

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos											
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	VAR	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (28/09/2018)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
Renda Fixa											
Artigo 7º I, Alínea a - Títulos do Tesouro Nacional											
TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545	0,00%	0,00	-1,11%	-1,59%	0,46%	7.217.553,33	4,07%	--	--
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a - Títulos do Tesouro Nacional				0,00				7.217.553,33	4,07%		
Artigo 7º I, Alínea b - 4604 - Fundos 100% Títulos Públicos - Referenciado											
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF IRF-M TP	3,14%	0,35	1,28%	-0,01%	4,10%	25.261.519,00	14,24%	4.903.984.503,12	0,52%
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RF INFLAÇÃO 5 FIC	2,89%	0,32	0,85%	-0,03%	4,66%	16.292.378,62	9,18%	1.199.027.503,74	1,36%
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	4,87%	0,51	-0,18%	-0,04%	2,51%	8.399.578,91	4,73%	293.321.433,02	2,86%
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,52%	0,08	0,59%	-0,02%	4,66%	15.723.281,11	8,86%	12.769.780.117,05	0,12%
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF IMA-B TP	4,86%	0,51	-0,16%	-0,01%	2,71%	18.959.234,96	10,68%	3.646.686.495,81	0,52%
BRABESCO	BRABESCO	BRABESCO FI RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS	4,90%	0,52	-0,18%	-0,04%	2,61%	31.007.103,39	17,47%	486.210.931,09	6,38%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IMAB TP FI RF LP	4,88%	0,52	-0,18%	-0,03%	2,69%	28.739.011,45	16,20%	3.081.131.095,61	0,93%
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,52%	0,08	0,59%	-0,01%	2,17%	613.014,54	0,35%	345.133.485,16	0,18%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP FI RF LP	2,90%	0,32	0,86%	-0,03%	4,79%	16.913.934,19	9,53%	8.106.459.151,64	0,21%
BB	BB	BB RPPS RF IMA B5+ FI	6,89%	0,71	-1,03%	0,01%	0,69%	8.326.757,57	4,69%	657.939.315,10	1,27%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - 4604 - Fundos 100% Títulos Públicos - Referenciado				0,42				170.235.813,74	95,93%		
Sub-total Renda Fixa				0,40				177.453.367,07	100,00%		
Total								177.453.367,07	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 a	Títulos do Tesouro Nacional	7.217.553,33	4,07%	10,00%	100,00%
Artigo 7º I, Alínea b - 4604	Fundos 100% Títulos Públicos - Referenciado	170.235.813,74	95,93%	90,00%	100,00%
Total Renda Fixa		177.453.367,07	100,00%		

Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)

Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	-1,11 -237,7	0,46 9,6	-- --	-- --
Artigo 7º I, Alínea b - 4604 % do CDI	0,26 56,5	3,37 70,0	-- --	-- --

Ganhos Financeiros

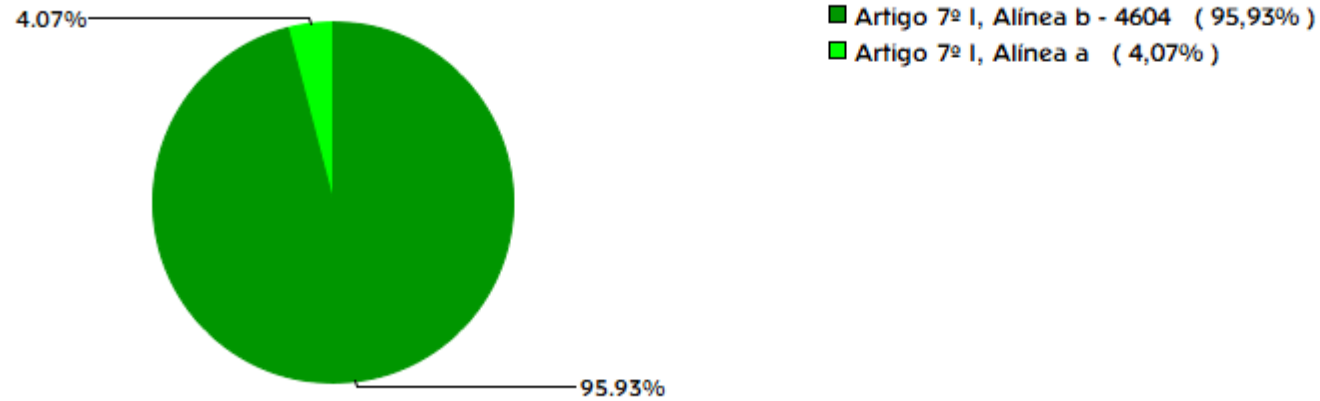
Estratégia	No Mês(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a	-81.213,98
Artigo 7º I, Alínea b - 4604	454.177,96
Total	372.963,98

Análise da Disponibilidade Financeira

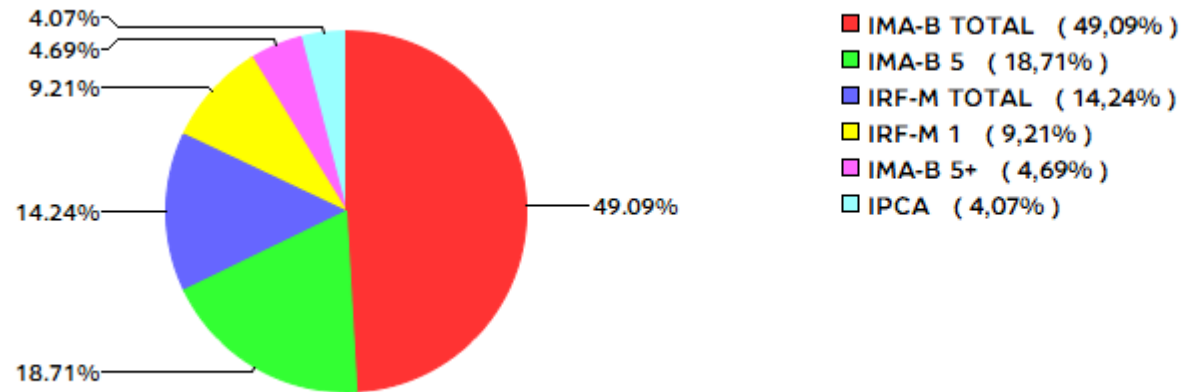
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acum. Bruto (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	170.235.813,74	96	170.235.813,74	96
acima de 365 dias	7.217.553,33	4	177.453.367,07	100

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia

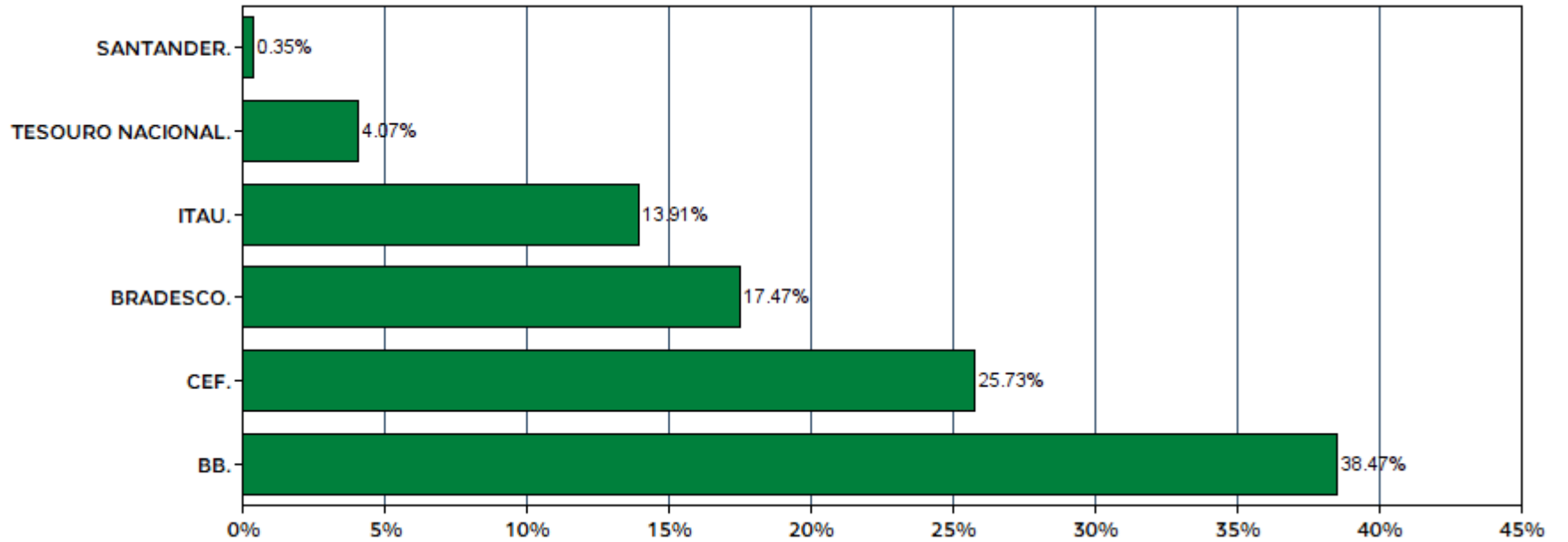


Indexadores



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor

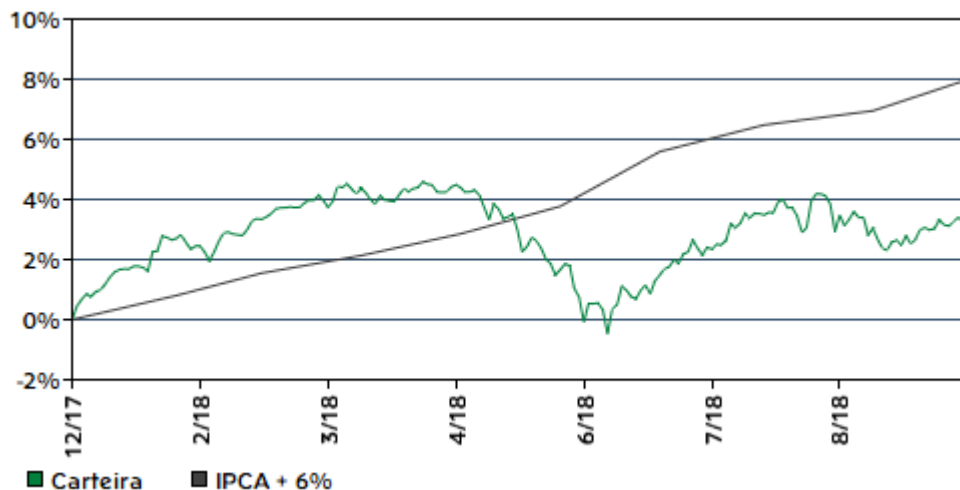


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

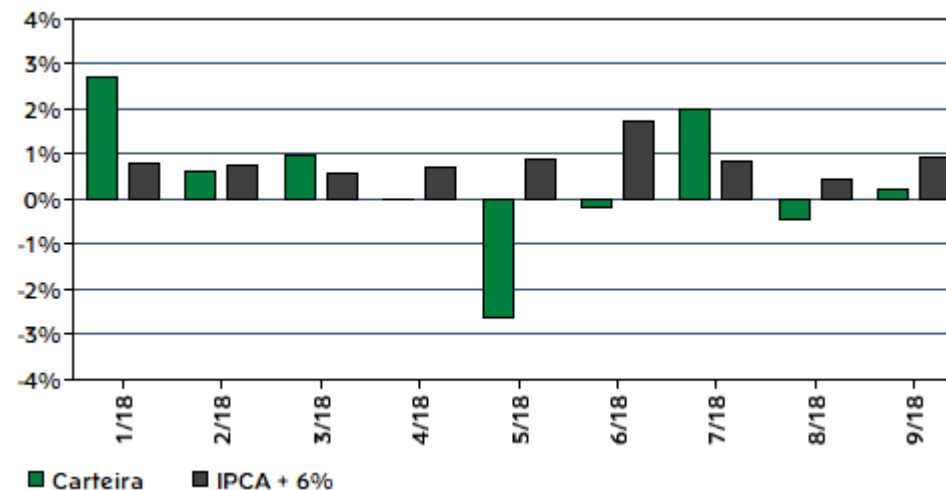
Rentabilidades da Carteira

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
2018	2,70	0,63	1,00	0,02	-2,62	-0,18	1,98	-0,44	0,21	--	--	--	3,25
IPCA + 6%	0,80	0,74	0,58	0,71	0,89	1,75	0,84	0,44	0,92	--	--	--	7,93
p.p. Indx	1,90	-0,11	0,42	-0,69	-3,50	-1,93	1,14	-0,88	-0,71	--	--	--	-4,69

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	IPCA + 6%	p.p. Indx.	
Meses acima do Benchmark	3	33,3%	03 meses	1,74	2,22	-0,5	4,408
Meses abaixo do Benchmark	6	66,7%	06 meses	-1,08	5,68	-6,8	4,768
			12 meses	--	--	--	--
			24 meses	--	--	--	--
			36 meses	--	--	--	--
			Desde o início	3,25	7,93	-4,7	4,277

	Rentab.	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,70%	jan/18
Menor rentabilidade da Carteira	-2,62%	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
NTN-B 150545 % do Var. IPCA p.p.	-1,11 -1,59	0,46 -2,88	1,68 0,96	-5,48 -8,10	-1,70 -6,22	16,27 9,09	63,61 47,35
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,59 -0,02	4,66 -0,19	1,67 -0,05	2,86 -0,14	6,51 -0,24	19,70 -0,56	37,54 -0,92
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,16 -0,01	2,71 -0,17	1,66 -0,05	-2,06 -0,09	2,32 -0,23	18,15 -0,57	51,21 -1,17
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M TP % do Var. IRF-M TOTAL p.p.	1,28 -0,01	4,10 -0,14	1,80 -0,03	0,35 -0,10	5,53 -0,21	23,63 -0,55	50,92 -0,84
BB RPPS RF IMA B5+ FI % do Var. IMA-B 5+ p.p.	-1,03 0,01	0,69 -0,14	1,48 -0,07	-4,85 -0,03	-1,01 -0,19	15,46 -0,87	55,17 -1,52
BRÁDESCO FI RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,18 -0,04	2,61 -0,27	1,61 -0,09	-2,17 -0,21	2,20 -0,35	17,81 -0,91	50,52 -1,87
CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP FI RF LP % do Var. IMA-B 5 p.p.	0,86 -0,03	4,79 -0,20	2,05 -0,06	1,27 -0,13	6,28 -0,25	20,38 -0,48	42,56 -1,06
CAIXA FI BRASIL IMAB TP FI RF LP % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,18 -0,03	2,69 -0,20	1,64 -0,06	-2,10 -0,13	2,28 -0,27	18,27 -0,45	50,99 -1,39

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
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLAÇÃO 5 FIC % do Var. IMA-B 5 p.p.	0,85 -0,03	4,66 -0,32	2,01 -0,10	1,19 -0,21	6,10 -0,43	19,91 -0,95	41,90 -1,72
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,18 -0,04	2,51 -0,37	1,58 -0,13	-2,19 -0,23	2,08 -0,47	17,63 -1,09	50,24 -2,15
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,59 -0,01	4,65 -0,19	1,69 -0,03	2,86 -0,13	6,53 -0,22	19,94 -0,32	37,94 -0,52
CDI	0,47	4,81	1,59	3,17	6,66	18,98	35,79
IBOVESPA	3,48	3,85	9,04	-7,06	6,80	35,94	76,09
DOLAR COMERCIAL	-3,18	21,04	3,84	20,46	26,39	23,34	0,78
INPC + 6%	0,74	7,72	2,05	5,70	10,14	18,59	37,21
IPCA + 6%	0,92	7,93	2,22	5,68	10,72	20,29	38,31