

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											
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF IRF-M TP	3,14%	0,35	1,28%	-0,01%	4,10%	5.122.213,51	3,28%	4.903.984.503,12	0,10%
BANESTES	BANESTES	BANESTES PREVIDENCIARIO FI RF REF IMA-B	6,91%	0,71	-0,52%	-0,37%	0,10%	3.662.956,83	2,35%	179.080.776,13	2,05%
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,52%	0,08	0,59%	-0,02%	4,66%	16.087.260,51	10,31%	12.769.780.117,05	0,13%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IRFM 1 TP FI RF	0,52%	0,08	0,59%	-0,02%	4,69%	53.805.447,87	34,47%	19.832.435.937,17	0,27%
CEF	CEF	CAIXA BRASIL IDKa IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RF LP	2,27%	0,26	1,15%	-0,21%	5,71%	8.619.946,48	5,52%	6.494.582.562,75	0,13%
BANESTES	BANESTES	FUNDO DE INVESTIMENTO BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS-RENDA FIXA	1,03%	0,13	0,71%	0,11%	5,01%	800.475,53	0,51%	150.898.272,80	0,53%
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF ALOCACAO ATIVA FICFI	2,60%	0,29	0,60%	-0,01%	1,56%	11.416.690,18	7,31%	3.381.634.547,73	0,34%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - 4604 - Fundos 100% Títulos Públicos - Referenciado				0,16				99.514.990,91	63,76%		
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Renda Fixa											
CEF	CEF	CAIXA BRASIL GESTAO ESTRATEGICA FI RF	1,69%	0,20	0,66%	0,18%	2,18%	34.214.132,23	21,92%	2.463.089.662,35	1,39%
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Renda Fixa				0,20				34.214.132,23	21,92%		
Artigo 7º VII, Alínea b - 4604 - Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"											
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IPCA XVI RF CRED PRIV	2,08%	0,24	1,16%	0,24%	4,21%	2.170.809,00	1,39%	153.683.035,42	1,41%
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b - 4604 - Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"				0,24				2.170.809,00	1,39%		
Sub-total Renda Fixa				0,17				135.899.932,14	87,07%		
Renda Variável											
Artigo 8º I, Alínea a - 4604 - Fundos de Ações Referenciados											
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO ACOES GOVERNANCA FI	18,79%	1,96	3,25%	-0,22%	1,27%	5.063.499,36	3,24%	267.797.231,50	1,89%
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a - 4604 - Fundos de Ações Referenciados				1,96				5.063.499,36	3,24%		
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%	2.431.891,85	1,56%	377.962.784,99	0,64%
CEF	CEF	Caixa FI Ações Institucional BDR Nível I	15,43%	1,76	-0,59%	-4,07%	-2,36%	2.438.224,87	1,56%	548.574.948,18	0,44%
BANESTES	BANESTES	BANESTES FIC DE FI ACOES BTG ABSOL. INST	17,60%	1,84	2,18%	2,01%	0,54%	1.462.665,41	0,94%	15.513.523,52	9,43%

**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
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO ACOES VALOR FC FIA	-%	--	-0,22%	-3,69%	-2,08%	4.896.223,82	3,14%	27.381.850,62	17,88%
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a - 4604 - Fundos de Ações				1,00				11.229.005,95	7,19%		
Artigo 8º III - 4604 - Fundos Multimercados											
CEF	CEF	FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES MULTIMERCADO	0,00%	0,00	0,67%	-2,80%	1,58%	2.521.207,53	1,62%	440.281.136,36	0,57%
Sub-total Artigo 8º III - 4604 - Fundos Multimercados				0,00				2.521.207,53	1,62%		
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604 - Fundos de Investimentos Imobiliários											
CEF i	CEF i	CXCE11B	0,00%	0,00	-6,52%	-10,00%	-16,55%	799.992,00	0,51%	159.888.296,32	0,50%
RB CAPITAL INVESTIMENTOS LTDA	VOTORANTIM	RBRD11	0,00%	0,00	-0,20%	-3,68%	10,83%	573.275,08	0,37%	1,06	54.068.900,79%
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b - 4604 - Fundos de Investimentos Imobiliários				0,00				1.373.267,08	0,88%		
Sub-total Renda Variável				1,05				20.186.979,92	12,93%		
Total								156.086.912,06	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	99.514.990,91	63,76%	94,23%	100,00%
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604	Fundos de Renda Fixa	34.214.132,23	21,92%	0,00%	40,00%
Artigo 7º VII, Alínea b - 4604	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	2.170.809,00	1,39%	1,38%	5,00%
	Total Renda Fixa	135.899.932,14	87,07%		
Renda Variável					
Artigo 8º I, Alínea a - 4604	Fundos de Ações Referenciados	5.063.499,36	3,24%	0,00%	30,00%
Artigo 8º II, Alínea a - 4604	Fundos de Ações	11.229.005,95	7,19%	2,86%	20,00%
Artigo 8º III - 4604	Fundos Multimercados	2.521.207,53	1,62%	0,00%	10,00%
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604	Fundos de Investimentos Imobiliários	1.373.267,08	0,88%	0,91%	5,00%
	Total Renda Variável	20.186.979,92	12,93%		

**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	0,63 135,2	4,48 93,2	6,13 92,0	-- --
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 % do CDI	0,66 140,2	4,75 98,6	-- --	-- --
Artigo 7º VII, Alínea b - 4604 % do CDI	1,16 247,6	4,21 87,6	-- --	-- --
Artigo 8º I, Alínea a - 4604 Var. IBOVESPA p.p	3,25 -0,2	1,27 -0,5	-- --	-- --
Artigo 8º II, Alínea a - 4604 Var. IBOVESPA p.p	-0,28 -3,8	-5,31 -9,2	-4,13 -10,9	-- --
Artigo 8º III - 4604 Var. IBOVESPA p.p	0,67 -2,8	1,58 -2,8	-- --	-- --
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604 Var. IBOVESPA p.p	-3,98 -7,5	-6,09 -9,9	-- --	-- --

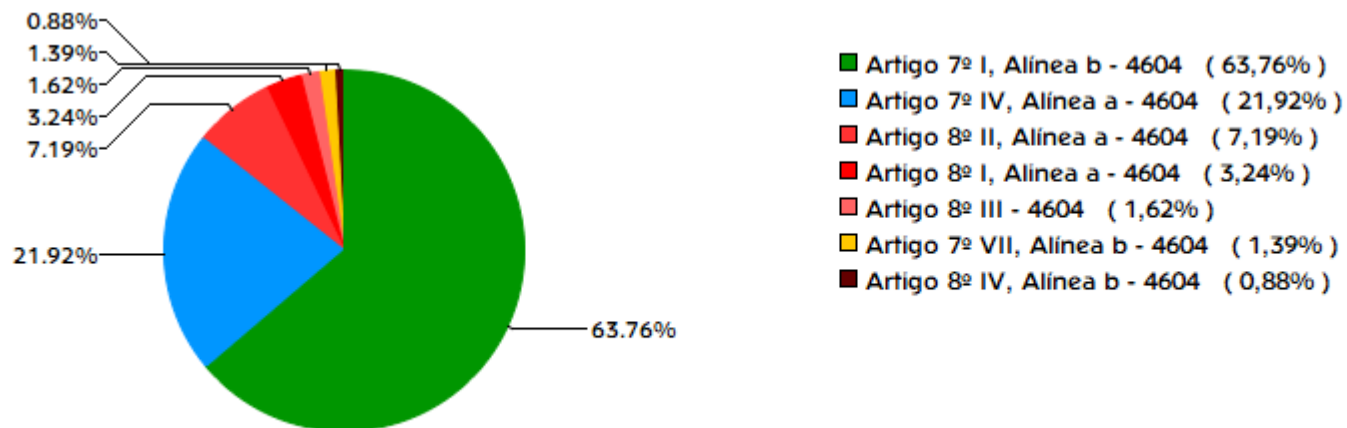
Ganhos Financeiros	
Estratégia	No Mês(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b - 4604	630.927,21
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604	223.082,52
Artigo 8º I, Alínea a - 4604	159.433,97
Artigo 8º II, Alínea a - 4604	-31.267,73
Artigo 8º III - 4604	16.864,71
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604	-56.953,91
Total	942.086,78

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

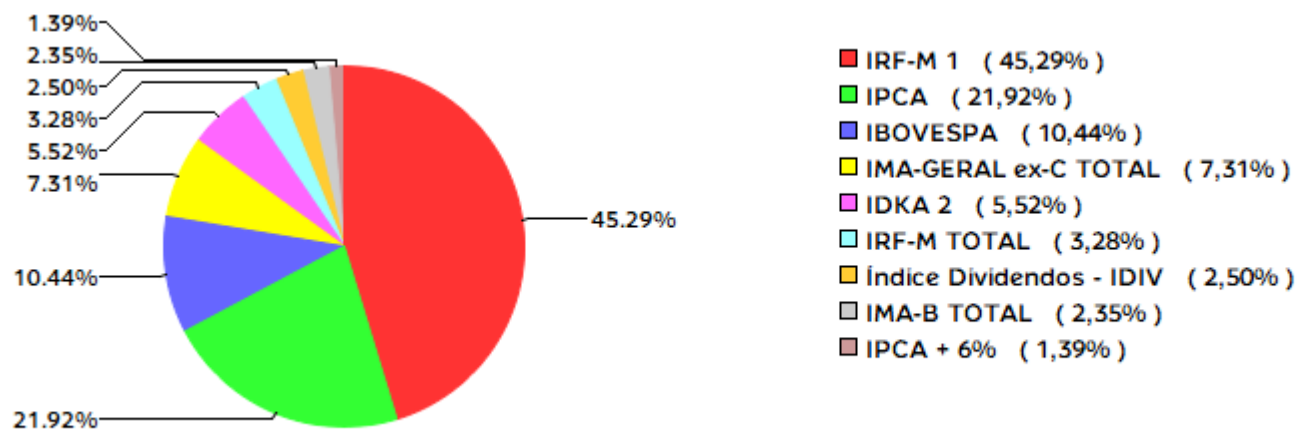
Análise da Disponibilidade Financeira				
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acum. Bruto (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	153.565.704,53	98	153.565.704,53	98
acima de 365 dias	2.521.207,53	2	156.086.912,06	100

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia

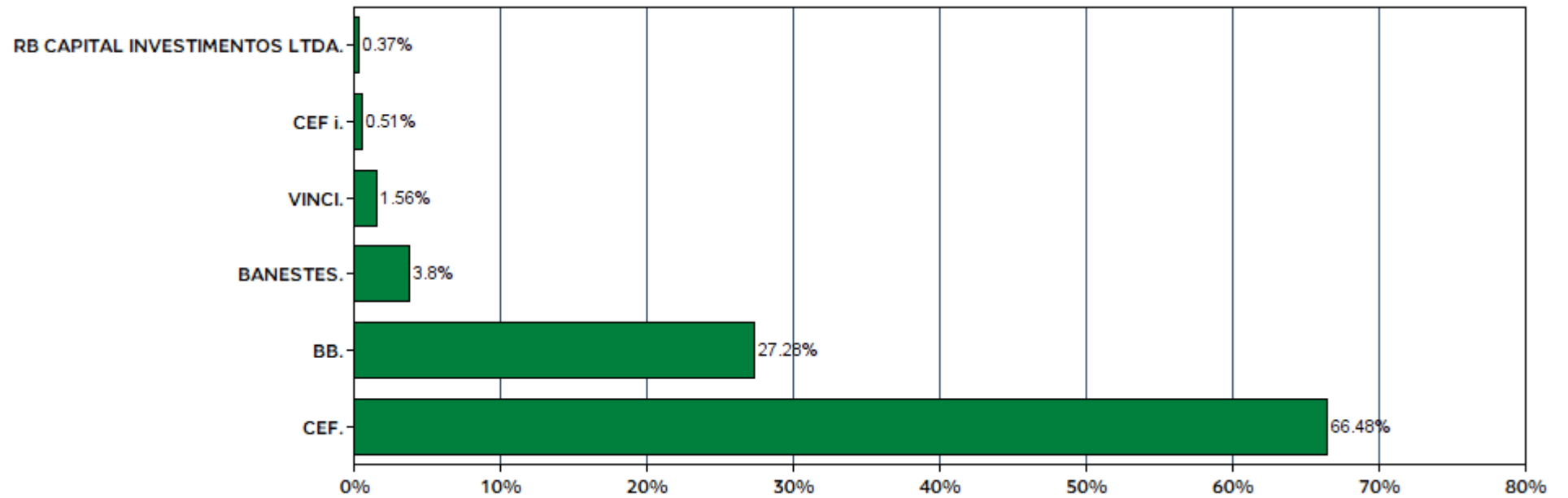


Indexadores



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

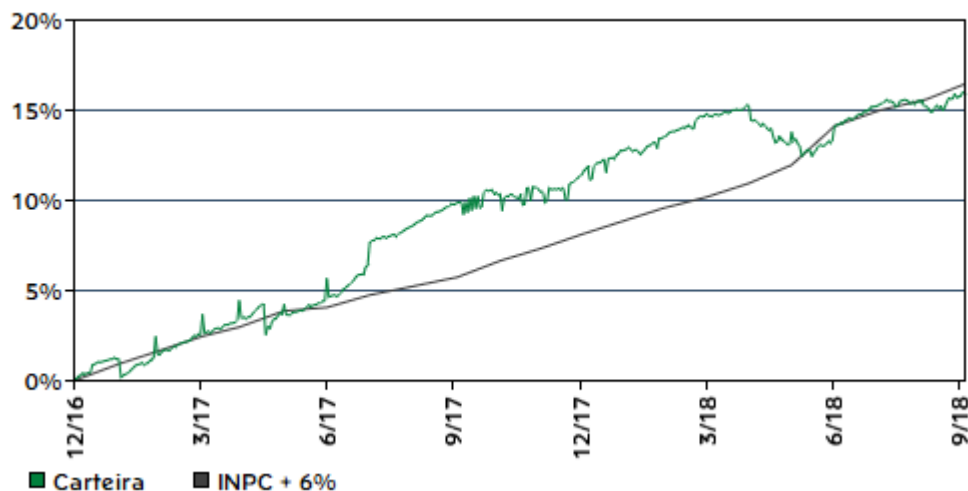
Alocação por Gestor



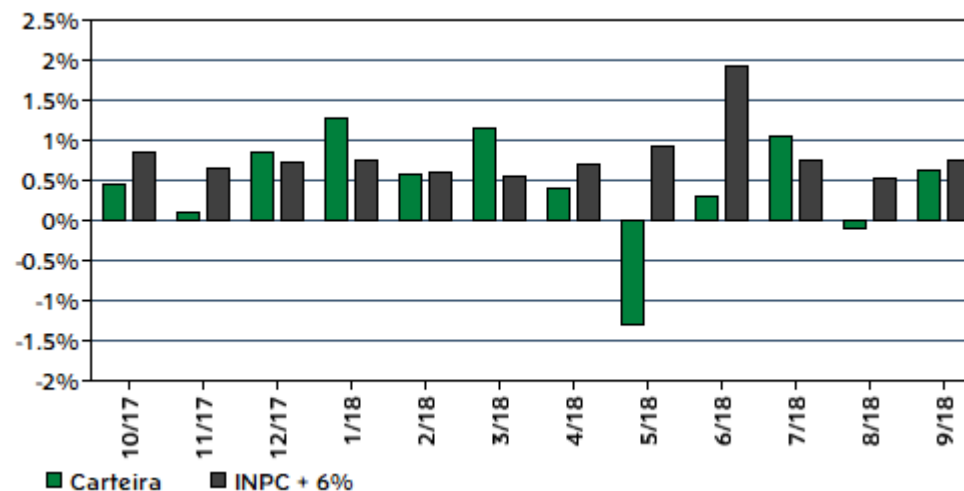
**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

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	0,58	1,16	0,40	-1,31	0,30	1,06	-0,10	0,62	--	--	--	4,03
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	0,54	-0,02	0,60	-0,30	-2,23	-1,63	0,30	-0,63	-0,12	--	--	--	-3,68

**Evolução da Rentabilidade**



**Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses**





**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Análise de Risco / Retorno da Carteira**

	Qtd.	Perct.
Meses acima do Benchmark	12	57,1%
Meses abaixo do Benchmark	9	42,9%

	Rentab.	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,86%	jul/17
Menor rentabilidade da Carteira	-1,31%	mai/18

Período	Rentabilidade (%)			Volat. Anual
	Carteira	INPC + 6%	p.p. Indx.	
03 meses	1,59	2,05	-0,5	2,159
06 meses	0,96	5,70	-4,7	2,562
12 meses	5,50	10,14	-4,6	3,789
24 meses	--	--	--	--
36 meses	--	--	--	--
Desde o início	15,91	16,46	-0,6	4,157

**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 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 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 IRF-M TP % do Var. IRF-M TOTAL p.p.	1,28 -0,01	4,10 -0,14	1,80 -0,03	0,35 -0,10	5,53 -0,21	23,63 -0,55	50,92 -0,84
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
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
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA 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	-- --	-- --

## 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 FI BRASIL IPCA XVI RF CRED PRIV % do Var. IPCA + 6% p.p.	1,16 0,24	4,21 -3,72	2,37 0,15	2,16 -3,53	5,83 -4,89	16,45 -3,83	40,65 2,34
BB PREVIDENCIARIO ACOES GOVERNANCA FI % do Var. IBOVESPA p.p.	3,25 -0,22	0,13 -3,72	8,09 -0,95	-6,12 0,93	1,40 -5,39	30,07 -5,87	59,70 -16,39
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
BB PREVIDENCIARIO ACOES VALOR FC FIA % do Var. IBOVESPA p.p.	-0,22 -3,69	-15,03 -7,80	5,11 -3,93	-14,04 -6,99	-- --	-- --	-- --
Caixa FI Ações Institucional BDR Nível I % do Var. IBOVESPA p.p.	-0,59 -4,07	32,87 29,02	12,55 3,51	36,43 43,48	49,63 42,84	69,31 33,38	58,18 -17,91
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
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES MULTIMERCADO % do Var. IBOVESPA p.p.	0,67 -2,80	1,66 -0,72	-- --	-- --	-- --	-- --	-- --
CXCE11B % do Var. IBOVESPA p.p.	-6,52 -10,00	-16,55 -20,40	-10,17 -19,22	-17,21 -10,15	-20,00 -26,79	-- --	-- --
RBRD11 % do Var. IBOVESPA p.p.	-0,20 -3,68	10,83 6,98	6,35 -2,70	-1,39 5,67	9,59 2,79	-- --	-- --
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