

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos											
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	VAR	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (31/08/2018)	% 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	3,07%	0,34	-0,96%	-0,03%	2,79%	5.057.435,72	3,31%	5.061.058.278,04	0,10%
BANESTES	BANESTES	BANESTES FI PREVIDENCIÁRIO RF	6,85%	0,72	-0,84%	-0,40%	0,62%	3.681.946,57	2,41%	191.758.854,33	1,92%
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,52%	0,08	0,40%	-0,04%	4,04%	15.992.876,52	10,47%	12.924.978.431,45	0,12%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IRFM 1 TP RF	0,51%	0,08	0,41%	-0,03%	4,08%	53.973.601,09	35,35%	19.599.360.376,27	0,28%
CEF	CEF	CAIXA BRASIL IDKa IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RJ LP	2,23%	0,26	0,01%	0,45%	4,50%	8.521.749,33	5,58%	6.077.575.260,09	0,14%
BANESTES	BANESTES	FUNDO DE INVESTIMENTO BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS-RENDA FIXA	1,03%	0,13	0,21%	-0,23%	4,27%	794.803,49	0,52%	139.234.796,30	0,57%
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF ALOCACAO ATIVA FCFI	2,63%	0,30	-0,39%	-0,15%	0,96%	10.894.655,56	7,13%	3.270.782.760,92	0,33%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - 4604 - Fundos 100% Títulos Públicos - Referenciado				0,16				98.917.068,28	64,78%		
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Renda Fixa											
CEF	CEF	CAIXA FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	1,68%	0,20	0,14%	0,23%	1,51%	33.991.049,70	22,26%	2.363.020.349,90	1,44%
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Renda Fixa				0,20				33.991.049,70	22,26%		
Artigo 7º VII, Alínea b - 4604 - Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"											
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IPCA XVI RF CRED PRIV	2,01%	0,23	0,00%	-0,44%	3,02%	2.145.933,00	1,41%	153.404.150,05	1,40%
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b - 4604 - Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"				0,23				2.145.933,00	1,41%		
Sub-total Renda Fixa				0,17				135.054.050,98	88,44%		
Renda Variável											
Artigo 8º I, Alínea a - 4604 - Fundos de Ações Referenciados											
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO ACOES GOVERNANCA FI	18,29%	1,91	-1,92%	-0,31%	-1,92%	4.904.065,39	3,21%	261.257.715,45	1,88%
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a - 4604 - Fundos de Ações Referenciados				1,91				4.904.065,39	3,21%		
Artigo 8º II, Alínea a - 4604 - Fundos de Ações											
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALAOR DIVIDENDOS RPPS	16,84%	1,74	-2,66%	1,04%	-8,28%	2.469.260,45	1,62%	390.818.623,10	0,63%
BANESTES	BANESTES	BANESTES FIC DE FI ACOES BTG ABSOL. INST	16,98%	1,78	-4,57%	-0,87%	-1,60%	1.431.459,08	0,94%	15.300.087,72	9,36%
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO ACOES VALOR FC FIA	--%	--	-1,86%	-0,26%	-1,86%	4.906.807,11	3,21%	27.441.037,04	17,88%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos											
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	VAR	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (31/08/2018)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a - 4604 - Fundos de Ações				0,78				8.807.526,64	5,77%		
Artigo 8º III - 4604 - Fundos Multimercados											
CEF	CEF	FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES MULTIMERCADO	0,00%	0,00	0,90%	0,05%	0,90%	2.504.342,82	1,64%	437.336.034,99	0,57%
Sub-total Artigo 8º III - 4604 - Fundos Multimercados				0,00				2.504.342,82	1,64%		
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604 - Fundos de Investimentos Imobiliários											
CEF i	CEF i	CXCE11B	0,00%	0,00	-10,46%	-7,25%	-10,73%	855.820,00	0,56%	0,00	0,00%
RIO BRAVO	RIO BRAVO	RBRD11	0,00%	0,00	1,22%	4,43%	5,81%	577.862,36	0,38%	0,00	0,00%
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b - 4604 - Fundos de Investimentos Imobiliários				0,00				1.433.682,36	0,94%		
Sub-total Renda Variável				0,92				17.649.617,21	11,56%		
Total								152.703.668,19	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	98.917.068,28	64,78%	94,23%	100,00%
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604	Fundos de Renda Fixa	33.991.049,70	22,26%	0,00%	40,00%
Artigo 7º VII, Alínea b - 4604	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	2.145.933,00	1,41%	1,38%	5,00%
	Total Renda Fixa	135.054.050,98	88,45%		
Renda Variável					
Artigo 8º I, Alínea a - 4604	Fundos de Ações Referenciados	4.904.065,39	3,21%	0,00%	30,00%
Artigo 8º II, Alínea a - 4604	Fundos de Ações	8.807.526,64	5,77%	2,86%	20,00%
Artigo 8º III - 4604	Fundos Multimercados	2.504.342,82	1,64%	0,00%	10,00%
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604	Fundos de Investimentos Imobiliários	1.433.682,36	0,94%	0,91%	5,00%
	Total Renda Variável	17.649.617,21	11,56%		

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)				
Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
Artigo 7º I, Alínea b - 4604 % do CDI	0,20 34,5	3,83 88,5	5,98 87,4	-- --
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 % do CDI	0,14 24,7	4,06 94,0	-- --	-- --
Artigo 7º VII, Alínea b - 4604 % do CDI	0,00 0,7	3,02 69,8	-- --	-- --
Artigo 8º I, Alínea a - 4604 Var. IBOVESPA p.p	-1,92 -0,3	-1,92 -0,3	-- --	-- --
Artigo 8º II, Alínea a - 4604 Var. IBOVESPA p.p	-3,68 -0,5	-5,03 -5,4	0,42 -7,8	-- --
Artigo 8º III - 4604 Var. IBOVESPA p.p	0,90 0,1	0,90 0,1	-- --	-- --
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604 Var. IBOVESPA p.p	0,00 3,2	-6,58 -6,9	-- --	-- --

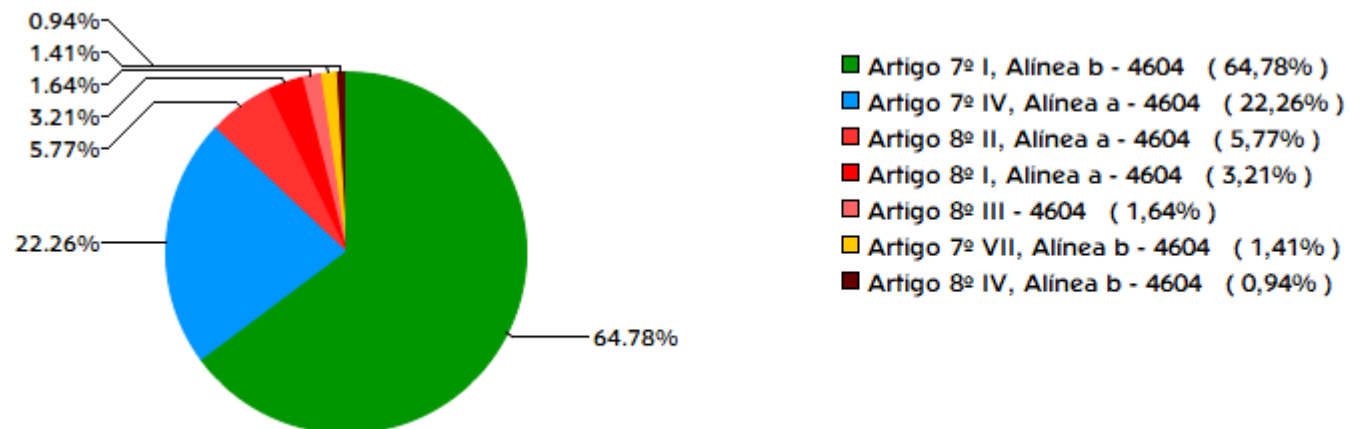
Ganhos Financeiros	
Estratégia	No Mês(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b - 4604	234.577,25
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604	34.956,10
Artigo 8º I, Alínea a - 4604	-95.934,61
Artigo 8º II, Alínea a - 4604	-229.153,79
Artigo 8º III - 4604	22.433,60
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604	-93.031,62
Total	-126.153,06

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

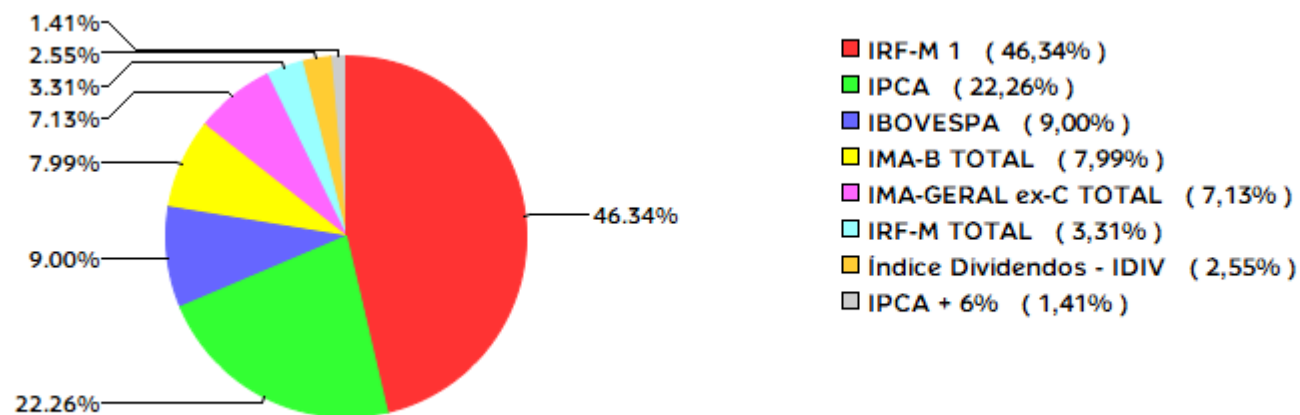
Análise da Disponibilidade Financeira				
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acum. Bruto (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	150.199.325,37	98	150.199.325,37	98
acima de 365 dias	2.504.342,82	2	152.703.668,19	100

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia

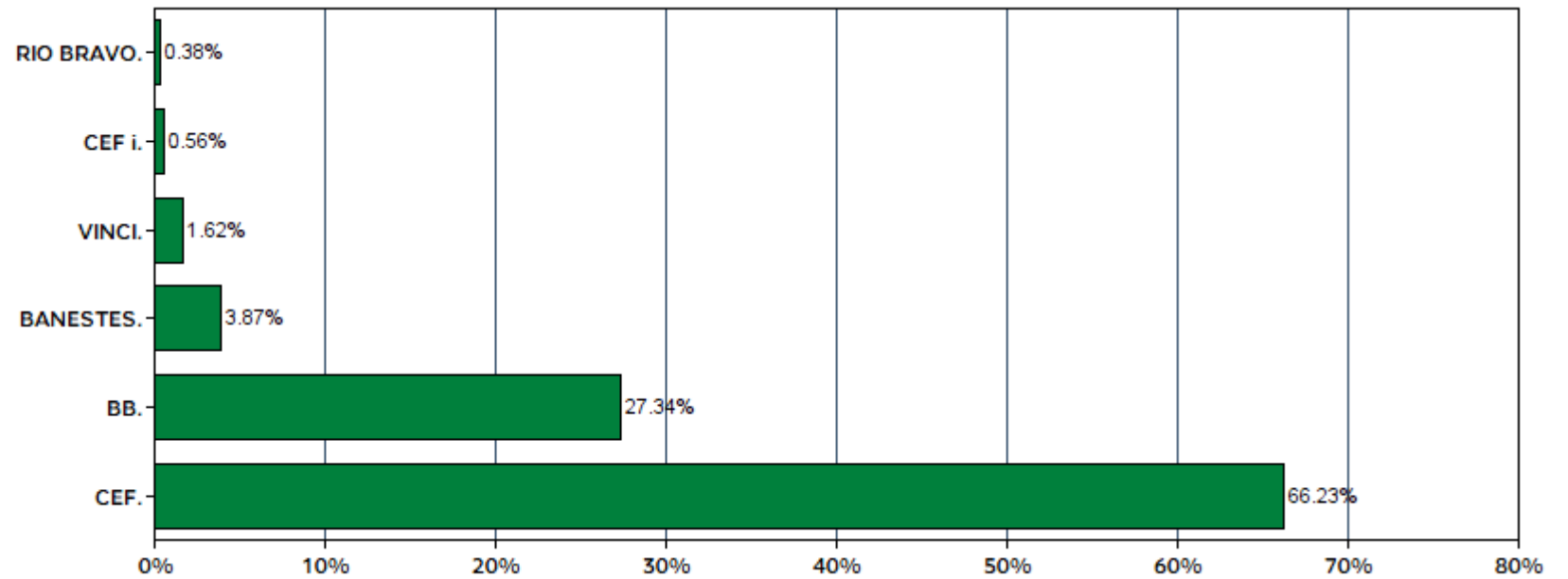


Indexadores



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

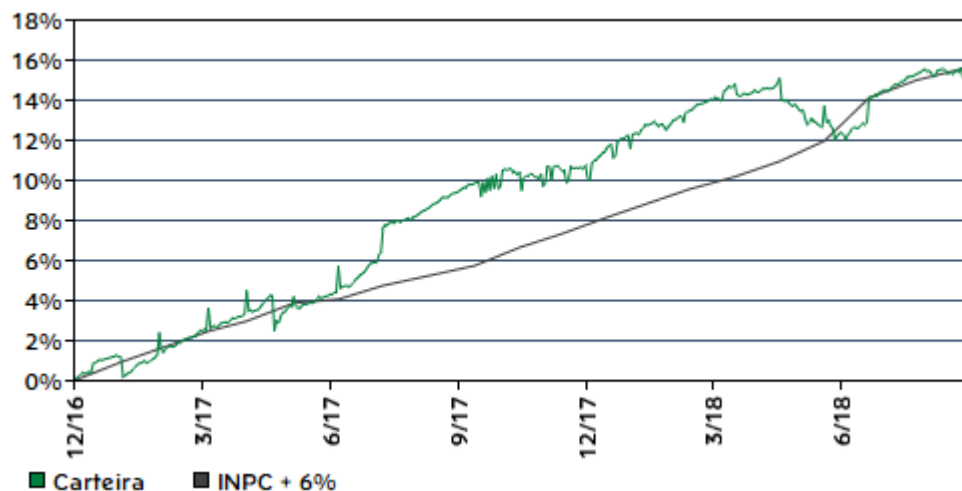
Alocação por Gestor



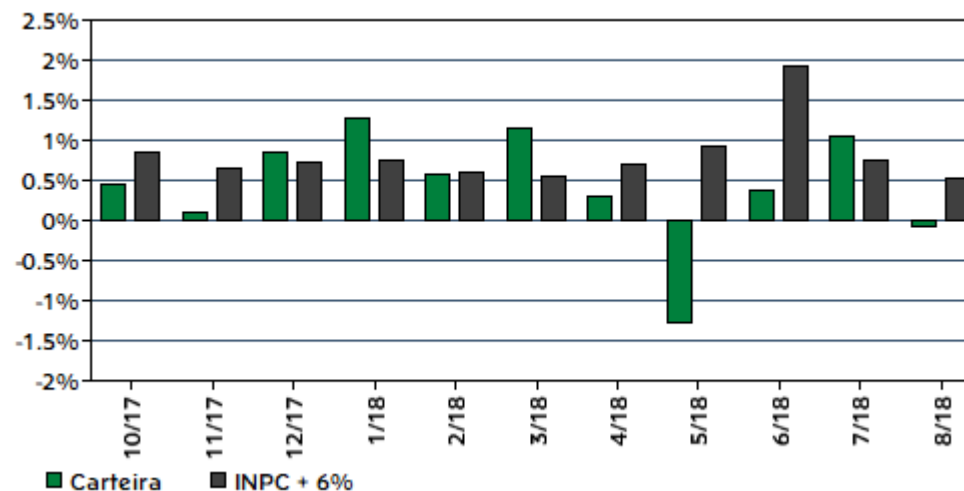
**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Rentabilidades da Carteira													
Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
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	1,16	0,30	-1,29	0,37	1,06	-0,07	-	-	-	-	3,40
INPC + 6%	0,74	0,60	0,56	0,70	0,92	1,92	0,76	0,53	-	-	-	-	6,92
p.p. Indx	0,54	-0,02	0,60	-0,40	-2,21	-1,55	0,30	-0,61	-	-	-	-	-3,53

**Evolução da Rentabilidade**



**Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses**





EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco / Retorno da Carteira

	Qtd.	Perct.	Período	Rentabilidade (%)			Volat. Anual
				Carteira	INPC + 6%	p.p. Indx.	
Meses acima do Benchmark	12	60,0%	03 meses	1,36	3,25	-1,9	3,541
Meses abaixo do Benchmark	8	40,0%	06 meses	1,51	5,51	-4,0	3,207
			12 meses	5,91	9,81	-3,9	4,017
			24 meses	--	--	--	--
			36 meses	--	--	--	--
			Desde o início	15,20	15,60	-0,4	4,374

	Rentab.	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,86%	jul/17
Menor rentabilidade da Carteira	-1,29%	mai/18

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.	-0,84 -0,40	0,62 -2,42	1,06 -0,47	-4,64 -3,75	1,88 -2,68	17,14 -3,63	47,42 -4,15
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,40 -0,04	4,04 -0,17	1,58 -0,08	2,90 -0,14	6,64 -0,26	20,37 -0,59	37,95 -1,00
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FCFI % do Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	-0,39 -0,15	3,55 0,08	1,17 -0,09	1,03 -0,00	5,73 -0,17	21,15 -1,08	-- --
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M TP % do Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,96 -0,03	2,79 -0,12	0,53 -0,05	0,37 -0,11	5,71 -0,22	24,46 -0,54	47,48 -0,92
CAIXA BRASIL IDKa IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RJ LP % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,01 0,45	4,50 1,46	1,41 -0,13	2,93 3,83	7,39 2,82	21,63 0,86	43,25 -8,31
CAIXA FI BRASIL IRFM 1 TP RF % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,41 -0,03	4,08 -0,14	1,59 -0,06	2,94 -0,10	6,70 -0,20	20,53 -0,43	38,30 -0,65
FI BRASIL 2018 III TP RF % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,34 0,38	2,35 -1,12	-- --	-- --	-- --	-- --	-- --
FUNDO DE INVESTIMENTO BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS-RENDA FIXA % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,21 -0,23	4,27 0,05	1,31 -0,34	2,73 -0,31	7,10 0,20	21,83 0,88	40,04 1,09

## 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
CAIXA FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF % do Var. IPCA p.p.	0,14 0,23	3,56 0,71	1,54 0,04	1,87 -0,35	5,95 1,76	-- --	-- --
CAIXA FI BRASIL IPCA XVI RF CRED PRIV % do Var. IPCA + 6% p.p.	0,00 -0,44	3,02 -3,93	1,37 -1,69	1,58 -3,74	5,15 -5,24	16,21 -3,66	38,23 -0,23
BB PREVIDENCIARIO ACOES GOVERNANCA FI % do Var. IBOVESPA p.p.	-3,26 -0,05	-3,03 -3,39	0,09 0,19	-10,00 0,17	2,71 -5,54	25,87 -6,56	51,86 -12,60
BANESTES FIC DE FI ACOES BTG ABSOL. INST % do Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-4,57 -0,87	-1,60 2,19	-0,69 0,48	-8,84 3,06	3,58 3,29	15,17 -18,67	37,38 -34,44
BB PREVIDENCIARIO ACOES VALOR FC FIA % do Var. IBOVESPA p.p.	-1,90 1,31	-14,85 -4,50	-3,73 -3,63	-14,87 -4,71	-- --	-- --	-- --
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALAOR DIVIDENDOS RPPS % do Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-2,66 1,04	-8,28 -4,48	-3,31 -2,14	-13,52 -1,62	-3,00 -3,29	9,30 -24,54	30,22 -41,60
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES MULTIMERCADO % do Var. IBOVESPA p.p.	0,98 2,03	0,98 2,03	-- --	-- --	-- --	-- --	-- --
CXCE11B % do Var. IBOVESPA p.p.	-10,46 -7,25	-10,73 -11,09	0,59 0,69	-14,24 -4,08	-5,38 -13,63	-- --	-- --
RBRD11 % do Var. IBOVESPA p.p.	1,22 4,43	5,81 5,44	31,85 31,94	0,16 10,33	3,89 -4,35	-- --	-- --
CDI	0,57	4,32	1,64	3,24	6,84	19,74	36,66
IBOVESPA	-3,21	0,36	-0,10	-10,16	8,25	32,43	64,46
DOLAR COMERCIAL	10,13	25,01	10,66	27,44	31,40	27,62	13,40
INPC + 6%	0,53	6,92	3,25	5,51	9,81	18,39	37,57
IPCA + 6%	0,44	6,95	3,06	5,32	10,39	19,86	38,46