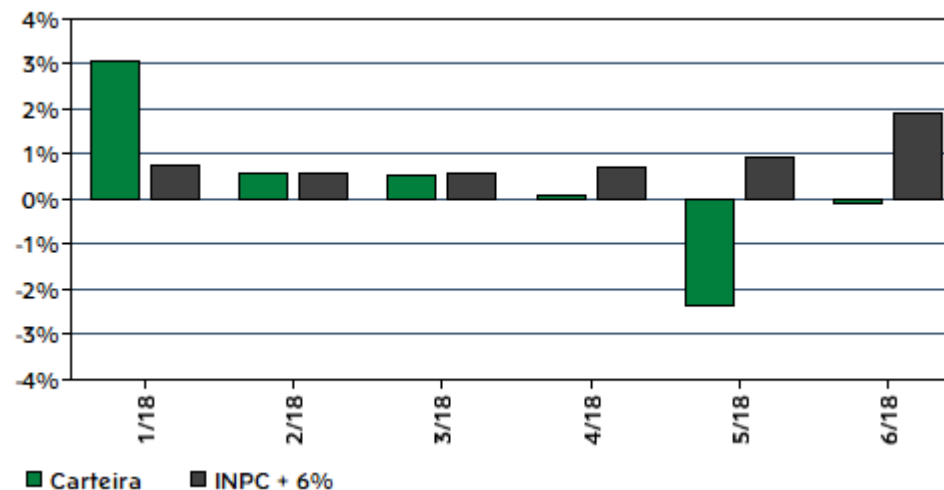
Rentabilidades da Carteira

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
2018	3,06	0,58	0,52	0,09	-2,33	-0,08	-	-	-	-	-	-	1,78
INPC + 6%	0,74	0,60	0,56	0,70	0,92	1,92	-	-	-	-	-	-	5,55
p.p. Indx	2,32	-0,02	-0,04	-0,60	-3,25	-2,01	-	-	-	-	-	-	-3,78

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	16,7%
Meses abaixo do Benchmark	5	83,3%

	Rentab.	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	3,06%	jan/18
Menor rentabilidade da Carteira	-2,33%	mai/18

Período	Rentabilidade (%)			Volat. Anual
	Carteira	INPC + 6%	p.p. Indx.	
03 meses	-2,32	3,58	-5,9	2,823
06 meses	1,78	5,55	-3,8	2,790
12 meses	--	--	--	--
24 meses	--	--	--	--
36 meses	--	--	--	--
Desde o início	1,78	5,55	-3,8	2,790

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 IMA-B 5 FIC RF PREVIDENCIÁRIO LP % do Var. IMA-B 5 p.p.	0,43 -0,02	2,70 -0,11	-0,74 -0,05	2,70 -0,11	9,53 -0,20	22,39 -0,42	42,63 -0,98
BANESTES FI PREVIDENCIÁRIO RF % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,29 -0,97	-1,72 -2,88	-6,85 -3,25	-1,72 -2,88	4,97 -3,23	18,47 -4,14	38,18 -4,94
BB IDKA 2 TP FI RF PREV % do % do CDI	0,29 55,59	3,16 99,67	0,13 8,19	3,16 99,67	9,69 131,55	22,95 108,34	43,31 113,22
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,50 -0,05	2,94 -0,14	1,17 -0,09	2,94 -0,14	7,55 -0,25	21,72 -0,60	39,56 -1,06
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FCFI % do Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,19 0,09	2,55 0,26	-0,93 0,13	2,55 0,26	8,41 0,15	-- --	-- --
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,35 -0,03	1,04 -0,12	-3,65 -0,05	1,04 -0,12	7,91 -0,29	22,07 -0,54	41,89 -1,24
BB PREVIDENCIÁRIO RF TIT PUB X FI % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,14 0,46	2,43 1,27	-2,08 1,52	2,43 1,27	9,77 1,58	24,23 1,61	-- --
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,13 1,45	1,50 0,34	2,36 5,97	1,50 0,34	3,17 -5,02	8,87 -13,74	19,43 -23,69

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
CAIXA BRASIL IDKa IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RJ LP % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,21 0,53	3,27 2,11	0,20 3,80	3,27 2,11	9,73 1,53	23,00 0,39	43,59 0,46
CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP RF LP % do Var. IMA-B 5 p.p.	0,42 -0,03	2,68 -0,13	-0,77 -0,07	2,68 -0,13	9,48 -0,25	22,32 -0,48	42,41 -1,20
CAIXA FI BRASIL IMAB TP RF LP % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,36 -0,04	1,03 -0,13	-3,68 -0,07	1,03 -0,13	7,92 -0,27	22,14 -0,47	40,72 -2,40
CAIXA FI BRASIL IRF M 1+ TP RF LP % do Var. IRF-M 1+ p.p.	-0,15 -0,00	2,00 -0,07	-2,56 -0,23	2,00 -0,07	8,88 -0,40	28,46 -0,64	51,26 -0,64
CAIXA FI BRASIL IRFM 1 TP RF % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,50 -0,05	2,95 -0,12	1,18 -0,07	2,95 -0,12	7,60 -0,21	21,87 -0,45	39,92 -0,70
FUNDO DE INVESTIMENTO BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS-RENDA FIXA % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,29 -0,25	3,22 0,14	0,72 -0,54	3,22 0,14	8,49 0,68	23,29 0,97	41,77 1,15
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,10 0,42	0,90 -0,26	0,21 3,82	0,90 -0,26	5,01 -3,19	12,01 -10,60	-- --
FI BANESTES INSTITUCIONAL RF % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	-1,22 -0,90	-1,61 -2,77	-6,66 -3,05	-1,61 -2,77	5,33 -2,87	19,80 -2,81	39,35 -3,77
BB RPPS RF PERFIL FIC % do % do CDI	0,50 96,82	3,15 99,04	1,53 98,30	3,15 99,04	7,41 100,62	21,42 101,13	38,33 100,18
CAIXA FI BRASIL REF DI LP % do % do CDI	0,50 96,79	3,07 96,80	1,52 97,32	3,07 96,80	7,21 97,79	21,04 99,31	38,16 99,74
CAIXA FI BRASIL TP RF LP % do % do CDI	0,49 94,32	3,02 95,20	1,46 93,41	3,02 95,20	7,22 98,06	20,87 98,51	37,68 98,49
CAIXA FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF % do Var. IPCA p.p.	0,45 -0,81	2,45 -0,16	-0,40 -2,29	2,45 -0,16	8,12 3,73	-- --	-- --
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP % do % do CDI	0,50 97,47	3,16 99,48	1,54 98,73	3,16 99,48	7,23 98,15	21,57 101,84	38,04 99,42
BANESTES FIC DE FI ACOES BTG ABSOL. INST % do Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-1,82 2,51	-2,72 4,14	-11,55 4,06	-2,72 4,14	13,69 4,84	18,34 -30,44	25,41 -17,38
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALAOR DIVIDENDOS RPPS % do Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-5,34 -1,01	-10,19 -3,33	-15,87 -0,26	-10,19 -3,33	2,90 -5,95	13,47 -35,31	16,86 -25,92

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	0,52	3,18	1,56	3,18	7,37	21,18	38,26
IBOVESPA	-5,20	-4,76	-14,76	-4,76	15,68	41,22	37,08
DOLAR COMERCIAL	3,18	16,56	16,01	16,56	16,55	20,13	24,28
INPC + 6%	1,92	5,55	3,58	5,55	9,66	19,19	38,33
IPCA + 6%	1,75	5,59	3,38	5,59	10,58	20,70	39,26