

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos											
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	VAR	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (28/06/2018)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
Renda Fixa											
Artigo 7º I, Alínea b - 4604 - Fundos 100% Títulos Públicos - Referenciado											
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,51%	0,08	0,47%	-0,05%	2,91%	15.276.543,66	26,42%	11.447.791.301,99	0,13%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IMAB TP RF LP	4,56%	0,50	-0,58%	-0,04%	0,80%	4.965.504,12	8,59%	3.528.866.430,84	0,14%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IRFM 1 TP RF	0,50%	0,08	0,47%	-0,05%	2,93%	1.469.215,81	2,54%	16.738.584.209,10	0,01%
BRABESCO	BRABESCO	BRABESCO FI RF IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS	0,50%	0,08	0,40%	-0,12%	2,83%	4.832.357,11	8,36%	1.019.367.510,56	0,47%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP RF LP	2,66%	0,31	0,30%	-0,03%	2,55%	7.687.450,22	13,30%	7.662.265.838,25	0,10%
BB	BB	BB IDKA 2 TP FI RF PREV	2,11%	0,26	0,17%	34,41%	3,04%	11.409.745,51	19,73%	6.103.549.604,89	0,19%
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,66%	0,31	0,31%	-0,01%	2,57%	1.762.455,22	3,05%	1.135.562.022,83	0,16%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - 4604 - Fundos 100% Títulos Públicos - Referenciado				0,21				47.403.271,65	81,99%		
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Renda Fixa											
BRABESCO	BRABESCO	BRABESCO FI REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,07%	0,04	0,48%	97,13%	3,04%	1.378.903,77	2,38%	7.230.099.273,32	0,02%
BRABESCO	BRABESCO	BRABESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	0,11%	0,04	0,49%	98,51%	3,12%	2.197.191,25	3,80%	8.977.378.168,73	0,02%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL REF DI LP	0,08%	0,04	0,48%	97,97%	3,06%	1.219.222,67	2,11%	7.961.418.599,00	0,02%
BB	BB	BB RPPS RF PERFIL FIC	0,09%	0,04	0,48%	97,05%	3,12%	2.248.810,46	3,89%	4.664.473.168,71	0,05%
GRAPHEN	ORLA	LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	0,00%	0,00	0,00%	0,54%	2,84%	1.806.782,33	3,12%	0,00	0,00%
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Renda Fixa				0,03				8.850.910,48	15,31%		
Artigo 7º VII, Alínea a - 4604 - Cota Sênior de FIDC											
LEME	LEME	LEME MULTISSETORIAL IPCA FIDC ..	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	-14,18%	78.718,72	0,14%	0,00	0,00%
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a - 4604 - Cota Sênior de FIDC				0,00				78.718,72	0,14%		
Sub-total Renda Fixa				0,19				56.332.900,85	97,43%		
Renda Variável											
Artigo 8º III - 4604 - Fundos Multimercados											
BB	BB	BB RPPS MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO FI LP V	2,58%	0,30	0,30%	61,45%	3,04%	1.484.333,69	2,57%	382.326.166,67	0,39%
Sub-total Artigo 8º III - 4604 - Fundos Multimercados				0,30				1.484.333,69	2,57%		

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Posição de Ativos											
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	VAR	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (28/06/2018)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
		Sub-total Renda Variável		0,30				1.484.333,69	2,57%		
Total								57.817.234,54	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	47.403.271,65	81,99%	70,00%	100,00%
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604	Fundos de Renda Fixa	8.850.910,48	15,31%	15,00%	40,00%
Artigo 7º VII, Alínea a - 4604	Cota Sênior de FIDC	78.718,72	0,14%	0,00%	5,00%
Total Renda Fixa		56.332.900,85	97,44%		
Renda Variável					
Artigo 8º III - 4604	Fundos Multimercados	1.484.333,69	2,57%	0,00%	10,00%
Total Renda Variável		1.484.333,69	2,57%		

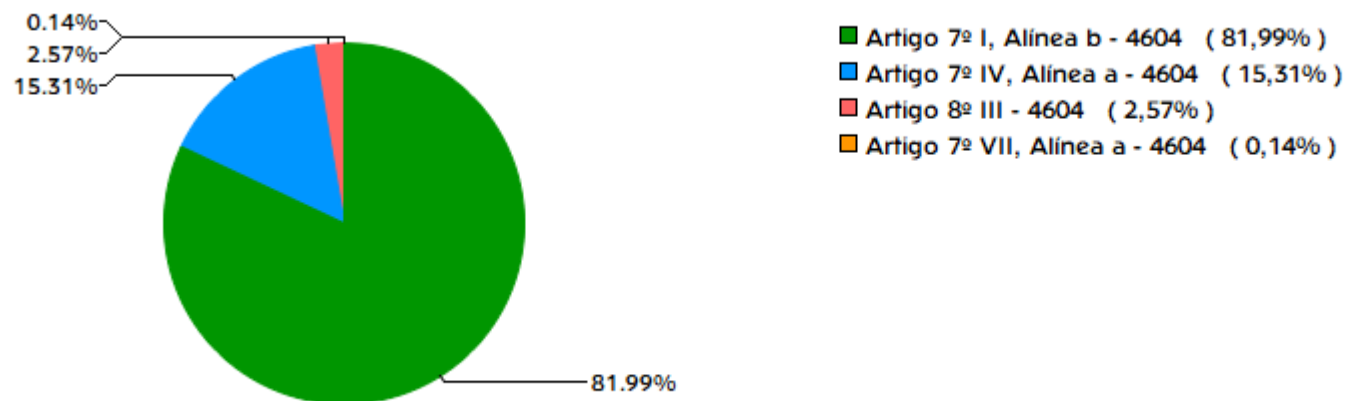
Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)				
Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
Artigo 7º I, Alínea b - 4604 % do CDI	0,24 49,3	2,64 83,9	-- --	-- --
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 % do CDI	0,38 77,7	2,85 90,5	-- --	-- --
Artigo 7º VII, Alínea a - 4604 % do CDI	0,00 0,0	-0,17 -5,4	-- --	-- --
Artigo 8º III - 4604 Var. IBOVESPA p.p	0,30 6,8	3,04 9,1	-- --	-- --

Ganhos Financeiros	
Estratégia	No Mês(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b - 4604	117.104,50
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604	33.813,73
Artigo 7º VII, Alínea a - 4604	0,00
Artigo 8º III - 4604	4.481,57
Total	155.399,79

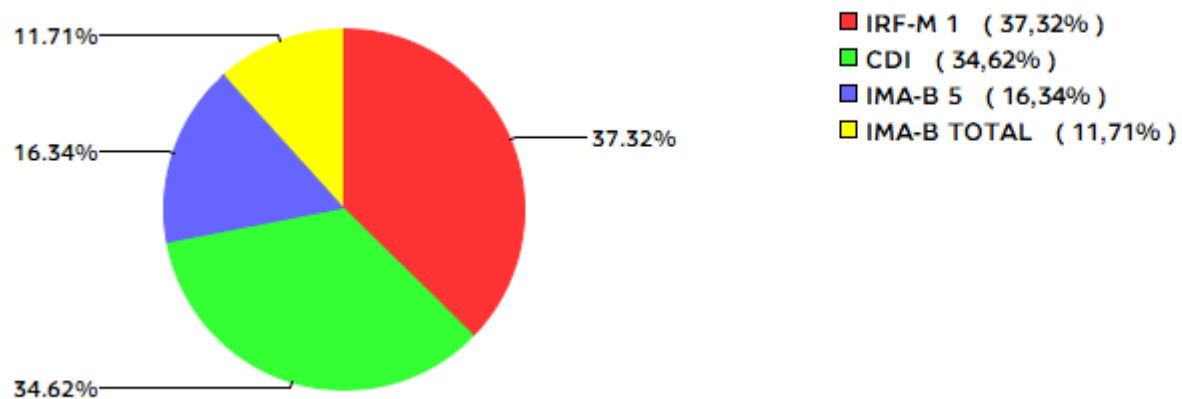
Análise da Disponibilidade Financeira				
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acum. Bruto (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	57.817.234,54	100	57.817.234,54	100

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia

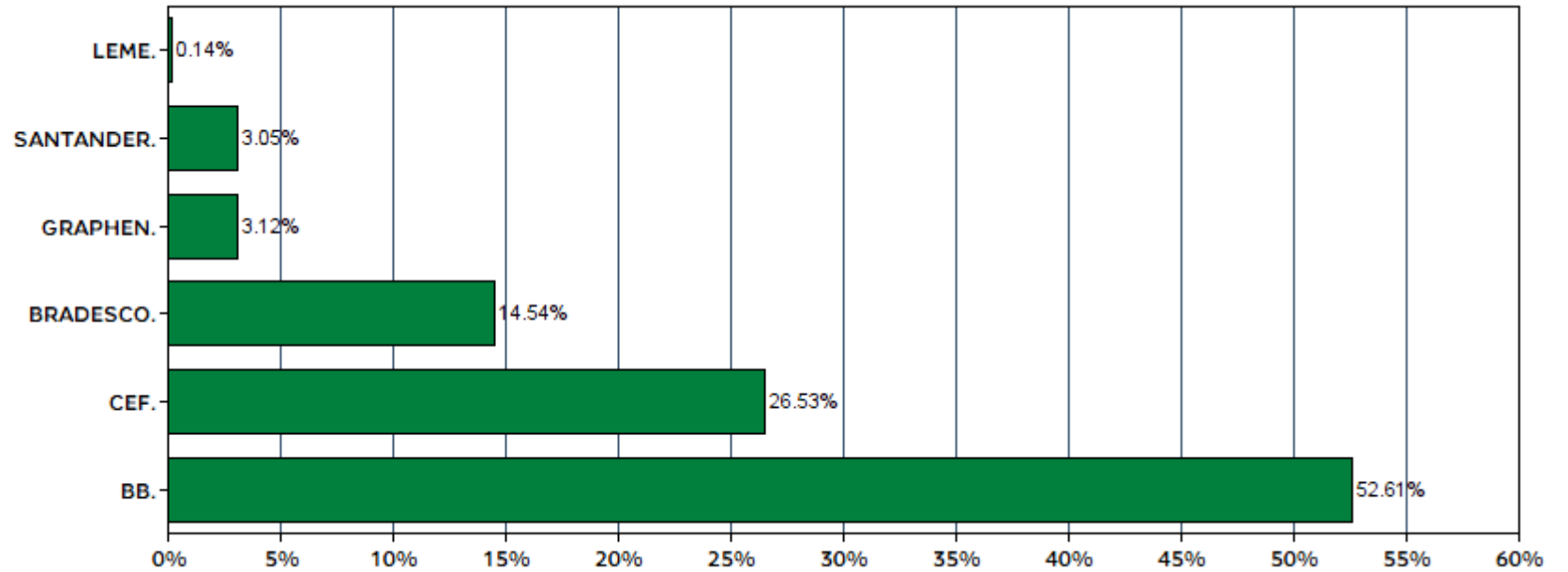


Indexadores



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor

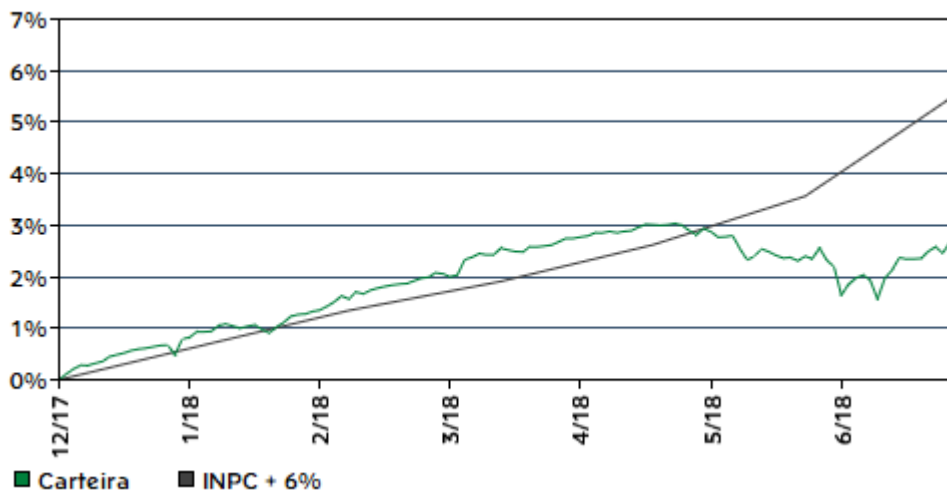


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

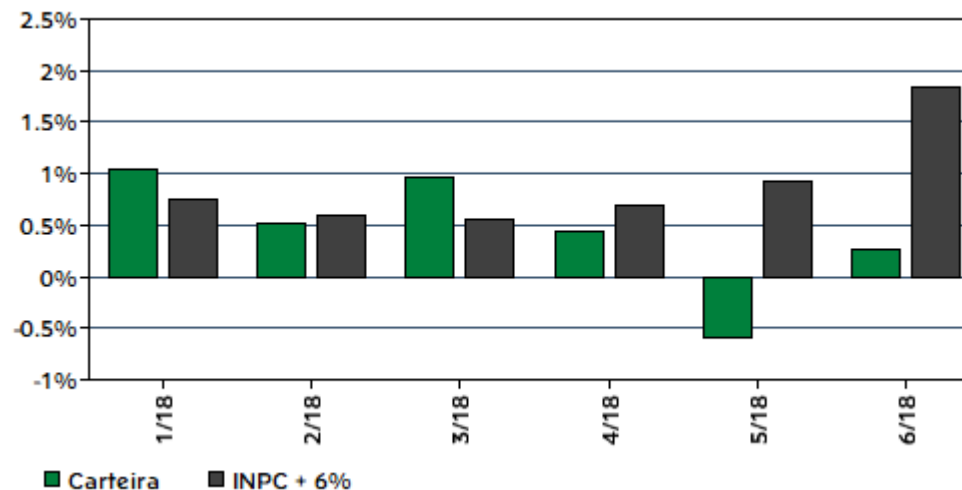
Rentabilidades da Carteira

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
2018	1,05	0,52	0,97	0,44	-0,60	0,27	-	-	-	-	-	-	2,67
INPC + 6%	0,74	0,60	0,56	0,70	0,92	1,83	-	-	-	-	-	-	5,46
p.p. Indx	0,31	-0,08	0,41	-0,25	-1,52	-1,57	-	-	-	-	-	-	-2,79

Evolução da Rentabilidade



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Análise de Risco / Retorno da Carteira**

	Qtd.	Perct.
Meses acima do Benchmark	2	33,3%
Meses abaixo do Benchmark	4	66,7%

	Rentab.	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,05%	jan/18
Menor rentabilidade da Carteira	-0,60%	mai/18

Período	Rentabilidade (%)			Volat. Anual
	Carteira	INPC + 6%	p.p. Indx.	
03 meses	0,23	3,51	-3,3	2,151
06 meses	--	--	--	--
12 meses	--	--	--	--
24 meses	--	--	--	--
36 meses	--	--	--	--
Desde o início	2,67	5,46	-2,8	1,765

**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 IDKA 2 TP FI RF PREV % do % do CDI	0,17 34,41	3,04 96,62	0,18 11,52	3,07 96,63	9,73 131,13	22,32 104,86	43,06 112,24
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,47 -0,05	2,91 -0,14	1,17 -0,09	2,94 -0,07	7,61 -0,25	21,77 -0,60	39,70 -1,06
BRADESCO FI RF IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,40 -0,12	2,83 -0,22	1,09 -0,17	2,86 -0,15	7,54 -0,32	21,71 -0,66	39,75 -1,00
CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP RF LP % do Var. IMA-B 5 p.p.	0,30 -0,03	2,55 -0,13	-0,72 -0,08	2,58 0,13	9,45 -0,26	21,72 -0,48	42,12 -1,21
CAIXA FI BRASIL IMAB TP RF LP % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,58 -0,04	0,80 -0,13	-3,67 -0,08	0,84 0,42	7,72 -0,28	21,01 -0,47	39,48 -2,44
CAIXA FI BRASIL IRFM 1 TP RF % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,47 -0,05	2,93 -0,12	1,18 -0,07	2,95 -0,05	7,65 -0,21	21,93 -0,45	40,06 -0,70
SANTANDER FIC IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF % do Var. IMA-B 5 p.p.	0,31 -0,01	2,57 -0,11	-0,70 -0,06	2,60 0,15	9,50 -0,21	21,74 -0,46	42,55 -0,78
BB RPPS RF PERFIL FIC % do % do CDI	0,48 97,05	3,12 99,10	1,54 98,40	3,15 99,09	7,47 100,65	21,52 101,12	38,44 100,19

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
BRADESCO FI REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA % do % do CDI	0,48 97,13	3,04 96,60	1,50 96,41	3,07 96,60	7,27 97,87	20,94 98,40	37,66 98,16
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM % do % do CDI	0,49 98,51	3,12 98,95	1,52 97,48	3,14 98,94	7,61 102,52	21,97 103,22	39,16 102,09
CAIXA FI BRASIL REF DI LP % do % do CDI	0,48 97,97	3,06 96,99	1,52 97,69	3,08 96,99	7,27 97,87	21,14 99,36	38,27 99,77
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,00 0,54	2,84 1,90	0,62 4,21	-- --	-- --	-- --	-- --
LEME MULTISETORIAL IPCA FIDC ... % do % do CDI	0,00 0,00	-14,18 -450,03	-9,51 -609,23	-17,85 -561,77	-96,39 -1.298,41	-97,41 -457,74	-98,51 -256,78
BB RPPS MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO FI LP V % do % do CDI	0,30 61,45	3,04 96,61	1,30 83,02	3,07 96,51	8,86 119,39	23,35 109,71	40,08 104,48
CDI	0,49	3,15	1,56	3,18	7,42	21,28	38,36
IBOVESPA	-6,50	-6,07	-14,44	-6,07	15,72	43,52	32,86
DOLAR COMERCIAL	3,08	16,45	15,40	16,45	16,62	15,79	23,18
INPC + 6%	1,83	5,46	3,51	5,50	9,58	19,19	38,37
IPCA + 6%	1,67	5,50	3,33	5,55	10,51	20,69	39,31