

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos										
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (31/07/2018)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
Renda Fixa										
BANESTES DTVM	Banco BANESTES	FI BANESTES PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B	6,32%	3,25%	0,93%	1,47%	1.329.970,49	1,00%	198.247.052,97	0,67%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M 1 TP FIC FI	0,50%	0,68%	0,02%	3,64%	8.657.899,89	6,50%	11.702.481.616,22	0,07%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI	4,43%	2,29%	-0,02%	3,35%	47.544.884,20	35,69%	3.931.831.423,60	1,21%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RF LP	4,45%	2,30%	-0,01%	3,35%	23.236.789,14	17,44%	3.471.759.918,07	0,67%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 I TP RF	5,84%	2,22%	-0,09%	1,65%	1.189.006,14	0,89%	388.979.536,86	0,31%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2018 IV TP RF	3,90%	0,50%	-1,81%	2,01%	5.151.840,09	3,87%	290.991.115,43	1,77%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA II FI	1,23%	0,73%	-0,12%	4,71%	3.132.780,72	2,35%	632.369.166,26	0,50%
Sub-total 4604 - Artigo 7º I, Alínea b - FI 100% Títulos TN							90.243.170,67	67,74%		
BANESTES DTVM	Banco BANESTES	FI BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA	5,69%	2,45%	0,13%	0,80%	9.009.469,51	6,76%	183.129.579,77	4,92%
Sub-total 4604 - Artigo 7º III, Alínea a - FI Renda Fixa "Referenciado"							9.009.469,51	6,76%		
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC FI	0,08%	0,52%	96,03%	3,68%	11.193.320,28	8,40%	4.749.425.745,50	0,24%
CEF	CEF	FI CAIXA ALIANÇA TP RF	0,08%	0,53%	98,57%	3,50%	1.600.051,17	1,20%	362.903.810,99	0,44%
BANESTES DTVM	Banco BANESTES	BANESTES ESTRATÉGIA FIC FI RF	--%	0,14%	94,02%	0,14%	2.002.775,16	1,50%	20.889.368,79	9,59%
Sub-total 4604 - Artigo 7º IV, Alínea a - FI Renda Fixa - Geral							14.796.146,61	11,11%		
Sub-total Renda Fixa - FI Renda Fixa - Geral							114.048.786,78	85,61%		
Renda Variável										
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	18,66%	8,76%	-0,11%	3,38%	4.534.114,07	3,40%	73.962.227,88	6,13%
Sub-total 4604 - Artigo 8º I, Alínea a - FI de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações							4.534.114,07	3,40%		
BANESTES DTVM	Banco BANESTES	BANESTES FIC FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INST	16,10%	5,99%	-2,88%	3,11%	1.905.718,79	1,43%	15.958.631,42	11,94%
CEF	CEF	FIA CAIXA DIVIDENDOS	16,39%	6,52%	-2,35%	5,02%	154.163,75	0,12%	61.199.000,12	0,25%
VINCI EQUITIES Gest Rec	CEF	FIC FIA CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	16,17%	4,92%	-3,95%	-5,77%	11.322.382,10	8,50%	396.763.645,16	2,85%
Sub-total 4604 - Artigo 8º II, Alínea a - FI de Ações - Geral							13.382.264,64	10,05%		
RIO BRAVO Invest	CEF	CAIXA RIO BRAVO FII	0,00%	7,78%	7,45%	-3,99%	1.252.273,86	0,94%	158.824.852,30	0,79%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos										
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (31/07/2018)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
Sub-total 4604 - Artigo 8º IV, Alínea b - FI Imobiliários							1.252.273,86	0,94%		
Sub-total Renda Variável							19.168.652,57	14,39%		
Total							133.217.439,35	100%		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

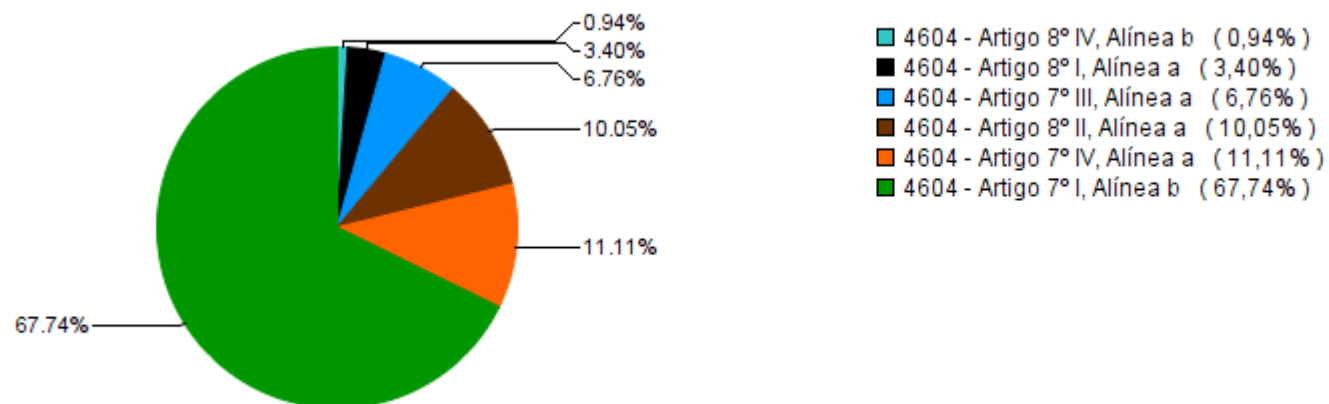
Enquadramento da Carteira					
Artigo	Classe	Valor(R\$)	% Carteira	Política Investimento	Limite Res. 4.604/17
Renda Fixa					
4604 - Artigo 7º I, Alínea b	FI 100% Títulos TN	90.243.170,67	67,74%	69,00%	100,00%
4604 - Artigo 7º III, Alínea a	FI Renda Fixa "Referenciado"	9.009.469,51	6,76%	6,00%	60,00%
4604 - Artigo 7º IV, Alínea a	FI Renda Fixa - Geral	14.796.146,61	11,11%	6,00%	40,00%
Total Renda Fixa		114.048.786,79	85,61%		
Renda Variável					
4604 - Artigo 8º I, Alínea a	FI de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações	4.534.114,07	3,40%	3,00%	30,00%
4604 - Artigo 8º II, Alínea a	FI de Ações - Geral	13.382.264,64	10,05%	13,00%	20,00%
4604 - Artigo 8º IV, Alínea b	FI Imobiliários	1.252.273,86	0,94%	3,00%	5,00%
Total Renda Variável		19.168.652,57	14,39%		

Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)				
Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
4604 - Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,99 367,5	2,88 77,1	5,91 83,4	20,37 99,3
4604 - Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	2,45 451,8	0,80 21,3	3,69 52,0	19,21 93,7
4604 - Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,52 96,3	3,67 98,3	7,09 100,0	20,66 100,7
4604 - Artigo 8º I, Alínea a % do CDI	8,76 1.616,1	3,38 90,6	19,35 272,9	36,63 178,6
4604 - Artigo 8º II, Alínea a % do CDI	5,10 940,8	-4,74 -127,0	7,24 102,0	17,95 87,6
4604 - Artigo 8º IV, Alínea b % do CDI	7,78 1.434,1	-3,99 -106,7	-3,21 -45,3	22,31 108,8

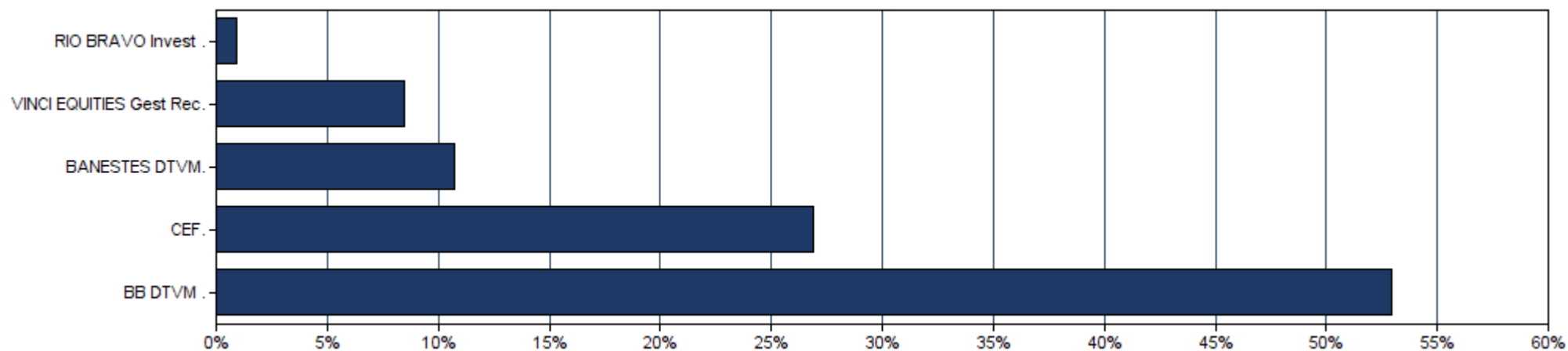
Ganhos Financeiros	
Estratégia	Ganho Bruto (R\$)
4604 - Artigo 7º I, Alínea b	1.762.348,48
4604 - Artigo 7º III, Alínea a	213.704,01
4604 - Artigo 7º IV, Alínea a	77.517,61
4604 - Artigo 8º I, Alínea a	365.312,33
4604 - Artigo 8º II, Alínea a	585.056,84
4604 - Artigo 8º IV, Alínea b	90.571,86
Total	3.094.511,14

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia



Alocação por Gestor

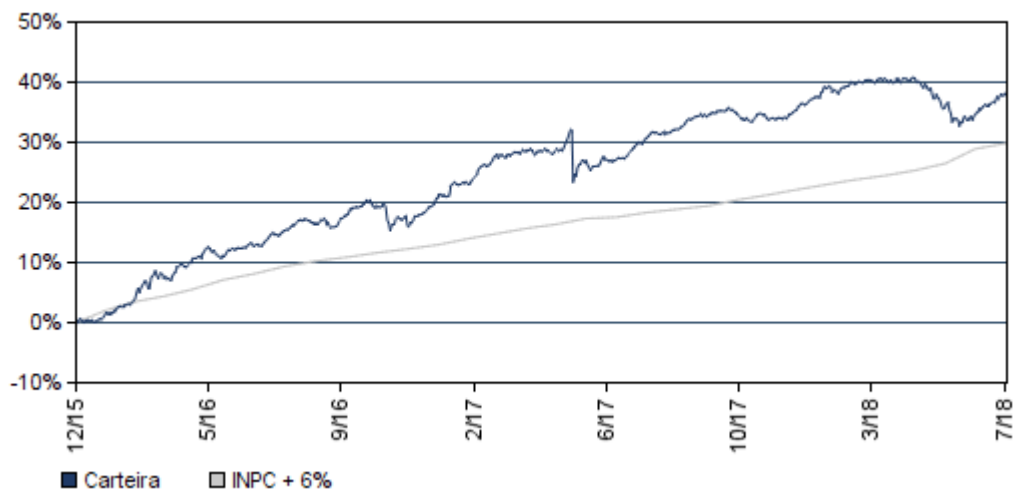


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

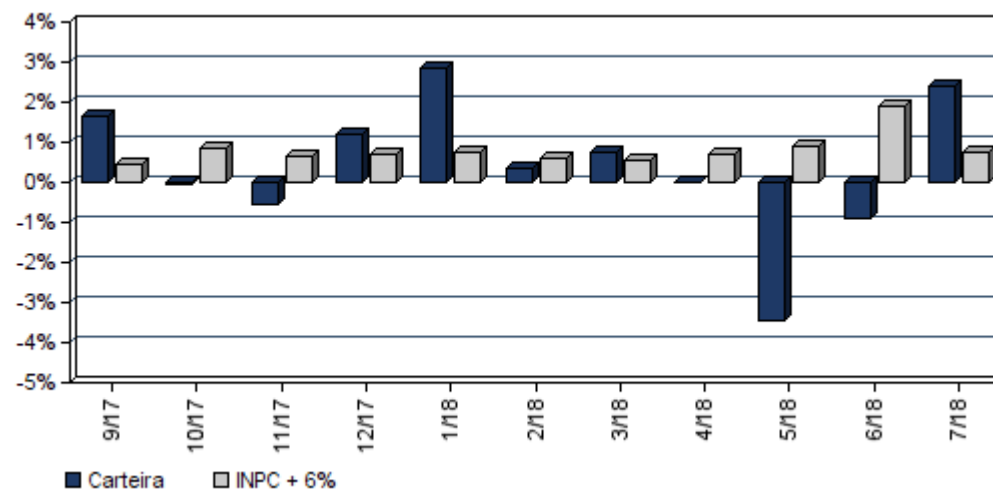
Rentabilidades da Carteira

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
2016	1,34	1,97	4,06	3,03	0,07	1,69	2,33	0,88	1,50	1,07	-1,32	2,51	20,77
IPCA + 6%	1,74	1,34	0,94	1,08	1,27	0,86	1,01	0,98	0,57	0,72	0,64	0,81	12,64
p.p. Indx	-0,40	0,63	3,12	1,95	-1,20	0,83	1,32	-0,10	0,93	0,34	-1,96	1,70	8,13
2017	1,89	3,69	0,85	-0,21	-1,20	0,24	2,79	1,28	1,65	-0,06	-0,56	1,19	12,05
IPCA + 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	0,96	3,03	-0,01	-0,71	-2,07	0,05	2,14	0,78	1,21	-0,92	-1,21	0,46	3,93
2018	2,87	0,34	0,73	-0,01	-3,46	-0,88	2,39	--	--	--	--	--	1,87
IPCA + 6%	0,74	0,60	0,56	0,70	0,92	1,92	0,76	--	--	--	--	--	6,36
p.p. Indx	2,13	-0,26	0,18	-0,71	-4,37	-2,80	1,63	--	--	--	--	--	-4,49

Evolução da Rentabilidade



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco / Retorno da Carteira

	Qtd.	Perct.
Meses acima do Benchmark	19	61,3%
Meses abaixo do Benchmark	12	38,7%

	Rentab.	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	4,09%	mar/16
Menor rentabilidade da Carteira	-3,46%	mai/18

Período	Rentabilidade (%)			Volat. Anual
	Carteira	INPC + 6%	p.p. Indx.	
03 meses	-2,02	3,64	-5,7	0,000
06 meses	-0,98	5,58	-6,6	0,000
12 meses	5,46	9,78	-4,3	0,000
24 meses	19,49	18,75	0,7	0,000
36 meses	--	--	--	--
Desde o início	37,84	29,88	8,0	0,000

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 BANESTES PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B Var. do 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	7,32 -3,66	7,32 -3,66
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M 1 TP FIC FI Var. do 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	8,35 -0,23	8,35 -0,23
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI Var. do IMA-B TOTAL p.p.	2,29 -0,02	3,35 -0,15	-1,29 -0,06	-0,03 -0,13	6,18 -0,26	21,82 -0,56	44,80 -0,90
FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RF LP Var. do IMA-B TOTAL p.p.	2,30 -0,01	3,35 -0,15	-1,30 -0,07	-0,02 -0,12	6,19 -0,26	21,93 -0,45	44,89 -0,81
FI CAIXA BRASIL 2024 I TP RF Var. do IMA-B TOTAL p.p.	2,22 -0,09	1,65 -1,85	-1,18 0,06	-1,36 -1,46	1,80 -4,64	10,93 -11,46	27,16 -18,54
FI CAIXA BRASIL 2018 IV TP RF Var. do IMA-B TOTAL p.p.	0,50 -1,81	2,01 -1,49	2,45 3,68	0,96 0,86	2,01 -4,44	8,52 -13,86	15,86 -29,84
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA II FI Var. do IPCA + 6% p.p.	0,73 -0,12	4,71 -1,77	1,37 -2,15	3,63 -2,00	8,17 -2,53	22,65 2,16	35,61 4,83
FI BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA Var. do IMA-B TOTAL p.p.	2,45 0,13	0,80 -2,70	-4,36 -3,13	-3,37 -3,46	3,69 -2,76	19,21 -3,17	43,09 -2,62

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 PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC FI % do CDI	0,52 96,03	3,68 98,59	1,54 96,95	3,09 98,73	7,11 100,25	20,69 100,90	29,97 99,82
FI CAIXA ALIANÇA TP RF % do CDI	0,53 98,57	3,50 93,83	1,51 95,02	2,92 93,12	6,82 96,22	20,05 97,78	29,64 98,70
BANESTES ESTRATÉGIA FIC FI RF % do CDI	0,14 94,02	0,14 94,02	0,14 94,02	0,14 94,02	0,14 94,02	0,14 94,02	0,14 94,02
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA Var. do IBOVESPA p.p.	8,76 -0,11	3,38 -0,30	-8,12 -0,11	-6,88 -0,18	19,35 -0,82	36,63 -1,61	79,80 -2,96
BANESTES FIC FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INST Var. do IBOVESPA p.p.	5,99 -2,88	3,11 -0,58	-5,33 2,68	-4,28 2,42	1,59 -2,57	1,59 -2,57	1,59 -2,57
FIA CAIXA DIVIDENDOS Var. do IBOVESPA p.p.	6,52 -2,35	5,02 -4,82	5,02 -4,82	5,02 -4,82	5,02 -4,82	5,02 -4,82	5,02 -4,82
FIC FIA CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. do IBOVESPA p.p.	4,92 -3,95	-5,77 -9,46	-11,18 -3,18	-10,86 -4,16	6,13 -14,05	13,26 -24,97	26,76 -55,99
CAIXA RIO BRAVO FII Var. do IPCA p.p.	7,78 7,45	-3,99 -6,93	-4,71 -6,71	-12,47 -15,12	-3,21 -7,70	22,31 15,00	57,28 44,64
IPCA + 5,5%	0,80	6,19	3,40	5,38	10,18	19,37	36,88
CDI	0,54	3,73	1,59	3,13	7,09	20,51	37,39
IMA-B 5	1,48	4,33	0,35	2,95	8,27	23,13	43,18
IMA-B 5+	3,15	2,41	-2,71	-2,42	4,57	21,18	49,39
IMA-B TOTAL	2,32	3,50	-1,23	0,09	6,45	22,38	47,51
IMA-GERAL TOTAL	1,41	3,89	0,09	2,10	7,49	23,59	44,84
IRF-M 1	0,66	3,76	1,41	3,15	7,39	21,86	39,76

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
<i>IRF-M 1+</i>	1,79	3,90	-1,02	2,31	8,26	29,52	52,77
<i>IRF-M TOTAL</i>	1,47	3,88	-0,36	2,55	8,06	27,41	48,53
<i>IBOVESPA</i>	8,88	3,69	-8,01	-6,70	20,18	38,24	55,75
<i>IFIX</i>	1,37	-3,21	-7,82	-5,71	4,28	24,18	46,56
<i>SMALL CAP</i>	5,09	-4,38	-10,21	-8,35	10,75	39,56	62,89
<i>INPC + 6%</i>	0,76	6,36	3,64	5,58	9,78	18,75	37,85
<i>IPCA + 6%</i>	0,84	6,48	3,52	5,63	10,70	20,50	38,82