

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos											
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	VAR	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (28/02/2018)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
Renda Fixa											
Artigo 7º I, Alínea b - 4604 - Fundos 100% Títulos Públicos - Referenciado											
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF IRF-M TP	4,54%	0,52	1,10%	0,00%	2,40%	5.038.672,23	3,30%	5.033.785.063,57	0,10%
BANESTES	BANESTES	BANESTES FI PREVIDENCIÁRIO RF	10,88%	1,17	0,81%	0,26%	5,51%	3.861.233,16	2,53%	252.382.581,45	1,53%
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,65%	0,10	0,52%	-0,02%	1,11%	16.307.781,67	10,67%	12.566.930.658,11	0,13%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IRFM 1 TP RF	0,64%	0,10	0,53%	-0,01%	1,11%	33.469.726,89	21,89%	17.525.487.466,80	0,19%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP RF LP	3,46%	0,40	0,53%	-0,01%	1,85%	51.178.207,31	33,48%	6.991.874.867,20	0,73%
CEF	CEF	CAIXA BRASIL IDKa IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RJ LP	2,64%	0,32	0,57%	0,02%	1,53%	8.279.110,45	5,42%	4.475.500.473,21	0,18%
BB	BB	BB PREVID RF IMA-B 5 LP FIC DE FI	3,47%	0,40	0,52%	-0,02%	1,84%	22.503.847,54	14,72%	2.178.485.001,44	1,03%
BANESTES	BANESTES	FUNDO DE INVESTIMENTO BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS-RENDA FIXA	2,02%	0,25	0,78%	0,24%	1,50%	773.682,36	0,51%	106.874.048,30	0,72%
CEF	CEF	FI BRASIL 2018 III TP RF	4,22%	0,45	-2,43%	-2,98%	-1,41%	2.389.394,00	1,56%	144.677.812,28	1,65%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - 4604 - Fundos 100% Títulos Públicos - Referenciado				0,32				143.801.655,61	94,07%		
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Renda Fixa											
BB	BB	BB RPPS RF PERFIL FIC	0,12%	0,05	0,47%	100,40%	1,04%	956.518,10	0,63%	4.019.607.676,83	0,02%
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Renda Fixa				0,05				956.518,10	0,63%		
Artigo 7º VII, Alínea b - 4604 - Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"											
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IPCA XVI RF CRED PRIV	1,26%	0,17	0,42%	-0,32%	1,41%	2.112.477,00	1,38%	230.688.357,94	0,92%
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b - 4604 - Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"				0,17				2.112.477,00	1,38%		
Sub-total Renda Fixa				0,32				146.870.650,71	96,07%		
Renda Variável											
Artigo 8º II, Alínea a - 4604 - Fundos de Ações											
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALAOR DIVIDENDOS RPPS	17,80%	1,92	0,34%	0,94%	6,07%	2.855.426,51	1,87%	370.078.348,45	0,77%
BANESTES	BANESTES	BANESTES FIC DE FI ACOES BTG ABSOL. INST	16,28%	1,78	0,20%	0,81%	7,94%	1.570.307,18	1,03%	10.514.019,96	14,94%
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a - 4604 - Fundos de Ações				1,87				4.425.733,69	2,90%		
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604 - Fundos de Investimentos Imobiliários											

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Posição de Ativos											
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	VAR	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (28/02/2018)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
CEF i	CEF i	CXCE11B	0,00%	0,00	2,78%	2,26%	4,10%	997.980,00	0,65%	0,00	0,00%
RIO BRAVO	RIO BRAVO	RBRD11	0,00%	0,00	4,34%	3,82%	5,63%	576.917,92	0,38%	139.439.297,89	0,41%
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b - 4604 - Fundos de Investimentos Imobiliários				0,00				1.574.897,92	1,03%		
Sub-total Renda Variável				1,38				6.000.631,61	3,93%		
Total								152.871.282,32	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	143.801.655,61	94,07%	0,00%	100,00%
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604	Fundos de Renda Fixa	956.518,10	0,63%	0,00%	40,00%
Artigo 7º VII, Alínea b - 4604	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	2.112.477,00	1,38%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa		146.870.650,71	96,08%		
Renda Variável					
Artigo 8º II, Alínea a - 4604	Fundos de Ações	4.425.733,69	2,90%	0,00%	20,00%
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604	Fundos de Investimentos Imobiliários	1.574.897,92	1,03%	0,00%	5,00%
Total Renda Variável		6.000.631,61	3,93%		

Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)				
Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
Artigo 7º I, Alínea b - 4604 % do CDI	0,56 119,4	1,67 159,2	6,90 76,9	-- --
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 % do CDI	0,47 100,4	1,04 99,0	-- --	-- --
Artigo 7º VII, Alínea b - 4604 % do CDI	0,42 90,4	1,41 134,3	-- --	-- --
Artigo 8º II, Alínea a - 4604 Var. IBOVESPA p.p	0,29 -0,2	8,10 -3,6	20,51 -7,5	-- --
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604 Var. IBOVESPA p.p	3,35 2,8	4,66 -7,1	-- --	-- --

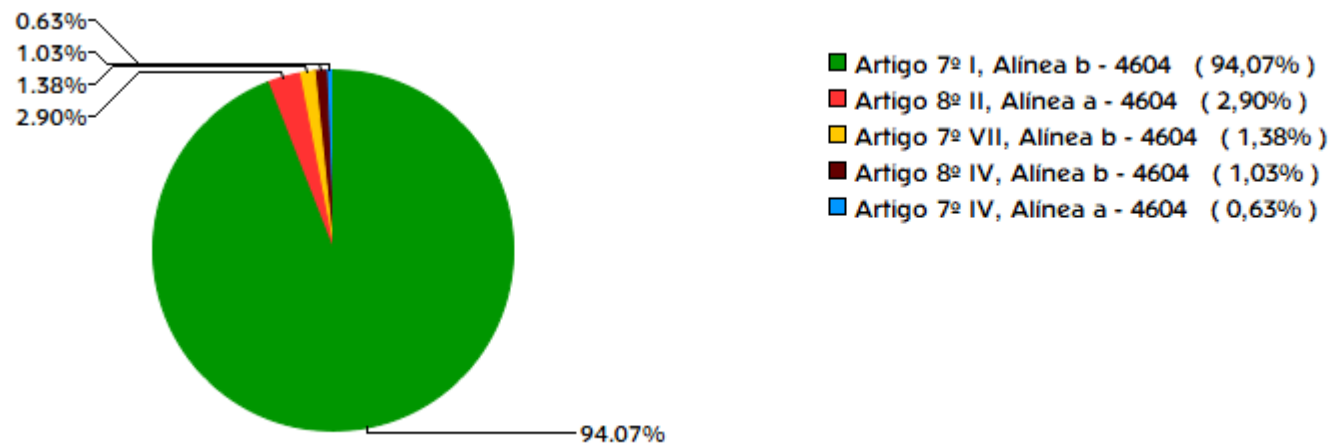
Ganhos Financeiros	
Estratégia	No Mês(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b - 4604	796.590,22
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604	4.452,97
Artigo 8º II, Alínea a - 4604	12.798,60
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604	51.047,76
Total	864.889,56

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS****Análise da Disponibilidade Financeira**

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acum. Bruto (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	150.758.805,32	99	150.758.805,32	99
de 31 a 364 dias	2.112.477,00	1	152.871.282,32	100

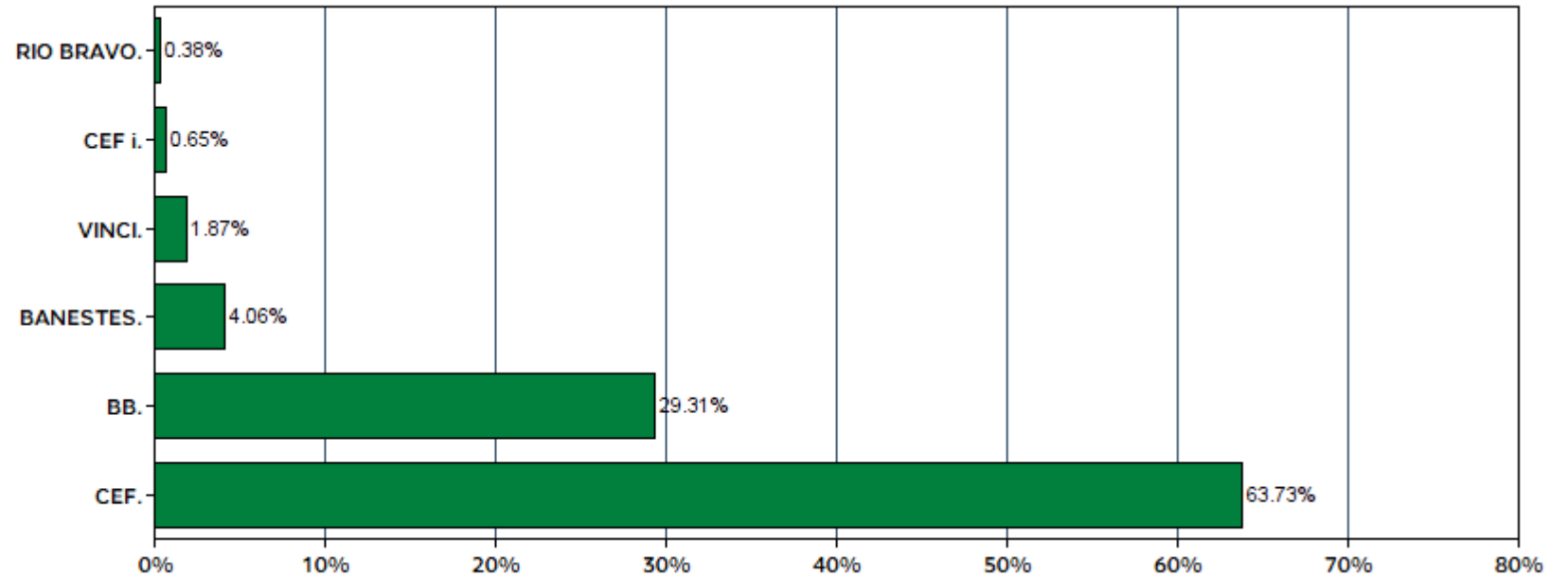
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

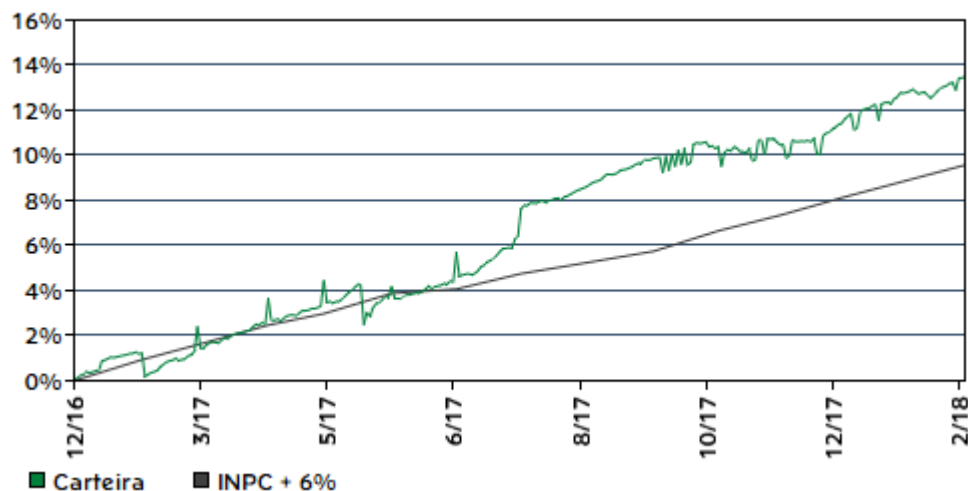
Alocação por Gestor



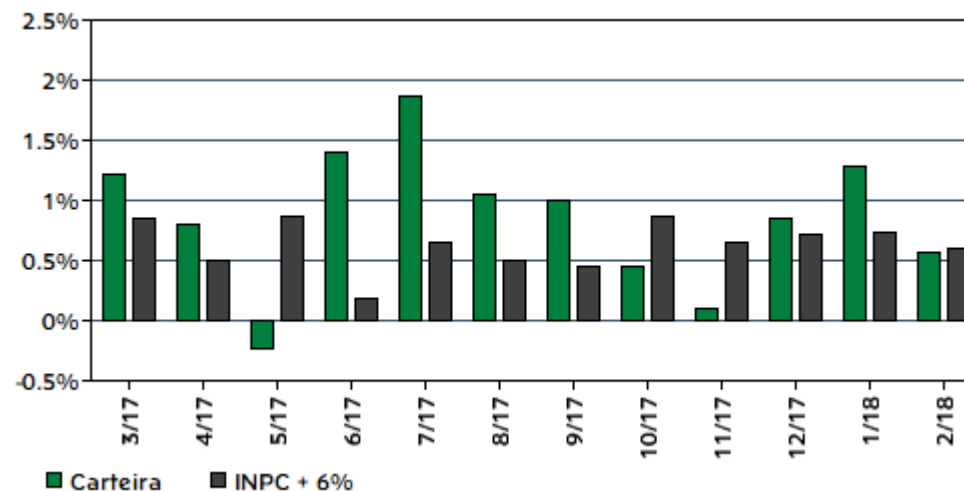
**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Rentabilidades da Carteira													
Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
2017	1,21	1,17	1,22	0,80	-0,24	1,39	1,86	1,05	1,01	0,45	0,10	0,85	11,41
INPC + 6%	0,93	0,66	0,85	0,50	0,87	0,19	0,66	0,50	0,44	0,86	0,64	0,72	8,12
p.p. Indx	0,28	0,51	0,36	0,30	-1,11	1,21	1,20	0,55	0,56	-0,41	-0,54	0,13	3,30
2018	1,28	0,57	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	1,86
INPC + 6%	0,74	0,60	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	1,34
p.p. Indx	0,54	-0,02	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	0,52

**Evolução da Rentabilidade**



**Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses**



**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Análise de Risco / Retorno da Carteira**

	Qtd.	Perct.
Meses acima do Benchmark	10	71,4%
Meses abaixo do Benchmark	4	28,6%

	Rentab.	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,86%	jul/17
Menor rentabilidade da Carteira	-0,24%	mai/17

Período	Rentabilidade (%)			Volat. Anual
	Carteira	INPC + 6%	p.p. Indx.	
03 meses	2,73	2,08	0,7	3,994
06 meses	4,34	4,08	0,3	4,722
12 meses	10,83	7,85	3,0	5,033
24 meses	--	--	--	--
36 meses	--	--	--	--
Desde o início	13,49	9,57	3,9	4,796

**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 PREVID RF IMA-B 5 LP FIC DE FI % do Var. IMA-B 5 p.p.	0,52 -0,02	1,84 -0,04	2,72 -0,06	4,31 -0,12	11,55 -0,17	26,29 -0,39	46,97 -1,07
BANESTES FI PREVIDENCIÁRIO RF % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,81 0,26	5,51 1,55	6,14 1,31	6,84 1,33	10,31 -0,54	43,68 3,24	59,14 5,43
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,52 -0,02	1,11 -0,02	1,68 -0,03	3,63 -0,11	9,62 -0,23	24,91 -0,57	42,04 -1,05
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M TP % do Var. IRF-M TOTAL p.p.	1,10 0,00	2,40 -0,01	3,66 -0,03	5,32 -0,11	12,77 -0,30	38,94 -0,51	51,72 -1,03
CAIXA BRASIL IDKa IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RJ LP % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,57 0,02	1,53 -2,44	2,41 -2,42	4,33 -1,18	11,41 0,56	25,72 -14,73	46,88 -6,83
CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP RF LP % do Var. IMA-B 5 p.p.	0,53 -0,01	1,85 -0,03	2,73 -0,05	4,32 -0,10	11,52 -0,20	26,20 -0,48	46,80 -1,24
CAIXA FI BRASIL IRFM 1 TP RF % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,53 -0,01	1,11 -0,03	1,68 -0,03	3,65 -0,09	9,68 -0,17	25,09 -0,39	42,39 -0,70
FI BRASIL 2018 III TP RF % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	-2,43 -2,98	-1,41 -5,38	-1,07 -5,90	0,63 -4,88	3,65 -7,20	10,06 -30,39	-- --



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise dos Fundos &amp; Ativos da Carteira

## Rentabilidades em Períodos Fechados (%)

Fundo / Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
FUNDO DE INVESTIMENTO BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS-RENDA FIXA % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,78 0,24	1,50 0,36	2,28 0,57	4,25 0,51	10,30 0,46	27,33 1,86	44,69 1,59
BB RPPS RF PERFIL FIC % do % do CDI	0,47 100,40	1,04 99,00	1,63 102,08	3,56 101,94	9,05 100,86	24,14 100,18	41,20 100,61
CAIXA FI BRASIL IPCA XVI RF CRED PRIV % do Var. IPCA + 6% p.p.	0,42 -0,32	1,41 -0,13	1,83 -0,64	3,51 -1,30	8,92 -0,02	23,58 2,61	-- --
BANESTES FIC DE FI ACOES BTG ABSOL. INST % do Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	0,20 0,81	7,94 -1,27	13,26 -1,36	13,63 -0,21	26,18 8,41	55,13 -69,35	46,77 -16,06
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALAOR DIVIDENDOS RPPS % do Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	0,34 0,94	6,07 -3,14	11,62 -2,99	12,17 -1,68	18,24 0,47	42,73 -81,75	38,51 -24,33
CXCE11B % do Var. IBOVESPA p.p.	2,78 2,26	4,10 -7,61	2,74 -15,86	10,34 -10,16	-- --	-- --	-- --
RBRD11 % do Var. IBOVESPA p.p.	4,34 3,82	5,63 -6,08	7,05 -11,55	3,72 -16,77	-- --	-- --	-- --
CDI	0,47	1,05	1,60	3,49	8,97	24,10	40,95
IBOVESPA	0,52	11,72	18,60	20,50	28,04	99,46	65,47
DOLAR COMERCIAL	2,61	-1,91	-0,51	3,11	4,70	-18,46	12,74
INPC + 6%	0,60	1,34	2,08	4,08	7,85	19,68	40,85
IPCA + 6%	0,74	1,55	2,47	4,82	8,94	20,97	41,44