

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos										
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (30/11/2018)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
Renda Fixa										
BANESTES DTVM	Banco BANESTES	FI BANESTES PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B	7,81%	1,19%	0,29%	11,09%	1.456.070,01	0,99%	208.121.963,07	0,70%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M 1 TP FIC FI	0,55%	0,52%	-0,02%	6,19%	9.101.406,64	6,20%	12.831.650.129,38	0,07%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI	5,45%	0,91%	0,00%	10,97%	52.591.435,53	35,84%	3.733.451.663,62	1,41%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA II FI	1,46%	0,11%	-0,15%	8,10%	1.079.159,50	0,74%	217.886.829,19	0,50%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 I TP RF	6,79%	0,12%	-0,79%	4,12%	1.218.003,19	0,83%	398.465.995,30	0,31%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RF LP	5,48%	0,90%	-0,01%	11,03%	27.155.633,47	18,51%	3.321.105.855,74	0,82%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP RF LP	7,83%	1,49%	-0,04%	12,02%	1.837.764,32	1,25%	812.961.028,89	0,23%
Sub-total 4604 - Artigo 7º I, Alínea b - FI 100% Títulos TN							94.439.472,66	64,36%		
BANESTES DTVM	Banco BANESTES	FI BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA	6,70%	1,00%	0,09%	8,92%	9.794.255,03	6,67%	194.398.903,88	5,04%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC FI	0,06%	0,49%	98,98%	5,84%	11.426.193,47	7,79%	5.039.302.378,97	0,23%
CEF	CEF	CAIXA FIC PRATICO RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,01%	0,05%	19,08%	0,05%	19.563,92	0,01%	14.279.069.226,83	0,00%
CEF	CEF	FI CAIXA ALIANÇA TP RF	0,07%	0,47%	95,20%	5,61%	2.437.988,92	1,66%	295.004.756,04	0,83%
BANESTES DTVM	Banco BANESTES	BANESTES ESTRATÉGIA FIC FI RF	--%	0,73%	148,32%	5,59%	2.132.795,98	1,45%	39.127.503,11	5,45%
Sub-total 4604 - Artigo 7º IV, Alínea a - FI Renda Fixa - Geral							25.810.797,32	17,59%		
Sub-total Renda Fixa - FI Renda Fixa - Geral							120.250.269,98	81,95%		
Renda Variável										
CEF	CEF	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	21,65%	2,33%	-0,05%	16,56%	5.111.832,86	3,48%	92.450.959,28	5,53%
Sub-total 4604 - Artigo 8º I, Alínea a - FI de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações							5.111.832,86	3,48%		
CEF	CEF	FIA CAIXA DIVIDENDOS	17,02%	5,44%	3,06%	20,90%	177.488,17	0,12%	61.705.161,47	0,29%
VINCI EQUITIES Gest Rec	CEF	FIC FIA CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	18,60%	5,49%	3,11%	7,28%	17.555.148,31	11,96%	442.448.931,42	3,97%
BANESTES DTVM	Banco BANESTES	BANESTES FIC FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INST	19,15%	3,42%	1,04%	17,44%	2.350.225,64	1,60%	21.851.733,12	10,76%
Sub-total 4604 - Artigo 8º II, Alínea a - FI de Ações - Geral							20.082.862,12	13,69%		
RIO BRAVO Invest	CEF	CAIXA RIO BRAVO FII	0,00%	4,41%	4,62%	2,48%	1.298.448,00	0,88%	163.878.008,51	0,79%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos										
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (30/11/2018)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
							1.298.448,00	0,88%		
							26.493.142,98	18,05%		
Total							146.743.412,96	100%		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

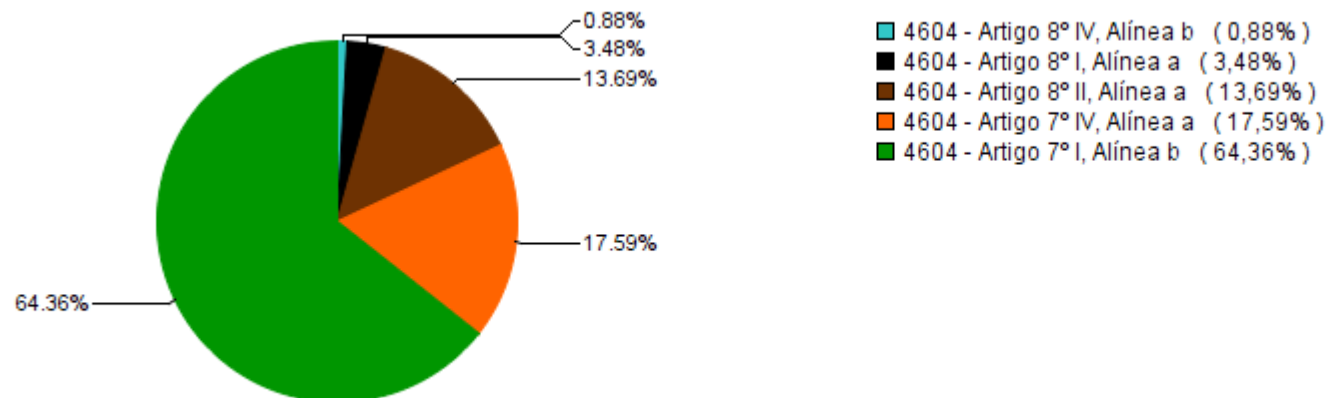
Enquadramento da Carteira					
Artigo	Classe	Valor(R\$)	% Carteira	Política Investimento	Limite Res. 4.604/17
Renda Fixa					
4604 - Artigo 7º I, Alínea b	FI 100% Títulos TN	94.439.472,66	64,36%	69,00%	100,00%
4604 - Artigo 7º IV, Alínea a	FI Renda Fixa - Geral	25.810.797,32	17,59%	6,00%	40,00%
Total Renda Fixa		120.250.269,98	81,95%		
Renda Variável					
4604 - Artigo 8º I, Alínea a	FI de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações	5.111.832,86	3,48%	3,00%	30,00%
4604 - Artigo 8º II, Alínea a	FI de Ações - Geral	20.082.862,12	13,69%	13,00%	20,00%
4604 - Artigo 8º IV, Alínea b	FI Imobiliários	1.298.448,00	0,88%	3,00%	5,00%
Total Renda Variável		26.493.142,98	18,05%		

Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)				
Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
4604 - Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,69 140,0	9,05 153,4	9,82 151,7	25,10 141,4
4604 - Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,70 141,5	7,38 125,0	8,05 124,3	21,75 122,6
4604 - Artigo 8º I, Alínea a % do CDI	2,33 471,7	16,56 280,6	23,82 368,1	42,76 241,0
4604 - Artigo 8º II, Alínea a % do CDI	5,24 1.062,7	8,43 142,8	14,08 217,5	33,01 186,0
4604 - Artigo 8º IV, Alínea b % do CDI	4,41 894,2	2,48 42,0	4,66 72,1	23,80 134,1

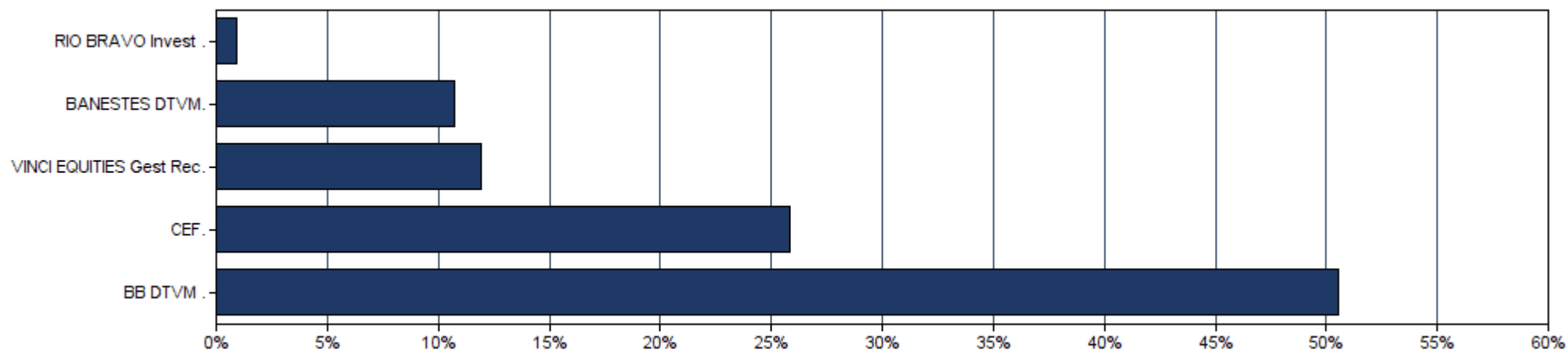
Ganhos Financeiros	
Estratégia	Ganho Bruto (R\$)
4604 - Artigo 7º I, Alínea b	945.874,95
4604 - Artigo 7º IV, Alínea a	179.235,48
4604 - Artigo 8º I, Alínea a	116.305,94
4604 - Artigo 8º II, Alínea a	1.000.827,86
4604 - Artigo 8º IV, Alínea b	54.954,00
Total	2.297.198,23

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia



Alocação por Gestor

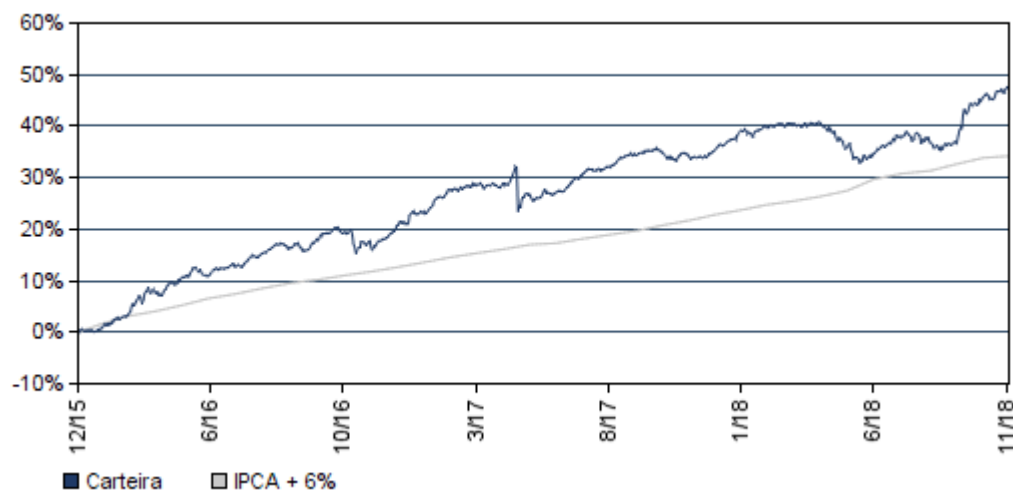


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

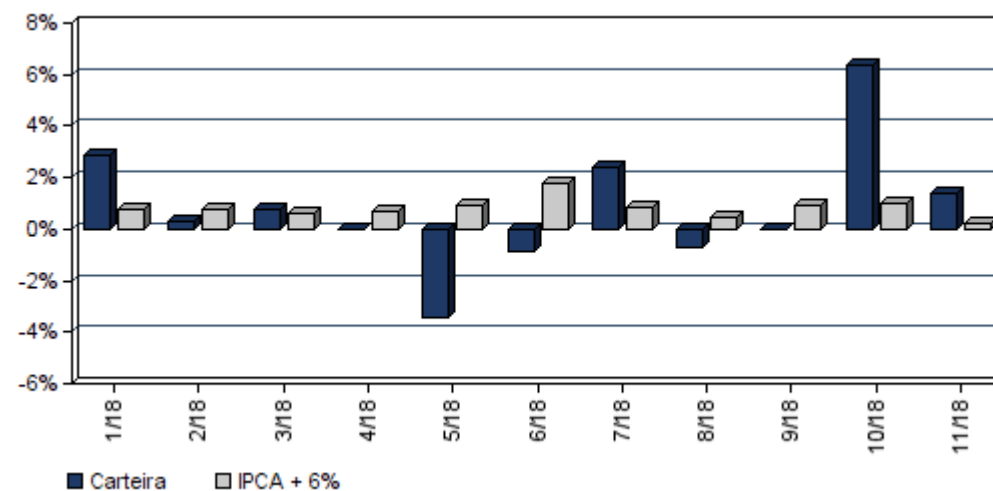
Rentabilidades da Carteira

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
2016	1,34	1,97	4,06	3,03	0,07	1,69	2,33	0,88	1,50	1,07	-1,32	2,51	20,77
IPCA + 6%	1,74	1,34	0,94	1,08	1,27	0,86	1,01	0,98	0,57	0,72	0,64	0,81	12,64
p.p. Indx	-0,40	0,63	3,12	1,95	-1,20	0,83	1,32	-0,10	0,93	0,34	-1,96	1,70	8,13
2017	1,89	3,69	0,85	-0,21	-1,20	0,24	2,79	1,28	1,65	-0,06	-0,56	1,19	12,05
IPCA + 6%	0,89	0,75	0,78	0,56	0,82	0,26	0,73	0,72	0,62	0,91	0,74	0,91	9,05
p.p. Indx	1,00	2,94	0,06	-0,77	-2,02	-0,02	2,07	0,56	1,03	-0,97	-1,31	0,28	3,00
2018	2,87	0,34	0,73	-0,01	-3,46	-0,88	2,39	-0,73	-0,02	6,39	1,39	--	9,04
IPCA + 6%	0,80	0,74	0,58	0,71	0,89	1,75	0,84	0,44	0,92	0,96	0,25	--	9,25
p.p. Indx	2,07	-0,40	0,16	-0,72	-4,34	-2,63	1,55	-1,18	-0,95	5,43	1,13	--	-0,20

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	20	57,1%					
Meses abaixo do Benchmark	15	42,9%					
	Rentab.	Mês					
Maior rentabilidade da Carteira	6,39%	out/18	03 meses	7,84	2,15	5,7	6,325
Menor rentabilidade da Carteira	-3,46%	mai/18	06 meses	8,64	5,28	3,4	6,115
			12 meses	10,34	10,24	0,1	5,038
			24 meses	25,32	20,10	5,2	6,538
			36 meses	47,55	34,19	13,4	6,181
			Desde o início	47,55	34,19	13,4	6,181

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
FI BANESTES PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B Var. do IMA-B TOTAL p.p.	1,19 0,29	11,09 -0,13	10,41 2,47	11,58 1,98	11,75 -0,39	17,50 -1,77	17,50 -1,77
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M 1 TP FIC FI Var. do IRF-M 1 p.p.	0,52 -0,02	6,19 -0,19	2,06 -0,02	3,67 -0,10	6,78 -0,20	11,01 -0,30	11,01 -0,30
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI Var. do IMA-B TOTAL p.p.	0,91 0,00	10,97 -0,25	7,87 -0,08	9,45 -0,15	11,87 -0,28	28,47 -0,63	55,47 -1,11
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA II FI Var. do IPCA + 6% p.p.	0,11 -0,15	8,10 -1,15	3,06 0,91	4,64 -0,64	8,85 -1,39	22,55 2,45	40,00 5,81
FI CAIXA BRASIL 2024 I TP RF Var. do IMA-B TOTAL p.p.	0,12 -0,79	4,12 -7,10	5,98 -1,96	4,71 -4,89	4,75 -7,40	13,83 -15,27	30,27 -26,31
FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RF LP Var. do IMA-B TOTAL p.p.	0,90 -0,01	11,03 -0,20	7,93 -0,02	9,50 -0,10	11,92 -0,22	28,55 -0,55	55,65 -0,93
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP RF LP Var. do IMA-B 5+ p.p.	1,49 -0,04	12,02 -0,21	12,02 -0,21	12,02 -0,21	12,02 -0,21	12,02 -0,21	12,02 -0,21
FI BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA Var. do IMA-B TOTAL p.p.	1,00 0,09	8,92 -2,30	8,93 0,98	9,35 -0,25	9,69 -2,46	26,87 -2,23	54,62 -1,96

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
BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC FI % do CDI	0,49 98,98	5,84 98,96	1,52 100,41	3,13 98,54	6,46 99,75	17,83 100,46	32,68 99,80
CAIXA FIC PRATICO RENDA FIXA CURTO PRAZO % do CDI	0,05 19,08	0,05 19,08	0,05 19,08	0,05 19,08	0,05 19,08	0,05 19,08	0,05 19,08
FI CAIXA ALIANÇA TP RF % do CDI	0,47 95,20	5,61 95,11	1,49 98,81	3,11 97,98	6,16 95,23	17,31 97,56	32,28 98,58
BANESTES ESTRATÉGIA FIC FI RF % do CDI	0,73 148,32	5,59 249,74	5,02 332,18	5,59 249,74	5,59 249,74	5,59 249,74	5,59 249,74
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA Var. do IBOVESPA p.p.	2,33 -0,05	16,56 -0,59	16,40 -0,33	16,21 -0,40	23,82 -0,54	42,76 -1,82	102,70 -3,77
FIA CAIXA DIVIDENDOS Var. do IBOVESPA p.p.	5,44 3,06	20,90 -3,19	17,83 1,10	20,90 -3,19	20,90 -3,19	20,90 -3,19	20,90 -3,19
FIC FIA CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. do IBOVESPA p.p.	5,49 3,11	7,28 -9,87	16,96 0,23	13,08 -3,53	12,89 -11,47	27,75 -16,83	44,32 -62,15
BANESTES FIC FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INST Var. do IBOVESPA p.p.	3,42 1,04	17,44 0,29	19,35 2,63	18,53 1,92	23,22 -1,14	15,71 -1,97	15,71 -1,97
CAIXA RIO BRAVO FII Var. do IPCA p.p.	4,41 4,62	2,48 -1,11	9,72 9,00	2,19 -0,04	4,66 0,62	23,80 16,84	67,87 54,52
IPCA + 5,5%	0,21	8,78	2,03	5,03	9,72	18,98	34,26
CDI	0,49	5,90	1,51	3,17	6,47	17,75	34,28
IMA-B 5	0,14	8,39	4,16	5,90	9,35	23,72	43,90
IMA-B 5+	1,52	13,28	11,19	12,86	14,17	32,46	69,25
IMA-B TOTAL	0,90	11,22	7,95	9,60	12,15	29,10	58,96
IMA-GERAL TOTAL	0,76	8,76	4,92	6,30	9,72	25,01	49,97

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
<i>IRF-M 1</i>	0,54	6,38	2,08	3,77	6,98	19,62	37,21
<i>IRF-M 1+</i>	1,17	10,15	7,59	7,76	11,75	31,23	66,87
<i>IRF-M TOTAL</i>	0,99	9,06	5,97	6,58	10,42	27,95	55,87
<i>IBOVESPA</i>	2,38	17,15	16,73	16,61	24,36	44,58	98,37
<i>IFIX</i>	2,59	3,35	7,53	3,90	3,95	25,23	58,43
<i>SMALL CAP</i>	4,79	5,91	15,67	12,13	13,35	57,33	97,41
<i>INPC + 6%</i>	0,21	8,93	1,88	5,18	9,72	18,54	34,90
<i>IPCA + 6%</i>	0,25	9,25	2,15	5,28	10,24	20,10	36,17