

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos											
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	VAR	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (31/01/2018)	% 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	4,55%	0,52	1,29%	-0,01%	1,29%	30.872.052,64	6,27%	4.729.358.053,62	0,65%
BANESTES	BANESTES	BANESTES FI PREVIDENCIÁRIO RF	10,88%	1,18	4,67%	1,27%	4,67%	48.453.932,83	9,84%	246.268.759,44	19,68%
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,65%	0,11	0,59%	-0,01%	0,59%	11.348.272,19	2,30%	12.260.945.818,60	0,09%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IMAB TP RF LP	9,35%	1,02	3,37%	-0,03%	3,37%	1.596.332,44	0,32%	4.249.583.705,83	0,04%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IRFM 1 TP RF	0,65%	0,11	0,57%	-0,02%	0,57%	31.246.348,69	6,34%	17.470.086.690,73	0,18%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP RF LP	3,46%	0,41	1,31%	-0,03%	1,31%	106.374.620,04	21,59%	6.740.982.774,06	1,58%
BB	BB	BB RPPS RF IDKA 2 FI	2,70%	0,33	0,96%	165,00%	0,96%	42.462.473,13	8,62%	5.633.824.262,86	0,75%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	8,07%	0,87	3,05%	-0,35%	3,05%	5.902.368,00	1,20%	394.351.398,82	1,50%
BANESTES	BANESTES	FUNDO DE INVESTIMENTO BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS-RENDA FIXA	2,02%	0,25	0,72%	0,12%	0,72%	23.334.074,52	4,74%	108.981.776,14	21,41%
CEF	CEF	CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4,36%	0,47	1,05%	-2,36%	1,05%	1.502.544,73	0,31%	3.273.575.281,08	0,05%
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII	3,16%	0,37	1,17%	-2,23%	1,17%	3.841.060,32	0,78%	1.171.096.134,77	0,33%
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF ALOCACAO ATIVA FCFI	4,92%	0,56	1,72%	0,04%	1,72%	42.782.149,72	8,68%	2.168.161.038,35	1,97%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - 4604 - Fundos 100% Títulos Públicos - Referenciado				0,50				349.716.229,25	70,99%		
Artigo 7º III, Alínea a - 4604 - Fundos Renda Fixa Referenciados											
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF IMAB FI	9,35%	1,02	3,35%	-0,05%	3,35%	40.722.100,97	8,27%	1.072.547.291,88	3,80%
BANESTES	BANESTES	FI BANESTES INSTITUCIONAL RF	10,76%	1,17	4,31%	0,91%	4,31%	33.904.586,22	6,88%	222.406.307,29	15,24%
BB	BB	BB PREVID RF IMA-B 5 LP FIC DE FI	3,47%	0,41	1,31%	-0,02%	1,31%	18.208.432,84	3,70%	2.196.083.459,89	0,83%
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a - 4604 - Fundos Renda Fixa Referenciados				0,96				92.835.120,03	18,84%		
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Renda Fixa											
BANESTES	BANESTES	FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP	0,14%	0,05	0,58%	99,45%	0,58%	11.293.823,06	2,29%	455.525.532,22	2,48%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL REF DI LP	0,13%	0,05	0,57%	97,37%	0,57%	941.944,71	0,19%	6.349.465.352,27	0,01%
INFINITY	INFINITY	INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA	8,93%	0,97	0,81%	139,26%	0,81%	3.295.793,08	0,67%	106.941.077,86	3,08%
BB	BB	BB RPPS RF PERFIL FIC	0,13%	0,05	0,57%	97,88%	0,57%	67.685,06	0,01%	4.094.151.480,10	0,00%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos											
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	VAR	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (31/01/2018)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	4,05%	0,43	1,06%	0,26%	1,06%	4.665.867,50	0,95%	1.336.682.662,13	0,35%
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI	5,89%	0,67	1,82%	1,02%	1,82%	8.593.822,08	1,74%	405.661.844,15	2,12%
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Renda Fixa				0,40				28.858.935,49	5,86%		
Artigo 7º VII, Alínea a - 4604 - Cota Sênior de FIDC											
CEF	CEF	FIDC CASAN SANEAMENTO SEN	6,58%	0,65	-1,13%	-193,54%	-1,13%	4.621.466,44	0,94%	221.830.389,05	2,08%
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a - 4604 - Cota Sênior de FIDC				0,65				4.621.466,44	0,94%		
Sub-total Renda Fixa - Cota Sênior de FIDC								476.031.751,21	96,63%		
Renda Variável											
Artigo 8º II, Alínea a - 4604 - Fundos de Ações											
GERAÇÃO FUTURO	GERAÇÃO FUTURO	GERAÇÃO FI EM AÇÕES	22,26%	2,34	9,67%	-1,47%	9,67%	1.638.755,55	0,33%	124.926.155,07	1,31%
VINCI	VINCI	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALAOR DIVIDENDOS RPPS	17,46%	1,90	5,71%	-4,16%	5,71%	6.163.180,09	1,25%	364.884.519,37	1,69%
BANESTES	BANESTES	FIC BANESTES FIA BTG PACTUAL DIVIDENDOS	16,07%	1,77	7,72%	-2,15%	7,72%	1.648.474,65	0,33%	9.005.639,48	18,30%
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a - 4604 - Fundos de Ações				1,95				9.450.410,29	1,92%		
Artigo 8º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Participações											
BRPP	BRPP	RIO BRAVO ENERGIA I FIP	0,91%	0,09	-0,07%	-11,60%	-0,07%	1.890.430,21	0,38%	258.894.417,45	0,73%
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Participações				0,09				1.890.430,21	0,38%		
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604 - Fundos de Investimentos Imobiliários											
RIO BRAVO	RIO BRAVO	CAIXA RIO BRAVO FII	3,51%	0,37	0,26%	-2,39%	0,26%	2.185.441,26	0,44%	172.186.546,00	1,27%
RIO BRAVO	RIO BRAVO	BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	7,96%	0,84	0,35%	-2,30%	0,35%	1.943.545,50	0,39%	100.578.479,66	1,93%
REAL ESTATE	CEF	DOMC11	0,00%	0,00	-35,50%	-35,76%	-35,50%	1.130.700,00	0,23%	-	0,00%
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b - 4604 - Fundos de Investimentos Imobiliários				0,46				5.259.686,76	1,07%		
Sub-total Renda Variável								16.600.527,26	3,37%		
Total								492.632.278,47	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	349.716.229,25	70,99%	56,00%	100,00%
Artigo 7º III, Alínea a - 4604	Fundos Renda Fixa Referenciados	92.835.120,03	18,84%	25,00%	60,00%
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604	Fundos de Renda Fixa	28.858.935,49	5,86%	6,00%	40,00%
Artigo 7º VII, Alínea a - 4604	Cota Sênior de FIDC	4.621.466,44	0,94%	2,00%	5,00%
Total Renda Fixa		476.031.751,21	96,63%		
Renda Variável					
Artigo 8º II, Alínea a - 4604	Fundos de Ações	9.450.410,29	1,92%	3,00%	20,00%
Artigo 8º IV, Alínea a - 4604	Fundos de Participações	1.890.430,21	0,38%	0,50%	5,00%
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604	Fundos de Investimentos Imobiliários	5.259.686,76	1,07%	2,00%	5,00%
Total Renda Variável		16.600.527,26	3,37%		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)

Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,81 150,7	12,21 122,7	12,21 122,7	-- --
Artigo 7º I, Alínea b - 4604 % do CDI	1,67 286,7	1,67 286,7	-- --	-- --
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	0,80 148,0	12,58 126,4	12,58 126,4	-- --
Artigo 7º III, Alínea a - 4604 % do CDI	3,29 563,9	3,29 563,9	-- --	-- --
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,72 133,0	11,14 111,9	11,14 111,9	-- --
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 % do CDI	1,11 189,9	1,11 189,9	-- --	-- --
Artigo 7º VII, Alínea a - 4604 % do CDI	-1,13 -193,5	-1,13 -193,5	-- --	-- --
Artigo 8º II, Alínea a - 4604 Var. IBOVESPA p.p	6,73 -4,4	6,73 -4,4	-- --	-- --
Artigo 8º IV, Alínea a - 4604 Var. IBOVESPA p.p	0,00 -11,1	0,00 -11,1	-- --	-- --
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604 Var. IBOVESPA p.p	37,83 26,7	37,83 26,7	-- --	-- --
Artigo 8º VI Var. IBOVESPA p.p	0,00 -6,2	-28,19 -55,0	-28,19 -55,0	-- --

Ganhos Financeiros

Estratégia	Ganho Bruto (R\$)
Artigo 7º I, Alínea b - 4604	5.752.868,14
Artigo 7º III, Alínea a - 4604	2.965.979,71
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604	284.004,05
Artigo 7º VII, Alínea a - 4604	-52.776,79
Artigo 8º II, Alínea a - 4604	595.756,72
Artigo 8º IV, Alínea a - 4604	-1.279,79
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604	-609.869,79
Total	8.934.682,25

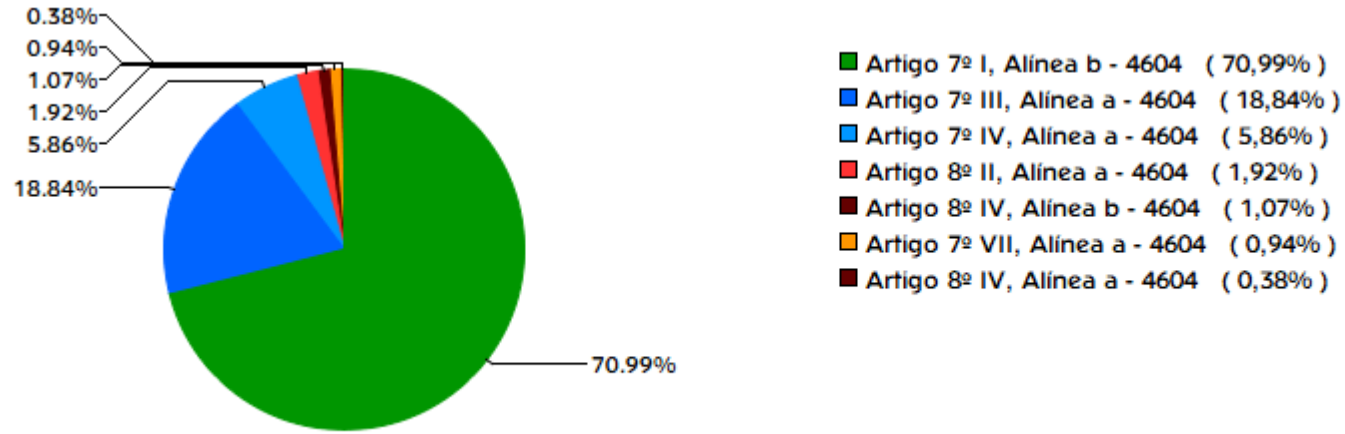
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise da Disponibilidade Financeira

Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acum. Bruto (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	461.614.719,19	94	461.614.719,19	94
de 31 a 364 dias	6.168.412,23	1	467.783.131,42	95
acima de 365 dias	24.849.147,05	5	492.632.278,47	100

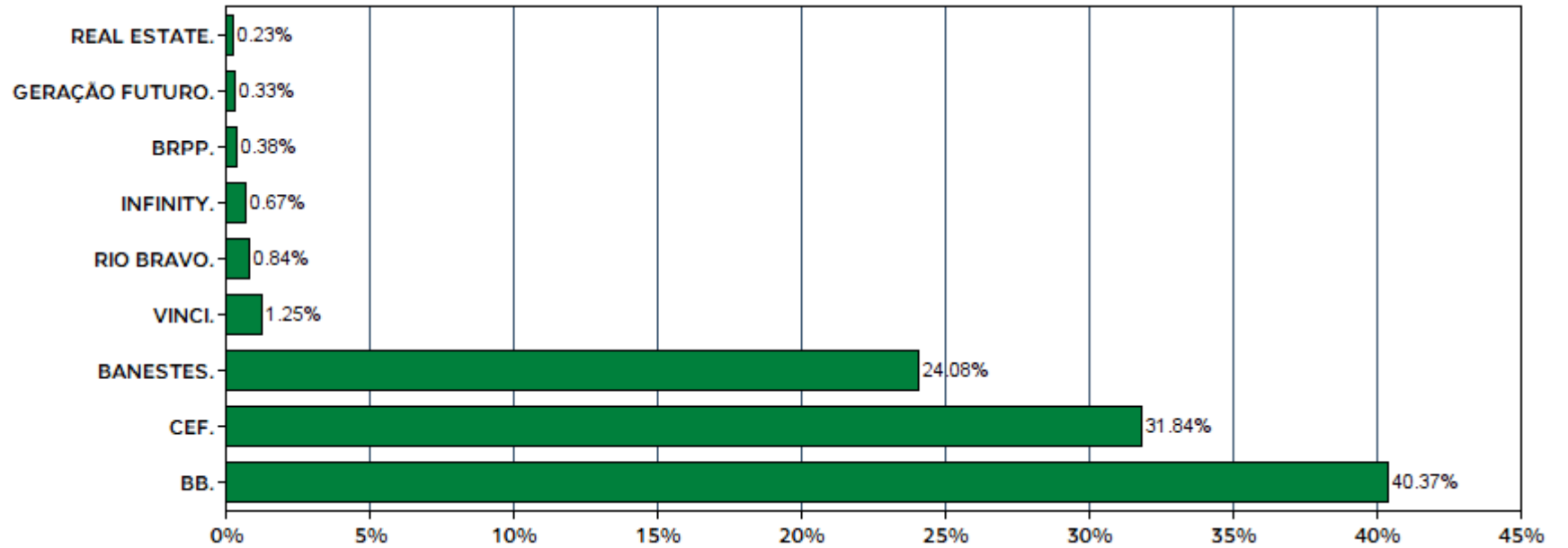
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

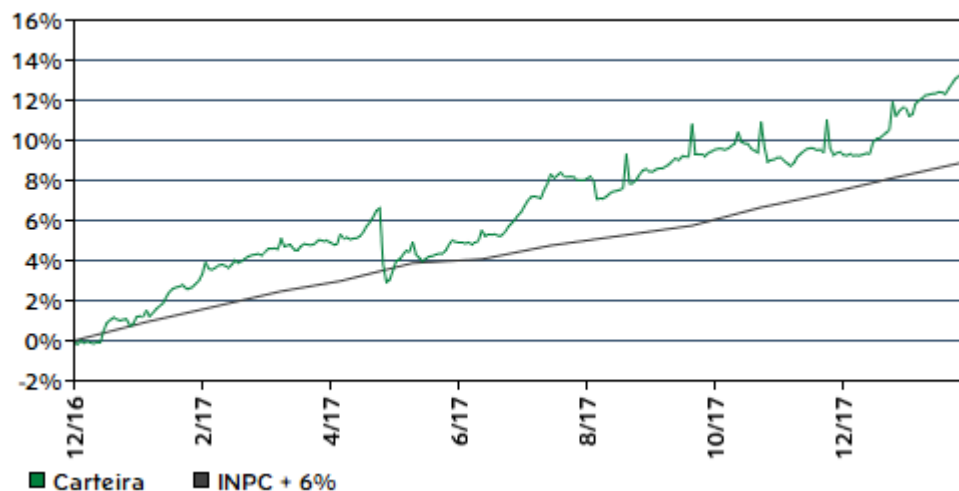
Alocação por Gestor



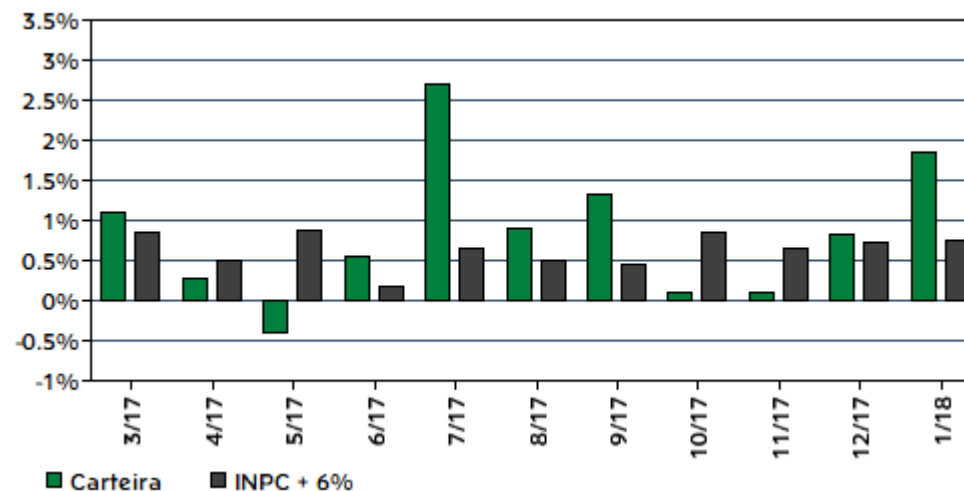
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira													
Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
2017	1,54	2,35	1,09	0,27	-0,39	0,55	2,69	0,89	1,33	0,09	0,10	0,83	11,90
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	0,61	1,69	0,24	-0,22	-1,26	0,36	2,04	0,39	0,89	-0,77	-0,55	0,10	3,78
2018	1,86	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	1,86
INPC + 6%	0,74	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	0,74
p.p. Indx	1,12	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	1,12

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	69,2%
Meses abaixo do Benchmark	4	30,8%

	Rentab.	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,69%	jul/17
Menor rentabilidade da Carteira	-0,39%	mai/17

Período	Rentabilidade (%)			Volat. Anual
	Carteira	INPC + 6%	p.p. Indx.	
03 meses	2,80	2,13	0,7	0,000
06 meses	5,19	3,98	1,2	0,000
12 meses	12,25	7,91	4,3	0,000
24 meses	--	--	--	--
36 meses	--	--	--	--
Desde o início	13,98	8,92	5,1	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
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,17 -2,23	1,17 -2,23	1,98 -1,49	4,59 -1,76	12,19 -2,30	27,57 -15,27	-- --
BANESTES FI PREVIDENCIÁRIO RF % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	4,67 1,27	4,67 1,27	4,20 0,73	7,22 0,88	14,95 0,45	46,05 3,21	56,05 2,34
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,59 -0,01	0,59 -0,01	1,74 -0,05	4,00 -0,12	10,12 -0,23	25,62 -0,53	42,31 -1,07
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FCFI % do Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	1,72 0,04	1,72 0,04	2,51 -0,07	4,99 -0,19	12,17 -0,62	-- --	-- --
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M TP % do Var. IRF-M TOTAL p.p.	1,29 -0,01	1,29 -0,01	2,59 -0,05	5,25 -0,13	13,78 -0,31	39,58 -0,47	50,47 -1,05
BB RPPS RF IDKA 2 FI % do % do CDI	0,96 165,00	0,96 165,00	2,12 124,94	4,80 125,00	12,27 130,42	26,56 107,27	47,58 114,80
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,05 -2,36	1,05 -2,36	1,61 -1,85	1,04 -5,30	4,30 -10,19	10,82 -32,02	-- --
CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP RF LP % do Var. IMA-B 5 p.p.	1,31 -0,03	1,31 -0,03	2,28 -0,06	5,06 -0,11	12,57 -0,20	27,44 -0,50	47,69 -1,36

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 FI BRASIL IMAB TP RF LP % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	3,37 -0,03	3,37 -0,03	3,39 -0,07	6,21 -0,13	14,24 -0,25	42,39 -0,45	50,85 -2,85
CAIXA FI BRASIL IRFM 1 TP RF % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,57 -0,02	0,57 -0,02	1,74 -0,05	4,02 -0,09	10,18 -0,18	25,79 -0,37	42,65 -0,73
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	3,05 -0,35	3,05 -0,35	2,77 -0,70	3,21 -3,14	8,77 -5,72	26,90 -15,94	27,92 -25,78
FUNDO DE INVESTIMENTO BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS-RENDA FIXA % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,72 0,12	0,72 0,12	2,00 0,21	4,42 0,30	10,71 0,36	27,66 1,51	44,67 1,29
BB PREVID RF IMA-B 5 LP FIC DE FI % do Var. IMA-B 5 p.p.	1,31 -0,02	1,31 -0,02	2,28 -0,05	5,06 -0,11	12,61 -0,16	27,54 -0,40	47,87 -1,17
BB PREVIDENCIARIO RF IMAB FI % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	3,35 -0,05	3,35 -0,05	3,42 -0,04	6,27 -0,07	14,41 -0,08	42,42 -0,42	52,87 -0,84
FI BANESTES INSTITUCIONAL RF % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	4,31 0,91	4,31 0,91	4,02 0,56	7,30 0,95	14,82 0,32	45,93 3,09	55,92 2,21
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI % do Var. IPCA + 6% p.p.	1,82 1,02	1,82 1,02	2,78 0,31	5,72 0,92	14,62 5,67	37,27 15,57	49,72 7,01
BB RPPS RF PERFIL FIC % do % do CDI	0,57 97,88	0,57 97,88	1,73 101,51	3,90 101,49	9,51 101,09	24,76 99,99	41,71 100,64
CAIXA FI BRASIL REF DI LP % do % do CDI	0,57 97,37	0,57 97,37	1,66 97,37	3,78 98,57	9,39 99,84	24,73 99,88	41,51 100,16
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP % do % do CDI	0,58 99,45	0,58 99,45	1,64 96,33	3,73 97,19	9,39 99,81	24,89 100,50	41,00 98,93
FI CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS RF % do Var. IPCA + 6% p.p.	1,06 0,26	1,06 0,26	2,61 0,14	2,08 -2,72	3,16 -5,79	9,62 -12,08	21,52 -21,20
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA % do % do CDI	0,81 139,26	0,81 139,26	1,93 113,57	4,29 111,69	10,91 116,00	28,00 113,07	47,05 113,54
FIDC CASAN SANEAMENTO SEN % do % do CDI	-1,13 -193,54	-1,13 -193,54	-3,54 -208,21	-6,84 -178,13	-8,23 -87,51	-8,59 -34,68	-8,70 -20,99
FIC BANESTES FIA BTG PACTUAL DIVIDENDOS % do Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	7,72 -2,15	7,72 -2,15	10,58 2,95	20,39 -2,12	29,02 2,24	57,98 -86,24	58,54 -21,93

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
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALAOR DIVIDENDOS RPPS % do Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	5,71 -4,16	5,71 -4,16	7,79 0,16	19,06 -3,44	23,08 -3,70	46,62 -97,59	46,02 -34,46
GERAÇÃO FI EM AÇÕES % do Var. IBOVESPA p.p.	9,67 -1,47	9,67 -1,47	6,62 -7,65	11,86 -16,95	5,17 -26,13	28,31 -81,84	32,81 -48,22
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO % do Var. IFIX p.p.	0,35 -2,30	0,35 -2,30	-0,40 -3,05	-11,07 -21,67	-9,09 -27,24	-6,33 -79,17	-2,01 -68,56
CAIXA RIO BRAVO FII % do Var. IFIX p.p.	0,26 -2,39	0,26 -2,39	-4,91 -7,56	-0,42 -11,02	-0,09 -18,24	26,32 -46,53	13,90 -52,64
DOMC11 % do Var. IBOVESPA p.p.	-35,50 -46,64	-35,50 -46,64	-19,24 -33,51	-- --	-- --	-- --	-- --
RIO BRAVO ENERGIA I FIP % do % do CDI	-0,07 -11,60	-0,07 -11,60	-- --	18,59 484,14	17,77 188,93	16,23 65,55	-51,83 -125,07
CDI	0,58	0,58	1,70	3,84	9,40	24,76	41,44
IBOVESPA	11,14	11,14	14,27	28,81	31,30	110,15	81,02
DOLAR COMERCIAL	-4,40	-4,40	-3,49	1,01	1,13	-21,78	18,78
INPC + 6%	0,74	0,74	2,13	3,98	7,91	20,63	42,23
IPCA + 6%	0,80	0,80	2,47	4,80	8,95	21,70	42,71