

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos											
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	VAR	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (28/02/2019)	% 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	3,40%	0,39	0,28%	-0,02%	1,64%	1.756.116,92	1,73%	5.408.545.141,61	0,03%
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,55%	0,08	0,44%	-0,03%	1,02%	10.724.675,33	10,54%	11.109.701.736,66	0,10%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IMAB TP FI RF LP	5,55%	0,63	0,52%	-0,03%	4,93%	3.271.781,75	3,22%	9.214.450.825,23	0,04%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IRFM 1 TP FI RF	0,55%	0,08	0,45%	-0,02%	1,02%	11.567.816,13	11,37%	15.820.022.979,24	0,07%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP FI RF LP	3,06%	0,35	0,52%	-0,02%	2,06%	3.309.488,62	3,25%	9.015.548.852,64	0,04%
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2 FI	2,36%	0,28	0,61%	0,08%	1,83%	63.574,36	0,06%	6.882.421.501,08	0,00%
CEF	CEF	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA..	4,57%	0,49	0,54%	-0,01%	1,59%	2.053.596,80	2,02%	252.409.419,25	0,81%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	6,95%	0,74	0,36%	-0,19%	2,78%	3.799.660,00	3,73%	406.182.987,87	0,94%
CEF	CEF	CAIXA BRASIL 2030 III TITULOS PUBLICOS FI RENDA FIXA	7,69%	0,83	0,65%	0,10%	5,69%	6.475.177,84	6,36%	320.958.586,20	2,02%
CEF	CEF	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RF LP	2,36%	0,28	0,56%	0,03%	1,83%	6.014.864,40	5,91%	8.185.770.171,15	0,07%
WESTERN	WESTERN	WESTERN ASSET IMAB5 ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA	4,76%	0,54	0,37%	-0,18%	2,56%	1.119.015,75	1,10%	283.974.943,30	0,39%
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL IPCA FI	4,96%	0,56	0,33%	-0,57%	2,47%	6.858.261,31	6,74%	316.824.513,79	2,16%
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII	2,09%	0,25	0,52%	-0,02%	1,87%	949.316,00	0,93%	654.453.489,37	0,15%
BB	BB	BB Previdenciario XI Títulos Públicos	4,45%	0,50	0,49%	-0,06%	2,43%	6.097.903,64	5,99%	182.021.276,11	3,35%
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF ALOCACAO ATIVA FICFI	2,80%	0,33	0,39%	-0,05%	2,40%	4.336.549,03	4,26%	5.409.881.290,27	0,08%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - 4604 - Fundos 100% Títulos Públicos - Referenciado				0,38				68.397.797,88	67,22%		
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Renda Fixa											
BB	BB	BB RPPS RF PERFIL FIC	0,04%	0,03	0,24%	98,21%	0,24%	3.508.472,39	3,45%	4.083.660.760,57	0,09%
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF FLUXO FC FI	0,01%	0,02	0,41%	82,54%	0,86%	6.834.273,21	6,72%	1.231.918.985,49	0,55%
CEF	CEF	CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RF	0,00%	0,02	0,43%	86,31%	0,90%	91.107,69	0,09%	658.863.890,63	0,01%
CEF	CEF	CAIXA BRASIL GESTAO ESTRATEGICA FI RF	2,44%	0,29	0,50%	0,07%	3,40%	3.640.383,75	3,58%	4.070.797.730,66	0,09%
ITAU	ITAU	ITAU INST ALOCACAO DINAMICA II FIC RF	1,64%	0,20	0,34%	-0,09%	2,72%	6.079.818,18	5,98%	2.763.600.790,43	0,22%
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Renda Fixa				0,13				20.154.055,22	19,81%		

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Posição de Ativos											
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	VAR	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (28/02/2019)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
Artigo 7º VII, Alínea b - 4604 - Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"											
AZ QUEST	BEM	AZ LEGAN VALORE FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA - CRÉDITO PRIVADO	0,15%	0,04	0,51%	103,41%	1,17%	3.342.122,33	3,28%	382.629.716,89	0,87%
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b - 4604 - Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"				0,04				3.342.122,33	3,28%		
Sub-total Renda Fixa				0,31				91.893.975,43	90,31%		
Renda Variável											
Artigo 8º II, Alínea a - 4604 - Fundos de Ações											
CONSTÂNCIA	BEM	CONSTANCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	22,30%	2,37	-1,83%	0,02%	9,52%	4.335.284,36	4,26%	202.638.748,32	2,14%
VINCI	VINCI	VINCI SELECTION EQUITIES FIA	17,43%	1,87	-1,88%	-0,02%	8,37%	3.225.244,75	3,17%	212.225.914,66	1,52%
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a - 4604 - Fundos de Ações				2,16				7.560.529,11	7,43%		
Artigo 8º III - 4604 - Fundos Multimercados											
WESTERN	WESTERN	WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	1,63%	0,20	0,88%	177,72%	0,97%	1.052.902,11	1,03%	413.481.256,55	0,25%
Sub-total Artigo 8º III - 4604 - Fundos Multimercados				0,20				1.052.902,11	1,03%		
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604 - Fundos de Investimentos Imobiliários											
RIO BRAVO	CEF	RBBV11	0,00%	0,00	11,22%	10,19%	12,22%	1.243.500,00	1,22%	125.830.401,38	0,99%
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b - 4604 - Fundos de Investimentos Imobiliários				0,00				1.243.500,00	1,22%		
Sub-total Renda Variável				1,68				9.856.931,22	9,69%		
Total								101.750.906,65	100%		

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Enquadramento da Carteira					
Artigo	Classe	Valor(R\$)	% Carteira	Politica Investimento	Limite Res. 3.922/10
<b>Renda Fixa</b>					
Artigo 7º I, Alínea b - 4604	Fundos 100% Títulos Públicos - Referenciado	68.397.797,88	67,22%	60,00%	100,00%
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604	Fundos de Renda Fixa	20.154.055,22	19,81%	17,00%	40,00%
Artigo 7º VII, Alínea b - 4604	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	3.342.122,33	3,28%	4,00%	5,00%
Total Renda Fixa		91.893.975,43	90,31%		
<b>Renda Variável</b>					
Artigo 8º II, Alínea a - 4604	Fundos de Ações	7.560.529,11	7,43%	5,00%	20,00%
Artigo 8º III - 4604	Fundos Multimercados	1.052.902,11	1,03%	3,00%	10,00%
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604	Fundos de Investimentos Imobiliários	1.243.500,00	1,22%	1,00%	5,00%
Total Renda Variável		9.856.931,22	9,68%		

Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)				
Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
Artigo 7º I, Alínea b - 4604 % do CDI	0,46 93,9	2,29 220,0	9,59 149,5	- -
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 % do CDI	0,39 79,6	1,43 137,9	6,24 97,4	- -
Artigo 7º VII, Alínea b - 4604 % do CDI	0,51 103,4	1,17 112,6	6,95 108,4	- -
Artigo 8º II, Alínea a - 4604 Var. IBOVESPA p.p	-1,68 0,2	9,44 0,7	17,34 5,4	- -
Artigo 8º III - 4604 Var. IBOVESPA p.p	0,88 2,7	0,97 -7,8	6,81 -5,0	- -
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604 Var. IBOVESPA p.p	11,22 13,1	12,22 3,5	23,08 11,1	- -

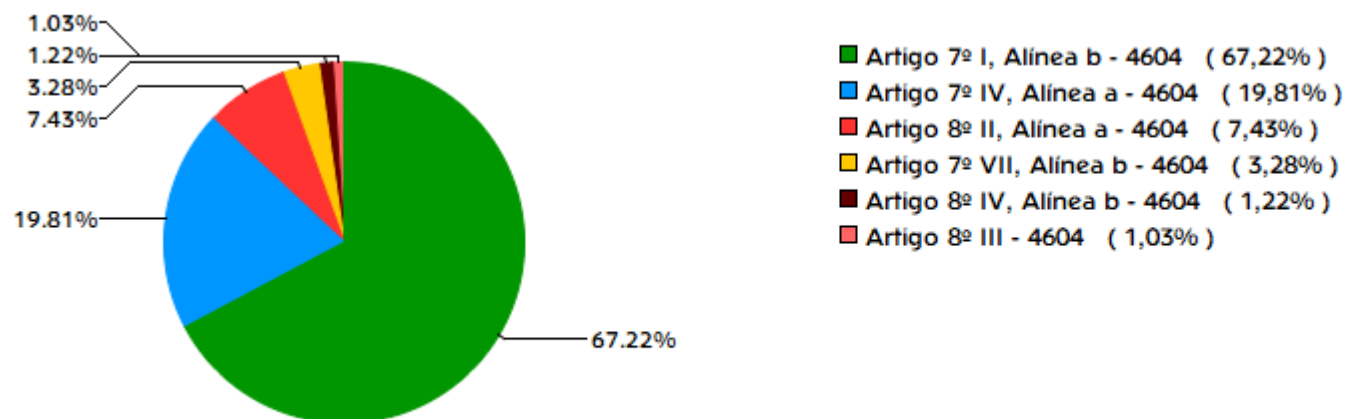
Ganhos Financeiros	
Estratégia	No Mês(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b - 4604	317.349,49
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604	73.087,39
Artigo 7º VII, Alínea b - 4604	16.971,04
Artigo 8º II, Alínea a - 4604	-132.939,41
Artigo 8º III - 4604	9.155,34
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604	125.488,08
Total	409.111,92

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

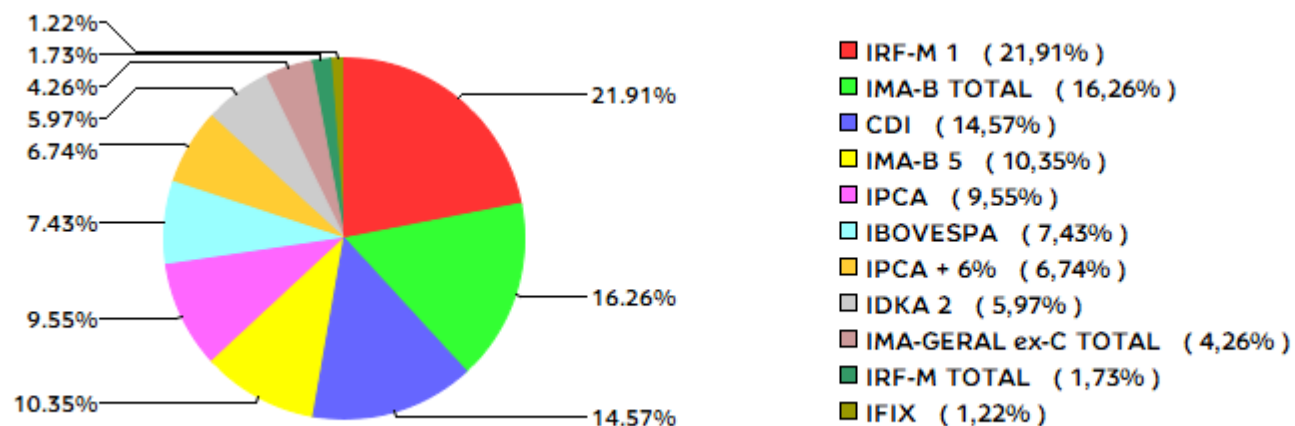
Análise da Disponibilidade Financeira				
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acum. Bruto (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	75.516.991,06	74	75.516.991,06	74
acima de 365 dias	26.233.915,59	26	101.750.906,65	100

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia

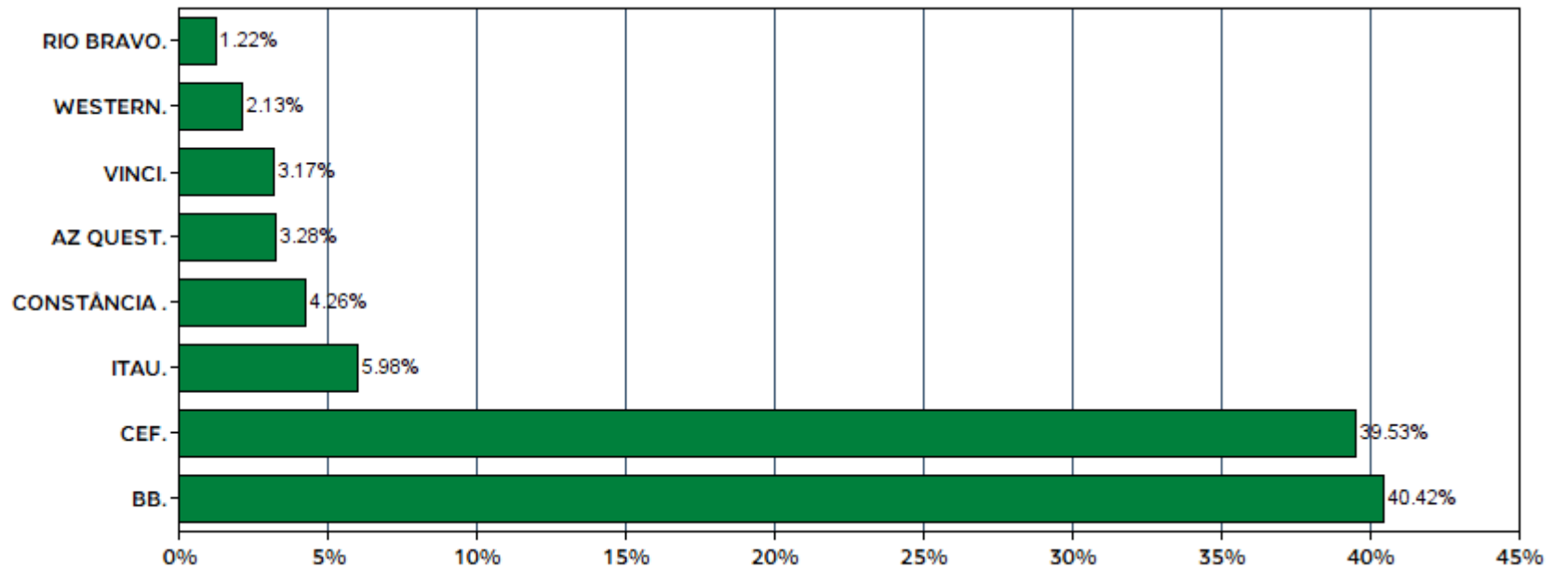


Indexadores



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

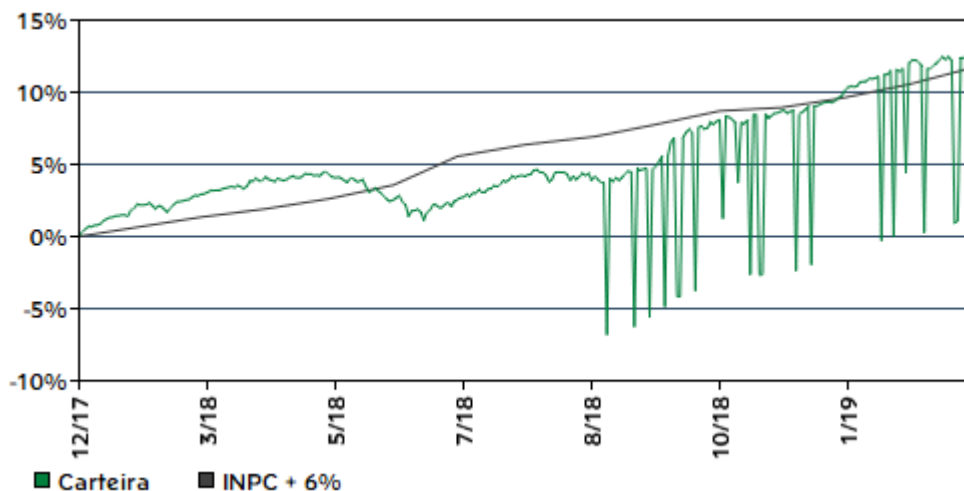
Alocação por Gestor



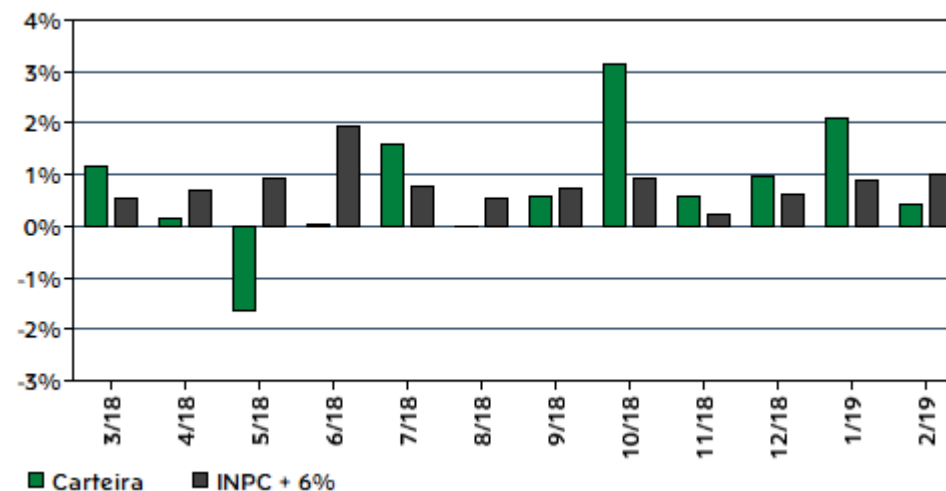
**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

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	-0,00	0,59	3,13	0,56	0,97	9,73
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	1,46	0,11	0,59	-0,55	-2,57	-1,91	0,83	-0,53	-0,16	2,22	0,35	0,36	0,14
2019	2,08	0,41	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	2,51
INPC + 6%	0,87	1,01	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	1,89
p.p. Indx	1,21	-0,59	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	0,62

**Evolução da Rentabilidade**



**Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses**



**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Análise de Risco / Retorno da Carteira**

	Qtd.	Perct.
Meses acima do Benchmark	8	57,1%
Meses abaixo do Benchmark	6	42,9%

	Rentab.	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	3,13%	out/18
Menor rentabilidade da Carteira	-1,66%	mai/18

Período	Rentabilidade (%)			Volat. Anual
	Carteira	INPC + 6%	p.p. Indx.	
03 meses	3,50	2,50	1,0	77,659
06 meses	7,97	4,43	3,5	84,130
12 meses	9,28	10,18	-0,9	58,840
24 meses	--	--	--	--
36 meses	--	--	--	--
Desde o início	12,48	11,66	0,8	54,668

**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.	0,52 -0,02	1,87 -3,07	3,05 -3,61	6,95 -8,20	10,05 -4,06	22,09 -4,41	38,90 -21,37
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,44 -0,03	1,02 -0,03	1,56 -0,05	3,65 -0,08	6,65 -0,23	16,91 -0,49	33,22 -0,89
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FICFI % do Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,39 -0,05	2,40 0,04	3,60 0,03	8,69 0,07	9,81 0,07	21,35 -0,60	-- --
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 FI % do Var. IDKA 2 p.p.	0,61 0,08	1,83 0,03	3,07 0,00	6,58 -0,12	9,55 -0,64	22,05 -1,84	37,60 -1,68
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M TP % do Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,28 -0,02	1,64 -0,04	3,18 -0,06	9,31 -0,11	9,71 -0,23	23,72 -0,59	52,44 -0,88
BB PREVIDENCIÁRIO RF TIT PUBL IPCA FI % do Var. IPCA + 6% p.p.	0,33 -0,57	2,47 0,73	4,43 2,07	10,16 5,60	10,96 0,84	24,34 4,37	50,55 17,33
BB Previdenciário XI Títulos Públicos % do Var. IMA-B 5 p.p.	0,49 -0,06	2,43 0,33	4,10 0,61	9,59 1,80	10,67 0,58	24,30 1,30	43,51 5,41
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,65 0,10	5,69 0,75	7,20 0,53	16,92 1,78	14,64 0,53	22,86 -3,64	53,66 -6,60

## 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 IDKa IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RF LP % do Var. IDKA 2 p.p.	0,56 0,03	1,83 0,03	3,01 -0,06	6,51 -0,18	9,63 -0,56	22,15 -1,75	37,82 -1,46
CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP FI RF LP % do Var. IMA-B 5 p.p.	0,52 -0,02	2,06 -0,03	3,47 -0,01	7,74 -0,06	9,90 -0,19	22,57 -0,43	38,70 -0,77
CAIXA FI BRASIL IMAB TP FI RF LP % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,52 -0,03	4,93 -0,00	6,64 -0,02	15,10 -0,05	13,92 -0,19	26,03 -0,47	59,48 -0,79
CAIXA FI BRASIL IRFM 1 TP FI RF % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,45 -0,02	1,02 -0,03	1,57 -0,05	3,66 -0,06	6,71 -0,17	17,04 -0,37	33,48 -0,63
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,36 -0,19	2,78 -2,15	4,64 -2,03	10,90 -4,25	10,97 -3,15	20,70 -5,80	40,47 -19,79
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS RENDA FIXA.. % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,54 -0,01	1,59 -3,34	2,54 -4,13	5,67 -9,47	8,97 -5,14	18,74 -7,76	29,03 -31,24
WESTERN ASSET IMAB5 ATIVO FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA % do Var. IMA-B 5 p.p.	0,37 -0,18	2,56 0,47	4,74 1,26	10,68 2,89	11,78 1,68	26,21 3,21	45,64 6,17
BB PREVIDENCIARIO RF FLUXO FC FI % do % do CDI	0,41 82,54	0,86 82,48	1,27 82,38	2,53 82,40	5,27 82,16	13,53 84,80	28,32 88,35
BB RPPS RF PERFIL FIC % do % do CDI	0,48 98,20	1,02 97,91	1,49 96,90	3,03 98,63	6,31 98,43	15,93 99,83	31,98 99,76
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RF % do % do CDI	0,43 86,31	0,90 86,28	1,33 86,30	2,65 86,28	5,52 86,19	14,04 88,02	28,80 89,84
CAIXA BRASIL GESTAO ESTRATEGICA FI RF % do Var. IPCA p.p.	0,50 0,07	3,40 2,65	4,77 3,87	7,64 6,01	9,66 5,77	20,69 13,84	-- --
ITAU INST ALOCACAO DINAMICA II FIC RF % do Var. IPCA p.p.	0,34 -0,09	2,72 1,97	4,26 3,36	6,02 4,39	8,73 4,84	19,83 12,98	-- --
AZ LEGAN VALORE FUNDO DE INVESTIMENTO RENDA FIXA - CRÉDITO PRIVADO % do % do CDI	0,51 103,41	1,17 112,60	1,80 116,74	3,48 113,08	6,95 108,36	17,23 107,99	34,17 106,60
CONSTANCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES % do Var. IBOVESPA p.p.	-1,83 0,02	9,52 0,76	7,46 0,67	24,98 0,32	16,68 4,69	47,16 3,77	108,72 -14,65
VINCI SELECTION EQUITIES FIA % do Var. IBOVESPA p.p.	-1,88 -0,02	8,37 -0,39	8,15 1,36	25,42 0,76	18,00 6,01	51,51 8,12	101,51 -21,85

**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
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO % do % do CDI	0,88 177,72	0,97 93,81	1,80 117,33	3,89 126,65	6,96 108,51	15,55 97,48	35,66 111,25
RBBV11 % do Var. IFIX p.p.	11,22 10,19	12,22 8,69	19,15 13,32	26,66 12,86	23,08 17,74	-- --	-- --
CDI	0,49	1,04	1,54	3,07	6,41	15,95	32,05
IBOVESPA	-1,86	8,76	6,79	24,66	11,99	43,39	123,36
DOLAR COMERCIAL	2,37	-3,52	-3,23	-9,60	15,21	20,62	-6,06
INPC + 6%	1,01	1,89	2,50	4,43	10,18	18,82	31,86
IPCA + 6%	0,90	1,73	2,36	4,56	10,12	19,97	33,22