

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos											
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	VAR	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (31/07/2018)	% 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	2,79%	0,32	1,48%	0,01%	3,78%	1.622.089,67	1,83%	5.447.124.355,33	0,03%
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,50%	0,08	0,68%	0,02%	3,64%	9.317.169,57	10,52%	11.702.481.616,22	0,08%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IMAB TP RF LP	4,45%	0,49	2,30%	-0,01%	3,35%	3.862.766,61	4,36%	3.471.759.918,07	0,11%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IRFM 1 TP RF	0,49%	0,08	0,68%	0,02%	3,66%	11.113.771,60	12,55%	17.362.996.877,14	0,06%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP RF LP	2,58%	0,30	1,46%	-0,01%	2,76%	3.080.190,86	3,48%	7.322.766.489,39	0,04%
BB	BB	BB IDKA 2 TP FI RF PREV	2,05%	0,25	1,23%	227,52%	4,44%	59.697,26	0,07%	6.047.649.862,28	0,00%
CEF	CEF	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA..	4,21%	0,45	1,10%	-1,22%	4,69%	2.050.006,40	2,32%	251.968.225,72	0,81%
CEF	CEF	CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3,92%	0,41	0,51%	-1,81%	4,81%	370.979,10	0,42%	3.304.843.294,13	0,01%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	5,84%	0,61	2,22%	-0,09%	4,26%	3.638.730,00	4,11%	388.979.536,86	0,94%
CEF	CEF	CAIXA BRASIL 2030 III TITULOS PUBLICOS FI RENDA FIXA	6,26%	0,65	2,59%	0,28%	2,68%	5.833.464,50	6,59%	289.150.514,08	2,02%
CEF	CEF	CAIXA BRASIL IDKa IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RJ LP	2,06%	0,25	1,19%	-1,13%	4,50%	5.646.945,29	6,38%	5.028.426.826,17	0,11%
WESTERN	WESTERN	WESTERN ASSET IMAB5 ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	4,09%	0,46	2,05%	0,57%	1,23%	1.018.315,44	1,15%	266.675.055,75	0,38%
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL IPCA FI	4,22%	0,47	2,10%	1,26%	3,92%	6.420.100,09	7,25%	296.583.201,31	2,16%
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII	1,65%	0,20	1,01%	-1,30%	4,64%	1.600.591,59	1,81%	1.147.839.840,70	0,14%
BB	BB	BB Previdenciario XI Títulos Públicos	3,92%	0,44	1,97%	0,50%	4,05%	5.908.224,69	6,67%	176.359.395,35	3,35%
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF ALOCACAO ATIVA FCFI	2,43%	0,28	1,37%	-0,02%	3,96%	4.396.405,94	4,97%	2.874.979.005,40	0,15%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - 4604 - Fundos 100% Títulos Públicos - Referenciado				0,32				65.939.448,61	74,48%		
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Renda Fixa											
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF FLUXO FC FI	0,06%	0,03	0,45%	82,84%	3,08%	10.093.001,61	11,40%	1.135.822.818,10	0,89%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,05%	0,03	0,47%	86,57%	3,24%	392.445,70	0,44%	500.288.162,58	0,08%
CEF	CEF	CAIXA FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	1,61%	0,19	0,95%	0,62%	2,33%	3.377.167,02	3,81%	1.941.557.842,39	0,17%
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Renda Fixa				0,07				13.862.614,33	15,66%		
Artigo 7º VII, Alínea b - 4604 - Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"											

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos											
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	VAR	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (31/07/2018)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
AZ QUEST	BEM	AZ LEGAN VALORE FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA - CRÉDITO PRIVADO	0,14%	0,04	0,58%	107,84%	3,91%	3.211.032,10	3,63%	208.345.015,62	1,54%
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b - 4604 - Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"				0,04				3.211.032,10	3,63%		
Sub-total Renda Fixa				0,27				83.013.095,04	93,76%		
Renda Variável											
Artigo 8º II, Alínea a - 4604 - Fundos de Ações											
AZ QUEST	BEM	AZ LEGAN BRASIL FI AÇÕES	18,63%	2,02	9,16%	0,29%	8,58%	3.575.029,75	4,04%	137.557.888,71	2,60%
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a - 4604 - Fundos de Ações				2,02				3.575.029,75	4,04%		
Artigo 8º III - 4604 - Fundos Multimercados											
WESTERN	WESTERN	WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	1,50%	0,19	0,33%	61,22%	3,25%	1.017.871,13	1,15%	331.602.560,77	0,31%
Sub-total Artigo 8º III - 4604 - Fundos Multimercados				0,19				1.017.871,13	1,15%		
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604 - Fundos de Investimentos Imobiliários											
RIO BRAVO	CEF	RBBV11	0,00%	0,00	2,78%	1,40%	-1,49%	933.000,00	1,05%	0,99	94.714.828,32%
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b - 4604 - Fundos de Investimentos Imobiliários				0,00				933.000,00	1,05%		
Sub-total Renda Variável				1,34				5.525.900,88	6,24%		
Total								88.538.995,92	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	65.939.448,61	74,48%	70,00%	100,00%
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604	Fundos de Renda Fixa	13.862.614,33	15,66%	20,00%	40,00%
Artigo 7º VII, Alínea b - 4604	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	3.211.032,10	3,63%	5,00%	5,00%
Total Renda Fixa		83.013.095,04	93,77%		
Renda Variável					
Artigo 8º II, Alínea a - 4604	Fundos de Ações	3.575.029,75	4,04%	3,50%	20,00%
Artigo 8º III - 4604	Fundos Multimercados	1.017.871,13	1,15%	0,00%	10,00%
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604	Fundos de Investimentos Imobiliários	933.000,00	1,05%	1,50%	5,00%
Total Renda Variável		5.525.900,88	6,24%		

Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)				
Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
Artigo 7º I, Alínea b - 4604 % do CDI	1,47 270,5	4,11 109,9	-- --	-- --
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 % do CDI	0,57 105,9	3,02 81,0	-- --	-- --
Artigo 7º VII, Alínea b - 4604 % do CDI	0,58 107,8	3,91 104,8	-- --	-- --
Artigo 8º II, Alínea a - 4604 Var. IBOVESPA p.p	9,16 0,3	8,58 4,9	-- --	-- --
Artigo 8º III - 4604 Var. IBOVESPA p.p	0,33 -8,5	3,25 10,6	-- --	-- --
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604 Var. IBOVESPA p.p	2,78 -6,1	0,12 -3,6	-- --	-- --

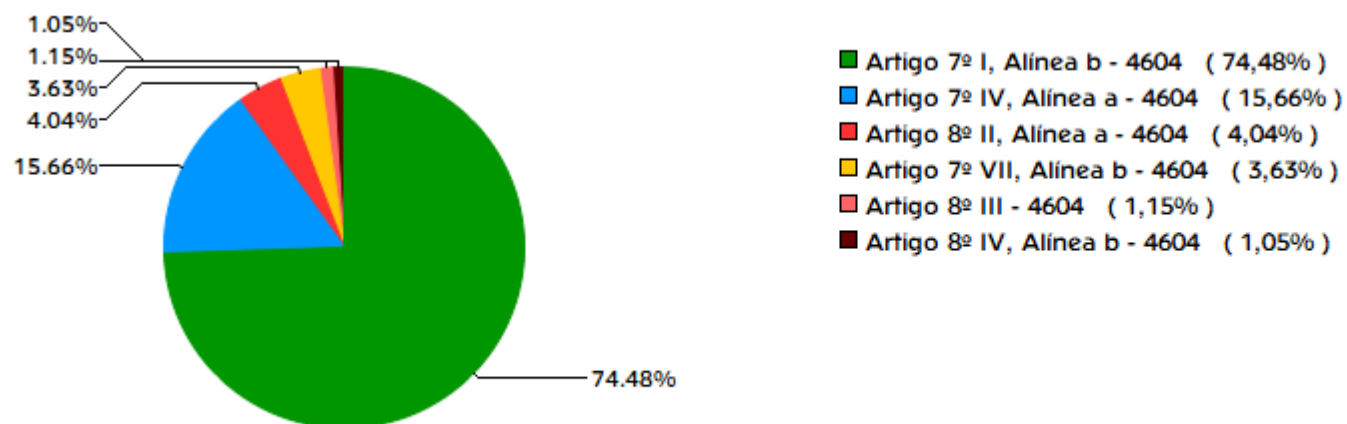
Ganhos Financeiros	
Estratégia	No Mês(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b - 4604	953.171,18
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604	77.344,23
Artigo 7º VII, Alínea b - 4604	18.666,28
Artigo 8º II, Alínea a - 4604	300.049,02
Artigo 8º III - 4604	3.316,19
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604	25.249,28
Total	1.377.796,18

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**Análise da Disponibilidade Financeira**

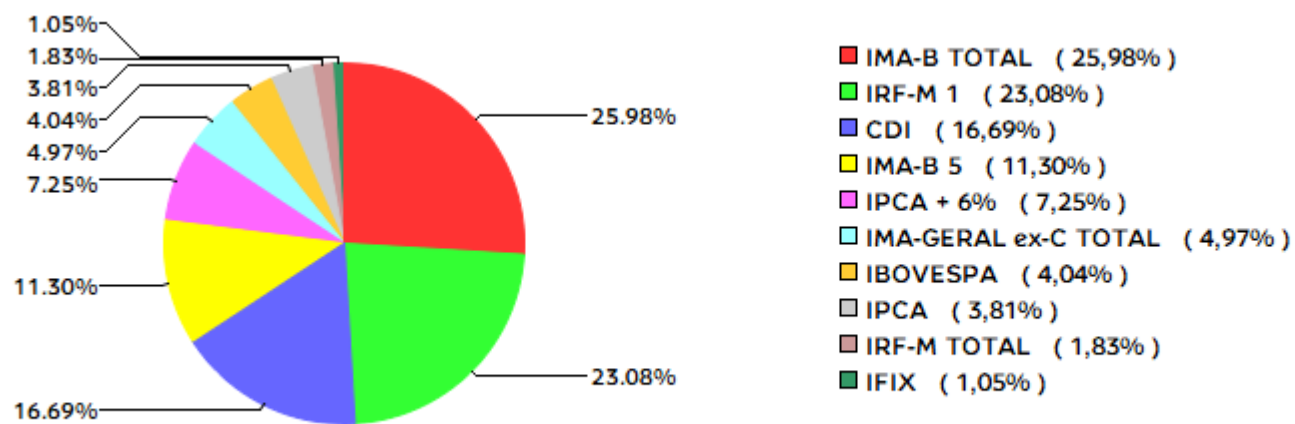
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acum. Bruto (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	74.610.079,55	84	74.610.079,55	84
acima de 365 dias	13.928.916,37	16	88.538.995,92	100

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia

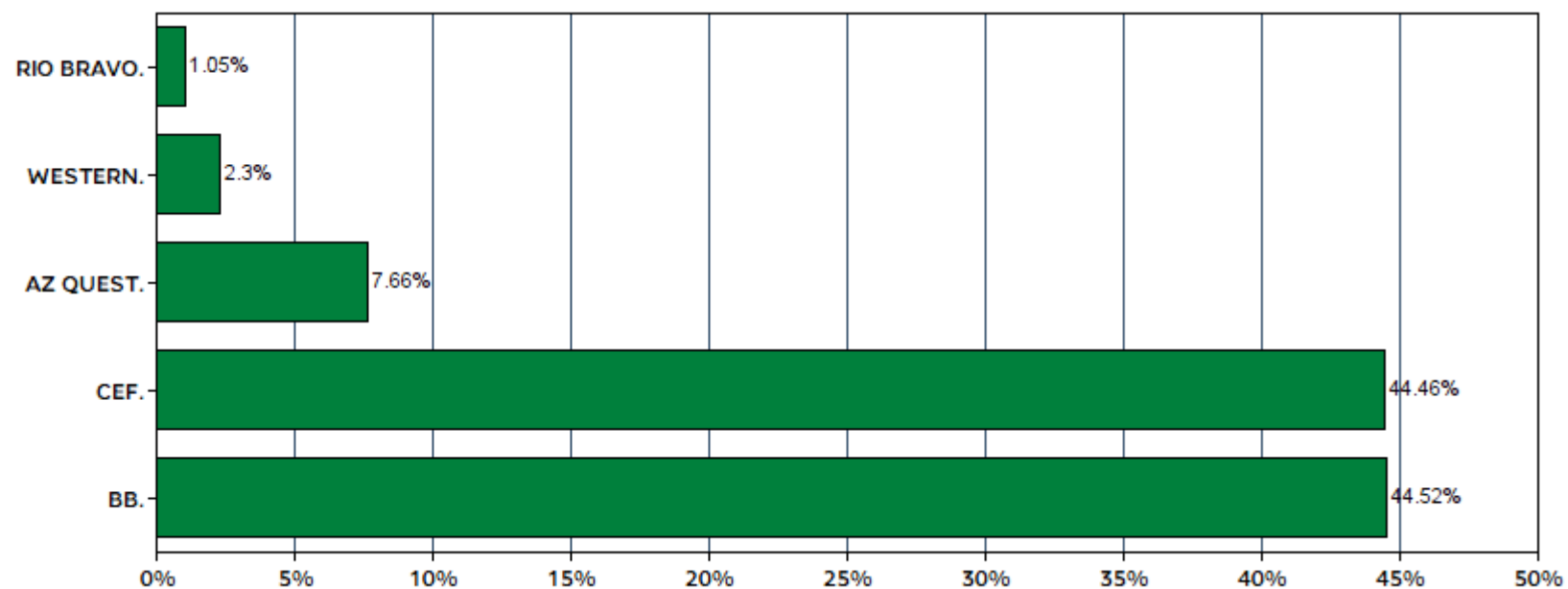


Indexadores



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor

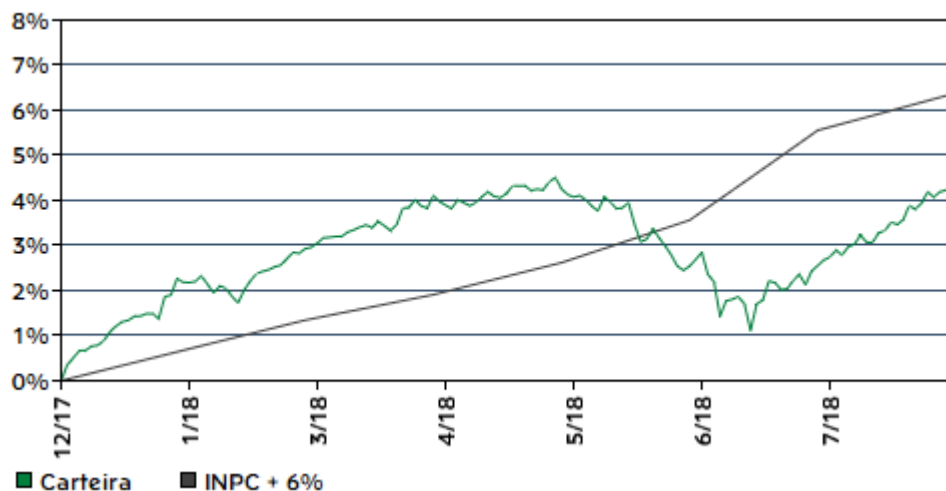


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

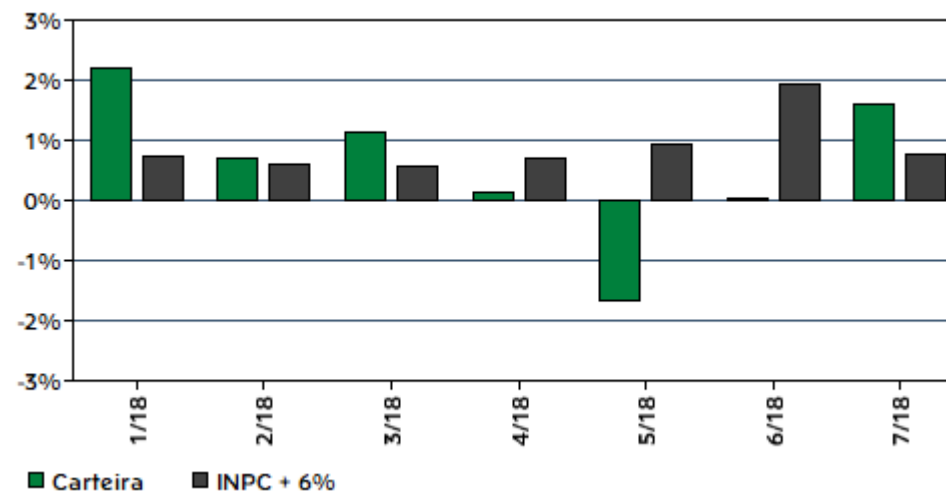
Rentabilidades da Carteira

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
2018	2,20	0,71	1,15	0,15	-1,66	0,02	1,59	-	-	-	-	-	4,18
INPC + 6%	0,74	0,60	0,56	0,70	0,92	1,92	0,76	-	-	-	-	-	6,36
p.p. Indx	1,46	0,11	0,59	-0,55	-2,57	-1,91	0,83	-	-	-	-	-	-2,18

Evolução da Rentabilidade



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco / Retorno da Carteira

	Qtd.	Perct.
Meses acima do Benchmark	4	57,1%
Meses abaixo do Benchmark	3	42,9%

	Rentab.	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,20%	jan/18
Menor rentabilidade da Carteira	-1,66%	mai/18

Período	Rentabilidade (%)			Volat. Anual
	Carteira	INPC + 6%	p.p. Indx.	
03 meses	-0,08	3,64	-3,7	3,615
06 meses	1,94	5,58	-3,6	2,915
12 meses	--	--	--	--
24 meses	--	--	--	--
36 meses	--	--	--	--
Desde o início	4,18	6,36	-2,2	2,862

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.	1,01 -1,30	4,64 1,14	1,08 2,32	3,42 3,33	8,17 1,72	22,62 0,23	41,96 -5,54
BB IDKA 2 TP FI RF PREV % do % do CDI	1,23 227,52	4,44 118,82	0,67 42,11	3,44 109,85	8,41 118,52	23,17 112,97	42,60 113,94
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI % do Var. 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	21,29 -0,57	38,76 -0,99
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FCFI % do Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	1,37 -0,02	3,96 0,24	0,20 0,19	2,19 0,19	7,29 0,01	-- --	-- --
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M TP % do Var. IRF-M TOTAL p.p.	1,48 0,01	3,78 -0,10	-0,39 -0,02	2,46 -0,09	7,83 -0,22	26,90 -0,51	47,57 -0,96
BB PREVIDENCIÁRIO RF TIT PUBL IPCA FI % do Var. IPCA + 6% p.p.	2,10 1,26	3,92 -2,55	-0,83 -4,35	1,71 -3,92	7,53 -3,18	23,60 3,10	46,87 8,05
BB Previdenciário XI Títulos Públicos % do Var. IMA-B 5 p.p.	1,97 0,50	4,05 -0,28	-0,55 -0,90	2,22 -0,73	7,98 -0,29	23,94 0,80	-- --
CAIXA BRASIL 2018 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,51 -1,81	4,81 1,31	2,45 3,68	3,72 3,63	4,80 -1,64	11,32 -11,06	20,92 -26,58

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 BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,59 0,28	2,68 -0,81	-2,38 -1,15	-1,70 -1,79	2,61 -3,83	10,98 -11,40	28,12 -19,39
CAIXA BRASIL IDKa IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RJ LP % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,19 -1,13	4,50 1,00	0,60 1,83	3,51 3,41	8,42 1,97	23,10 0,72	42,82 -4,69
CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP RF LP % do Var. IMA-B 5 p.p.	1,46 -0,01	4,18 -0,15	0,27 -0,07	2,83 -0,12	8,03 -0,24	22,65 -0,48	42,00 -1,18
CAIXA FI BRASIL IMAB TP RF LP % do Var. 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	45,21 -2,29
CAIXA FI BRASIL IRFM 1 TP RF % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,68 0,02	3,66 -0,10	1,38 -0,03	3,07 -0,08	7,21 -0,18	21,45 -0,41	39,12 -0,64
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,22 -0,09	4,26 0,76	-1,18 0,06	1,17 1,08	4,42 -2,03	13,78 -8,61	28,60 -18,91
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA.. % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,10 -1,22	4,69 1,19	0,38 1,61	3,64 3,55	5,85 -0,60	14,84 -7,55	-- --
WESTERN ASSET IMAB5 ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA % do Var. IMA-B 5 p.p.	2,05 0,57	4,31 -0,02	-0,81 -1,15	2,67 -0,28	8,00 -0,27	24,77 1,64	45,70 2,52
BB PREVIDENCIARIO RF FLUXO FC FI % do % do CDI	0,45 82,84	3,08 82,55	1,30 82,28	2,58 82,45	5,95 83,84	18,20 88,77	33,68 90,07
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do % do CDI	0,47 86,57	3,24 86,63	1,37 86,49	2,71 86,55	6,21 87,55	18,53 90,35	34,01 90,96
CAIXA FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF % do Var. IPCA p.p.	0,95 0,62	3,42 0,47	0,22 -1,78	2,39 -0,26	6,95 2,46	-- --	-- --
AZ LEGAN VALORE FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA - CRÉDITO PRIVADO % do % do CDI	0,58 107,84	3,91 104,76	1,59 100,50	3,26 104,11	7,45 105,06	21,93 106,94	38,91 104,07
AZ LEGAN BRASIL FI AÇÕES % do Var. IBOVESPA p.p.	9,16 0,29	8,58 4,89	-5,54 2,47	-2,57 4,13	21,42 1,25	38,47 0,23	45,24 -10,51
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO % do % do CDI	0,33 61,22	5,76 154,31	1,33 83,86	4,60 146,72	9,10 128,24	23,47 114,47	44,25 118,34
RBBV11 % do Var. IFIX p.p.	2,78 1,40	-1,49 1,72	-3,17 4,65	-0,42 5,29	-- --	-- --	-- --

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
CDI	0,54	3,73	1,59	3,13	7,09	20,51	37,39
IBOVESPA	8,88	3,69	-8,01	-6,70	20,18	38,24	55,75
DOLAR COMERCIAL	-2,62	13,51	7,87	18,74	19,94	15,93	10,63
INPC + 6%	0,76	6,36	3,64	5,58	9,78	18,75	37,85
IPCA + 6%	0,84	6,48	3,52	5,63	10,70	20,50	38,82