

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos											
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	VAR	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (29/06/2018)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
Renda Fixa											
Artigo 7º I, Alínea a - Títulos do Tesouro Nacional											
TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535	0,00%	0,00	-0,80%	-0,48%	-0,04%	84.994.279,60	21,34%	--	--
TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824	0,00%	0,00	0,01%	0,33%	2,11%	8.703.233,75	2,18%	--	--
TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850	0,00%	0,00	-1,53%	-2,79%	-1,66%	8.934.511,55	2,24%	--	--
TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545	0,00%	0,00	-1,34%	-2,60%	-1,20%	6.803.607,50	1,71%	--	--
TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523	0,00%	0,00	0,36%	0,68%	1,96%	18.712.885,92	4,70%	--	--
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a - Títulos do Tesouro Nacional				0,00				128.148.518,32	32,17%		
Artigo 7º I, Alínea b - 4604 - Fundos 100% Títulos Públicos - Referenciado											
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL IPCA FI	4,32%	0,48	0,27%	-1,48%	1,78%	13.978.486,58	3,51%	290.475.645,84	4,81%
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	0,37%	0,08	1,39%	-0,36%	5,38%	9.521.873,17	2,39%	1.081.379.482,31	0,88%
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII	1,78%	0,22	0,58%	0,90%	3,59%	25.987.990,23	6,52%	1.136.332.229,99	2,29%
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF ALOCACAO ATIVA FCFI	2,47%	0,29	0,19%	0,09%	0,45%	5.022.299,15	1,26%	2.829.191.536,13	0,18%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS RF ..	4,13%	0,44	1,38%	-0,38%	5,29%	4.053.603,00	1,02%	1.354.827.398,95	0,30%
CEF	CEF	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 II TP RF..	6,29%	0,66	-0,97%	-0,65%	0,08%	13.104.176,40	3,29%	52.435.598,91	24,99%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	5,91%	0,63	-0,01%	0,31%	1,99%	16.631.329,00	4,17%	180.594.182,46	9,21%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - 4604 - Fundos 100% Títulos Públicos - Referenciado				0,40				88.299.757,53	22,16%		
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Renda Fixa											
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,09%	0,04	0,39%	98,97%	0,39%	37.770.683,36	9,48%	5.005.435.641,69	0,75%
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	1,82%	0,23	0,59%	-0,67%	3,87%	2.455.388,63	0,62%	1.494.479.068,39	0,16%
ITAU	ITAU	ITAU INST ALOCACAO DINAMICA II RF FICFI	1,82%	0,23	0,59%	-0,67%	3,89%	31.423.781,94	7,89%	1.674.150.820,35	1,88%
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Renda Fixa				0,13				71.649.853,93	17,99%		
Artigo 7º VII, Alínea b - 4604 - Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"											
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	2,77%	0,33	0,12%	-1,63%	3,06%	3.184.294,87	0,80%	469.679.669,45	0,68%
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b - 4604 - Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"				0,33				3.184.294,87	0,80%		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos											
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	VAR	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (29/06/2018)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
Sub-total Renda Fixa				0,16				291.282.424,65	73,12%		
Renda Variável											
Artigo 8º II, Alínea a - 4604 - Fundos de Ações											
AZ QUEST	BNY MELLON	AZ QUEST ACOES FC FIA	18,40%	2,02	-4,35%	0,85%	4,71%	8.110.807,59	2,04%	472.313.252,19	1,72%
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES	14,54%	1,52	-4,67%	0,53%	-11,47%	4.910.368,25	1,23%	65.896.942,00	7,45%
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	16,53%	1,78	-4,59%	0,61%	-3,69%	26.849.364,55	6,74%	674.378.078,38	3,98%
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	15,71%	1,65	-5,52%	-0,32%	-11,70%	5.244.481,23	1,32%	94.547.946,57	5,55%
AZ QUEST	BNY MELLON	AZ QUEST SMALL MID CAPS FC FI DE ACOES	16,94%	1,88	-2,60%	2,60%	3,61%	11.534.407,74	2,90%	599.564.848,43	1,92%
WESTERN	LEGG MASON	WA ASSET VALUATION FIA	17,80%	1,89	-4,07%	1,13%	-4,94%	5.933.906,10	1,49%	137.554.482,26	4,31%
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FI DE AÇÕES	15,89%	1,71	-1,91%	3,29%	-2,72%	27.854.825,11	6,99%	572.372.369,78	4,87%
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALAOR DIVIDENDOS RPPS	16,22%	1,70	-5,34%	-1,01%	-8,40%	2.218.167,66	0,56%	387.954.203,90	0,57%
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a - 4604 - Fundos de Ações				1,78				92.656.328,23	23,26%		
Artigo 8º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Participações											
KINEA	KINEA	FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II..	0,00%	0,00	-0,17%	-31,91%	4,47%	14.033.220,08	3,52%	1,78	787.093.939,33%
KINEA	LIONS TRUST	KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGIA	0,00%	0,00	-28,31%	-30,06%	-28,22%	402.950,69	0,10%	6.427.063,53	6,27%
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Participações				0,00				14.436.170,77	3,62%		
Sub-total Renda Variável				1,54				107.092.499,00	26,88%		
Total								398.374.923,65	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 a	Títulos do Tesouro Nacional	128.148.518,32	32,17%	42,00%	100,00%
Artigo 7º I, Alínea b - 4604	Fundos 100% Títulos Públicos - Referenciado	88.299.757,53	22,16%	18,00%	100,00%
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604	Fundos de Renda Fixa	71.649.853,93	17,99%	15,00%	40,00%
Artigo 7º VII, Alínea b - 4604	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	3.184.294,87	0,80%	1,00%	5,00%
Total Renda Fixa		291.282.424,65	73,12%		
Renda Variável					
Artigo 8º II, Alínea a - 4604	Fundos de Ações	92.656.328,23	23,26%	18,00%	20,00%
Artigo 8º IV, Alínea a - 4604	Fundos de Participações	14.436.170,77	3,62%	4,00%	5,00%
Total Renda Variável		107.092.499,00	26,88%		

Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)				
Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	-0,65 -126,5	0,21 6,7	7,14 96,9	-- --
Artigo 7º I, Alínea b - 4604 % do CDI	0,01 2,5	2,23 70,3	8,77 119,1	-- --
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 % do CDI	0,55 106,6	3,57 112,5	-- --	-- --
Artigo 7º VII, Alínea b - 4604 % do CDI	0,12 23,2	3,06 96,4	-- --	-- --
Artigo 8º II, Alínea a - 4604 Var. IBOVESPA p.p	-3,57 1,6	-2,95 1,8	-- --	-- --
Artigo 8º IV, Alínea a - 4604 Var. IBOVESPA p.p	-3,70 1,5	2.178,21 2.183,0	5.108,00 5.092,3	-- --

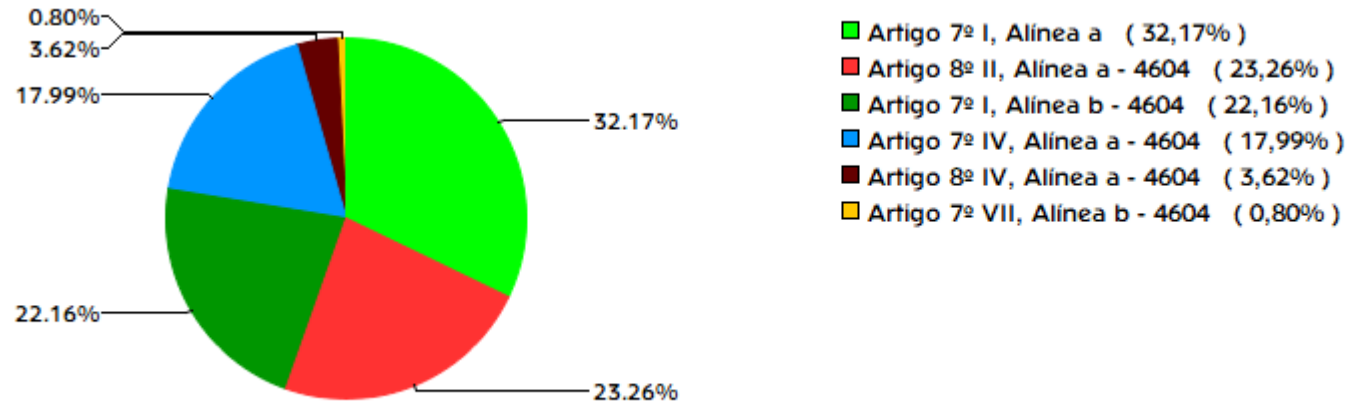
Ganhos Financeiros	
Estratégia	No Mês(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a	-844.661,19
Artigo 7º I, Alínea b - 4604	-291.044,00
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604	318.605,03
Artigo 7º VII, Alínea b - 4604	3.823,61
Artigo 8º II, Alínea a - 4604	-3.432.258,35
Artigo 8º IV, Alínea a - 4604	-160.667,95
Total	-4.406.202,85

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

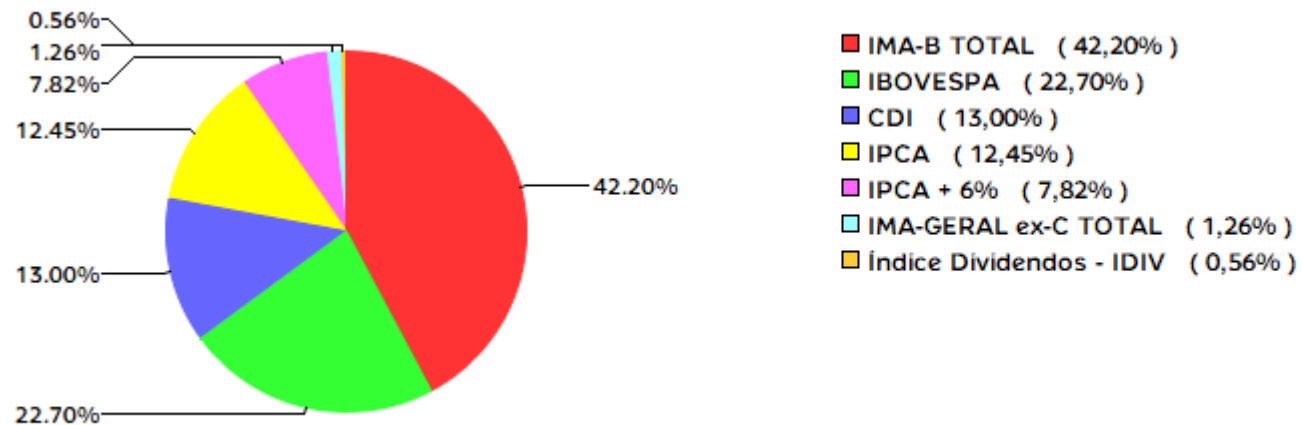
Análise da Disponibilidade Financeira				
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acum. Bruto (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	220.738.055,35	55	220.738.055,35	55
acima de 365 dias	177.636.868,30	45	398.374.923,65	100

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia

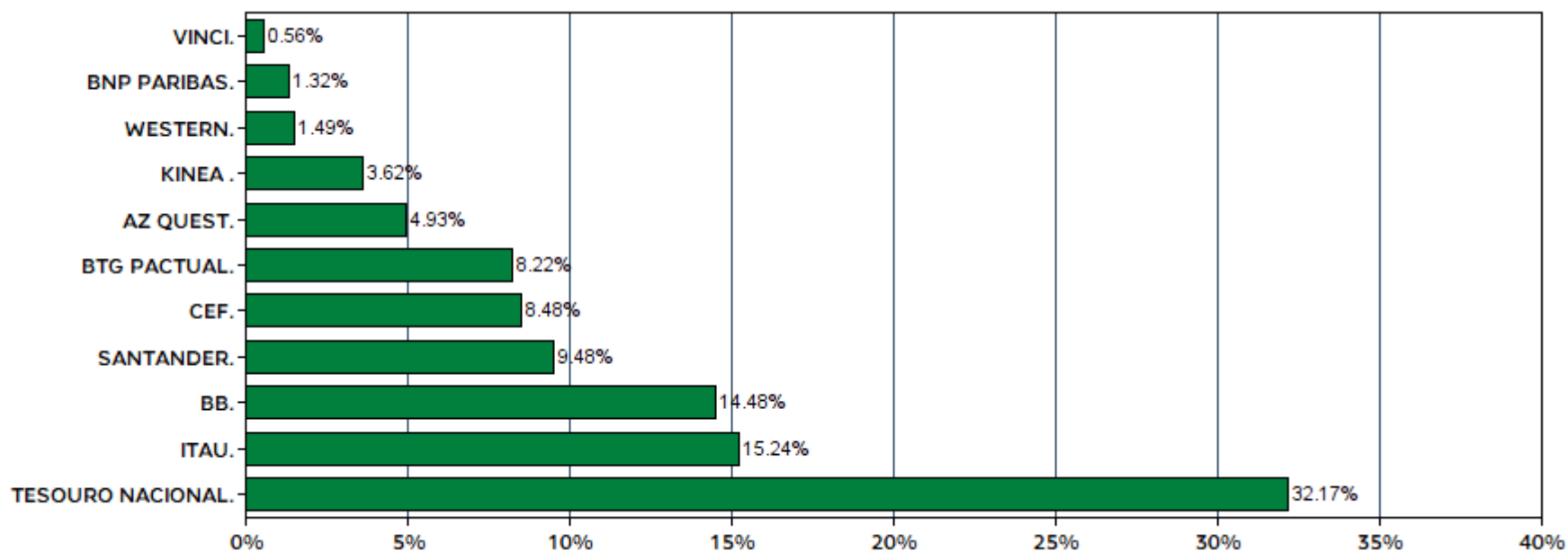


Indexadores



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

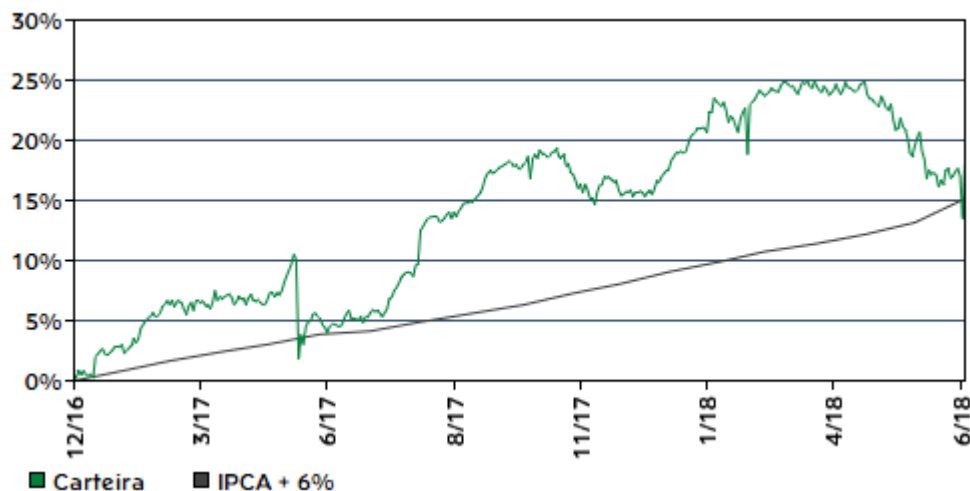
Alocação por Gestor



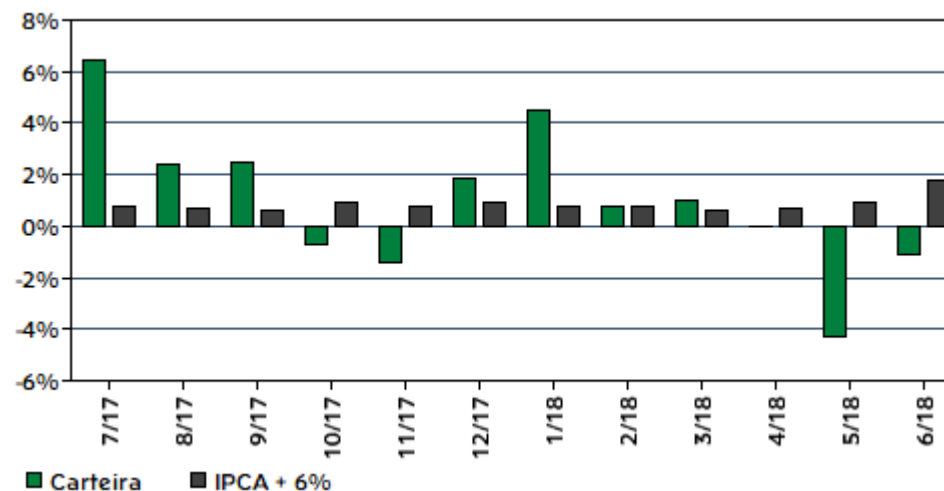
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira													
Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
2017	2,46	3,79	0,60	-0,18	-1,48	0,41	6,44	2,39	2,45	-0,71	-1,44	1,85	17,56
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	1,57	3,04	-0,19	-0,74	-2,30	0,16	5,71	1,67	1,83	-1,62	-2,18	0,95	8,52
2018	4,47	0,74	0,98	-0,04	-4,30	-1,07	-	-	-	-	-	-	0,57
IPCA + 6%	0,80	0,74	0,58	0,71	0,89	1,75	-	-	-	-	-	-	5,59
p.p. Indx	3,67	-0,00	0,40	-0,75	-5,19	-2,82	-	-	-	-	-	-	-5,01

Evolução da Rentabilidade



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco / Retorno da Carteira

	Qtd.	Perct.
Meses acima do Benchmark	9	50,0%
Meses abaixo do Benchmark	9	50,0%

	Rentab.	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	6,44%	jul/17
Menor rentabilidade da Carteira	-4,30%	mai/18

Período	Rentabilidade (%)			Volat. Anual
	Carteira	IPCA + 6%	p.p. Indx.	
03 meses	-5,36	3,38	-8,7	12,889
06 meses	0,57	5,59	-5,0	12,141
12 meses	11,93	10,58	1,3	9,790
24 meses	--	--	--	--
36 meses	--	--	--	--
Desde o início	18,24	15,14	3,1	10,891

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
NTN-B 150523 % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,36 0,68	1,96 0,80	-2,78 0,82	1,96 0,80	9,61 1,41	24,38 1,77	45,56 2,43
NTN-B 150535 % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,80 -0,48	-0,04 -1,19	-5,57 -1,96	-0,04 -1,19	6,74 -1,45	22,28 -0,33	43,58 0,46
NTN-B 150545 % do Var. IPCA p.p.	-1,34 -2,60	-1,20 -3,80	-7,04 -8,93	-1,20 -3,80	6,14 1,75	22,39 14,86	42,18 25,15
NTN-B 150824 % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,01 0,33	2,11 0,95	-3,56 0,05	2,11 0,95	9,12 0,93	23,90 1,28	45,39 2,27
NTN-B 150850 % do Var. IPCA p.p.	-1,53 -2,79	-1,66 -4,27	-7,65 -9,54	-1,66 -4,27	4,96 0,57	21,19 13,67	41,44 24,41
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,58 0,90	3,59 2,43	0,64 4,25	3,59 2,43	9,79 1,59	22,95 0,34	42,64 -0,49
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FCFI % do Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,19 0,09	2,55 0,26	-0,93 0,13	2,55 0,26	8,41 0,15	-- --	-- --
BB PREVIDENCIÁRIO RF TIT PUBL IPCA FI % do Var. IPCA + 6% p.p.	0,27 -1,48	1,78 -3,80	-2,90 -6,28	1,78 -3,80	9,31 -1,26	23,82 3,12	44,61 5,36

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 TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI % do Var. IPCA + 6% p.p.	1,39 -0,36	5,38 -0,21	2,81 -0,57	5,38 -0,21	10,06 -0,52	21,04 0,34	40,51 1,25
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF.. % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,01 0,31	1,99 0,83	-3,61 -0,00	1,99 0,83	8,87 0,67	20,01 -2,60	-- --
CAIXA FI BRASIL IRF M 1+ TP RF LP % do Var. IRF-M 1+ p.p.	-0,15 -0,00	2,00 -0,07	-2,56 -0,23	2,00 -0,07	8,88 -0,40	28,46 -0,64	51,26 -0,64
FI CAIXA BRASIL 2018 I TÍTULOS PÚBLICOS RF .. % do Var. IPCA + 6% p.p.	1,38 -0,38	5,29 -0,30	2,76 -0,62	5,29 -0,30	9,83 -0,75	17,03 -3,66	27,99 -11,26
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 II TP RF.. % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,97 -0,65	0,08 -1,08	-5,17 -1,56	0,08 -1,08	6,68 -1,51	17,27 -5,34	29,81 -13,32
SANTANDER FI IRF-M TÍTULOS PUBLICOS RF % do Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,02 -0,07	2,17 -0,19	-1,53 -0,17	2,17 -0,19	8,50 -0,45	28,59 1,38	51,50 3,33
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,36 -0,04	1,01 -0,14	-3,69 -0,08	1,01 -0,14	7,92 -0,27	22,11 -0,50	42,37 -0,76
ITAU INST ALOCACAO DINAMICA II RF FICFI % do Var. IPCA p.p.	0,59 -0,67	3,89 1,28	0,57 -1,32	3,89 1,28	10,45 6,06	-- --	-- --
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI % do Var. IPCA p.p.	0,59 -0,67	3,87 1,26	0,56 -1,33	3,87 1,26	10,43 6,04	26,03 18,51	49,16 32,13
SANTANDER FIC CORPORATE REFERENCIADO DI % do % do CDI	0,51 98,50	3,13 98,59	1,53 97,86	3,13 98,59	7,36 99,92	21,34 100,76	38,50 100,63
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI % do % do CDI	0,51 98,59	3,12 98,35	1,52 97,53	3,12 98,35	7,36 99,91	21,49 101,46	38,80 101,41
BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI % do Var. IPCA + 6% p.p.	0,12 -1,63	3,06 -2,53	-0,70 -4,09	3,06 -2,53	10,63 0,05	27,31 6,61	48,67 9,41
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES % do Var. IBOVESPA p.p.	-5,52 -0,32	-11,70 -6,93	-12,60 2,17	-11,70 -6,93	4,64 -11,04	48,14 6,92	55,36 18,28
AZ QUEST ACOES FC FIA % do Var. IBOVESPA p.p.	-4,35 0,85	4,71 9,47	-10,92 3,85	4,71 9,47	29,59 13,91	53,50 12,28	45,42 8,34
AZ QUEST SMALL MID CAPS FC FI DE ACOES % do Var. IBOVESPA p.p.	-2,60 2,60	3,61 8,37	-9,25 5,52	3,61 8,37	32,89 17,21	59,18 17,97	74,11 37,03

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
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FI DE AÇÕES % do Var. IBOVESPA p.p.	-1,91 3,29	-2,72 2,05	-11,64 3,12	-2,72 2,05	13,89 -1,79	24,60 -16,62	31,82 -5,26
BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES % do Var. IBOVESPA p.p.	-4,67 0,53	-11,47 -6,71	-16,89 -2,13	-11,47 -6,71	1,03 -14,65	6,97 -34,25	13,52 -23,56
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALAOR DIVIDENDOS RPPS .. % do Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-5,34 -1,01	-8,40 -1,53	-15,87 -0,26	-8,40 -1,53	4,95 -3,90	15,74 -33,04	19,20 -23,59
ITAU FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES % do Var. IBOVESPA p.p.	-4,59 0,61	-3,69 1,07	-13,06 1,71	-3,69 1,07	14,43 -1,25	35,28 -5,93	38,80 1,72
WA ASSET VALUATION FIA % do Var. IBOVESPA p.p.	-4,07 1,13	-4,94 -0,17	-12,60 2,16	-4,94 -0,17	9,37 -6,31	40,46 -0,75	42,90 5,82
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II.. % do % do CDI	-0,17 -31,91	4,47 140,70	-0,34 -21,67	4,47 140,70	138,81 1.884,04	115,97 547,44	95,29 249,07
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP MULTIESTRATÉGIA % do Var. IPCA + 6% p.p.	-28,31 -30,06	-28,22 -31,04	-- --	-- --	-- --	-- --	-- --
CDI	0,52	3,18	1,56	3,18	7,37	21,18	38,26
IBOVESPA	-5,20	-4,76	-14,76	-4,76	15,68	41,22	37,08
DOLAR COMERCIAL	3,18	16,56	16,01	16,56	16,55	20,13	24,28
INPC + 6%	1,92	5,55	3,58	5,55	9,66	19,19	38,33
IPCA + 6%	1,75	5,59	3,38	5,59	10,58	20,70	39,26