

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos

Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	VAR	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (31/01/2019)	% 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	3,39%	0,39	1,37%	-0,02%	1,37%	51.878.342,17	9,16%	5.222.909.560,37	0,99%
BANESTES	BANESTES	BANESTES PREVIDENCIARIO FI RF REF IMA-B	7,77%	0,86	5,36%	0,99%	5,36%	34.875.151,47	6,16%	225.992.034,94	15,43%
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,55%	0,08	0,58%	-0,00%	0,58%	12.113.806,69	2,14%	11.421.020.245,51	0,11%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IMAB TP FI RF LP	5,48%	0,62	4,39%	0,03%	4,39%	3.525.757,34	0,62%	8.160.723.544,72	0,04%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IRFM 1 TP FI RF	0,55%	0,08	0,57%	-0,01%	0,57%	45.811.886,80	8,09%	17.170.876.640,61	0,27%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP FI RF LP	3,06%	0,36	1,53%	-0,01%	1,53%	106.169.931,29	18,75%	8.675.733.038,54	1,22%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	6,75%	0,72	2,42%	-1,95%	2,42%	6.218.388,00	1,10%	415.465.378,69	1,50%
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2 FI	2,36%	0,28	1,22%	-0,05%	1,22%	46.494.629,42	8,21%	6.832.498.254,71	0,68%
BB	BB	BB IMA-B 5 FIC RF PREVIDENCIÁRIO LP	3,05%	0,35	1,52%	-0,02%	1,52%	20.006.838,89	3,53%	3.212.136.258,09	0,62%
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI	4,53%	0,51	1,94%	1,11%	1,94%	9.015.512,78	1,59%	473.530.443,52	1,90%
BANESTES	BANESTES	FUNDO DE INVESTIMENTO BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS-RENDA FIXA	1,11%	0,15	0,86%	0,28%	0,86%	38.943.923,01	6,88%	192.307.871,15	20,25%
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII	2,09%	0,25	1,34%	-3,02%	1,34%	2.344.590,38	0,41%	669.215.885,08	0,35%
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FICFI	2,76%	0,33	2,01%	0,10%	2,01%	50.923.265,04	8,99%	4.940.753.535,49	1,03%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - 4604 - Fundos 100% Títulos Públicos - Referenciado				0,34				428.322.023,28	75,65%		
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Renda Fixa											
BANESTES	BANESTES	FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP	0,04%	0,03	0,53%	98,33%	0,53%	8.950.849,58	1,58%	481.061.113,79	1,86%
BANESTES	BANESTES	FI BANESTES INVESTIDOR CURTO PRAZO	0,01%	0,01	0,28%	52,18%	0,28%	2.989.914,62	0,53%	466.604.557,91	0,64%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL RF REF DI LP	0,02%	0,03	0,53%	97,40%	0,53%	7.123.569,81	1,26%	6.807.583.623,84	0,10%
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF IMAB FI	5,43%	0,62	4,35%	-0,02%	4,35%	39.599.517,30	6,99%	1.058.776.180,32	3,74%
BANESTES	BANESTES	FI BANESTES INSTITUCIONAL RF	6,66%	0,74	4,78%	0,41%	4,78%	27.734.858,52	4,90%	210.950.606,87	13,15%
BB	BB	BB RPPS RF PERFIL FIC	0,04%	0,03	0,53%	97,64%	0,53%	1.574.014,32	0,28%	4.246.690.677,69	0,04%
BANESTES	BANESTES	BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI	0,04%	0,03	0,59%	108,77%	0,59%	24.365.903,51	4,30%	948.879.461,76	2,57%
BANESTES	BANESTES	BANESTES ESTRATEGIA FIC DE FI RF	-0%	-	1,82%	336,06%	1,82%	4.327.826,92	0,76%	41.413.498,70	10,45%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos

Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	VAR	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (31/01/2019)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Renda Fixa				0,39				116.666.454,58	20,60%		
Artigo 7º VII, Alínea a - 4604 - Cota Sênior de FIDC											
CEF	CEF	FIDC CASAN SANEAMENTO SEN	0,00%	0,00	-1,60%	-294,43%	-1,60%	3.780.978,73	0,67%	1,07	353.775.105,71%
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a - 4604 - Cota Sênior de FIDC				0,00				3.780.978,73	0,67%		
Sub-total Renda Fixa				0,35				548.769.456,59	96,92%		
Renda Variável											
Artigo 8º II, Alínea a - 4604 - Fundos de Ações											
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	18,58%	2,00	12,23%	12,23%	12,23%	7.246.459,38	1,28%	506.731.472,62	1,43%
CEF	CEF	Caixa FI Ações Institucional BDR Nível I	18,85%	2,00	0,66%	-10,16%	0,66%	1.427.969,32	0,25%	415.620.508,23	0,34%
BANESTES	BANESTES	BANESTES FIC DE FI ACOES BTG ABSOL. INST	19,48%	2,10	7,61%	7,61%	7,61%	2.916.068,07	0,52%	27.842.798,15	10,47%
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a - 4604 - Fundos de Ações				2,02				11.590.496,77	2,05%		
Artigo 8º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Participações											
RIO BRAVO	CEF	BRASIL ENERGIA RENOVÁVEL - FIP MULTISTRATÉGIA	0,00%	0,00	-0,09%	-16,41%	-0,09%	1.930.924,85	0,34%	264.440.158,71	0,73%
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Participações				0,00				1.930.924,85	0,34%		
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604 - Fundos de Investimentos Imobiliários											
RIO BRAVO	RIO BRAVO	CAIXA RIO BRAVO FII	0,00%	0,00	1,10%	-1,37%	1,10%	2.139.584,67	0,38%	1,07	200.899.176,74%
RIO BRAVO	RIO BRAVO	BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	0,00%	0,00	0,73%	-1,75%	0,73%	1.777.041,64	0,31%	1,00	177.052.119,99%
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b - 4604 - Fundos de Investimentos Imobiliários				0,00				3.916.626,31	0,69%		
Sub-total Renda Variável				1,35				17.438.047,93	3,08%		
Total								566.207.504,52	100%		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Classe	Valor(R\$)	% Carteira	Politica Investimento	Limite Res. 3.922/10
Renda Fixa					
Artigo 7º I, Alínea b - 4604	Fundos 100% Títulos Públicos - Referenciado	428.322.023,28	75,65%	55,00%	100,00%
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604	Fundos de Renda Fixa	116.666.454,58	20,60%	19,00%	40,00%
Artigo 7º VII, Alínea a - 4604	Cota Sênior de FIDC	3.780.978,73	0,67%	1,00%	5,00%
Total Renda Fixa		548.769.456,59	96,92%		
Renda Variável					
Artigo 8º II, Alínea a - 4604	Fundos de Ações	11.590.496,77	2,05%	3,00%	20,00%
Artigo 8º IV, Alínea a - 4604	Fundos de Participações	1.930.924,85	0,34%	0,50%	5,00%
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604	Fundos de Investimentos Imobiliários	3.916.626,31	0,69%	0,00%	5,00%
Total Renda Variável		17.438.047,93	3,08%		

Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)

Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
Artigo 7º I, Alínea b - 4604 % do CDI	1,69 311,0	1,69 311,0	9,75 152,9	20,52 125,2
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 % do CDI	2,79 513,5	2,79 513,5	9,78 153,2	- -
Artigo 7º VII, Alínea a - 4604 % do CDI	0,00 0,0	0,00 0,0	10,22 160,1	- -
Artigo 8º II, Alínea a - 4604 Var. IBOVESPA p.p	9,50 -1,3	9,50 -1,3	14,60 -0,1	42,40 -8,2
Artigo 8º IV, Alínea a - 4604 Var. IBOVESPA p.p	0,00 -10,8	0,00 -10,8	0,00 -14,7	- -
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604 Var. IBOVESPA p.p	0,93 -9,9	0,93 -9,9	1,30 -13,4	- -

Ganhos Financeiros

Estratégia	No Mês(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a	150.873,55
Artigo 7º I, Alínea b - 4604	7.085.215,59
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604	3.276.405,04
Artigo 7º VII, Alínea a - 4604	-61.434,99
Artigo 8º II, Alínea a - 4604	1.005.347,71
Artigo 8º IV, Alínea a - 4604	-1.722,18
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604	35.989,01
Total	11.490.673,73

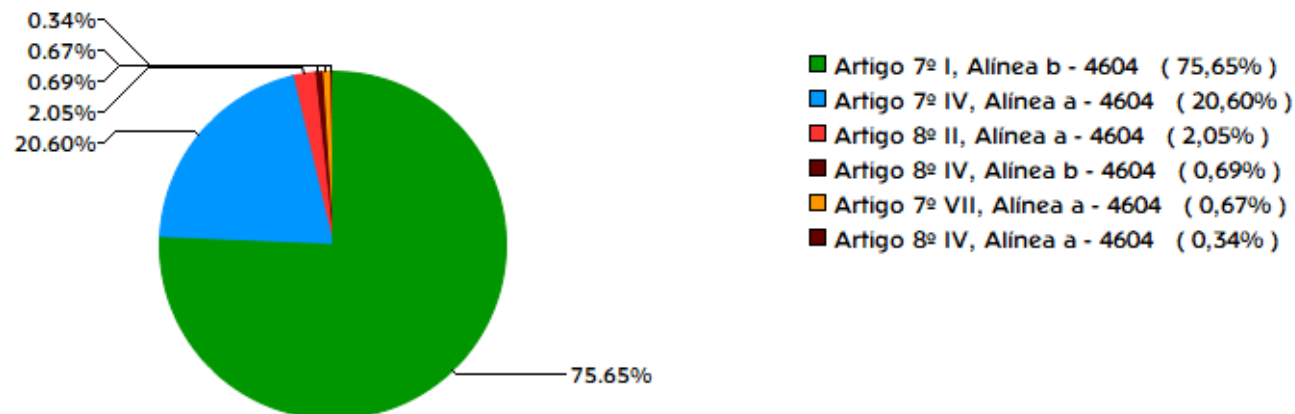
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise da Disponibilidade Financeira

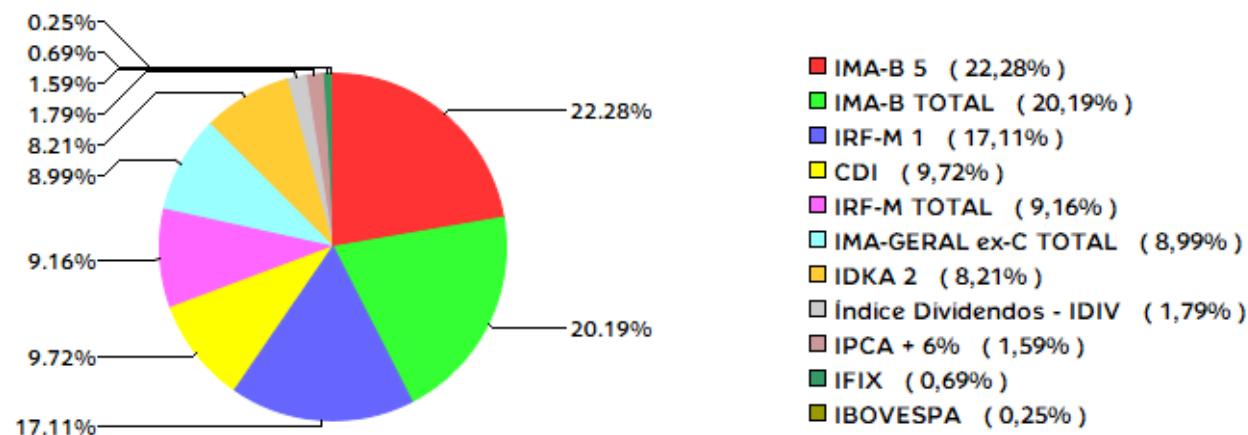
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acum. Bruto (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	541.140.068,14	96	541.140.068,14	96
acima de 365 dias	25.067.436,38	4	566.207.504,52	100

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia

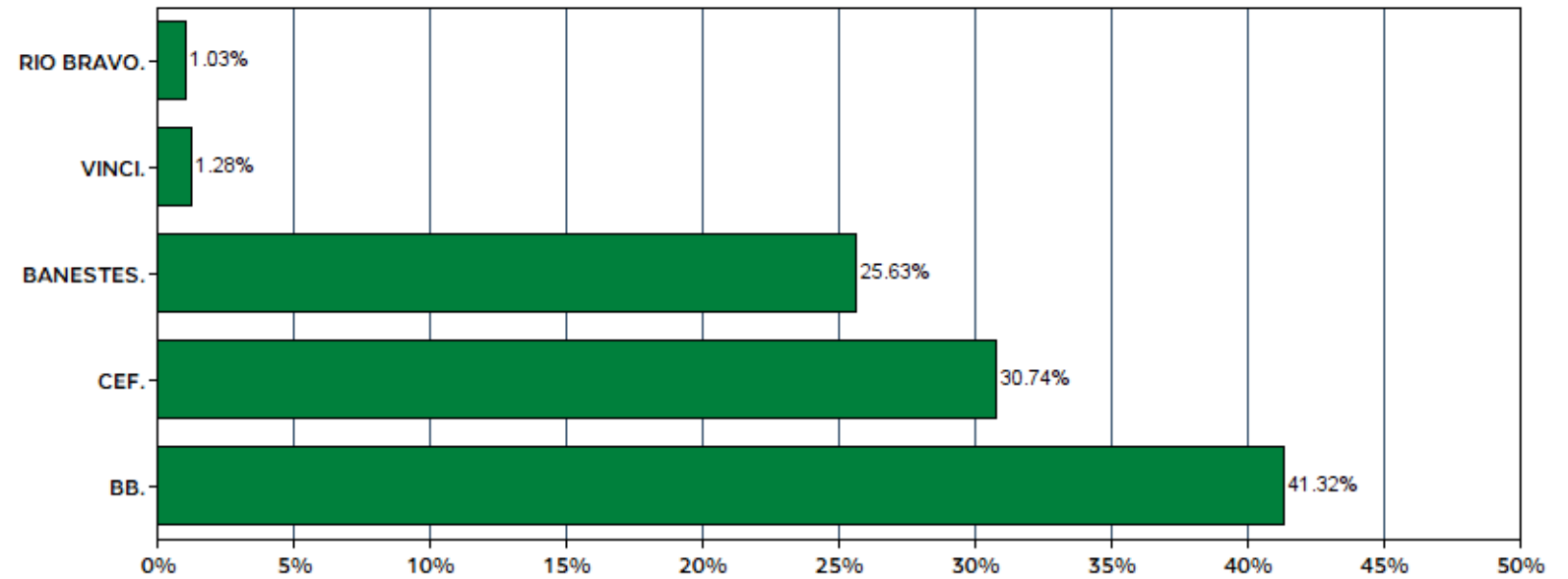


Indexadores



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor

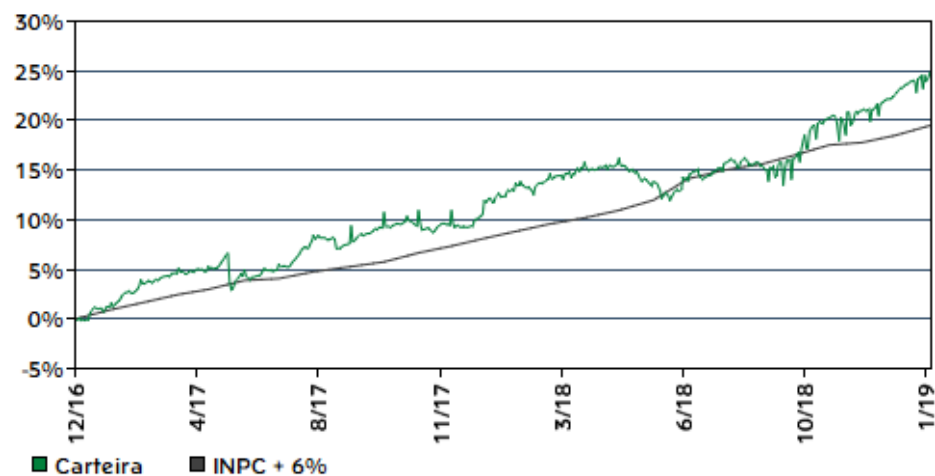


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

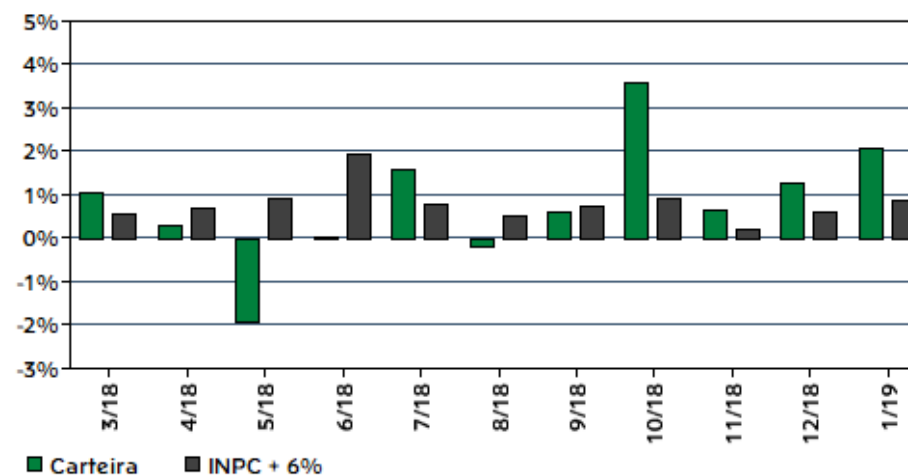
Rentabilidades da Carteira

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
2017	1,54	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	1,75	0,64	1,04	0,29	-1,93	0,01	1,56	-0,20	0,59	3,57	0,63	1,25	9,50
INPC + 6%	0,74	0,60	0,56	0,70	0,92	1,92	0,76	0,53	0,74	0,91	0,21	0,60	9,59
p.p. Indx	1,01	0,04	0,49	-0,41	-2,84	-1,92	0,80	-0,74	-0,15	2,66	0,42	0,65	-0,09
2019	2,04	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	2,04
INPC + 6%	0,87	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0,87
p.p. Indx	1,17	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	-	1,17

Evolução da Rentabilidade



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco / Retorno da Carteira

	Qtd.	Perct.	Período	Rentabilidade (%)			Volat. Anual
				Carteira	INPC + 6%	p.p. Indx.	
Meses acima do Benchmark	16	64,0%	03 meses	3,97	1,70	2,3	9,392
Meses abaixo do Benchmark	9	36,0%	06 meses	8,10	3,94	4,2	9,867
			12 meses	9,81	9,73	0,1	7,593
			24 meses	23,14	18,41	4,7	6,768
			36 meses	–	–	–	–
			Desde o início	25,03	19,52	5,5	6,655

	Rentab.	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	3,57%	out/18
Menor rentabilidade da Carteira	-1,93%	mai/18

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
NTNB 15/05/2035 IPCA+5.0500% % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,68 -3,69	0,68 -3,69	1,45 -5,39	– –	– –	– –	– –
BB IMA-B 5 FIC RF PREVIDENCIÁRIO LP % do Var. IMA-B 5 p.p.	1,52 -0,02	1,52 -0,02	3,02 -0,05	6,83 -0,10	9,88 -0,21	23,73 -0,42	40,13 -0,71
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,34 -3,02	1,34 -3,02	2,69 -4,36	6,34 -7,67	9,98 -4,13	23,39 -7,27	40,30 -22,69
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF REF IMA-B % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	5,36 0,99	5,36 0,99	8,86 1,82	17,78 3,78	14,18 0,07	31,24 0,59	66,76 3,76
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,58 -0,00	0,58 -0,00	1,64 -0,05	3,60 -0,09	6,75 -0,22	17,55 -0,48	34,09 -0,84
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FICFI % do Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	2,01 0,10	2,01 0,10	3,98 0,06	7,84 -0,04	10,21 0,17	23,62 -0,50	– –
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 FI % do Var. IDKA 2 p.p.	1,22 -0,05	1,22 -0,05	2,56 -0,15	5,85 -0,38	9,50 -0,80	22,93 -1,98	38,58 -1,63
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M TP % do Var. IRF-M TOTAL p.p.	1,37 -0,02	1,37 -0,02	3,91 -0,05	7,96 -0,11	10,62 -0,21	25,86 -0,58	54,41 -0,81

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 TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI % do Var. IPCA + 6% p.p.	1,94 1,11	1,94 1,11	3,91 2,20	8,36 4,27	10,73 0,78	26,92 7,12	52,00 18,19
CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP FI RF LP % do Var. IMA-B 5 p.p.	1,53 -0,01	1,53 -0,01	3,07 0,00	6,88 -0,05	9,91 -0,18	23,73 -0,42	40,07 -0,78
CAIXA FI BRASIL IMAB TP FI RF LP % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	4,39 0,03	4,39 0,03	7,05 0,00	13,97 -0,03	13,95 -0,16	30,18 -0,47	62,25 -0,75
CAIXA FI BRASIL IRFM 1 TP FI RF % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,57 -0,01	0,57 -0,01	1,65 -0,04	3,62 -0,08	6,80 -0,16	17,67 -0,36	34,35 -0,59
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,42 -1,95	2,42 -1,95	4,39 -2,66	9,81 -4,20	11,10 -3,02	20,84 -9,81	40,98 -22,02
FUNDO DE INVESTIMENTO BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS-RENDA FIXA % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,86 0,28	0,86 0,28	2,39 0,70	4,91 1,22	8,38 1,42	20,00 1,96	38,37 3,43
FI BANESTES INVESTIDOR CURTO PRAZO % do % do CDI	0,28 52,18	0,28 52,18	0,80 52,02	1,63 51,86	3,30 51,78	9,77 59,64	21,54 65,81
BANESTES ESTRATEGIA FIC DE FI RF % do % do CDI	1,82 336,06	1,82 336,06	3,45 224,53	8,29 263,36	- -	- -	- -
BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI % do % do CDI	0,59 108,77	0,59 108,77	1,65 107,50	3,37 107,10	6,91 108,28	17,64 107,66	34,93 106,74
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMAB FI % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	4,35 -0,02	4,35 -0,02	6,99 -0,05	13,87 -0,13	13,92 -0,19	30,34 -0,31	62,24 -0,75
BB RPPS RF PERFIL FIC % do % do CDI	0,53 97,64	0,53 97,64	1,49 97,16	3,10 98,52	6,29 98,60	16,40 100,07	32,61 99,66
CAIXA FI BRASIL RF REF DI LP % do % do CDI	0,53 97,40	0,53 97,40	1,50 97,72	3,07 97,40	6,19 97,00	16,16 98,63	32,45 99,17
FI BANESTES INSTITUCIONAL RF % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	4,78 0,41	4,78 0,41	8,20 1,16	15,77 1,76	11,87 -2,24	28,45 -2,20	63,26 0,26
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP % do % do CDI	0,53 98,33	0,53 98,33	1,49 96,99	3,04 96,52	6,23 97,57	16,20 98,85	32,66 99,81
INFINITY LOTUS FI RENDA FIXA % do % do CDI	0,75 138,96	0,75 138,96	1,79 116,28	3,63 115,37	7,19 112,64	18,88 115,23	37,20 113,67

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
FIDC CASAN SANEAMENTO SEN % do % do CDI	-1,60 -294,43	-1,60 -294,43	0,60 38,73	4,61 146,30	12,81 200,74	6,11 37,31	5,70 17,42
BANESTES FIC DE FI ACOES BTG ABSOL. INST % do Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	7,61 -	7,61 -	14,58 -6,87	26,19 -4,36	20,79 2,08	55,84 5,34	90,82 -99,09
Caixa FI Ações Institucional BDR Nível I % do Var. IBOVESPA p.p.	0,66 -10,16	0,66 -10,16	-2,76 -14,17	-6,33 -29,27	9,21 -5,49	40,02 -10,58	28,28 -112,76
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS % do Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	12,23 -	12,23 -	22,22 0,77	31,91 1,35	17,58 -1,14	44,71 -5,79	72,39 -117,52
BRASIL ENERGIA RENOVÁVEL - FIP MULTISTRATÉGIA % do % do CDI	-0,09 -16,41	-0,09 -16,41	0,09 5,64	-0,19 -6,13	2,14 33,57	20,29 123,83	18,72 57,22
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO % do Var. IFIX p.p.	0,73 -1,75	0,73 -1,75	3,96 -3,50	-5,08 -16,92	0,50 -4,96	-8,01 -32,61	-5,22 -87,49
CAIXA RIO BRAVO FII % do Var. IFIX p.p.	1,10 -1,37	1,10 -1,37	5,86 -1,60	9,86 -1,98	5,43 -0,03	-	-
CDI	0,54	0,54	1,54	3,15	6,38	16,38	32,72
IBOVESPA	10,82	10,82	11,40	22,94	14,70	50,60	141,04
DOLAR COMERCIAL	-5,75	-5,75	-1,77	-2,74	15,48	16,79	-9,67
INPC + 6%	0,87	0,87	1,70	3,94	9,73	18,41	32,37
IPCA + 6%	0,83	0,83	1,71	4,09	9,95	19,79	33,81