

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos											
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	VAR	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (31/10/2018)	% 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	0,55%	0,08	0,93%	0,02%	5,64%	17.077.538,38	27,78%	12.885.880.277,28	0,13%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IMAB TP FI RF LP	5,50%	0,61	7,16%	0,02%	10,04%	5.420.461,00	8,82%	3.166.189.623,94	0,17%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IRFM 1 TP FI RF	0,55%	0,08	0,94%	0,02%	5,67%	804.077,81	1,31%	19.282.041.339,97	0,00%
BRADESCO	BRADESCO	BRADESCO FI RF IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS	0,57%	0,09	0,90%	-0,02%	5,59%	4.962.076,27	8,07%	1.717.634.720,61	0,29%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP FI RF LP	3,05%	0,35	3,10%	-0,00%	8,03%	8.098.232,78	13,17%	9.298.896.034,42	0,09%
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2 FI	2,33%	0,28	2,09%	0,14%	7,79%	11.934.876,24	19,41%	6.844.791.587,40	0,17%
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,05%	0,35	3,10%	0,00%	8,05%	1.856.666,84	3,02%	1.428.751.490,64	0,13%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - 4604 - Fundos 100% Títulos Públicos - Referenciado				0,24				50.153.929,32	81,57%		
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Renda Fixa											
BRADESCO	BRADESCO	BRADESCO FI REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA	0,02%	0,03	0,53%	97,44%	5,21%	1.407.952,47	2,29%	7.545.933.053,51	0,02%
BRADESCO	BRADESCO	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	0,03%	0,03	0,54%	98,79%	5,31%	2.243.840,77	3,65%	7.898.846.795,17	0,03%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL RF REF DI LP	0,03%	0,03	0,53%	97,99%	5,21%	1.292.627,51	2,10%	8.101.441.130,94	0,02%
BB	BB	BB RPPS RF PERFIL FIC	0,07%	0,03	0,53%	97,75%	5,32%	485.505,40	0,79%	5.498.059.726,89	0,01%
BRADESCO	BRADESCO	BRADESCO FC FI RF ALOCACAO DINAMICA	--%	--	3,47%	638,42%	3,59%	1.864.631,60	3,03%	136.944.891,80	1,36%
GRAPHEN	ORLA	LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	0,00%	0,00	4,91%	-2,23%	-21,94%	1.382.874,94	2,25%	64.035.370,40	2,16%
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Renda Fixa				0,02				8.677.432,69	14,11%		
Artigo 7º VII, Alínea a - 4604 - Cota Sênior de FIDC											
GRAPHEN	ORLA	LME MULTISSETORIAL IPCA FIDC	0,00%	0,00	-0,23%	-42,23%	1.128,55%	1.126.844,62	1,83%	75.826.921,21	1,49%
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a - 4604 - Cota Sênior de FIDC				0,00				1.126.844,62	1,83%		
Sub-total Renda Fixa				0,20				59.958.206,63	97,52%		
Renda Variável											
Artigo 8º III - 4604 - Fundos Multifimercados											
BB	BB	BB RPPS MULTIMERCADO PREVIDENCIARIO FI LP V	2,71%	0,31	0,73%	133,99%	5,83%	1.524.471,94	2,48%	483.348.247,96	0,32%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos											
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	VAR	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (31/10/2018)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
		Sub-total Artigo 8º III - 4604 - Fundos Multimercados		0,31				1.524.471,94	2,48%		
		Sub-total Renda Variável		0,31				1.524.471,94	2,48%		
Total								61.482.678,57	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	50.153.929,32	81,57%	81,00%	100,00%
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604	Fundos de Renda Fixa	8.677.432,69	14,11%	14,00%	40,00%
Artigo 7º VII, Alínea a - 4604	Cota Sênior de FIDC	1.126.844,62	1,83%	2,00%	5,00%
Total Renda Fixa		59.958.206,63	97,51%		
Renda Variável					
Artigo 8º III - 4604	Fundos Multimercados	1.524.471,94	2,48%	3,00%	10,00%
Total Renda Variável		1.524.471,94	2,48%		

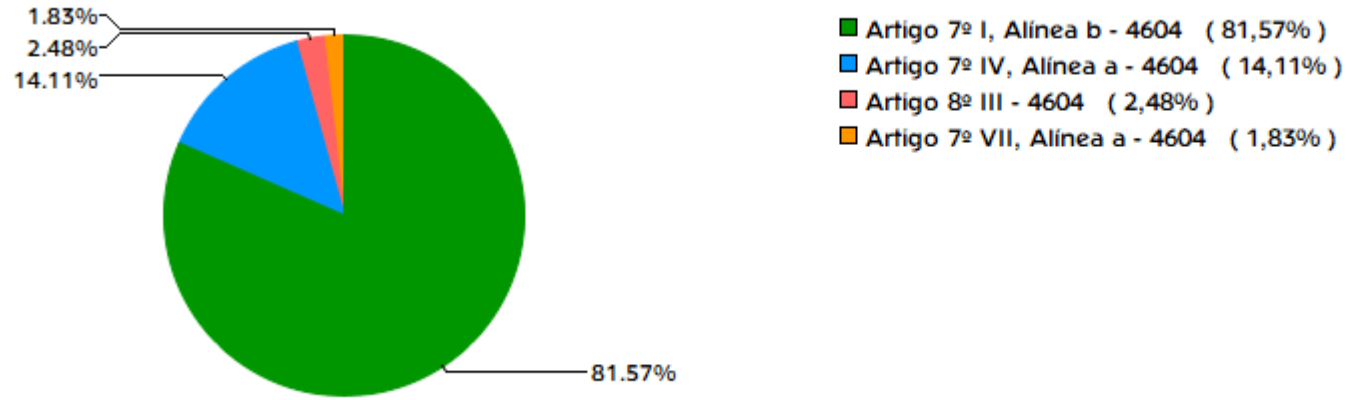
Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)				
Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
Artigo 7º I, Alínea b - 4604 % do CDI	2,28 419,6	7,09 131,7	-- --	-- --
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 % do CDI	1,83 336,8	0,25 4,7	-- --	-- --
Artigo 7º VII, Alínea a - 4604 % do CDI	0,00 0,0	-2,53 -47,1	-- --	-- --
Artigo 8º III - 4604 Var. IBOVESPA p.p	0,73 -9,5	5,83 -8,6	-- --	-- --

Ganhos Financeiros	
Estratégia	No Mês(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b - 4604	1.115.034,36
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604	155.978,07
Artigo 7º VII, Alínea a - 4604	-2.589,90
Artigo 8º III - 4604	11.011,77
Total	1.279.434,29

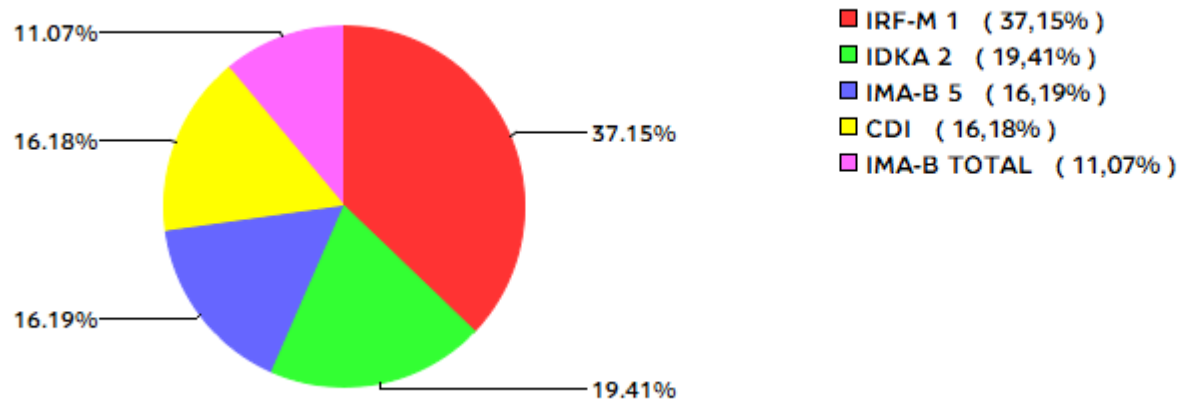
Análise da Disponibilidade Financeira				
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acum. Bruto (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	60.355.833,95	98	60.355.833,95	98
acima de 365 dias	1.126.844,62	2	61.482.678,57	100

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia

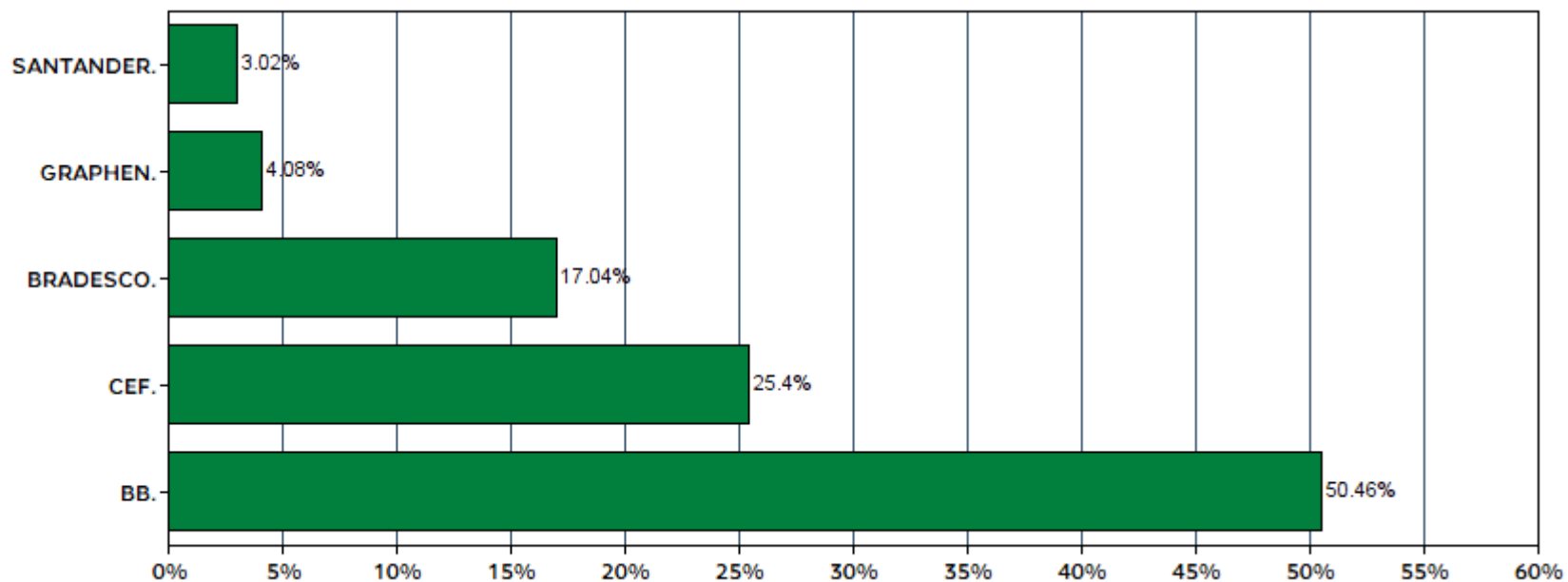


Indexadores



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor

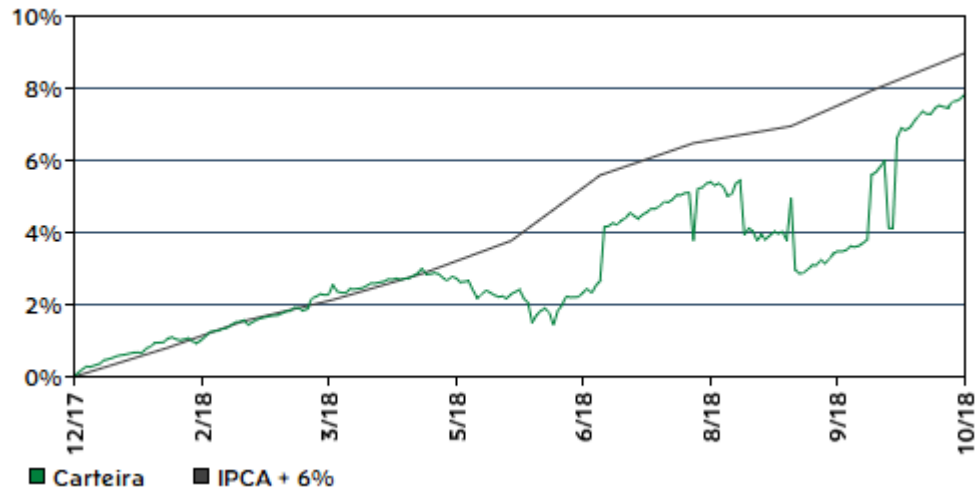


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

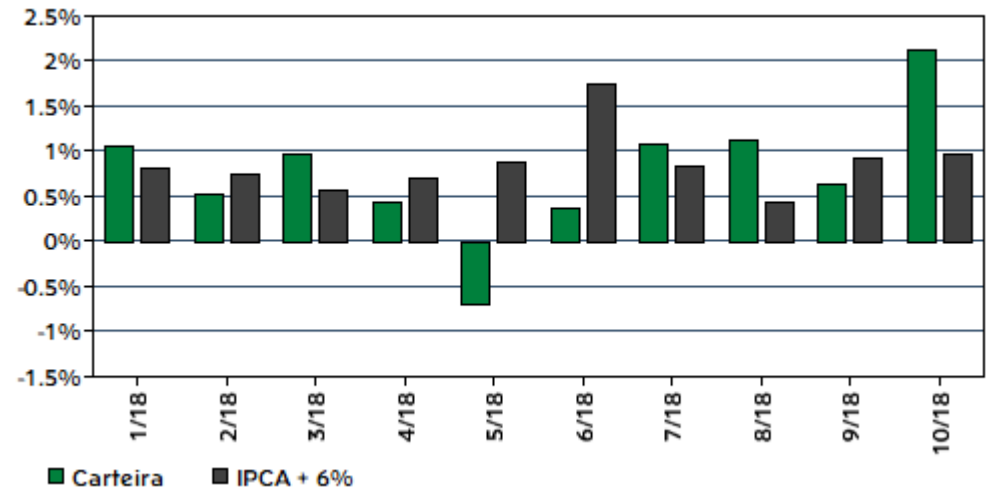
Rentabilidades da Carteira

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
2018	1,05	0,52	0,97	0,44	-0,69	0,36	1,07	1,13	0,63	2,13	--	--	7,85
IPCA + 6%	0,80	0,74	0,58	0,71	0,89	1,75	0,84	0,44	0,92	0,96	--	--	8,97
p.p. Indx	0,25	-0,22	0,39	-0,26	-1,58	-1,40	0,23	0,69	-0,29	1,17	--	--	-1,13

Evolução da Rentabilidade



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco / Retorno da Carteira

	Qtd.	Perct.
Meses acima do Benchmark	5	50,0%
Meses abaixo do Benchmark	5	50,0%

	Rentab.	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,13%	out/18
Menor rentabilidade da Carteira	-0,69%	mai/18

Período	Rentabilidade (%)			Volat. Anual
	Carteira	IPCA + 6%	p.p. Indx.	
03 meses	3,94	2,34	1,6	9,517
06 meses	4,70	5,95	-1,3	7,196
12 meses	--	--	--	--
24 meses	--	--	--	--
36 meses	--	--	--	--
Desde o início	7,85	8,97	-1,1	5,654

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 IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,93 0,02	5,64 -0,17	1,93 -0,04	3,32 -0,09	6,85 -0,21	19,69 -0,54	37,04 -0,89
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 FI % do Var. IDKA 2 p.p.	2,09 0,14	7,79 -0,42	3,21 -0,22	3,90 -0,29	9,03 -0,72	23,32 -1,90	42,59 -2,02
BRADESCO FI RF IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,90 -0,02	5,59 -0,21	1,91 -0,07	3,26 -0,15	6,83 -0,23	19,70 -0,52	37,05 -0,87
CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP FI RF LP % do Var. IMA-B 5 p.p.	3,10 -0,00	8,03 -0,20	3,70 -0,05	3,98 -0,12	9,07 -0,24	23,54 -0,49	43,50 -0,98
CAIXA FI BRASIL IMAB TP FI RF LP % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	7,16 0,02	10,04 -0,19	6,47 -0,03	5,08 -0,11	10,06 -0,23	25,93 -0,46	58,11 -1,05
CAIXA FI BRASIL IRFM 1 TP FI RF % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,94 0,02	5,67 -0,14	1,94 -0,03	3,35 -0,06	6,90 -0,16	19,82 -0,40	37,31 -0,62
SANTANDER FIC IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF % do Var. IMA-B 5 p.p.	3,10 0,00	8,05 -0,18	3,71 -0,04	4,01 -0,09	9,12 -0,18	23,59 -0,44	43,66 -0,82
BB RPPS RF PERFIL FIC % do % do CDI	0,53 97,75	5,32 98,96	1,58 99,87	3,15 98,40	6,53 99,75	18,49 100,55	35,00 99,91

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 FC FI RF ALOCACAO DINAMICA % do % do CDI	3,47 638,42	7,31 135,88	3,61 227,50	3,48 108,96	-- --	-- --	-- --
BRADESCO FI REFERENCIADO DI FEDERAL EXTRA % do % do CDI	0,53 97,44	5,21 96,90	1,55 97,50	3,10 97,02	6,35 97,00	18,09 98,38	34,34 98,02
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM % do % do CDI	0,54 98,79	5,31 98,62	1,56 98,59	3,13 97,92	6,46 98,55	18,83 102,41	35,73 101,99
CAIXA FI BRASIL RF REF DI LP % do % do CDI	0,53 97,99	5,21 96,85	1,54 97,12	3,10 96,91	6,35 96,92	18,18 98,88	34,79 99,29
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	4,91 -2,23	-21,94 -32,17	-22,38 -28,88	-23,46 -28,65	-- --	-- --	-- --
LME MULTISSETORIAL IPCA FIDC % do % do CDI	-0,23 -42,23	1.128,55 20.974,71	1.373,13 86.559,49	1.197,00 37.440,71	-- --	-- --	-- --
BB RPPS MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO FI LP V % do % do CDI	0,73 133,99	5,83 108,35	1,38 86,77	3,16 98,97	7,69 117,33	20,32 110,55	37,36 106,62
CDI	0,54	5,38	1,59	3,20	6,55	18,38	35,03
IBOVESPA	10,19	14,43	10,35	1,52	17,65	34,66	90,60
DOLAR COMERCIAL	-7,15	12,39	-0,99	6,80	13,45	16,87	-3,66
INPC + 6%	0,91	8,70	2,20	5,93	10,19	18,92	36,74
IPCA + 6%	0,96	8,97	2,34	5,95	10,78	20,57	37,84