

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos											
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	VAR	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (29/06/2018)	% 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	2,76%	0,32	0,01%	-0,03%	2,26%	5.031.615,07	3,25%	5.450.225.090,34	0,09%
BANESTES	BANESTES	BANESTES FI PREVIDENCIÁRIO RF	6,35%	0,68	-1,29%	-0,97%	-1,72%	3.596.367,93	2,33%	181.240.682,13	1,98%
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,51%	0,08	0,50%	-0,05%	2,94%	25.724.744,43	16,64%	11.461.270.746,53	0,22%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IRFM 1 TP RF	0,50%	0,08	0,50%	-0,05%	2,95%	64.411.941,33	41,65%	16.953.571.238,51	0,38%
CEF	CEF	CAIXA BRASIL IDKa IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RJ LP	2,13%	0,26	0,21%	0,53%	3,27%	8.421.149,28	5,45%	4.897.194.284,25	0,17%
BANESTES	BANESTES	FUNDO DE INVESTIMENTO BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS-RENDA FIXA	0,99%	0,14	0,29%	-0,25%	3,22%	786.817,52	0,51%	130.092.502,78	0,60%
CEF	CEF	FI BRASIL 2018 III TP RF	3,94%	0,42	1,13%	1,45%	1,49%	2.459.718,00	1,59%	148.935.920,14	1,65%
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF ALOCACAO ATIVA FCFI	2,47%	0,29	0,19%	0,09%	-0,02%	9.977.235,48	6,45%	2.829.191.536,13	0,35%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - 4604 - Fundos 100% Títulos Públicos - Referenciado				0,15				120.409.589,04	77,87%		
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Renda Fixa											
CEF	CEF	CAIXA FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	1,69%	0,21	0,45%	-0,81%	0,42%	26.831.517,29	17,35%	1.823.013.314,56	1,47%
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Renda Fixa				0,21				26.831.517,29	17,35%		
Artigo 7º VII, Alínea b - 4604 - Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"											
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IPCA XVI RF CRED PRIV	1,80%	0,21	0,17%	-1,58%	1,80%	2.120.551,50	1,37%	154.024.399,52	1,38%
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b - 4604 - Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"				0,21				2.120.551,50	1,37%		
Sub-total Renda Fixa				0,16				149.361.657,83	96,59%		
Renda Variável											
Artigo 8º II, Alínea a - 4604 - Fundos de Ações											
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALAOR DIVIDENDOS RPPS	16,22%	1,70	-5,34%	-1,01%	-10,19%	2.417.624,93	1,56%	387.954.203,90	0,62%
BANESTES	BANESTES	BANESTES FIC DE FI ACOES BTG ABSOL. INST	15,77%	1,69	-1,82%	2,51%	-2,72%	1.415.177,42	0,92%	15.056.263,05	9,40%
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a - 4604 - Fundos de Ações				1,70				3.832.802,35	2,48%		
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604 - Fundos de Investimentos Imobiliários											
CEF i	CEF i	CXCE11B	0,00%	0,00	4,68%	9,88%	-7,10%	890.596,00	0,58%	157.938.800,63	0,56%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos											
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	VAR	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (29/06/2018)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
RIO BRAVO	RIO BRAVO	RBRD11	0,00%	0,00	25,30%	30,50%	0,56%	549.191,86	0,36%	139.961.308,89	0,39%
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b - 4604 - Fundos de Investimentos Imobiliários				0,00				1.439.787,86	0,93%		
Sub-total Renda Variável				1,23				5.272.590,21	3,41%		
Total								154.634.248,04	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	120.409.589,04	77,87%	94,23%	100,00%
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604	Fundos de Renda Fixa	26.831.517,29	17,35%	0,00%	40,00%
Artigo 7º VII, Alínea b - 4604	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	2.120.551,50	1,37%	1,38%	5,00%
Total Renda Fixa		149.361.657,83	96,59%		
Renda Variável					
Artigo 8º II, Alínea a - 4604	Fundos de Ações	3.832.802,35	2,48%	2,86%	20,00%
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604	Fundos de Investimentos Imobiliários	1.439.787,86	0,93%	0,91%	5,00%
Total Renda Variável		5.272.590,21	3,41%		

Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)				
Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
Artigo 7º I, Alínea b - 4604 % do CDI	0,39 75,1	2,72 85,6	4,42 60,0	-- --
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 % do CDI	0,45 86,9	2,94 92,6	-- --	-- --
Artigo 7º VII, Alínea b - 4604 % do CDI	0,17 33,0	1,80 56,7	-- --	-- --
Artigo 8º II, Alínea a - 4604 Var. IBOVESPA p.p	-4,07 1,1	-6,38 -1,6	7,26 -8,4	-- --
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604 Var. IBOVESPA p.p	0,00 5,2	-6,58 -1,8	-- --	-- --

Ganhos Financeiros	
Estratégia	No Mês(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b - 4604	465.923,69
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604	119.171,86
Artigo 8º II, Alínea a - 4604	-162.474,73
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604	150.688,24
Total	573.309,06

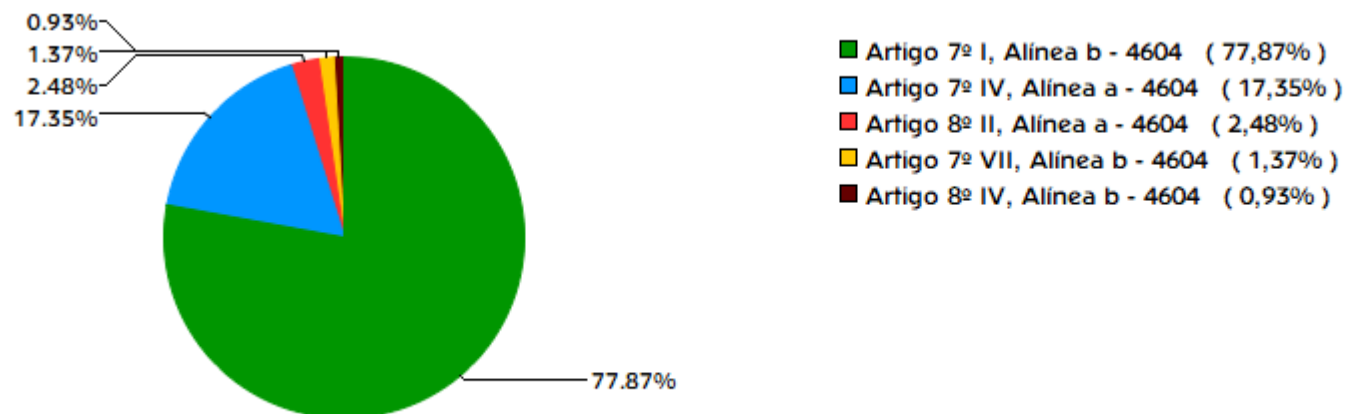
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise da Disponibilidade Financeira

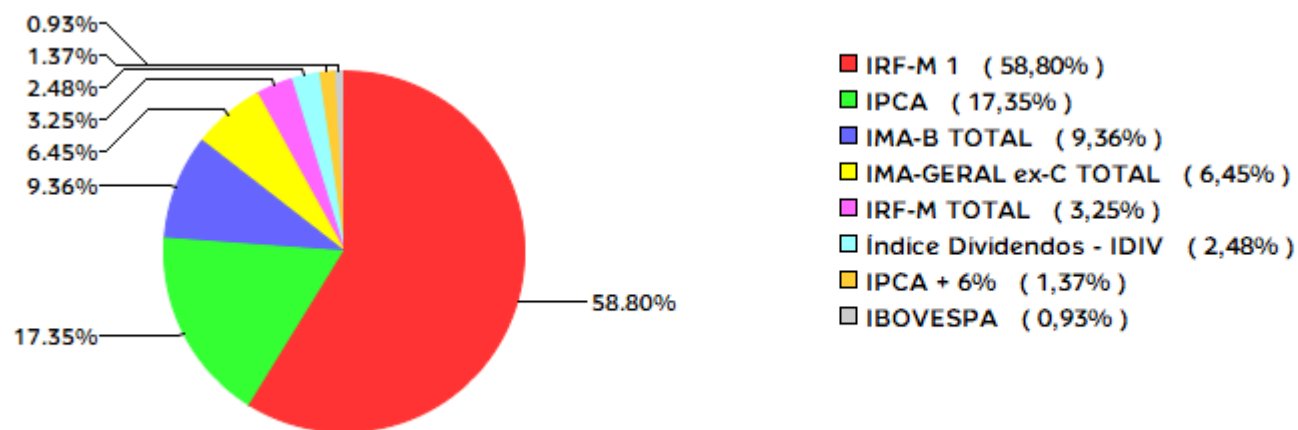
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acum. Bruto (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	154.634.248,04	100	154.634.248,04	100

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia

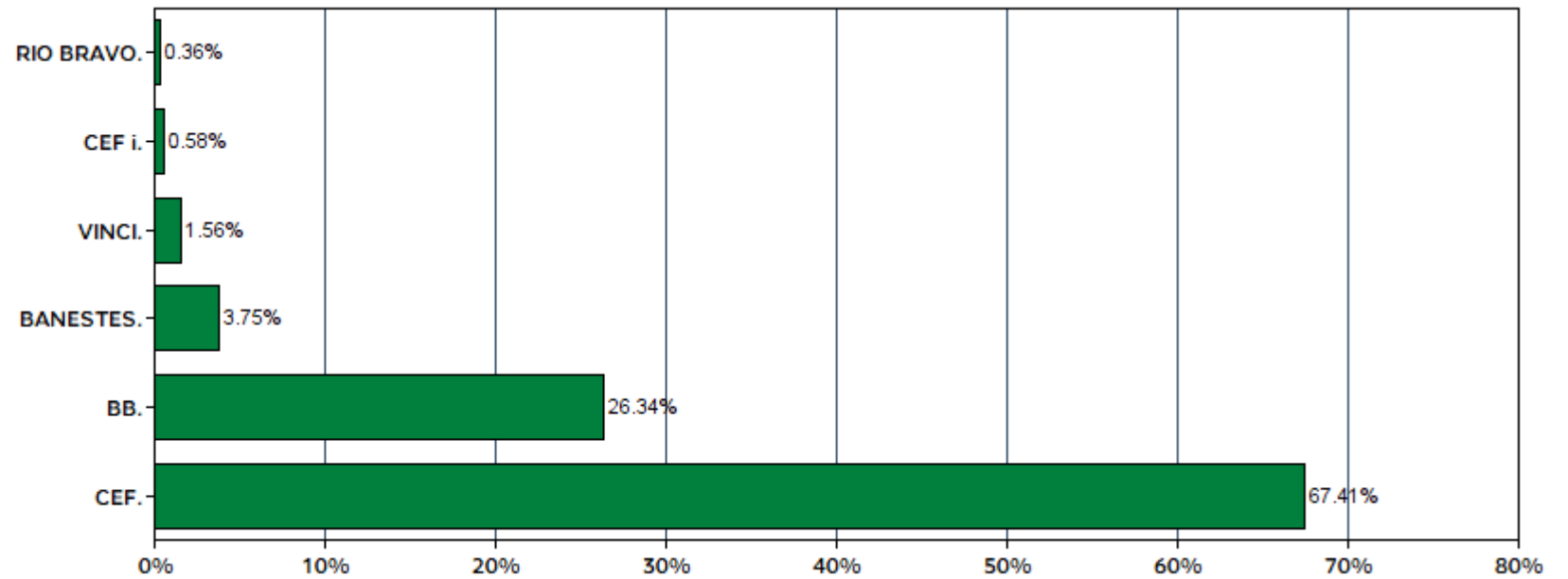


Indexadores



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

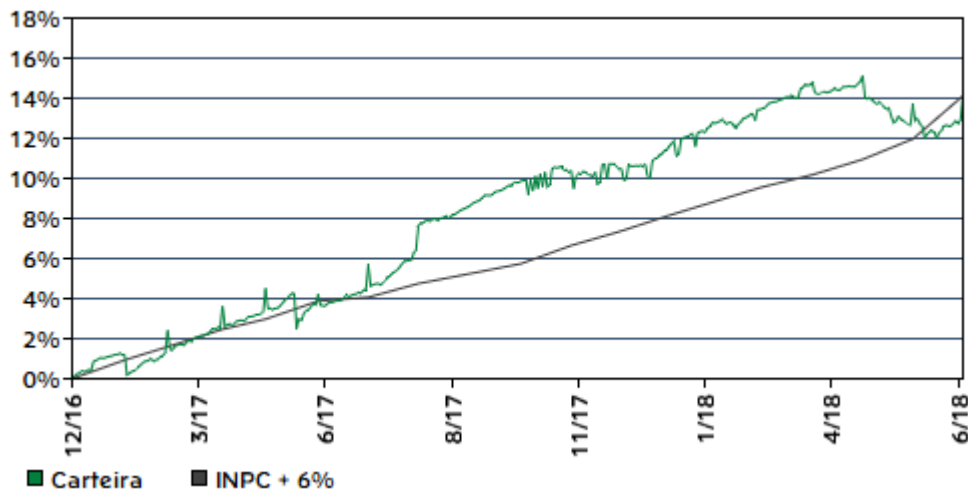
Alocação por Gestor



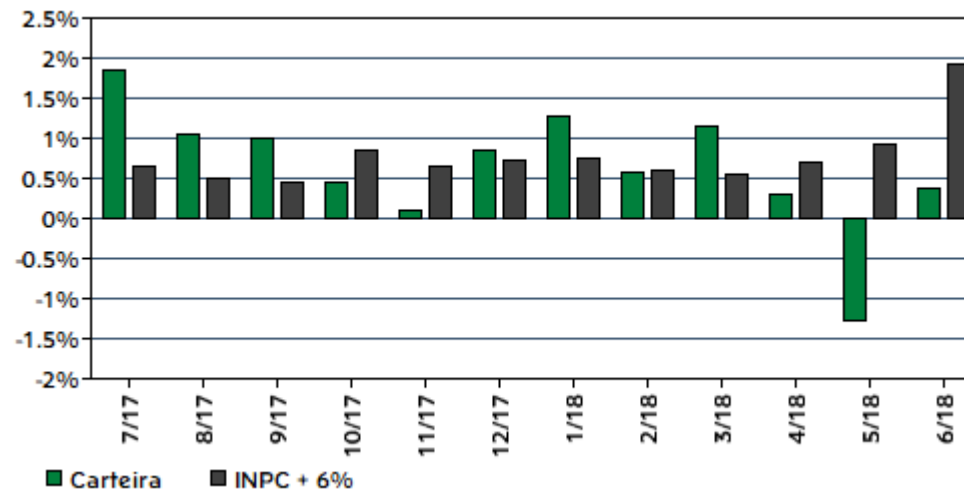
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	-	-	-	-	-	-	2,39
INPC + 6%	0,74	0,60	0,56	0,70	0,92	1,92	-	-	-	-	-	-	5,55
p.p. Indx	0,54	-0,02	0,60	-0,40	-2,21	-1,55	-	-	-	-	-	-	-3,16

Evolução da Rentabilidade



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco / Retorno da Carteira

	Qtd.	Perct.
Meses acima do Benchmark	11	61,1%
Meses abaixo do Benchmark	7	38,9%

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

Período	Rentabilidade (%)			Volat. Anual
	Carteira	INPC + 6%	p.p. Indx.	
03 meses	-0,63	3,58	-4,2	4,292
06 meses	2,39	5,55	-3,2	3,752
12 meses	7,96	9,66	-1,7	4,444
24 meses	--	--	--	--
36 meses	--	--	--	--
Desde o início	14,08	14,12	-0,0	4,598

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.	-1,29 -0,97	-1,72 -2,88	-6,85 -3,25	-1,72 -2,88	4,97 -3,23	18,47 -4,14	38,18 -4,94
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,50 -0,05	2,94 -0,14	1,17 -0,09	2,94 -0,14	7,55 -0,25	21,72 -0,60	39,56 -1,06
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FCFI % do Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,19 0,09	2,55 0,26	-0,93 0,13	2,55 0,26	8,41 0,15	-- --	-- --
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M TP % do Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,01 -0,03	2,26 -0,11	-1,42 -0,07	2,26 -0,11	8,71 -0,24	26,69 -0,53	47,18 -1,00
CAIXA BRASIL IDKa IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RJ LP % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,21 0,53	3,27 2,11	0,20 3,80	3,27 2,11	9,73 1,53	23,00 0,39	43,59 0,46
CAIXA FI BRASIL IRFM 1 TP RF % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,50 -0,05	2,95 -0,12	1,18 -0,07	2,95 -0,12	7,60 -0,21	21,87 -0,45	39,92 -0,70
FI BRASIL 2018 III TP RF % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,13 1,45	1,49 0,33	2,36 5,96	1,49 0,33	3,17 -5,03	9,04 -13,57	19,84 -23,29
FUNDO DE INVESTIMENTO BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS-RENDA FIXA % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,29 -0,25	3,22 0,14	0,72 -0,54	3,22 0,14	8,49 0,68	23,29 0,97	41,77 1,15

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 FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF % do Var. IPCA p.p.	0,45 -0,81	2,45 -0,16	-0,40 -2,29	2,45 -0,16	8,12 3,73	-- --	-- --
CAIXA FI BRASIL IPCA XVI RF CRED PRIV % do Var. IPCA + 6% p.p.	0,17 -1,58	1,80 -3,79	-0,21 -3,59	1,80 -3,79	5,88 -4,70	17,30 -3,40	37,57 -1,68
BANESTES FIC DE FI ACOES BTG ABSOL. INST % do Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-1,82 2,51	-2,72 4,14	-11,55 4,06	-2,72 4,14	13,69 4,84	18,34 -30,44	25,41 -17,38
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALAOR DIVIDENDOS RPPS % do Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-5,34 -1,01	-10,19 -3,33	-15,87 -0,26	-10,19 -3,33	2,90 -5,95	13,47 -35,31	16,86 -25,92
CXCE11B % do Var. IBOVESPA p.p.	4,68 9,88	-7,10 -2,34	-7,83 6,93	-7,10 -2,34	-- --	-- --	-- --
RBRD11 % do Var. IBOVESPA p.p.	25,30 30,50	0,56 5,32	-8,92 5,85	0,56 5,32	-- --	-- --	-- --
CDI	0,52	3,18	1,56	3,18	7,37	21,18	38,26
IBOVESPA	-5,20	-4,76	-14,76	-4,76	15,68	41,22	37,08
DOLAR COMERCIAL	3,18	16,56	16,01	16,56	16,55	20,13	24,28
INPC + 6%	1,92	5,55	3,58	5,55	9,66	19,19	38,33
IPCA + 6%	1,75	5,59	3,38	5,59	10,58	20,70	39,26