

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos											
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	VAR	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (31/07/2018)	% 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	2,79%	0,32	1,48%	0,01%	3,78%	5.106.239,93	3,27%	5.447.124.355,33	0,09%
BANESTES	BANESTES	BANESTES FI PREVIDENCIÁRIO RF	6,32%	0,67	3,25%	0,93%	1,47%	3.713.250,55	2,37%	198.247.052,97	1,87%
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,50%	0,08	0,68%	0,02%	3,64%	25.898.542,14	16,56%	11.702.481.616,22	0,22%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IRFM 1 TP RF	0,49%	0,08	0,68%	0,02%	3,66%	63.913.168,36	40,88%	17.362.996.877,14	0,37%
CEF	CEF	CAIXA BRASIL IDKa IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RJ LP	2,06%	0,25	1,19%	-1,13%	4,50%	8.521.302,69	5,45%	5.028.426.826,17	0,17%
BANESTES	BANESTES	FUNDO DE INVESTIMENTO BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS-RENDA FIXA	0,97%	0,13	0,80%	0,14%	4,05%	793.120,17	0,51%	126.143.724,02	0,63%
CEF	CEF	FI BRASIL 2018 III TP RF	3,90%	0,41	0,50%	-1,81%	2,00%	2.472.108,00	1,58%	149.686.199,81	1,65%
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF ALOCACAO ATIVA FCFI	2,43%	0,28	1,37%	-0,02%	1,35%	10.113.613,86	6,47%	2.874.979.005,40	0,35%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - 4604 - Fundos 100% Títulos Públicos - Referenciado				0,14				120.531.345,70	77,09%		
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Renda Fixa											
CEF	CEF	CAIXA FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	1,61%	0,19	0,95%	0,62%	1,37%	28.107.420,10	17,98%	1.941.557.842,39	1,45%
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Renda Fixa				0,19				28.107.420,10	17,98%		
Artigo 7º VII, Alínea b - 4604 - Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"											
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IPCA XVI RF CRED PRIV	1,82%	0,21	1,19%	0,35%	3,02%	2.145.853,50	1,37%	153.433.382,62	1,40%
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b - 4604 - Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"				0,21				2.145.853,50	1,37%		
Sub-total Renda Fixa				0,15				150.784.619,30	96,44%		
Renda Variável											
Artigo 8º II, Alínea a - 4604 - Fundos de Ações											
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALAOR DIVIDENDOS RPPS	16,17%	1,71	4,92%	-2,35%	-5,77%	2.536.687,09	1,62%	396.763.645,16	0,64%
BANESTES	BANESTES	BANESTES FIC DE FI ACOES BTG ABSOL. INST	16,10%	1,73	5,99%	-1,28%	3,11%	1.499.993,33	0,96%	15.958.631,42	9,40%
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a - 4604 - Fundos de Ações				1,71				4.036.680,42	2,58%		
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604 - Fundos de Investimentos Imobiliários											
CEF i	CEF i	CXCE11B	0,00%	0,00	7,32%	-1,55%	-0,30%	955.800,00	0,61%	157.972.927,40	0,61%

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Posição de Ativos											
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	VAR	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (31/07/2018)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
RIO BRAVO	RIO BRAVO	RBRD11	0,00%	0,00	3,96%	-4,92%	4,53%	570.913,98	0,37%	140.464.366,86	0,41%
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b - 4604 - Fundos de Investimentos Imobiliários				0,00				1.526.713,98	0,98%		
Sub-total Renda Variável				1,24				5.563.394,40	3,56%		
Total								156.348.013,70	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	120.531.345,70	77,09%	94,23%	100,00%
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604	Fundos de Renda Fixa	28.107.420,10	17,98%	0,00%	40,00%
Artigo 7º VII, Alínea b - 4604	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	2.145.853,50	1,37%	1,38%	5,00%
Total Renda Fixa		150.784.619,30	96,44%		
Renda Variável					
Artigo 8º II, Alínea a - 4604	Fundos de Ações	4.036.680,42	2,58%	2,86%	20,00%
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604	Fundos de Investimentos Imobiliários	1.526.713,98	0,98%	0,91%	5,00%
Total Renda Variável		5.563.394,40	3,56%		

Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)				
Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
Artigo 7º I, Alínea b - 4604 % do CDI	0,88 162,7	3,63 97,1	3,63 51,1	-- --
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 % do CDI	0,95 174,9	3,92 104,9	-- --	-- --
Artigo 7º VII, Alínea b - 4604 % do CDI	1,19 220,1	3,02 80,7	-- --	-- --
Artigo 8º II, Alínea a - 4604 Var. IBOVESPA p.p	5,32 -3,6	-1,40 -5,1	11,05 -9,1	-- --
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604 Var. IBOVESPA p.p	0,00 -8,9	-6,58 -10,3	-- --	-- --

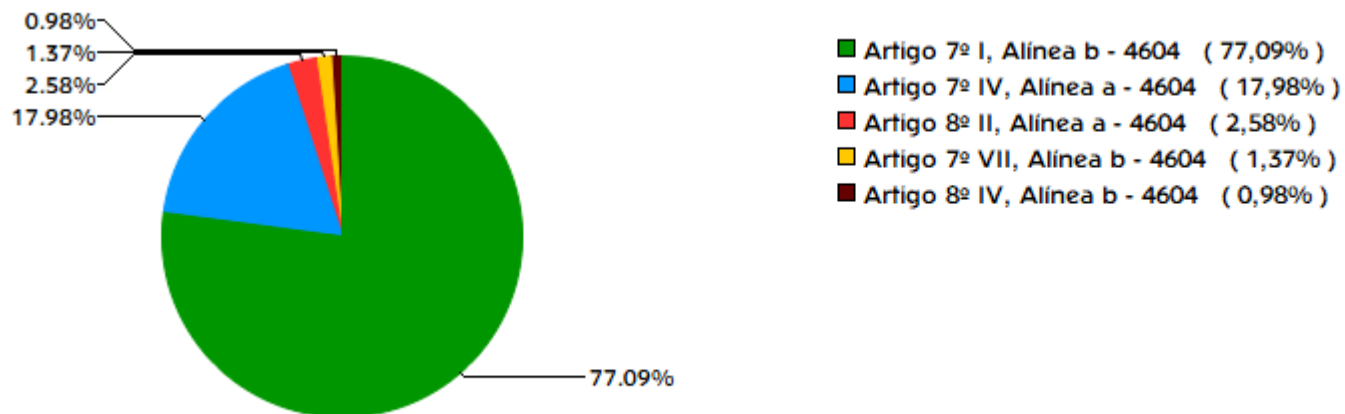
Ganhos Financeiros	
Estratégia	No Mês(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b - 4604	1.054.805,29
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604	258.048,67
Artigo 8º II, Alínea a - 4604	203.878,08
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604	86.926,12
Total	1.603.658,15

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

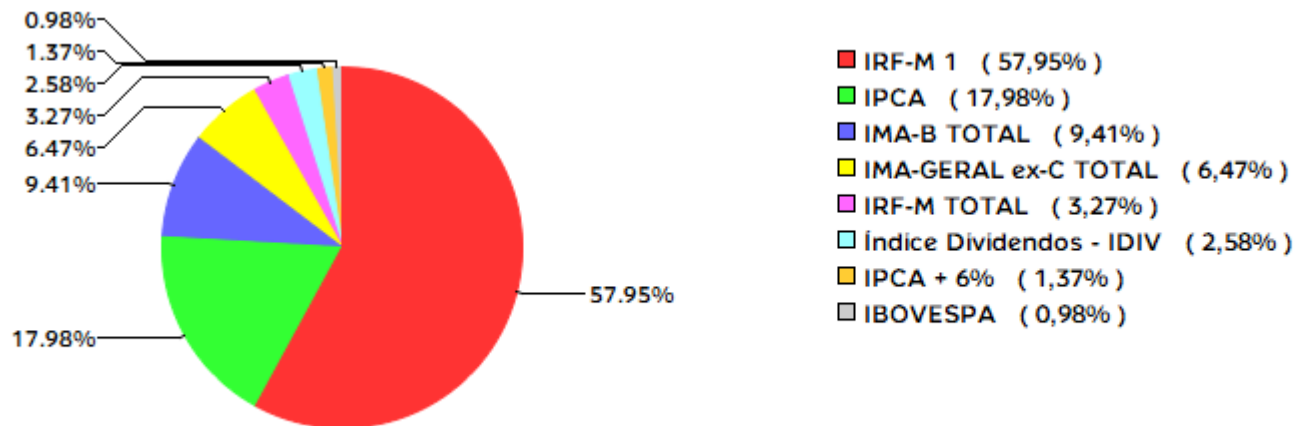
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acum. Bruto (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	156.348.013,70	100	156.348.013,70	100

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia

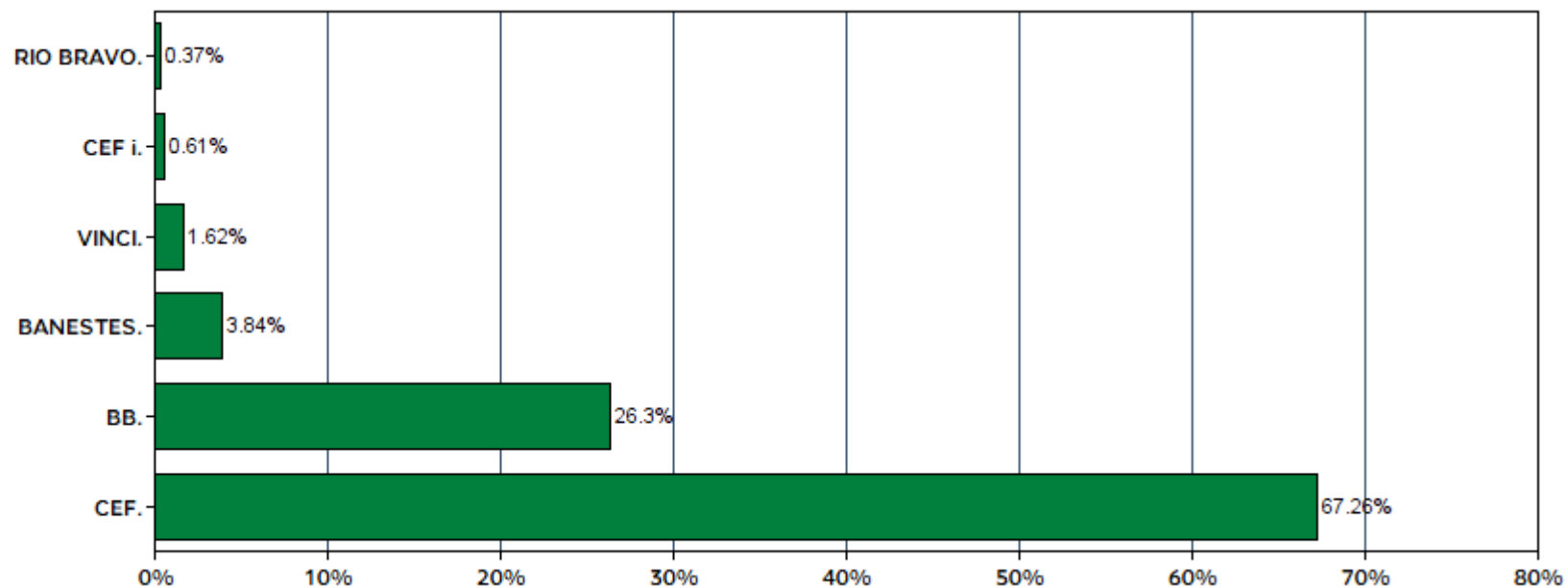


Indexadores



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

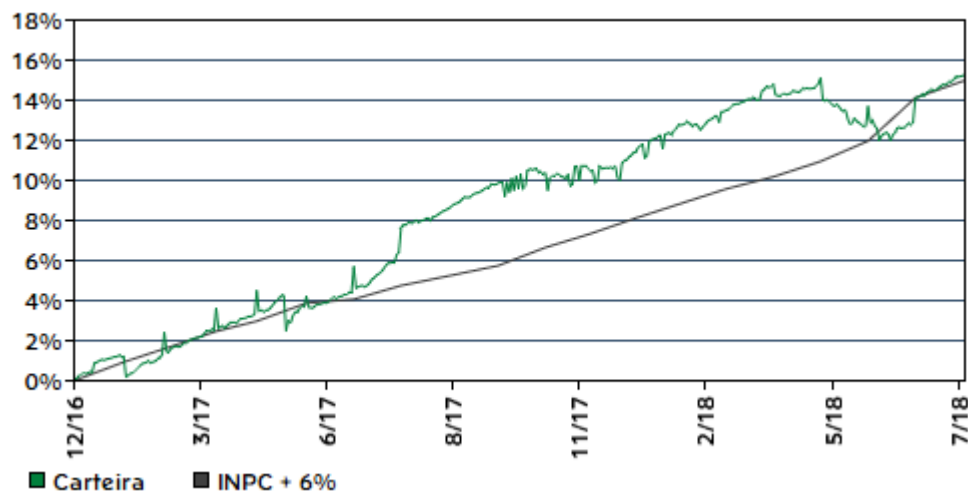
Alocação por Gestor



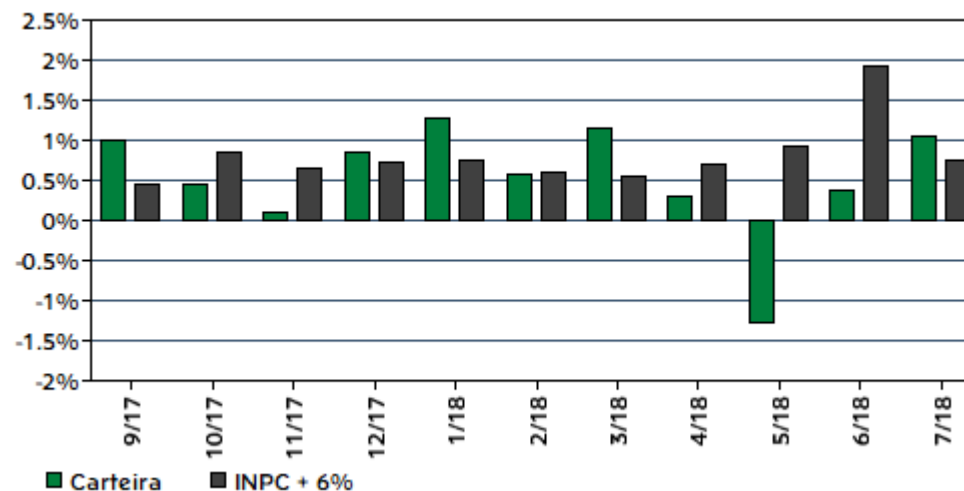
**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

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	-	-	-	-	-	3,47
INPC + 6%	0,74	0,60	0,56	0,70	0,92	1,92	0,76	-	-	-	-	-	6,36
p.p. Indx	0,54	-0,02	0,60	-0,40	-2,21	-1,55	0,30	-	-	-	-	-	-2,88

**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	63,2%
Meses abaixo do Benchmark	7	36,8%

	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	0,12	3,64	-3,5	4,173
06 meses	2,16	5,58	-3,4	3,279
12 meses	7,10	9,78	-2,7	4,134
24 meses	--	--	--	--
36 meses	--	--	--	--
Desde o início	15,28	14,99	0,3	4,472

**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.	3,25 0,93	1,47 -2,03	-3,66 -2,42	-3,06 -3,15	3,94 -2,50	18,89 -3,49	44,83 -2,67
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,68 0,02	3,64 -0,12	1,36 -0,05	3,03 -0,11	7,15 -0,24	21,29 -0,57	38,76 -0,99
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FCFI % do Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	1,37 -0,02	3,96 0,24	0,20 0,19	2,19 0,19	7,29 0,01	-- --	-- --
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M TP % do Var. IRF-M TOTAL p.p.	1,48 0,01	3,78 -0,10	-0,39 -0,02	2,46 -0,09	7,83 -0,22	26,90 -0,51	47,57 -0,96
CAIXA BRASIL IDKa IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RJ LP % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,19 -1,13	4,50 1,00	0,60 1,83	3,51 3,41	8,42 1,97	23,10 0,72	42,82 -4,69
CAIXA FI BRASIL IRFM 1 TP RF % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,68 0,02	3,66 -0,10	1,38 -0,03	3,07 -0,08	7,21 -0,18	21,45 -0,41	39,12 -0,64
FI BRASIL 2018 III TP RF % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,50 -1,81	2,00 -1,50	2,45 3,68	0,95 0,85	2,00 -4,44	8,52 -13,86	18,10 -29,41
FUNDO DE INVESTIMENTO BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS-RENDA FIXA % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,80 0,14	4,05 0,29	0,99 -0,42	3,31 0,16	7,87 0,48	22,99 1,13	41,21 1,45



## 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.	0,95 0,62	3,42 0,47	0,22 -1,78	2,39 -0,26	6,95 2,46	-- --	-- --
CAIXA FI BRASIL IPCA XVI RF CRED PRIV % do Var. IPCA + 6% p.p.	1,19 0,35	3,02 -3,46	0,54 -2,98	2,01 -3,62	5,76 -4,94	18,27 -2,23	37,86 -0,96
BANESTES FIC DE FI ACOES BTG ABSOL. INST % do Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	5,99 -1,28	3,11 3,20	-5,33 2,84	-4,28 4,79	15,23 3,84	17,37 -24,23	34,82 -23,84
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALAOR DIVIDENDOS RPPS % do Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	4,92 -2,35	-5,77 -5,68	-11,18 -3,01	-10,86 -1,79	6,13 -5,27	13,26 -28,34	23,96 -34,70
CXCE11B % do Var. IBOVESPA p.p.	7,32 -1,55	-0,30 -3,99	-2,54 5,46	-1,56 5,14	0,00 -20,18	-- --	-- --
RBRD11 % do Var. IBOVESPA p.p.	3,96 -4,92	4,53 0,84	34,33 42,34	3,26 9,96	0,00 -20,18	-- --	-- --
CDI	0,54	3,73	1,59	3,13	7,09	20,51	37,39
IBOVESPA	8,88	3,69	-8,01	-6,70	20,18	38,24	55,75
DOLAR COMERCIAL	-2,62	13,51	7,87	18,74	19,94	15,93	10,63
INPC + 6%	0,76	6,36	3,64	5,58	9,78	18,75	37,85
IPCA + 6%	0,84	6,48	3,52	5,63	10,70	20,50	38,82