

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos											
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	VAR	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (31/01/2019)	% 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	3,39%	0,39	1,37%	-0,02%	1,37%	5.812.107,70	3,46%	5.222.909.560,37	0,11%
BANESTES	BANESTES	BANESTES PREVIDENCIARIO FI RF REF IMA-B	7,77%	0,86	5,36%	0,99%	5,36%	1.388.130,45	0,83%	225.992.034,94	0,61%
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,55%	0,08	0,58%	-0,00%	0,58%	16.805.130,44	10,02%	11.421.020.245,51	0,15%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IRFM 1 TP FI RF	0,55%	0,08	0,57%	-0,01%	0,57%	48.679.030,82	29,02%	17.170.876.640,61	0,28%
CEF	CEF	CAIXA BRASIL IDKa IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RF LP	2,37%	0,28	1,27%	0,00%	1,27%	9.026.192,19	5,38%	7.762.559.317,98	0,12%
BANESTES	BANESTES	FUNDO DE INVESTIMENTO BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS-RENDA FIXA	1,11%	0,15	0,86%	0,28%	0,86%	832.087,18	0,50%	192.307.871,15	0,43%
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF ALOCACAO ATIVA FICFI	2,76%	0,33	2,01%	0,10%	2,01%	12.286.476,88	7,32%	4.940.753.535,49	0,25%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - 4604 - Fundos 100% Títulos Públicos - Referenciado				0,16				94.829.155,66	56,53%		
Artigo 7º IV, Alínea a - RF e REFERENCIAL LIVRE											
CEF	CEF	CAIXA FI ALIANÇA RF	0,07%	0,03	0,12%	96,93%	0,12%	2.305.107,01	1,37%	280.381.241,94	0,82%
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - RF e REFERENCIAL LIVRE				0,03				2.305.107,01	1,37%		
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Renda Fixa											
CEF	CEF	CAIXA BRASIL GESTAO ESTRATEGICA FI RF	2,03%	0,25	2,88%	2,56%	2,88%	37.117.448,16	22,13%	3.607.219.056,01	1,03%
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Renda Fixa				0,25				37.117.448,16	22,13%		
Artigo 7º VII, Alínea b - 4604 - Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"											
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IPCA XVI RF CRED PRIV	2,32%	0,27	1,90%	1,07%	1,90%	2.286.684,00	1,36%	152.992.148,12	1,49%
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b - 4604 - Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"				0,27				2.286.684,00	1,36%		
Sub-total Renda Fixa				0,19				136.538.394,83	81,39%		
Renda Variável											
Artigo 8º I, Alínea a - 4604 - Fundos de Ações Referenciados											
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO ACOES GOVERNANCA FI	20,83%	2,23	10,42%	-0,40%	10,42%	5.601.120,04	3,34%	447.231.351,89	1,25%
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a - 4604 - Fundos de Ações Referenciados				2,23				5.601.120,04	3,34%		
Artigo 8º II, Alínea a - 4604 - Fundos de Ações											

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos											
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	VAR	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (31/01/2019)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS FIC FI	18,73%	2,01	8,27%	-2,55%	8,27%	1.506.068,83	0,90%	714.072.629,09	0,21%
CEF	CEF	Caixa FI Ações Institucional BDR Nível I	18,85%	2,00	0,66%	-10,16%	0,66%	4.285.596,78	2,55%	415.620.508,23	1,03%
BANESTES	BANESTES	BANESTES FIC DE FI ACOES BTG ABSOL. INST	19,48%	2,10	7,61%	7,61%	7,61%	2.373.894,67	1,42%	27.842.798,15	8,53%
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES ALOCAÇÃO FIC DE FI	20,78%	2,22	8,93%	-1,89%	8,93%	2.123.547,55	1,27%	149.399.470,81	1,42%
BB	BB	BB ACOES GLOBAIS FC FIA BDR NIVEL I	18,66%	1,98	1,75%	-9,07%	1,75%	2.857.071,81	1,70%	37.232.579,97	7,67%
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO ACOES VALOR FC FIA	22,51%	2,42	15,28%	4,46%	15,28%	4.925.093,76	2,94%	49.181.639,49	10,01%
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALAOR DIVIDENDOS RPPS	18,58%	2,00	12,23%	12,23%	12,23%	3.346.037,60	1,99%	506.731.472,62	0,66%
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a - 4604 - Fundos de Ações				2,13				21.417.311,00	12,77%		
Artigo 8º III - 4604 - Fundos Multimercados											
CEF	CEF	FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES MULTIMERCADO	0,00%	0,00	0,99%	-9,83%	0,99%	2.682.870,24	1,60%	467.785.396,17	0,57%
Sub-total Artigo 8º III - 4604 - Fundos Multimercados				0,00				2.682.870,24	1,60%		
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604 - Fundos de Investimentos Imobiliários											
CEF	CEF	CXCE11B	0,00%	0,00	1,00%	-9,82%	1,00%	905.040,00	0,54%	1,05	86.103.127,10%
RB CAPITAL INVESTIMENTOS LTDA	VOTORANTIM	RBRD11	0,00%	0,00	0,49%	-10,33%	0,49%	605.386,04	0,36%	1,18	51.218.360,52%
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b - 4604 - Fundos de Investimentos Imobiliários				0,00				1.510.426,04	0,90%		
Sub-total Renda Variável				1,86				31.211.727,32	18,61%		
Total								167.750.122,15	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	94.829.155,66	56,53%	94,23%	100,00%
Artigo 7º IV, Alínea a	RF e REFERENCIAL LIVRE	2.305.107,01	1,37%	0,00%	30,00%
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604	Fundos de Renda Fixa	37.117.448,16	22,13%	0,00%	40,00%
Artigo 7º VII, Alínea b - 4604	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	2.286.684,00	1,36%	1,38%	5,00%
Total Renda Fixa		136.538.394,83	81,39%		
Renda Variável					
Artigo 8º I, Alínea a - 4604	Fundos de Ações Referenciados	5.601.120,04	3,34%	0,00%	30,00%
Artigo 8º II, Alínea a - 4604	Fundos de Ações	21.417.311,00	12,77%	2,86%	20,00%
Artigo 8º III - 4604	Fundos Multimercados	2.682.870,24	1,60%	0,00%	10,00%
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604	Fundos de Investimentos Imobiliários	1.510.426,04	0,90%	0,91%	5,00%
Total Renda Variável		31.211.727,32	18,61%		

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	0,94 172,5	0,94 172,5	7,58 118,8	12,28 75,0
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,12 22,0	0,12 22,0	0,12 1,9	9,03 55,1
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 % do CDI	2,88 530,5	2,88 530,5	10,82 169,7	-- --
Artigo 7º VII, Alínea b - 4604 % do CDI	1,90 349,5	1,90 349,5	8,70 136,4	-- --
Artigo 8º I, Alínea a - 4604 Var. IBOVESPA p.p	10,42 -0,4	10,42 -0,4	-- --	-- --
Artigo 8º II, Alínea a - 4604 Var. IBOVESPA p.p	8,00 -2,8	8,00 -2,8	4,97 -9,7	31,73 -18,9
Artigo 8º III - 4604 Var. IBOVESPA p.p	0,99 -9,8	0,99 -9,8	-- --	-- --
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604 Var. IBOVESPA p.p	0,79 -10,0	0,79 -10,0	9,53 -5,2	-- --

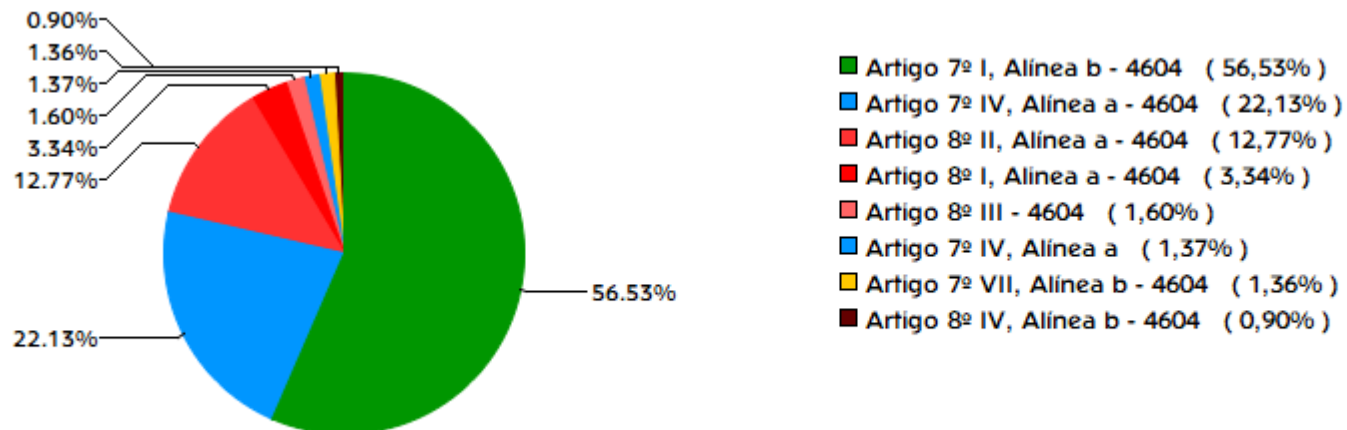
Ganhos Financeiros	
Estratégia	No Mês(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b - 4604	886.815,34
Artigo 7º IV, Alínea a	1.532,94
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604	1.046.907,06
Artigo 7º VII, Alínea b	42.588,00
Artigo 8º I, Alínea a - 4604	528.450,95
Artigo 8º II, Alínea a - 4604	1.613.227,31
Artigo 8º III - 4604	26.195,08
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604	11.960,79
Total	4.157.677,47

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

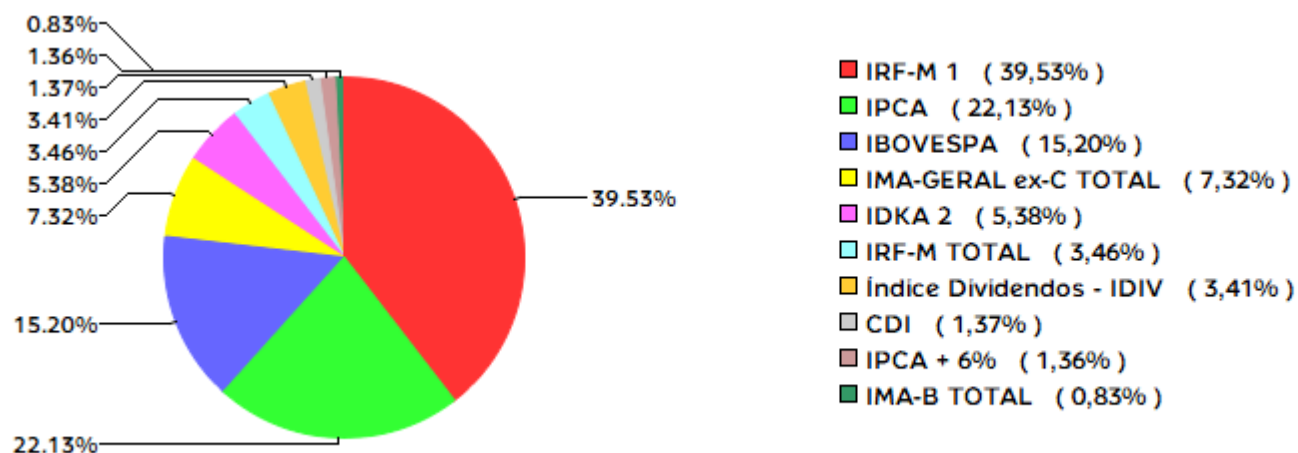
Análise da Disponibilidade Financeira				
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acum. Bruto (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	165.067.251,91	98	165.067.251,91	98
acima de 365 dias	2.682.870,24	2	167.750.122,15	100

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia

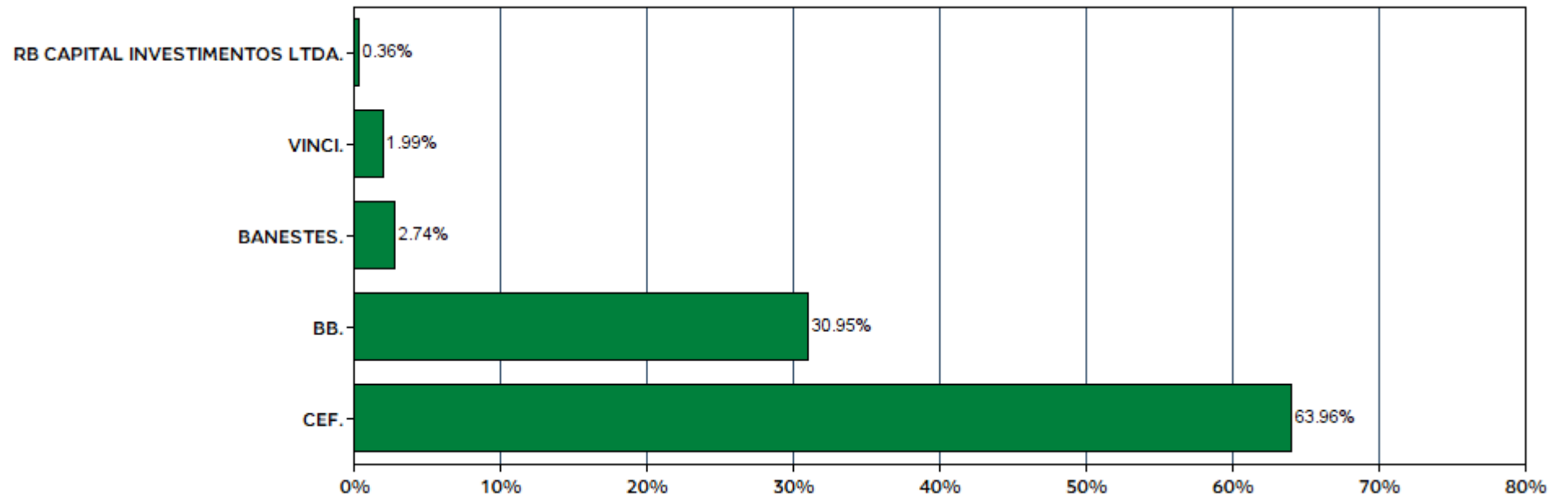


Indexadores



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

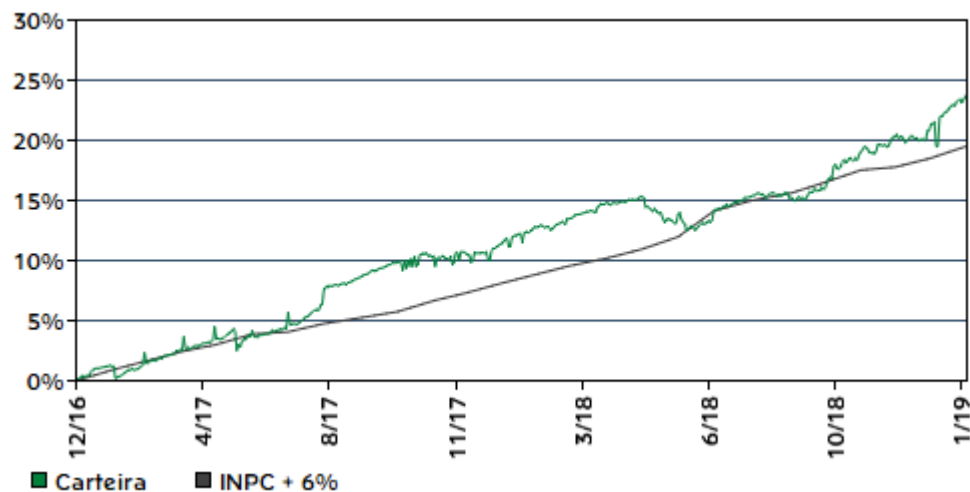
Alocação por Gestor



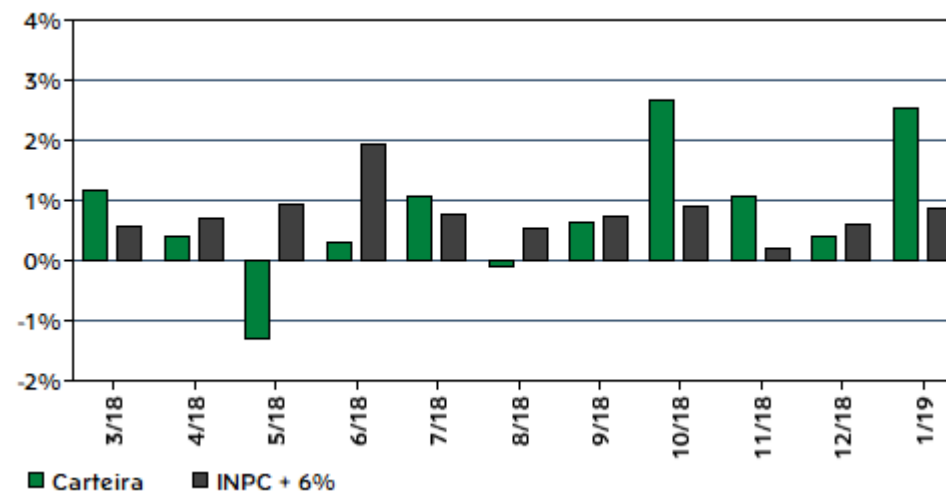
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	1,29	0,58	1,16	0,41	-1,31	0,30	1,07	-0,09	0,62	2,66	1,08	0,41	8,45
INPC + 6%	0,74	0,60	0,56	0,70	0,92	1,92	0,76	0,53	0,74	0,91	0,21	0,60	9,59
p.p. Indx	0,55	-0,02	0,61	-0,29	-2,22	-1,62	0,30	-0,63	-0,12	1,75	0,86	-0,19	-1,14
2019	2,53	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	2,53
INPC + 6%	0,87	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	0,87
p.p. Indx	1,66	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	1,66

Evolução da Rentabilidade



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco / Retorno da Carteira

	Qtd.	Perct.
Meses acima do Benchmark	15	60,0%
Meses abaixo do Benchmark	10	40,0%

	Rentab.	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,66%	out/18
Menor rentabilidade da Carteira	-1,31%	mai/18

Período	Rentabilidade (%)			Volat. Anual
	Carteira	INPC + 6%	p.p. Indx.	
03 meses	4,07	1,70	2,4	5,775
06 meses	7,41	3,94	3,5	4,541
12 meses	9,78	9,73	0,0	3,705
24 meses	22,41	18,41	4,0	4,461
36 meses	--	--	--	--
Desde o início	23,89	19,52	4,4	4,378

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.	5,36 0,99	5,36 0,99	8,86 1,82	17,78 3,78	14,18 0,07	31,24 0,59	66,76 3,76
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,58 -0,00	0,58 -0,00	1,64 -0,05	3,60 -0,09	6,75 -0,22	17,55 -0,48	34,09 -0,84
BB PREVIDENCIARIO RF ALOCACAO ATIVA FICFI % do Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	2,01 0,10	2,01 0,10	3,98 0,06	7,84 -0,04	10,21 0,17	23,62 -0,50	-- --
BB PREVIDENCIARIO RF IRF-M TP % do Var. IRF-M TOTAL p.p.	1,37 -0,02	1,37 -0,02	3,91 -0,05	7,96 -0,11	10,62 -0,21	25,86 -0,58	54,41 -0,81
CAIXA BRASIL IDKa IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RF LP % do Var. IDKA 2 p.p.	1,27 0,00	1,27 0,00	2,57 -0,14	5,93 -0,31	9,64 -0,65	23,04 -1,87	38,94 -1,27
CAIXA FI BRASIL IRFM 1 TP FI RF % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,57 -0,01	0,57 -0,01	1,65 -0,04	3,62 -0,08	6,80 -0,16	17,67 -0,36	34,35 -0,59
FUNDO DE INVESTIMENTO BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS-RENDA FIXA % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,86 0,28	0,86 0,28	2,39 0,70	4,91 1,22	8,38 1,42	20,00 1,96	38,37 3,43
CAIXA FI ALIANÇA RF % do % do CDI	0,53 96,94	0,53 96,94	1,49 96,59	3,07 97,43	6,07 95,21	15,93 97,23	32,12 98,15

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 GESTAO ESTRATEGICA FI RF % do Var. IPCA p.p.	2,88 2,56	2,88 2,56	4,64 4,38	7,26 6,15	9,82 6,04	21,96 15,22	-- --
CAIXA FI BRASIL IPCA XVI RF CRED PRIV % do Var. IPCA + 6% p.p.	1,90 1,07	1,90 1,07	3,22 1,51	6,56 2,47	8,70 -1,25	19,01 -0,78	35,17 1,36
BB PREVIDENCIARIO ACOES GOVERNANCA FI % do Var. IBOVESPA p.p.	10,42 -0,40	10,42 -0,40	12,38 0,97	25,18 2,24	16,05 1,35	51,30 0,70	119,63 -21,42
BANESTES FIC DE FI ACOES BTG ABSOL. INST % do Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	7,61 --	7,61 --	14,58 -6,87	26,19 -4,36	20,79 2,08	55,84 5,34	90,82 -99,09
BB AÇÕES DIVIDENDOS FIC FI % do Var. IBOVESPA p.p.	8,27 -2,55	8,27 -2,55	14,62 3,21	25,89 2,95	15,18 0,48	42,81 -7,79	91,17 -49,87
BB ACOES GLOBAIS FC FIA BDR NIVEL I % do Var. IBOVESPA p.p.	1,75 -9,07	1,75 -9,07	-4,20 -15,60	-6,32 -29,26	10,55 -4,15	32,86 -17,74	19,31 -121,73
BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES ALOCAÇÃO FIC DE FI % do Var. IBOVESPA p.p.	8,93 -1,89	8,93 -1,89	8,73 -2,68	19,54 -3,40	15,09 0,39	45,33 -5,27	105,25 -35,80
BB PREVIDENCIARIO ACOES VALOR FC FIA % do Var. IBOVESPA p.p.	15,28 4,46	15,28 4,46	20,18 8,77	40,84 17,90	22,76 8,06	-- --	-- --
Caixa FI Ações Institucional BDR Nivel I % do Var. IBOVESPA p.p.	0,66 -10,16	0,66 -10,16	-2,76 -14,17	-6,33 -29,27	9,21 -5,49	40,02 -10,58	28,28 -112,76
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALAOR DIVIDENDOS RPPS ... % do Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	12,23 --	12,23 --	22,22 0,77	31,91 1,35	17,58 -1,14	47,60 -2,90	75,83 -114,08
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES MULTIMERCADO % do Var. IBOVESPA p.p.	0,99 -9,83	0,99 -9,83	3,21 -8,20	8,18 -17,50	-- --	-- --	-- --
CXCE11B % do Var. IBOVESPA p.p.	1,00 -9,82	1,00 -9,82	11,11 -0,30	-0,26 -23,20	2,71 -11,99	-- --	-- --
RBRD11 % do Var. IBOVESPA p.p.	0,49 -10,33	0,49 -10,33	7,40 -4,01	12,60 -10,34	21,31 6,61	-- --	-- --
CDI	0,54	0,54	1,54	3,15	6,38	16,38	32,72
IBOVESPA	10,82	10,82	11,40	22,94	14,70	50,60	141,04

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
DOLAR COMERCIAL	-5,75	-5,75	-1,77	-2,74	15,48	16,79	-9,67
INPC + 6%	0,87	0,87	1,70	3,94	9,73	18,41	32,37
IPCA + 6%	0,83	0,83	1,71	4,09	9,95	19,79	33,81