

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos											
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	VAR	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (29/12/2017)	% 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	4,62%	0,53	0,00%	0,00%	0,00%	4.920.375,38	3,32%	4.707.912.251,54	0,10%
BANESTES	BANESTES	BANESTES FI PREVIDENCIÁRIO RF	10,99%	1,19	0,00%	0,00%	0,00%	3.659.422,57	2,47%	235.783.952,88	1,55%
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,68%	0,11	0,00%	0,00%	0,00%	15.797.044,44	10,65%	12.272.521.315,53	0,13%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IRFM 1 TP RF	0,67%	0,11	0,00%	0,00%	0,00%	32.554.982,44	21,95%	17.173.437.880,47	0,19%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP RF LP	3,52%	0,41	0,00%	0,00%	0,00%	49.238.665,00	33,20%	6.666.405.048,53	0,74%
CEF	CEF	CAIXA BRASIL IDKa IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RJ LP	2,70%	0,33	0,00%	0,00%	0,00%	8.154.718,16	5,50%	4.324.047.951,59	0,19%
BB	BB	BB PREVID RF IMA-B 5 LP FIC DE FI	3,54%	0,41	0,00%	0,00%	0,00%	22.097.439,30	14,90%	2.141.105.909,20	1,03%
BANESTES	BANESTES	FUNDO DE INVESTIMENTO BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS-RENDA FIXA	2,04%	0,26	0,00%	0,00%	0,00%	762.266,22	0,51%	103.883.116,56	0,73%
CEF	CEF	FI BRASIL 2018 III TP RF	4,37%	0,47	0,00%	0,00%	0,00%	2.423.648,00	1,63%	146.751.882,51	1,65%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - 4604 - Fundos 100% Títulos Públicos - Referenciado				0,33				139.608.561,51	94,15%		
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Renda Fixa											
BB	BB	BB RPPS RF PERFIL FIC	0,13%	0,05	0,00%	0,00%	0,00%	946.659,29	0,64%	4.205.421.961,32	0,02%
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Renda Fixa				0,05				946.659,29	0,64%		
Artigo 7º VII, Alínea b - 4604 - Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"											
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IPCA XVI RF CRED PRIV	1,35%	0,18	0,00%	0,00%	0,00%	2.083.047,00	1,40%	227.474.588,63	0,92%
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b - 4604 - Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"				0,18				2.083.047,00	1,40%		
Sub-total Renda Fixa				0,32				142.638.267,80	96,19%		
Renda Variável											
Artigo 8º II, Alínea a - 4604 - Fundos de Ações											
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALAOR DIVIDENDOS RPPS	17,19%	1,86	0,00%	0,00%	0,00%	2.692.043,35	1,82%	382.439.702,61	0,70%
BANESTES	BANESTES	BANESTES FIC DE FI ACOES BTG ABSOL. INST	16,19%	1,77	0,00%	0,00%	0,00%	1.454.773,61	0,98%	8.276.298,87	17,58%
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a - 4604 - Fundos de Ações				1,83				4.146.816,96	2,80%		
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604 - Fundos de Investimentos Imobiliários											

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos											
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	VAR	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (29/12/2017)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
CEF i	CEF i	CXCE11B	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	958.664,00	0,65%	-	0,00%
RIO BRAVO	RIO BRAVO	RBRD11	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	546.156,16	0,37%	-	0,00%
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b - 4604 - Fundos de Investimentos Imobiliários				0,00				1.504.820,16	1,01%		
Sub-total Renda Variável				1,34				5.651.637,12	3,81%		
Total								148.289.904,92	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	139.608.561,51	94,15%	0,00%	100,00%
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604	Fundos de Renda Fixa	946.659,29	0,64%	0,00%	40,00%
Artigo 7º VII, Alínea b - 4604	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	2.083.047,00	1,40%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa		142.638.267,80	96,19%		
Renda Variável					
Artigo 8º II, Alínea a - 4604	Fundos de Ações	4.146.816,96	2,80%	0,00%	20,00%
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604	Fundos de Investimentos Imobiliários	1.504.820,16	1,01%	0,00%	5,00%
Total Renda Variável		5.651.637,12	3,81%		

Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)				
Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
Artigo 7º I, Alínea b - 4604	0,35	4,26	4,26	-
% do CDI	64,7	42,8	42,8	-
Artigo 8º II, Alínea a - 4604	5,23	19,71	19,71	-
Var. IBOVESPA p.p	-0,9	-7,1	-7,1	-

Ganhos Financeiros	
Estratégia	No Mês(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b - 4604	8.426,01
Artigo 7º I, Alínea b	849.238,89
Artigo 7º III, Alínea a	190.258,38
Artigo 7º IV, Alínea a	6.304,29
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604	0,00
Artigo 7º VII, Alínea b	8.517,00
Artigo 8º II, Alínea a - 4604	133.876,29
Artigo 8º III	68.273,35
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604	0,00
Artigo 8º VI	-5.517,78
Total	1.259.376,42

Análise da Disponibilidade Financeira				
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acum. Bruto (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	146.206.857,92	99	146.206.857,92	99

de 31 a 364 dias

2.083.047,00

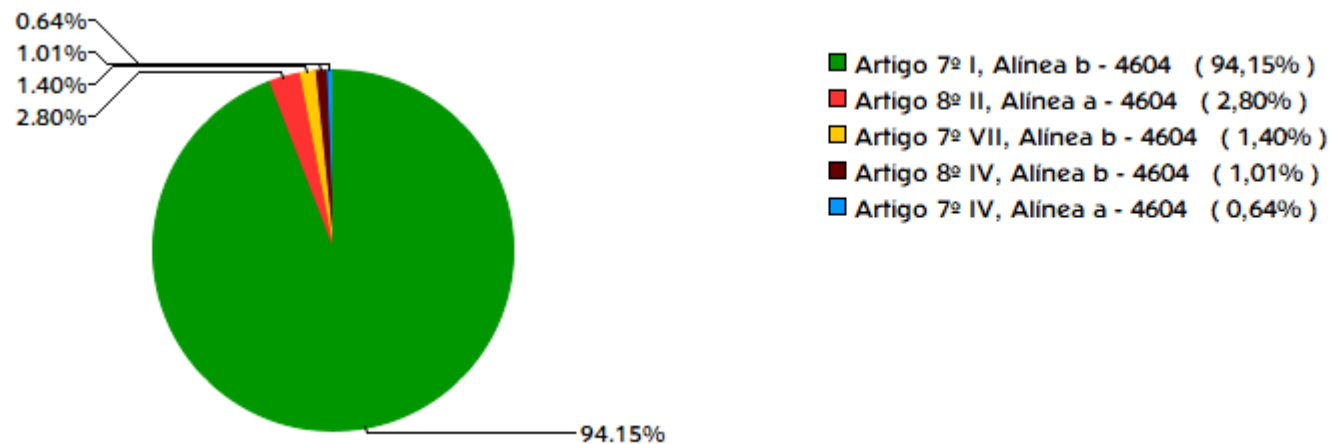
1

148.289.904,92

100

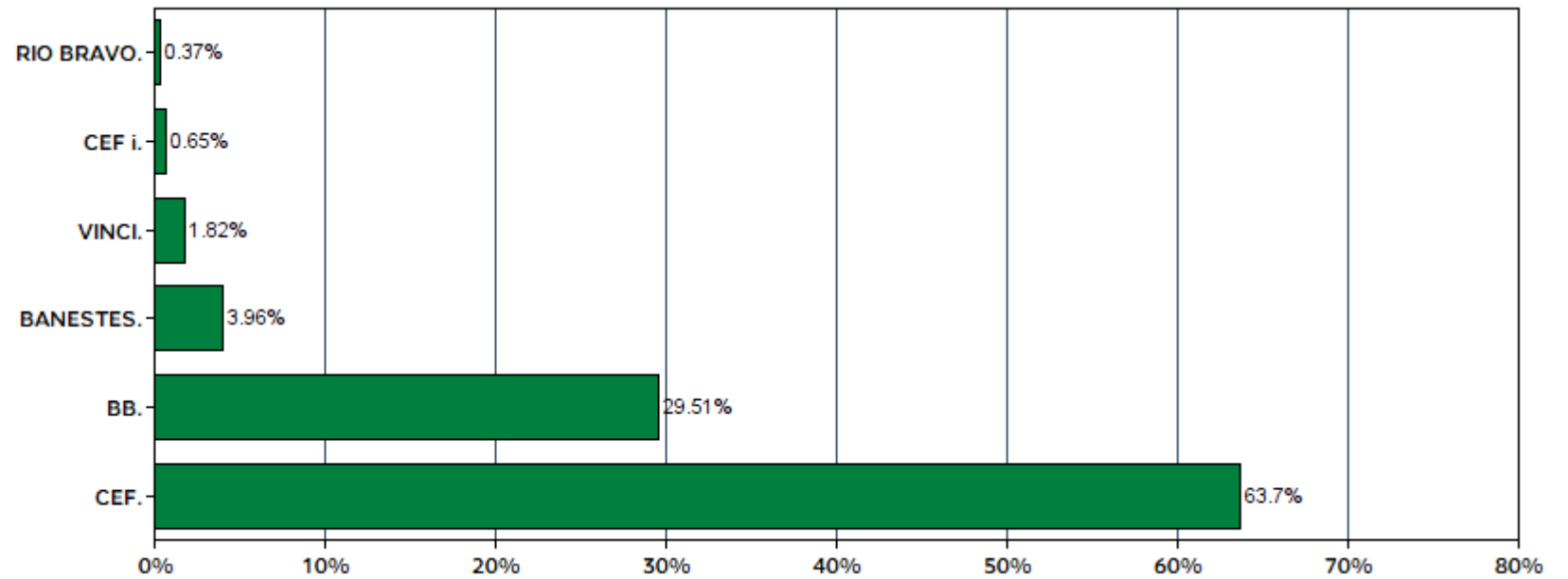
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor

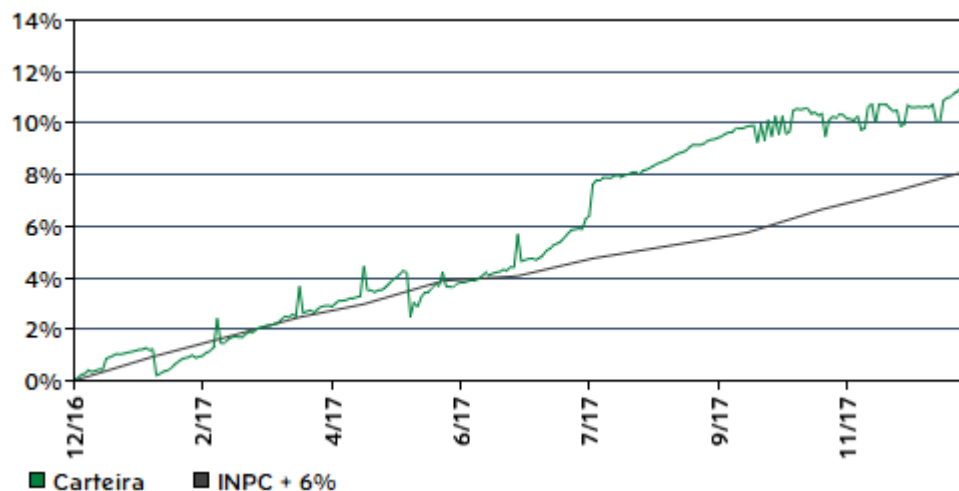


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

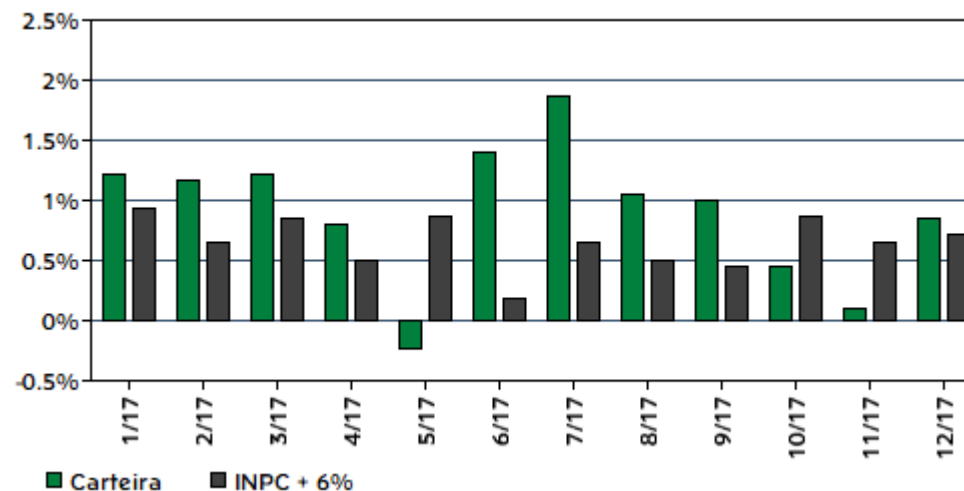
Rentabilidades da Carteira

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

Evolução da Rentabilidade



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco / Retorno da Carteira

	Qtd.	Perct.
Meses acima do Benchmark	9	75,0%
Meses abaixo do Benchmark	3	25,0%

	Rentab.	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,86%	jul/17
Menor rentabilidade da Carteira	-0,24%	mai/17

Período	Rentabilidade (%)			Volat. Anual
	Carteira	INPC + 6%	p.p. Indx.	
03 meses	1,41	2,24	-0,8	5,956
06 meses	5,43	3,89	1,5	5,024
12 meses	11,41	8,12	3,3	4,960
24 meses	--	--	--	--
36 meses	--	--	--	--
Desde o início	11,41	8,12	3,3	4,960

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
FI BRASIL 2018 III TP RF.. % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,35 -0,48	4,26 -8,53	1,57 1,89	1,66 -5,30	4,26 -8,53	13,58 -27,19	-- --
BANESTES FI PREVIDENCIÁRIO RF .. % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,60 -0,23	11,90 -0,90	-1,16 -0,84	6,81 -0,15	11,90 -0,90	41,61 0,83	53,72 0,43
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI.. % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,56 -0,01	10,86 -0,26	1,77 -0,05	4,48 -0,10	10,86 -0,26	26,92 -0,56	42,89 -1,17
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M TP .. % do Var. IRF-M TOTAL p.p.	1,22 -0,02	14,91 -0,29	1,37 -0,07	6,31 -0,12	14,91 -0,29	41,58 -0,54	51,14 -1,11
CAIXA BRASIL IDKa IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RJ LP .. % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,87 0,04	12,34 -0,45	1,85 2,17	6,25 -0,70	12,34 -0,45	29,13 -11,65	49,14 -4,14
CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP RF LP .. % do Var. IMA-B 5 p.p.	0,87 -0,01	12,38 -0,20	1,42 -0,05	6,63 -0,11	12,38 -0,20	29,45 -0,55	48,69 -1,41
CAIXA FI BRASIL IRFM 1 TP RF .. % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,57 0,00	10,93 -0,19	1,79 -0,03	4,51 -0,08	10,93 -0,19	27,11 -0,37	43,33 -0,73
FUNDO DE INVESTIMENTO BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS-RENDA FIXA.. % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,77 0,20	11,53 0,41	1,75 -0,07	5,10 0,52	11,53 0,41	28,57 1,10	45,03 0,97

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
BB PREVID RF IMA-B 5 LP FIC DE FI.. % do Var. IMA-B 5 p.p.	0,87 -0,02	12,42 -0,16	1,42 -0,06	6,65 -0,09	12,42 -0,16	29,60 -0,41	48,86 -1,24
BB RPPS RF PERFIL FIC .. % do % do CDI	0,58 108,04	10,08 101,29	1,83 103,91	4,14 101,85	10,08 101,29	25,36 100,05	42,23 100,72
CAIXA FI BRASIL IPCA XVI RF CRED PRIV.. % do Var. IPCA + 6% p.p.	0,41 -0,50	9,42 0,38	1,55 -1,03	4,00 -0,72	9,42 0,38	27,86 5,02	-- --
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALAOR DIVIDENDOS RPPS .. % do Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	5,23 0,28	19,71 -5,58	1,25 3,02	14,58 -2,30	19,71 -5,58	34,53 -66,56	30,19 -15,71
FIC BANESTES FIA BTG PACTUAL DIVIDENDOS.. % do Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	4,92 -0,02	23,51 -1,79	0,06 1,83	16,87 -0,00	23,51 -1,79	45,71 -55,37	42,37 -3,53
CXCE11B.. % do Var. IBOVESPA p.p.	-1,31 -7,47	1,12 -25,73	-4,13 -6,97	0,78 -20,68	1,12 -25,73	-- --	-- --
RBRD11.. % do Var. IBOVESPA p.p.	1,34 -4,82	24,61 -2,25	-1,12 -3,96	-2,45 -23,91	24,61 -2,25	-- --	-- --
CDI	0,54	9,95	1,76	4,06	9,95	25,35	41,93
IBOVESPA	6,16	26,86	2,84	21,47	26,86	76,25	52,78
DOLAR COMERCIAL	1,42	1,50	4,42	-0,01	1,50	-15,28	24,54
INPC + 6%	0,72	8,12	2,24	3,89	8,12	22,12	43,97
IPCA + 6%	0,91	9,05	2,58	4,73	9,05	22,83	44,03