

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos											
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	VAR	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (28/09/2018)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
Renda Fixa											
Artigo 7º I, Alínea b - 4604 - Fundos 100% Títulos Públicos - Referenciado											
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF IMA-B TP	4,86%	0,51	-0,16%	-0,01%	2,71%	2.667.564,78	11,95%	3.646.686.495,81	0,07%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP FI RF LP	2,90%	0,32	0,86%	-0,03%	4,79%	12.158.704,52	54,48%	8.106.459.151,64	0,15%
BB	BB	BB IDKA 2 TP FI RF PREV	2,27%	0,26	1,17%	-0,19%	5,58%	1.935.706,59	8,67%	6.551.962.373,55	0,03%
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI	2,52%	0,28	0,58%	-0,03%	3,92%	4.243.163,53	19,01%	395.656.176,90	1,07%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - 4604 - Fundos 100% Títulos Públicos - Referenciado				0,33				21.005.139,42	94,12%		
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Renda Fixa											
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF FLUXO FC FI	0,03%	0,02	0,39%	82,81%	3,97%	1.311.973,46	5,88%	1.316.299.879,59	0,10%
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Renda Fixa				0,02				1.311.973,46	5,88%		
Sub-total Renda Fixa				0,32				22.317.112,88	100,00%		
Total								22.317.112,88	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	21.005.139,42	94,12%	87,00%	100,00%
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604	Fundos de Renda Fixa	1.311.973,46	5,88%	5,00%	40,00%
Total Renda Fixa		22.317.112,88	100,00%		

Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)

Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
Artigo 7º I, Alínea b - 4604 % do CDI	0,70 149,2	4,41 91,8	-- --	-- --
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 % do CDI	0,39 82,8	3,97 82,5	-- --	-- --

Ganhos Financeiros

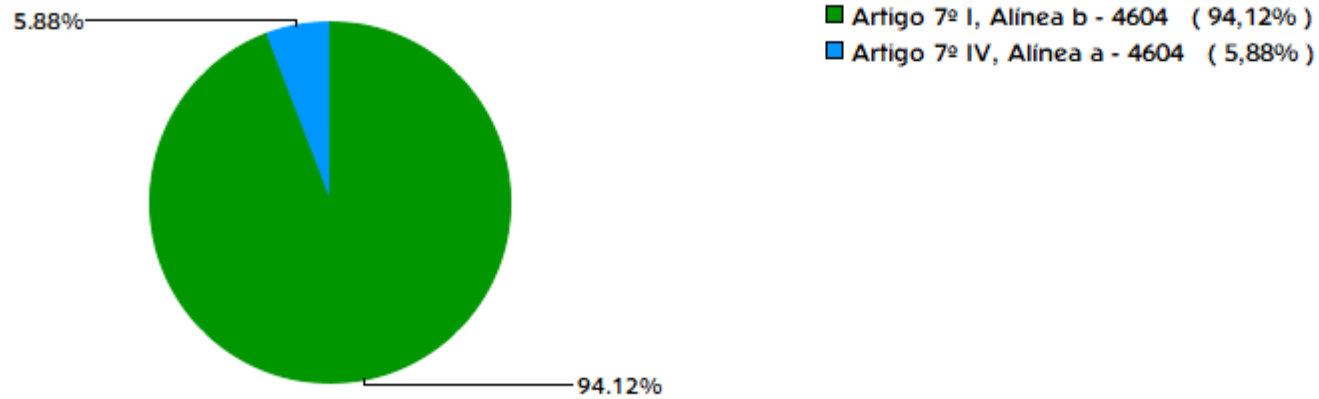
Estratégia	No Mês(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b - 4604	144.804,76
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604	4.878,51
Total	149.683,27

Análise da Disponibilidade Financeira

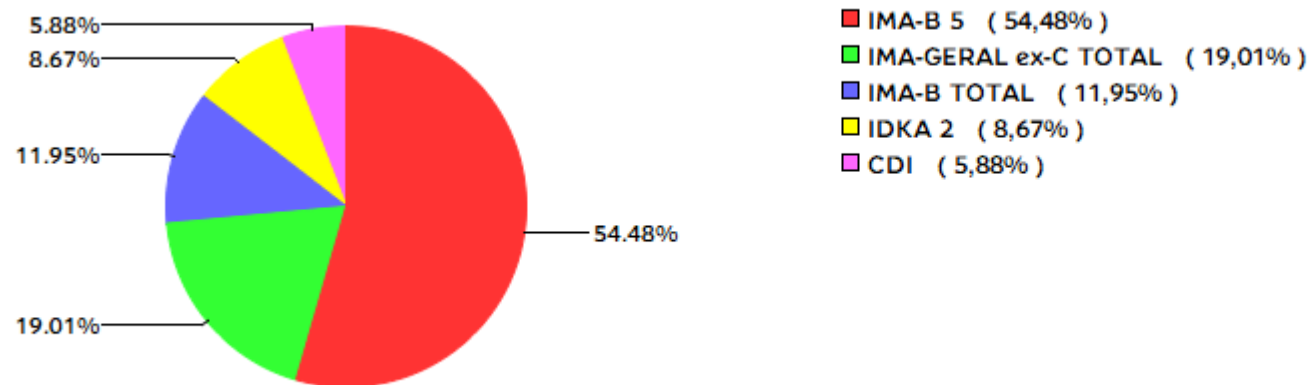
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acum. Bruto (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	22.317.112,88	100	22.317.112,88	100

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia

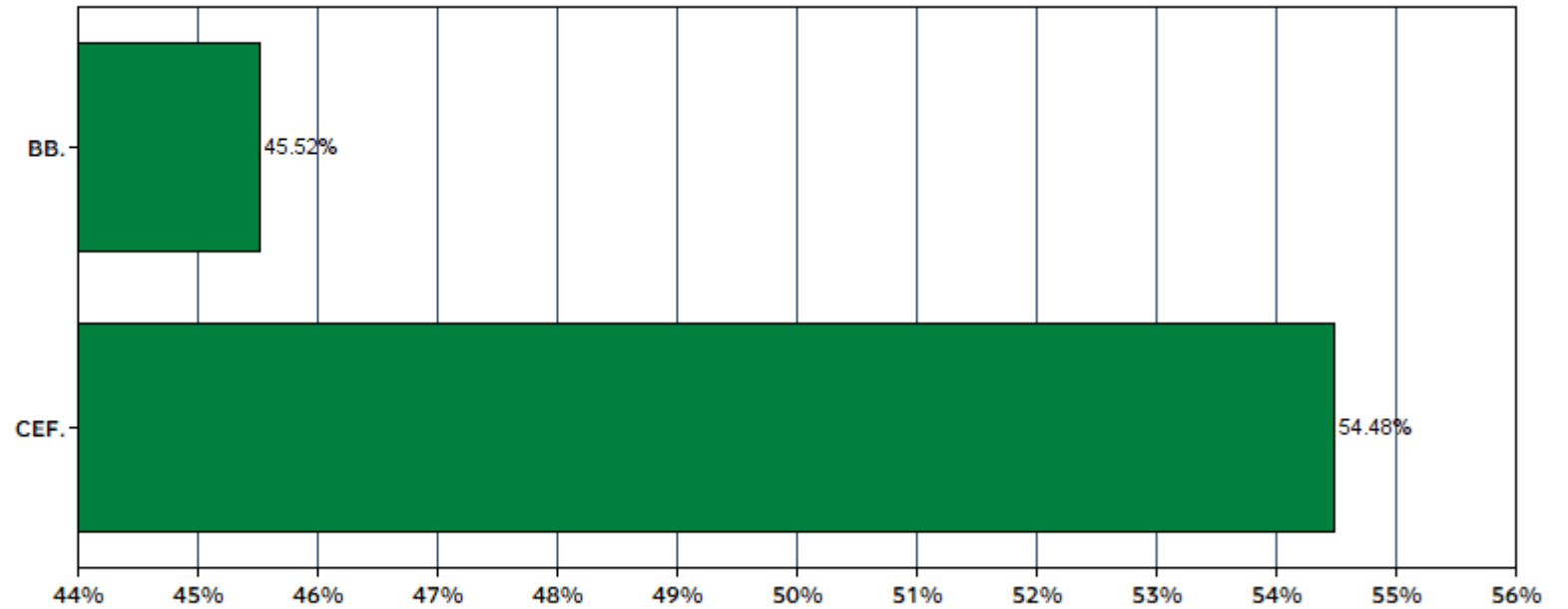


Indexadores



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor

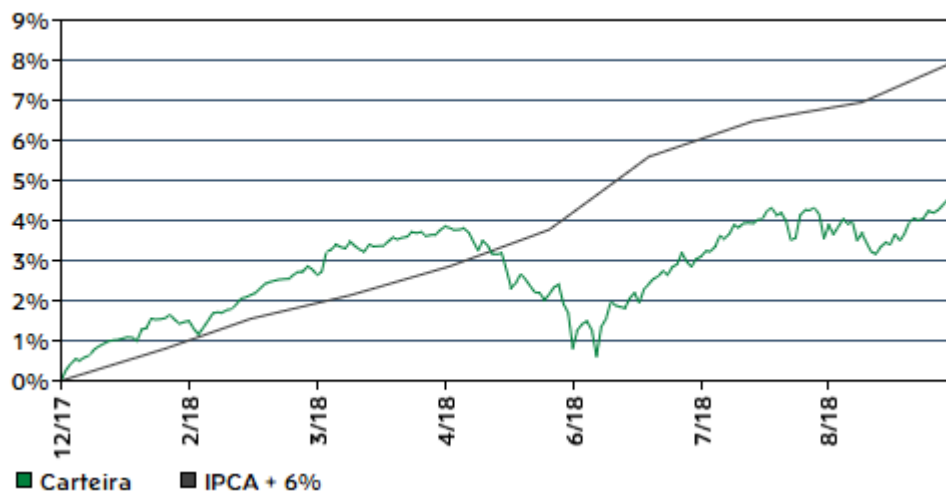


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

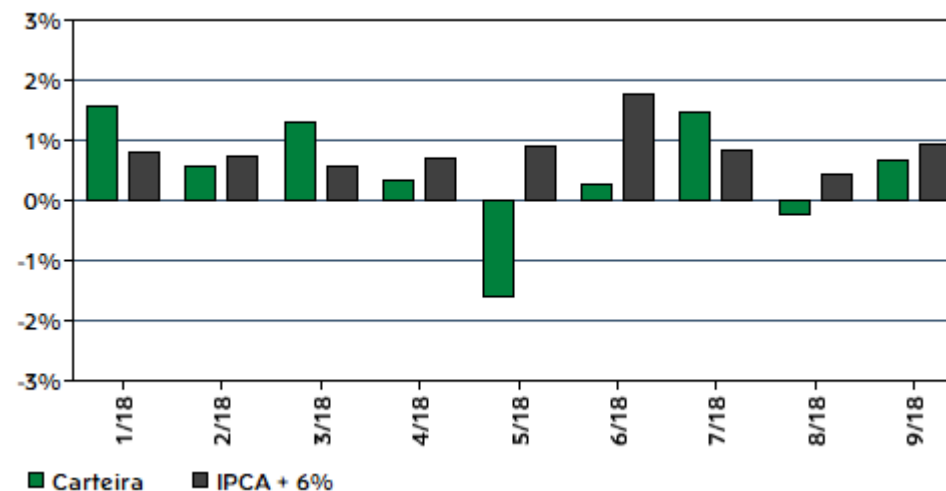
Rentabilidades da Carteira

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
2018	1,57	0,56	1,30	0,33	-1,60	0,25	1,48	-0,24	0,68	--	--	--	4,38
IPCA + 6%	0,80	0,74	0,58	0,71	0,89	1,75	0,84	0,44	0,92	--	--	--	7,93
p.p. Indx	0,76	-0,17	0,73	-0,38	-2,49	-1,50	0,64	-0,69	-0,24	--	--	--	-3,55

Evolução da Rentabilidade



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco / Retorno da Carteira

	Qtd.	Perct.
Meses acima do Benchmark	3	33,3%
Meses abaixo do Benchmark	6	66,7%

	Rentab.	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	1,57%	jan/18
Menor rentabilidade da Carteira	-1,60%	mai/18

Período	Rentabilidade (%)			Volat. Anual
	Carteira	IPCA + 6%	p.p. Indx.	
03 meses	1,92	2,22	-0,3	3,007
06 meses	0,88	5,68	-4,8	3,445
12 meses	--	--	--	--
24 meses	--	--	--	--
36 meses	--	--	--	--
Desde o início	4,38	7,93	-3,6	3,013

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 Var. IDKA 2 p.p.	1,17 -0,19	5,58 -0,56	2,34 -0,73	2,47 -0,57	7,60 -0,91	21,30 -2,04	43,44 -2,64
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI % do Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,58 -0,03	3,92 -0,18	1,69 -0,08	0,55 -0,15	4,91 -0,26	20,46 -0,59	46,34 -1,02
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	-0,16 -0,01	2,71 -0,17	1,66 -0,05	-2,06 -0,09	2,32 -0,23	18,15 -0,57	51,21 -1,17
CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP FI RF LP % do Var. IMA-B 5 p.p.	0,86 -0,03	4,79 -0,20	2,05 -0,06	1,27 -0,13	6,28 -0,25	20,38 -0,48	42,56 -1,06
BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FC FI % do % do CDI	0,39 82,81	3,97 82,45	1,31 82,65	2,61 82,28	5,52 82,90	16,64 87,67	32,07 89,59
CDI	0,47	4,81	1,59	3,17	6,66	18,98	35,79
IBOVESPA	3,48	3,85	9,04	-7,06	6,80	35,94	76,09
DOLAR COMERCIAL	-3,18	21,04	3,84	20,46	26,39	23,34	0,78

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
INPC + 6%	0,74	7,72	2,05	5,70	10,14	18,59	37,21
IPCA + 6%	0,92	7,93	2,22	5,68	10,72	20,29	38,31