

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos											
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	VAR	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (28/09/2018)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
Renda Fixa											
Artigo 7º I, Alínea b - 4604 - Fundos 100% Títulos Públicos - Referenciado											
BANESTES	BANESTES	BANESTES PREVIDENCIARIO FI RF REF IMA-B	6,91%	0,71	-0,52%	-0,37%	0,10%	11.283.193,46	5,01%	179.080.776,13	6,30%
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,52%	0,08	0,59%	-0,02%	2,19%	10.635.803,98	4,72%	12.769.780.117,05	0,08%
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF IMA-B TP	4,86%	0,51	-0,16%	-0,01%	2,71%	11.344.719,59	5,03%	3.646.686.495,81	0,31%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IMAB TP FI RF LP	4,88%	0,52	-0,18%	-0,03%	2,69%	20.189.447,68	8,96%	3.081.131.095,61	0,66%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IRFM 1 TP FI RF	0,52%	0,08	0,59%	-0,02%	2,21%	23.706.788,85	10,52%	19.832.435.937,17	0,12%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP FI RF LP	2,90%	0,32	0,86%	-0,03%	2,82%	7.711.772,43	3,42%	8.106.459.151,64	0,10%
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI	4,05%	0,44	0,56%	0,71%	4,43%	3.474.576,48	1,54%	487.249.998,09	0,71%
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF ALOCACAO ATIVA FICFI	2,60%	0,29	0,60%	-0,01%	1,56%	8.501.048,57	3,77%	3.381.634.547,73	0,25%
BB	BB	BB IDKA 2 TP FI RF PREV	2,27%	0,26	1,17%	-0,19%	3,97%	5.206.084,40	2,31%	6.551.962.373,55	0,08%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IRF M 1+ TP RF LP	4,33%	0,47	1,42%	-0,15%	3,72%	1.719.692,63	0,76%	1.276.095.342,94	0,13%
CEF	CEF	CAIXA BRASIL IDKa IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RF LP	2,27%	0,26	1,15%	-0,21%	2,85%	7.713.560,37	3,42%	6.494.582.562,75	0,12%
BB	BB	BB IMA-B 5 FIC RF PREVIDENCIÁRIO LP	2,89%	0,32	0,87%	-0,02%	3,92%	5.196.121,40	2,31%	2.433.480.206,62	0,21%
BANESTES	BANESTES	FUNDO DE INVESTIMENTO BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS-RENDA FIXA	1,03%	0,13	0,71%	0,11%	2,21%	17.427.237,60	7,73%	150.898.272,80	11,55%
CEF	CEF	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA	4,42%	0,47	1,22%	1,37%	0,58%	792.940,36	0,35%	964.178.377,16	0,08%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - 4604 - Fundos 100% Títulos Públicos - Referenciado				0,31				134.902.987,80	59,86%		
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Renda Fixa											
BANESTES	BANESTES	FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP	0,05%	0,03	0,44%	94,61%	4,73%	28.828.473,04	12,79%	482.032.132,36	5,98%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL TP RF LP	0,08%	0,03	0,47%	99,64%	4,61%	1.036.514,50	0,46%	3.024.975.787,53	0,03%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL RF REF DI LP	0,04%	0,03	0,44%	94,96%	4,65%	16.311.719,05	7,24%	8.348.473.002,20	0,20%
BANESTES	BANESTES	FI BANESTES INSTITUCIONAL RF	6,09%	0,63	-0,13%	0,02%	-0,14%	11.413.870,13	5,06%	163.913.124,30	6,96%
BB	BB	BB RPPS RF PERFIL FIC	0,07%	0,03	0,49%	105,01%	4,77%	26.861.969,09	11,92%	5.706.167.765,89	0,47%
CEF	CEF	CAIXA BRASIL GESTAO ESTRATEGICA FI RF	1,69%	0,20	0,66%	0,18%	1,27%	1.012.717,44	0,45%	2.463.089.662,35	0,04%
BANESTES	BANESTES	BANESTES ESTRATEGIA FIC DE FI RF	--%	--	0,40%	85,65%	0,99%	1.620.885,47	0,72%	31.416.892,82	5,16%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos											
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	VAR	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (28/09/2018)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Renda Fixa				0,11				87.086.148,72	38,64%		
Sub-total Renda Fixa				0,23				221.989.136,52	98,49%		
Renda Variável											
Artigo 8º II, Alínea a - 4604 - Fundos de Ações											
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	16,86%	1,72	-1,51%	-1,69%	-9,66%	1.981.038,77	0,88%	377.962.784,99	0,52%
BANESTES	BANESTES	BANESTES FIC DE FI ACOES BTG ABSOL. INST	17,60%	1,84	2,18%	2,01%	-5,85%	1.412.259,44	0,63%	15.513.523,52	9,10%
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a - 4604 - Fundos de Ações				1,77				3.393.298,21	1,51%		
Sub-total Renda Variável				1,77				3.393.298,21	1,51%		
Total								225.382.434,73	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 - 4604	Fundos 100% Títulos Públicos - Referenciado	134.902.987,80	59,86%	58,00%	100,00%
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604	Fundos de Renda Fixa	87.086.148,72	38,64%	24,00%	40,00%
Total Renda Fixa		221.989.136,52	98,50%		
Renda Variável					
Artigo 8º II, Alínea a - 4604	Fundos de Ações	3.393.298,21	1,51%	2,00%	20,00%
Total Renda Variável		3.393.298,21	1,51%		

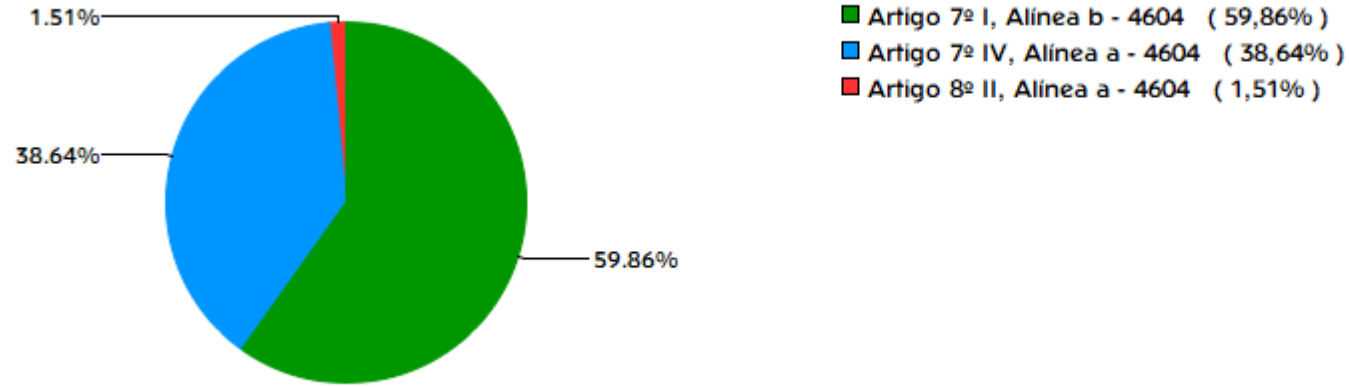
Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)				
Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
Artigo 7º I, Alínea b - 4604 % do CDI	0,43 90,8	3,52 73,1	-- --	-- --
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 % do CDI	0,39 82,2	4,10 85,2	-- --	-- --
Artigo 8º II, Alínea a - 4604 Var. IBOVESPA p.p	-0,01 -3,5	-7,20 -11,0	-- --	-- --

Ganhos Financeiros	
Estratégia	No Mês(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b - 4604	566.906,95
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604	334.376,82
Artigo 8º II, Alínea a - 4604	-309,86
Total	900.973,91

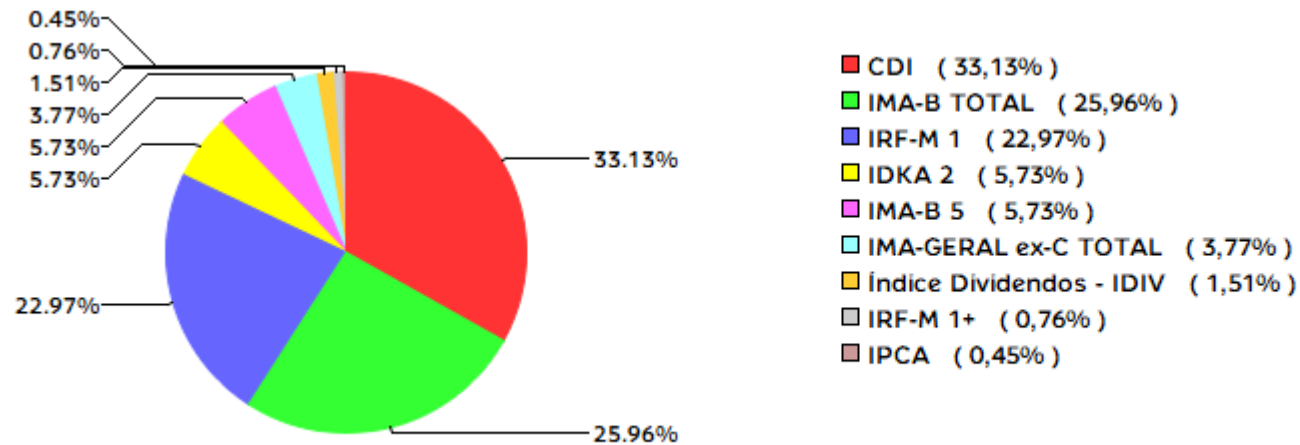
Análise da Disponibilidade Financeira				
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acum. Bruto (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	221.114.917,89	98	221.114.917,89	98
acima de 365 dias	4.267.516,84	2	225.382.434,73	100

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia

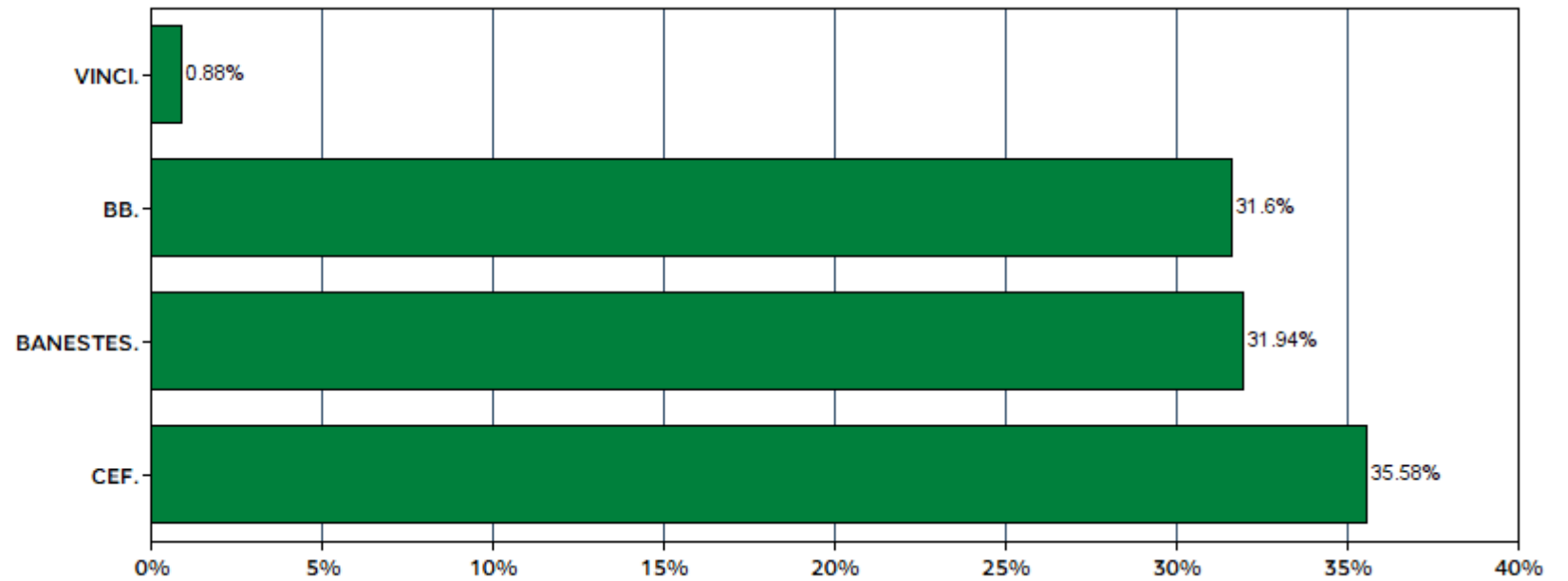


Indexadores



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

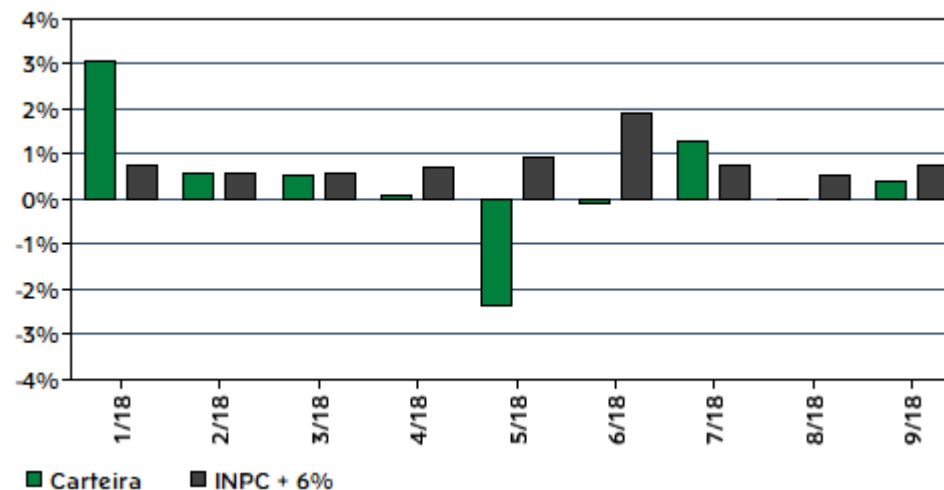
Rentabilidades da Carteira

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	1,29	-0,00	0,40	--	--	--	3,50
INPC + 6%	0,74	0,60	0,56	0,70	0,92	1,92	0,76	0,53	0,74	--	--	--	7,72
p.p. Indx	2,32	-0,02	-0,04	-0,60	-3,25	-2,01	0,53	-0,54	-0,34	--	--	--	-4,22

Evolução da Rentabilidade



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco / Retorno da Carteira

	Qtd.	Perct.
Meses acima do Benchmark	2	22,2%
Meses abaixo do Benchmark	7	77,8%

	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	1,69	2,05	-0,4	1,666
06 meses	-0,67	5,70	-6,4	2,365
12 meses	--	--	--	--
24 meses	--	--	--	--
36 meses	--	--	--	--
Desde o início	3,50	7,72	-4,2	2,464

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.	0,87 -0,02	4,83 -0,15	2,07 -0,04	1,31 -0,09	6,32 -0,21	20,44 -0,42	42,78 -0,84
BANESTES PREVIDENCIARIO FI RF REF IMA-B % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,52 -0,37	0,10 -2,79	1,85 0,15	-5,13 -3,17	-1,06 -3,61	14,72 -4,00	50,30 -2,08
BB IDKA 2 TP FI RF PREV % do Var. IDKA 2 p.p.	1,17 -0,19	5,58 -0,56	2,34 -0,73	2,47 -0,57	7,60 -0,91	21,30 -2,04	43,44 -2,64
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,59 -0,02	4,66 -0,19	1,67 -0,05	2,86 -0,14	6,51 -0,24	19,70 -0,56	37,54 -0,92
BB PREVIDENCIARIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FICFI % do Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,60 -0,01	4,17 0,07	1,58 -0,19	0,63 -0,06	4,99 -0,19	20,00 -1,05	-- --
BB PREVIDENCIARIO RF IMA-B TP % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,16 -0,01	2,71 -0,17	1,66 -0,05	-2,06 -0,09	2,32 -0,23	18,15 -0,57	51,21 -1,17
BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUB X FI % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,56 0,71	4,43 1,55	1,95 0,25	-0,17 1,79	5,14 2,59	21,05 2,33	50,67 -1,71
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RF LP % do Var. IDKA 2 p.p.	1,15 -0,21	5,71 -0,44	2,36 -0,71	2,56 -0,48	7,66 -0,85	21,41 -1,93	43,60 -2,47

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 FI BRASIL IMA B 5 TP FI RF LP % do Var. IMA-B 5 p.p.	0,86 -0,03	4,79 -0,20	2,05 -0,06	1,27 -0,13	6,28 -0,25	20,38 -0,48	42,56 -1,06
CAIXA FI BRASIL IMAB TP FI RF LP % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,18 -0,03	2,69 -0,20	1,64 -0,06	-2,10 -0,13	2,28 -0,27	18,27 -0,45	50,99 -1,39
CAIXA FI BRASIL IRF M 1+ TP RF LP % do Var. IRF-M 1+ p.p.	1,42 -0,15	3,72 -0,27	1,68 -0,19	-0,92 -0,43	4,85 -0,49	24,68 -0,90	58,58 -1,32
CAIXA FI BRASIL IRFM 1 TP FI RF % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,59 -0,02	4,69 -0,15	1,69 -0,03	2,89 -0,10	6,57 -0,18	19,83 -0,42	37,80 -0,66
FUNDO DE INVESTIMENTO BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS-RENDA FIXA % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,71 0,11	5,01 0,17	1,74 0,02	2,47 -0,53	6,85 0,10	21,07 0,81	39,64 1,18
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,22 1,37	0,58 -2,30	-0,32 -2,02	-0,11 1,86	2,20 -0,35	10,31 -8,40	26,84 -25,55
BANESTES ESTRATEGIA FIC DE FI RF % do % do CDI	0,40 85,65	1,11 81,47	-- --	-- --	-- --	-- --	-- --
BB RPPS RF PERFIL FIC % do % do CDI	0,49 105,01	4,77 99,11	1,57 99,27	3,13 98,78	6,69 100,43	19,12 100,73	35,79 99,99
CAIXA BRASIL GESTAO ESTRATEGICA FI RF % do Var. IPCA p.p.	0,66 0,18	4,24 0,90	1,75 1,03	1,35 -1,27	5,79 1,27	-- --	-- --
CAIXA FI BRASIL RF REF DI LP % do % do CDI	0,44 94,96	4,65 96,74	1,53 96,72	3,08 96,99	6,48 97,27	18,78 98,98	35,56 99,36
CAIXA FI BRASIL TP RF LP % do % do CDI	0,47 99,64	4,61 95,72	1,54 96,87	3,02 95,12	6,44 96,65	18,66 98,31	35,41 98,93
FI BANESTES INSTITUCIONAL RF % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,13 0,02	-0,14 -3,02	1,50 -0,21	-5,26 -3,30	-1,02 -3,57	15,52 -3,19	50,36 -2,03
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP % do % do CDI	0,44 94,61	4,73 98,30	1,52 96,04	3,09 97,35	6,49 97,49	19,15 100,92	35,61 99,50
BANESTES FIC DE FI ACOES BTG ABSOL. INST % do Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	2,18 2,01	0,54 4,17	3,36 -0,12	-8,58 4,10	0,61 5,94	19,45 -14,99	43,82 -39,64
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS % do Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-1,51 -1,69	-9,66 -6,04	0,59 -2,89	-15,37 -2,69	-8,54 -3,20	7,63 -26,81	29,40 -54,07

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	0,47	4,81	1,59	3,17	6,66	18,98	35,79
IBOVESPA	3,48	3,85	9,04	-7,06	6,80	35,94	76,09
DOLAR COMERCIAL	-3,18	21,04	3,84	20,46	26,39	23,34	0,78
INPC + 6%	0,74	7,72	2,05	5,70	10,14	18,59	37,21
IPCA + 6%	0,92	7,93	2,22	5,68	10,72	20,29	38,31