

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos												
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	VAR	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (29/03/2019)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo	
Renda Fixa												
Artigo 7º I, Alínea b - 4604 - Fundos 100% Títulos Públicos - Referenciado												
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M TP	3,49%	0,40	0,57%	-0,02%	2,22%	52.582.307,82	9,03%	5.377.416.934,86	0,98%	
BANESTES	BANESTES	BANESTES PREVIDENCIÁRIO FI RF REF IMA-B	8,68%	0,96	0,27%	-0,31%	7,17%	31.458.264,42	5,40%	241.756.941,87	13,01%	
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,55%	0,08	0,44%	-0,03%	1,46%	12.220.306,13	2,10%	10.181.411.879,74	0,12%	
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IMAB TP FI RF LP	5,96%	0,67	0,56%	-0,02%	5,52%	46.277.468,76	7,95%	9.918.979.524,38	0,47%	
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IRFM 1 TP FI RF	0,55%	0,08	0,44%	-0,03%	1,47%	5.234.910,04	0,90%	15.289.754.586,12	0,03%	
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP FI RF LP	3,07%	0,35	0,76%	-0,02%	2,85%	107.542.004,59	18,47%	9.063.168.823,86	1,19%	
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	7,06%	0,75	0,91%	0,33%	3,72%	6.135.036,00	1,05%	409.896.387,05	1,50%	
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 FI	2,35%	0,28	0,65%	-0,02%	2,49%	47.081.039,41	8,08%	7.065.416.525,36	0,67%	
BB	BB	BB IMA-B 5 FIC RF PREVIDENCIÁRIO LP	3,06%	0,35	0,76%	-0,03%	2,83%	20.328.602,51	3,49%	3.346.293.317,56	0,61%	
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI	4,52%	0,51	0,80%	-0,40%	3,26%	8.896.320,06	1,53%	467.268.295,64	1,90%	
BANESTES	BANESTES	FUNDO DE INVESTIMENTO BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS-RENDA FIXA	1,28%	0,16	0,51%	0,04%	1,72%	28.327.224,61	4,86%	172.365.539,02	16,43%	
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII	2,11%	0,26	0,66%	0,08%	2,54%	2.307.900,10	0,40%	658.743,010,56	0,35%	
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FICFI	2,98%	0,35	0,52%	-0,02%	2,94%	51.386.745,51	8,82%	5.854.681.523,58	0,88%	
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - 4604 - Fundos 100% Títulos Públicos - Referenciado				0,41				419.778.129,76	72,08%			
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Renda Fixa												
BANESTES	BANESTES	FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP	0,05%	0,03	0,49%	104,39%	1,51%	9.037.998,48	1,55%	471.736.974,95	1,92%	
BANESTES	BANESTES	FI BANESTES INVESTIDOR CURTO PRAZO	0,00%	0,01	0,24%	52,13%	0,79%	4.930.995,56	0,85%	489.890.403,98	1,01%	
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL RF REF DI LP	0,02%	0,03	0,47%	99,48%	1,49%	5.815.711,41	1,00%	6.496.458.652,48	0,09%	
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMAB FI	5,91%	0,66	0,55%	-0,03%	5,46%	40.022.974,83	6,87%	1.177.716.136,00	3,40%	
BANESTES	BANESTES	FI BANESTES INSTITUCIONAL RF	7,68%	0,84	0,12%	-0,46%	6,38%	30.300.904,67	5,20%	224.965.840,96	13,47%	
BB	BB	BB RPPS RF PERFIL FIC	0,04%	0,03	0,46%	98,32%	1,48%	1.588.933,64	0,27%	3.939.931.377,26	0,04%	
BANESTES	BANESTES	BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI	0,05%	0,03	0,54%	115,12%	1,67%	32.391.469,04	5,56%	1.048.247.431,46	3,09%	
BANESTES	BANESTES	BANESTES ESTRATÉGIA FIC DE FI RF	-0%	-	1,01%	215,24%	3,72%	12.489.342,14	2,14%	53.567.998,15	23,31%	

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos											
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	VAR	Mês	% Índice	Ano	Valor (R\$) (29/03/2019)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
Artigo 7º VII, Alínea a - 4604 - Cota Sênior de FIDC											
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Renda Fixa			0,39					136.578.329,77	23,45%		
CEF	CEF	FIDC CASAN SANEAMENTO SEN	0,00%	0,00	-1,85%	-394,71%	-2,29%	3.643.742,43	0,63%	1,06	343.347.650,08%
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a - 4604 - Cota Sênior de FIDC				0,00				3.643.742,43	0,63%		
Sub-total Renda Fixa				0,41				560.000.201,96	96,15%		
Renda Variável											
Artigo 8º II, Alínea a - 4604 - Fundos de Ações											
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	19,09%	2,05	-0,70%	1,09%	11,88%	7.223.964,85	1,24%	536.251.724,68	1,35%
CEF	CEF	Caixa FI Ações Institucional BDR Nivel II	18,22%	1,99	6,12%	6,29%	13,01%	1.603.183,54	0,28%	452.626.988,72	0,35%
BANESTES	BANESTES	BANESTES FIC DE FI ACOES BTG ABSOL. INST	20,15%	2,16	-1,42%	0,36%	4,11%	7.647.525,74	1,31%	36.636.368,96	20,87%
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a - 4604 - Fundos de Ações				2,09				16.474.674,13	2,83%		
Artigo 8º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Participações											
RIO BRAVO	CEF	BRASIL ENERGIA RENOVAVEL - FIP MULTIESTRATÉGIA	0,00%	0,00	-0,08%	-16,66%	-0,25%	1.927.829,73	0,33%	264.018.763,56	0,73%
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Participações				0,00				1.927.829,73	0,33%		
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604 - Fundos de Investimentos Imobiliários											
RIO BRAVO	RIO BRAVO	CAIXA RIO BRAVO FII	0,00%	0,00	1,37%	-0,61%	2,90%	2.177.840,00	0,37%	1,08	200.899.177,50%
RIO BRAVO	RIO BRAVO	BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	0,00%	0,00	0,44%	-1,54%	3,54%	1.826.660,44	0,31%	1,03	177.052.119,65%
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b - 4604 - Fundos de Investimentos Imobiliários				0,00				4.004.500,44	0,69%		
Sub-total Renda Variável				1,54				22.407.004,30	3,85%		
Total								582.407.206,26	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	419.778.129,76	72,08%	55,00%	100,00%
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604	Fundos de Renda Fixa	136.578.329,77	23,45%	19,00%	40,00%
Artigo 7º VII, Alínea a - 4604	Cota Sênior de FIDC	3.643.742,43	0,63%	1,00%	5,00%
	Total Renda Fixa	560.000.201,96	96,16%		
Renda Variável					
Artigo 8º II, Alínea a - 4604	Fundos de Ações	16.474.674,13	2,83%	3,00%	20,00%
Artigo 8º IV, Alínea a - 4604	Fundos de Participações	1.927.829,73	0,33%	0,50%	5,00%
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604	Fundos de Investimentos Imobiliários	4.004.500,44	0,69%	0,00%	5,00%
	Total Renda Variável	22.407.004,30	3,85%		

Estratégia	Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)			
	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
Artigo 7º I, Alínea b - 4604 % do CDI	0,61 129,5	2,83 187,1	9,01 142,1	19,98 130,7
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 % do CDI	0,48 103,4	4,02 266,0	9,66 152,2	-
Artigo 7º VII, Alínea a - 4604 % do CDI	0,00 0,0	0,00 0,0	7,69 121,3	-
Artigo 8º II, Alínea a - 4604 Var. IBOVESPA p.p	-0,43 -0,3	9,39 0,8	13,13 1,4	37,64 -9,2
Artigo 8º IV, Alínea a - 4604 Var. IBOVESPA p.p	0,00 0,2	0,00 -8,6	0,00 -11,8	-
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604 Var. IBOVESPA p.p	0,95 1,1	3,19 -5,4	-0,03 -11,8	-

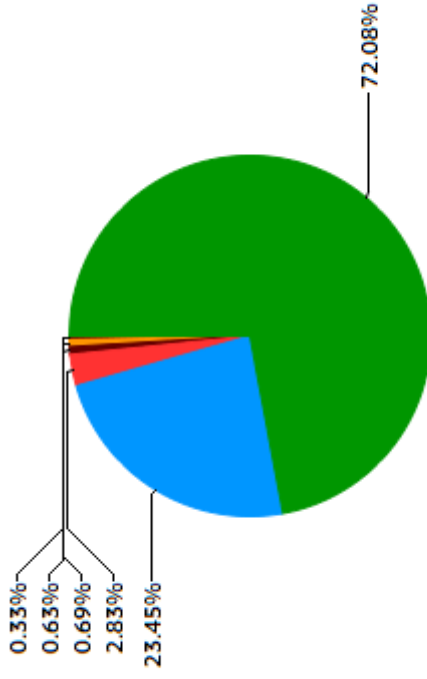
Estratégia	Ganhos Financeiros	
	Valor	No Mês(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b - 4604		2.532.705,05
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604		639.890,65
Artigo 7º VII, Alínea a - 4604		-68.696,80
Artigo 8º II, Alínea a - 4604		-145.860,25
Artigo 8º IV, Alínea a - 4604		-1.507,12
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604		37.511,60
Total		2.994.043,13

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Período	Análise da Disponibilidade Financeira			Valor Acum. Bruto (R\$)	(% Acum.)
	Valor (R\$)	(%)			
de 0 a 30 dias	557.669.717,50	96		557.669.717,50	96
acima de 365 dias	24.737.488,76	4		582.407.206,26	100

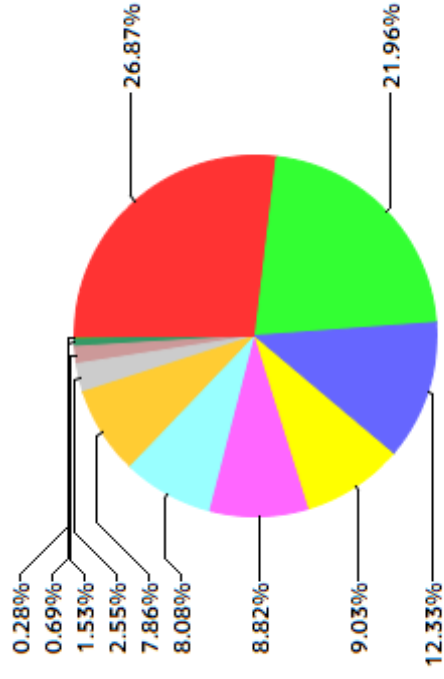
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia



- Artigo 7^o I, Alinea b - 4604 (72,08%)
- Artigo 7^o IV, Alinea a - 4604 (23,45%)
- Artigo 8^o II, Alinea a - 4604 (2,83%)
- Artigo 8^o IV, Alinea b - 4604 (0,69%)
- Artigo 7^o VII, Alinea a - 4604 (0,63%)
- Artigo 8^o IV, Alinea a - 4604 (0,33%)

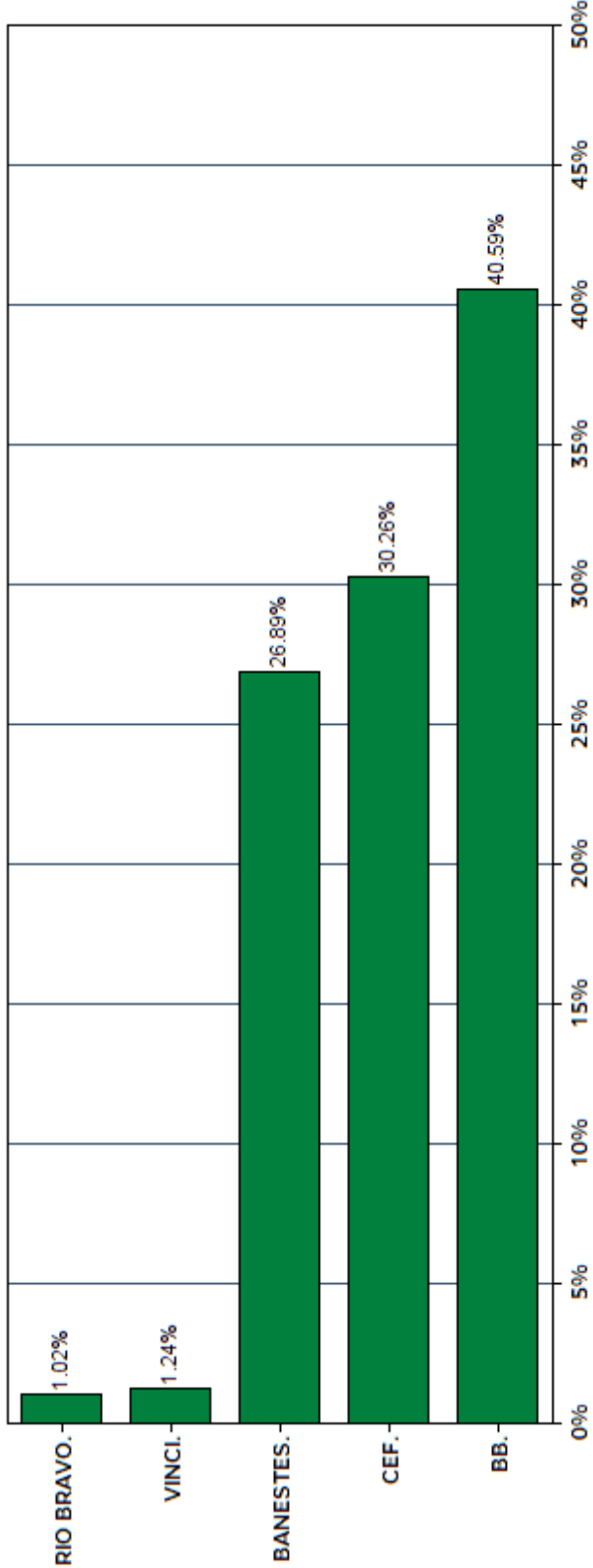
Indexadores



- IMA-B TOTAL (26,87%)
- IMA-B 5 (21,96%)
- CDI (12,33%)
- IRF-M TOTAL (9,03%)
- IMA-GERAL ex-C TOTAL (8,82%)
- IDKA 2 (8,08%)
- IRF-M 1 (7,86%)
- Índice Dividendos - IDIV (2,55%)
- IPCA + 6% (1,53%)
- IFIX (0,69%)
- IBOVESPA (0,28%)

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

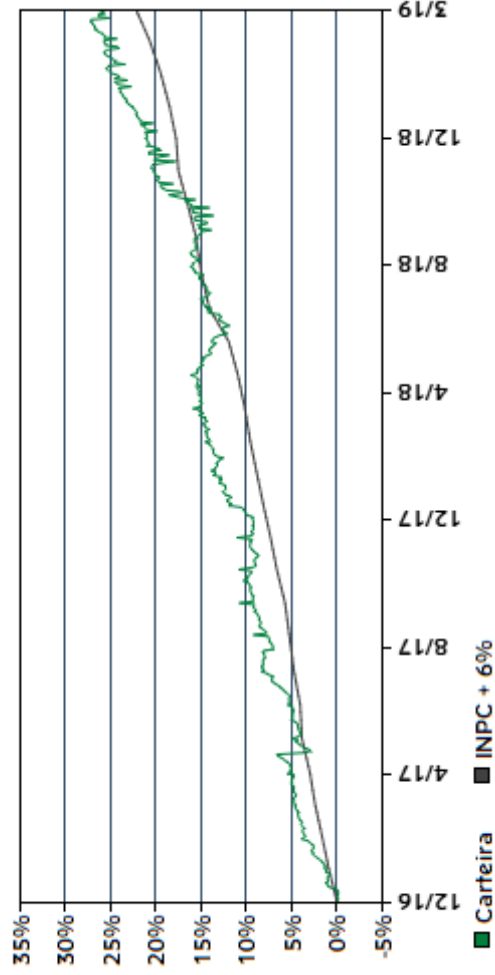
Alocação por Gestor



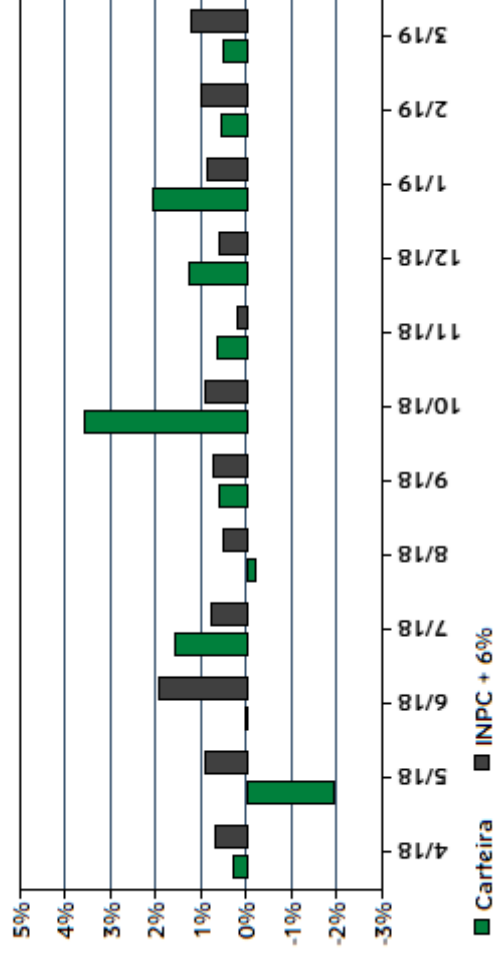
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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	0,56	0,52	-	-	-	-	-	-	-	-	-	3,15
INPC + 6%	0,87	1,01	1,21	-	-	-	-	-	-	-	-	-	3,12
p.p. Indx	1,17	-0,45	-0,70	-	-	-	-	-	-	-	-	-	0,02

Evolução da Rentabilidade



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco / Retorno da Carteira

	Qtd.	Perct.
Meses acima do Benchmark	16	59,3%
Meses abaixo do Benchmark	11	40,7%

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

Período	Carteira	Rentabilidade (%)		Volat. Anual
		INPC + 6%	p.p. Índx.	
03 meses	3,15	3,12	0,0	8,177
06 meses	8,85	4,91	3,9	9,598
12 meses	9,15	10,90	-1,7	8,157
24 meses	20,30	19,24	1,1	7,142
36 meses	-	-	-	-
Desde o início	26,38	22,18	4,2	6,796

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 IMA-B 5 FIC RF PREVIDENCIÁRIO LP % do Var. IMA-B 5 p.p.	0,76 -0,03	2,83 -0,07	2,83 -0,07	7,56 -0,13	8,97 -0,22	21,82 -0,44	38,78 -0,73
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,66 0,08	2,54 -3,01	2,54 -3,01	6,49 -9,50	9,39 -4,32	21,05 -4,86	38,40 -14,67
BANESTES PREVIDENCIÁRIO FIR REF IMA-B % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,27 -0,31	7,17 1,63	7,17 1,63	21,45 5,47	15,22 1,51	26,44 0,52	54,87 1,81
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,44 -0,03	1,46 -0,07	1,46 -0,07	3,49 -0,09	6,45 -0,24	16,15 -0,50	32,20 -0,87
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FICFI % do Var. IMA-GERAL ex-c TOTAL p.p.	0,52 -0,02	2,94 0,02	2,94 0,02	8,60 0,06	9,29 -0,01	20,53 -0,60	-
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 FI % do Var. IDKA 2 p.p.	0,65 -0,02	2,49 0,01	2,49 0,01	6,03 0,06	8,65 -0,54	21,14 -1,60	37,77 -2,23
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M TP % do Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,57 -0,02	2,22 -0,06	2,22 -0,06	8,54 -0,11	8,92 -0,22	22,62 -0,57	48,30 -0,82
BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI % do Var. IPCA + 6% p.p.	0,80 -0,40	3,26 0,31	3,26 0,31	9,58 4,74	9,27 -1,53	23,38 2,93	45,42 11,87

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 IMA B 5 TP FI RF LP % do Var. IMA-B 5 p.p.	0,76 -0,02	2,85 -0,05	2,85 -0,05	7,64 -0,05	9,00 -0,19	21,82 -0,44	38,74 -0,76
CAIXA FI BRASIL IMAB TP FI RF LP % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,56 -0,02	5,52 -0,02	5,52 -0,02	15,95 -0,03	13,52 -0,19	25,44 -0,48	52,28 -0,79
CAIXA FI BRASIL IRFM 1 TP FI RF % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,44 -0,03	1,47 -0,06	1,47 -0,06	3,51 -0,07	6,50 -0,18	16,26 -0,39	32,45 -0,62
FI CAIXA BRASIL 2024 I TITULOS PUBLICOS RF % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,91 0,33	3,72 -1,82	3,72 -1,82	12,22 -3,77	9,58 -4,13	20,38 -5,54	36,23 -16,84
FUNDO DE INVESTIMENTO BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 TITULOS PÚBLICOS-RENDA FIXA % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,51 0,04	1,72 0,20	1,72 0,20	4,84 1,25	7,42 0,74	18,21 1,56	36,17 3,10
FI BANESTES INVESTIDOR CURTO PRAZO % do % do CDI	0,24 52,13	0,79 52,03	0,79 52,03	1,59 51,84	3,27 51,48	8,76 57,29	20,12 64,59
BANESTES ESTRATEGIA FIC DE FI RF % do % do CDI	1,01 215,24	3,72 246,18	3,72 246,18	9,43 306,88	-	-	-
BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI % do % do CDI	0,54 115,12	1,67 110,59	1,67 110,59	3,34 108,55	6,87 108,38	16,55 108,27	33,51 107,57
BB PREVIDENCIARIO RF IMAB FI % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,55 -0,03	5,46 -0,08	5,46 -0,08	15,80 -0,18	13,46 -0,24	25,49 -0,43	52,56 -0,50
BB RPPS RF PERFIL FIC % do % do CDI	0,46 98,32	1,48 98,03	1,48 98,03	3,00 97,59	6,23 98,17	15,23 99,64	31,13 99,92
CAIXA FI BRASIL RF REF DI LP % do % do CDI	0,47 99,48	1,49 98,20	1,49 98,20	3,01 98,05	6,18 97,47	15,01 98,21	30,85 99,05
FI BANESTES INSTITUCIONAL RF % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,12 -0,46	6,38 0,83	6,38 0,83	18,64 2,65	12,40 -1,31	23,52 -2,40	52,36 -0,70
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP % do % do CDI	0,49 104,39	1,51 99,99	1,51 99,99	3,01 97,92	6,19 97,60	15,08 98,65	31,25 100,31
FIDC CASAN SANEAMENTO SEN % do % do CDI	-1,85 -394,71	-2,29 -1511,39	-2,29 -1511,39	1,14 37,02	9,45 149,00	5,29 34,61	5,05 16,22
BANESTES FIC DE FI ACOES BTG ABSOL. INST % do Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-1,42 0,36	4,11 -	4,11 -	25,20 -5,02	14,46 0,74	45,52 7,63	64,53 -49,39

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 Ações Institucional BDR Nível I % do Var. IBOVESPA p.p.	6,12 6,29	13,01 4,45	13,01 4,45	-6,28 -26,54	27,86 16,08	50,93 4,11	50,65 -39,97			
FIC DE FIEM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS % do Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-0,70 1,09	11,88 -	11,88 -	37,16 6,94	16,08 2,36	39,57 1,68	60,47 -53,44			
BRASIL ENERGIA RENOVÁVEL - FIP MULTISTRATÉGIA % do % do CDI	-0,08 -16,66	-0,25 -16,47	-0,25 -16,47	-0,16 -5,30	2,08 32,74	20,04 131,09	19,03 61,09			
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO % do Var. IFIX p.p.	0,44 -1,54	3,54 -2,05	3,54 -2,05	11,23 -5,07	-0,01 -5,36	-7,48 -29,67	-3,94 -71,14			
CAIXA RIO BRAVO FII % do Var. IFIX p.p.	1,37 -0,61	2,90 -2,68	2,90 -2,68	12,32 -3,98	4,82 -0,53	-	-			
CDI	0,47	1,51	1,51	3,07	6,34	15,29	31,15			
IBOVESPA	-0,18	8,56	8,56	20,26	11,77	46,83	90,62			
DOLAR COMERCIAL	4,23	0,57	0,57	-2,68	17,24	22,99	9,49			
INPC + 6%	1,21	3,12	3,12	4,91	10,90	19,24	32,20			
IPCA + 6%	1,19	2,95	2,95	4,84	10,80	20,46	33,55			