

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos											
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	VAR	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (31/01/2019)	% 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 IRF-M TP	3,39%	0,39	1,37%	-0,02%	1,37%	31.254.236,61	4,91%	5.222.909.560,37	0,60%
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,55%	0,08	0,58%	-0,00%	0,58%	6.941.188,33	1,09%	11.421.020.245,51	0,06%
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF IMA-B TP	5,45%	0,62	4,36%	-0,01%	4,36%	26.734.626,45	4,20%	4.159.431.811,57	0,64%
BRADESCO	BRADESCO	BRADESCO FI RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS	5,48%	0,62	4,33%	-0,03%	4,33%	63.791.344,97	10,02%	620.617.655,00	10,28%
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,56%	0,08	0,56%	-0,02%	0,56%	10.706.005,97	1,68%	304.814.435,92	3,51%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IRFM 1 TP FI RF	0,55%	0,08	0,57%	-0,01%	0,57%	107.951.972,50	16,95%	17.170.876.640,61	0,63%
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF ALOCACAO ATIVA FICFI	2,76%	0,33	2,01%	0,10%	2,01%	67.947.201,29	10,67%	4.940.753.535,49	1,38%
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	4,55%	0,57	1,81%	0,98%	1,81%	14.797.885,44	2,32%	498.132.848,72	2,97%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	2,99%	0,34	0,82%	-0,01%	0,82%	13.745.720,00	2,16%	79.824.548,70	17,22%
BRADESCO	BRADESCO	BRADESCO FI RF IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS	0,55%	0,08	0,56%	-0,02%	0,56%	6.059.889,56	0,95%	1.541.434.392,74	0,39%
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2 FI	2,36%	0,28	1,22%	-0,05%	1,22%	56.811.490,56	8,92%	6.832.498.254,71	0,83%
BB	BB	BB RPPS RF IMA B5+ FI	7,88%	0,88	6,58%	-0,03%	6,58%	33.014.116,91	5,18%	1.326.189.159,94	2,49%
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,06%	0,35	1,52%	-0,02%	1,52%	10.424.773,33	1,64%	1.308.500.779,85	0,80%
BB	BB	BB IMA-B 5 FIC RF PREVIDENCIÁRIO LP	3,05%	0,35	1,52%	-0,02%	1,52%	58.650.275,99	9,21%	3.212.136.258,09	1,83%
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII	2,09%	0,25	1,34%	-3,02%	1,34%	5.393.639,78	0,85%	669.215.885,08	0,81%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - 4604 - Fundos 100% Títulos Públicos - Referenciado				0,36				514.224.367,69	80,74%		
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Renda Fixa											
BB	BB	BB RPPS RF PERFIL FIC	0,04%	0,03	0,53%	97,64%	0,53%	51.943.286,14	8,16%	4.246.690.677,69	1,22%
ITAU	ITAU	ITAU INST ALOCACAO DINAMICA II FIC RF	1,50%	0,19	2,37%	2,05%	2,37%	24.050.196,77	3,78%	2.728.209.369,22	0,88%
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Renda Fixa				0,08				75.993.482,91	11,93%		
Artigo 7º VII, Alínea a - 4604 - Cota Sênior de FIDC											
BRPP	BRPP	FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER III ..	-0%	-	-9,08%	-1.672,53%	-9,08%	5.459,48	0,00%	0,01	58.116.670,22%
VOTORANTIM	VOTORANTIM	FIDC SANASA-SEN..	4,40%	0,45	0,45%	83,55%	0,45%	5.361.598,28	0,84%	1,17	458.690.819,87%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos											
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	VAR	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (31/01/2019)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
VILA RICA	BRL DTVM	FIDC ITALIA SENIOR	0,00%	0,00	60,06%	11.059,14%	60,06%	9.570,53	0,00%	0,07	14.456.817,07%
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a - 4604 - Cota Sênior de FIDC				0,45				5.376.628,29	0,84%		
Artigo 7º VII, Alínea b - 4604 - Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"											
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	3,02%	0,36	1,46%	0,63%	1,46%	1.993.782,89	0,31%	545.211.894,02	0,37%
ACRUX	ACRUX	URCA FI RF CRÉDITO PRIVADO PREVIDENCIÁRIO	0,00%	0,00	1,57%	289,27%	1,57%	264.135,74	0,04%	1,01	26.077.035,00%
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b - 4604 - Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"				0,31				2.257.918,63	0,35%		
Sub-total Renda Fixa				0,33				597.852.397,52	93,87%		
Renda Variável											
Artigo 8º II, Alínea a - 4604 - Fundos de Ações											
BBM	BBM	BAHIA AM VALUATION FC DE FIA	20,75%	2,24	8,71%	-2,10%	8,71%	11.624.147,38	1,83%	876.905.841,51	1,33%
NAVI	BEM	NAVI INSTITUCIONAL FIA	19,33%	2,13	12,37%	1,55%	12,37%	12.685.306,00	1,99%	752.807.374,13	1,69%
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a - 4604 - Fundos de Ações				2,18				24.309.453,38	3,82%		
Artigo 8º III - 4604 - Fundos Multimercados											
AZ QUEST	BNY MELLON	AZ QUEST EQUITY HEDGE FC FI MULTI	2,21%	0,26	0,50%	92,78%	0,50%	4.157.285,36	0,65%	260.466.192,36	1,60%
XP	BNY MELLON	XP MACRO INSTITUCIONAL FIC FIM	1,69%	0,20	1,93%	354,80%	1,93%	4.186.625,60	0,66%	94.333.831,19	4,44%
Sub-total Artigo 8º III - 4604 - Fundos Multimercados				0,23				8.343.910,96	1,31%		
Artigo 8º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Participações											
ROMA	RJI	FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES LSH	0,00%	0,00	-0,04%	-7,45%	-0,04%	3.975.634,30	0,62%	111.485.306,37	3,57%
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Participações				0,00				3.975.634,30	0,62%		
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604 - Fundos de Investimentos Imobiliários											
RB CAPITAL INVESTIMENTOS LTDA	VOTORANTIM	RBRD11	0,00%	0,00	0,49%	-10,33%	0,49%	2.421.454,42	0,38%	1,18	204.865.849,68%
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b - 4604 - Fundos de Investimentos Imobiliários				0,00				2.421.454,42	0,38%		
Sub-total Renda Variável				1,41				39.050.453,06	6,13%		
Total								636.902.850,58	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	514.224.367,69	80,74%	100,00%	100,00%
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604	Fundos de Renda Fixa	75.993.482,91	11,93%	40,00%	40,00%
Artigo 7º VII, Alínea a - 4604	Cota Sênior de FIDC	5.376.628,29	0,84%	5,00%	5,00%
Artigo 7º VII, Alínea b - 4604	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	2.257.918,63	0,35%	5,00%	5,00%
Total Renda Fixa		597.852.397,52	93,86%		
Renda Variável					
Artigo 8º II, Alínea a - 4604	Fundos de Ações	24.309.453,38	3,82%	15,00%	20,00%
Artigo 8º III - 4604	Fundos Multimercados	8.343.910,96	1,31%	10,00%	10,00%
Artigo 8º IV, Alínea a - 4604	Fundos de Participações	3.975.634,30	0,62%	5,00%	5,00%
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604	Fundos de Investimentos Imobiliários	2.421.454,42	0,38%	5,00%	5,00%
Total Renda Variável		39.050.453,06	6,13%		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)				
Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
Artigo 7º I, Alínea b - 4604 % do CDI	2,12 390,3	2,12 390,3	9,60 150,5	-- --
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 % do CDI	1,25 229,8	1,25 229,8	7,51 117,7	-- --
Artigo 7º VII, Alínea a - 4604 % do CDI	0,51 93,7	0,51 93,7	35,67 559,1	-- --
Artigo 7º VII, Alínea b - 4604 % do CDI	1,47 271,1	1,47 271,1	4,10 64,3	-- --
Artigo 8º II, Alínea a - 4604 Var. IBOVESPA p.p	10,59 -0,2	10,59 -0,2	-- --	-- --
Artigo 8º III - 4604 Var. IBOVESPA p.p	1,21 -9,6	1,21 -9,6	-- --	-- --
Artigo 8º IV, Alínea a - 4604 Var. IBOVESPA p.p	0,00 -10,8	0,00 -10,8	213,74 199,0	-- --
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604 Var. IBOVESPA p.p	0,00 -10,8	0,00 -10,8	1,47 -13,2	-- --

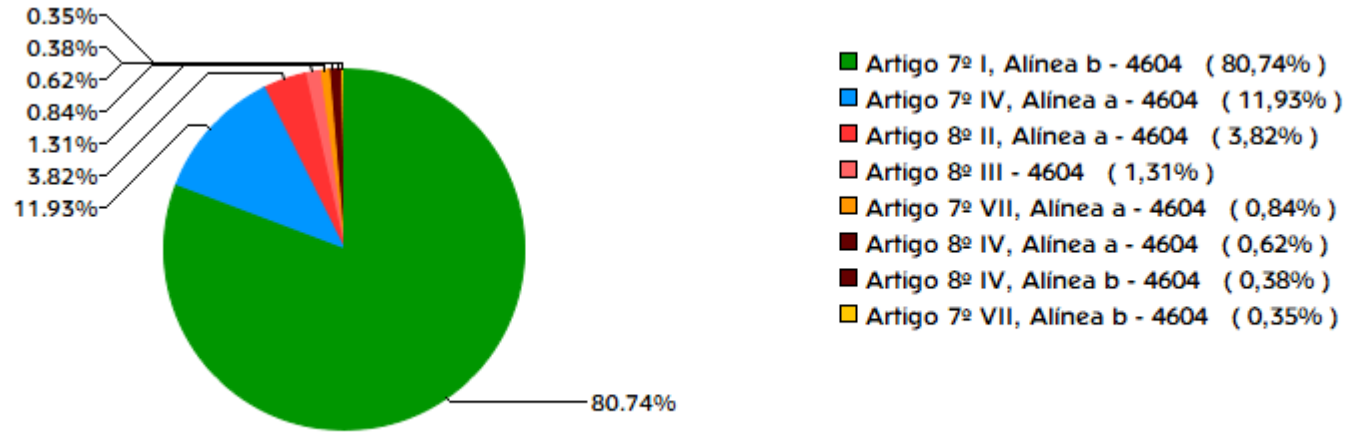
Ganhos Financeiros	
Estratégia	No Mês(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b - 4604	10.433.980,26
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604	765.667,49
Artigo 7º VII, Alínea a - 4604	27.408,21
Artigo 7º VII, Alínea b - 4604	32.759,74
Artigo 8º II, Alínea a - 4604	2.328.313,53
Artigo 8º III - 4604	99.980,58
Artigo 8º IV, Alínea a - 4604	-1.608,30
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604	11.818,55
Total	13.698.320,06

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

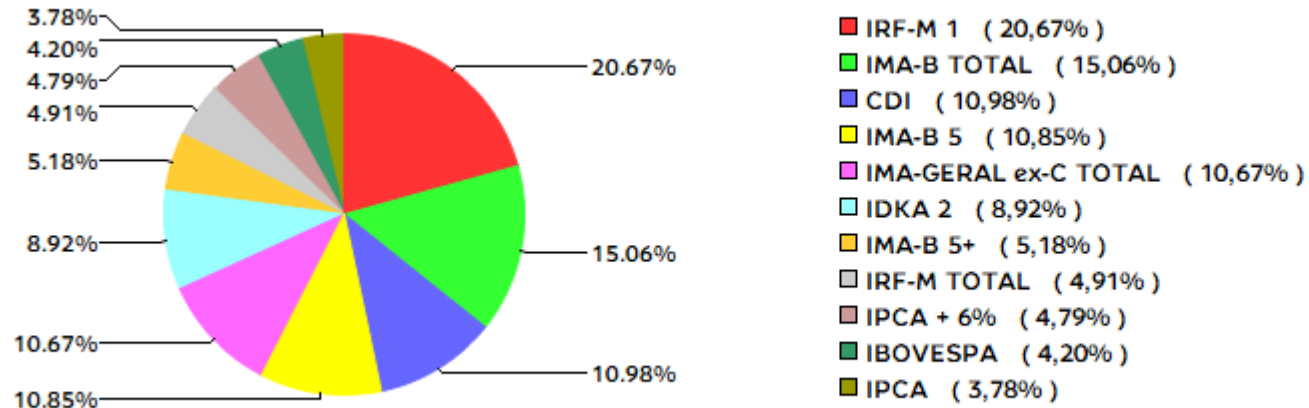
Análise da Disponibilidade Financeira				
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acum. Bruto (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	598.980.400,53	94	598.980.400,53	94
acima de 365 dias	37.922.450,05	6	636.902.850,58	100

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia

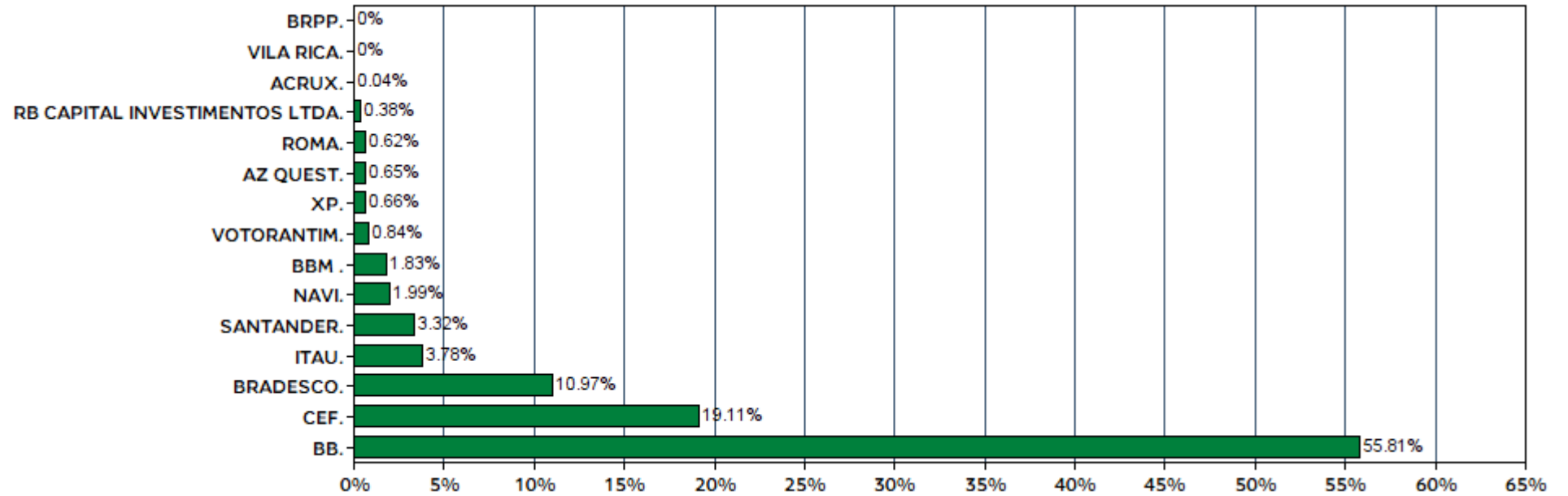


Indexadores



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

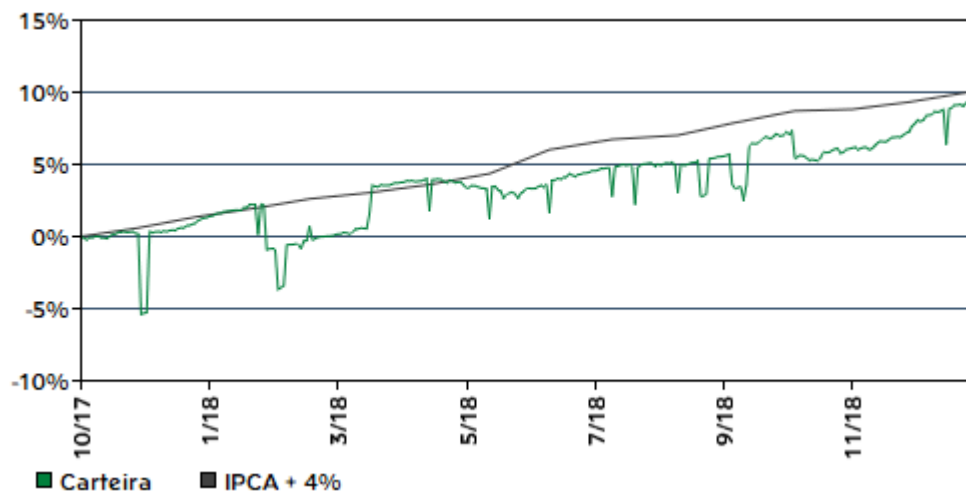
Alocação por Gestor



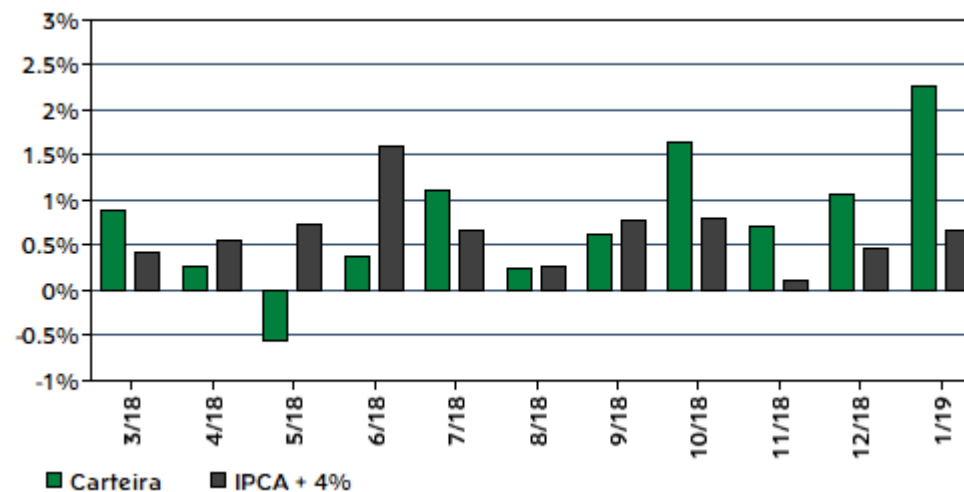
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira													
Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
2017	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	0,18	0,74	0,92
IPCA + 4%	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	0,59	0,75	1,35
p.p. Indx	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	-0,41	-0,02	-0,43
2018	-0,79	0,57	0,88	0,27	-0,56	0,38	1,10	0,24	0,62	1,65	0,70	1,07	6,28
IPCA + 4%	0,63	0,60	0,42	0,55	0,73	1,59	0,67	0,27	0,78	0,79	0,10	0,46	7,86
p.p. Indx	-1,42	-0,03	0,46	-0,27	-1,29	-1,21	0,43	-0,03	-0,16	0,86	0,60	0,61	-1,58
2019	2,26	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	2,26
IPCA + 4%	0,66	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	0,66
p.p. Indx	1,60	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	1,60

Evolução da Rentabilidade



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco / Retorno da Carteira

	Qtd.	Perct.
Meses acima do Benchmark	6	40,0%
Meses abaixo do Benchmark	9	60,0%

	Rentab.	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,26%	jan/19
Menor rentabilidade da Carteira	-0,79%	jan/18

Período	Rentabilidade (%)			Volat. Anual
	Carteira	IPCA + 4%	p.p. Indx.	
03 meses	4,08	1,23	2,8	7,610
06 meses	6,71	3,11	3,6	11,490
12 meses	9,55	7,89	1,7	11,581
24 meses	--	--	--	--
36 meses	--	--	--	--
Desde o início	9,68	10,04	-0,4	12,682

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 IMA-B 5 FIC RF PREVIDENCIÁRIO LP % do Var. IMA-B 5 p.p.	1,52 -0,02	1,52 -0,02	3,02 -0,05	6,83 -0,10	9,88 -0,21	23,73 -0,42	40,13 -0,71
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,34 -3,02	1,34 -3,02	2,69 -4,36	6,34 -7,67	9,98 -4,13	23,39 -7,27	40,30 -22,69
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,58 -0,00	0,58 -0,00	1,64 -0,05	3,60 -0,09	6,75 -0,22	17,55 -0,48	34,09 -0,84
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI % do Var. IPCA + 6% p.p.	1,81 0,98	1,81 0,98	3,64 1,94	7,90 3,81	18,55 8,60	29,35 9,56	45,42 11,61
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FICFI % do Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	2,01 0,10	2,01 0,10	3,98 0,06	7,84 -0,04	10,21 0,17	23,62 -0,50	-- --
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 FI % do Var. IDKA 2 p.p.	1,22 -0,05	1,22 -0,05	2,56 -0,15	5,85 -0,38	9,50 -0,80	22,93 -1,98	38,58 -1,63
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	4,36 -0,01	4,36 -0,01	7,01 -0,04	13,86 -0,15	13,82 -0,29	30,01 -0,64	61,91 -1,09
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M TP % do Var. IRF-M TOTAL p.p.	1,37 -0,02	1,37 -0,02	3,91 -0,05	7,96 -0,11	10,62 -0,21	25,86 -0,58	54,41 -0,81

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 RPPS RF IMA B5+ FI % do Var. IMA-B 5+ p.p.	6,58 -0,03	6,58 -0,03	10,26 -0,01	19,95 -0,18	16,96 -0,27	34,73 -0,96	77,98 -1,63
BRADESCO FI RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	4,33 -0,03	4,33 -0,03	6,96 -0,09	13,79 -0,21	13,71 -0,40	29,56 -1,10	61,28 -1,72
BRADESCO FI RF IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,56 -0,02	0,56 -0,02	1,63 -0,06	3,57 -0,13	6,70 -0,26	17,56 -0,48	34,11 -0,83
CAIXA FI BRASIL IRFM 1 TP FI RF % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,57 -0,01	0,57 -0,01	1,65 -0,04	3,62 -0,08	6,80 -0,16	17,67 -0,36	34,35 -0,59
FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF % do Var. IPCA + 6% p.p.	0,82 -0,01	0,82 -0,01	1,76 0,05	4,18 0,09	9,93 -0,02	13,31 -6,48	20,20 -13,61
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,56 -0,02	0,56 -0,02	1,71 0,02	3,68 -0,01	6,83 -0,13	17,83 -0,21	34,56 -0,38
SANTANDER FIC IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF % do Var. IMA-B 5 p.p.	1,52 -0,02	1,52 -0,02	3,02 -0,05	6,84 -0,09	9,87 -0,21	23,69 -0,46	40,06 -0,79
BB RPPS RF PERFIL FIC % do % do CDI	0,53 97,64	0,53 97,64	1,49 97,16	3,10 98,52	6,29 98,60	16,40 100,07	32,61 99,66
ITAU INST ALOCACAO DINAMICA II FIC RF % do Var. IPCA p.p.	2,37 2,05	2,37 2,05	4,69 4,43	6,05 4,95	9,18 5,40	22,45 15,71	-- --
FIDC ITALIA SENIOR % do % do CDI	60,06 11.059,14	60,06 11.059,14	50,21 3.264,44	-49,32 -1.566,51	-64,31 -1.007,93	-26,00 -158,66	-80,28 -245,33
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER III .. % do % do CDI	-9,08 -1.672,53	-9,08 -1.672,53	-31,21 -2.029,35	-44,91 -1.426,44	-31,92 -500,29	-7,95 -48,52	-42,20 -128,97
FIDC SANASA-SEN.. % do % do CDI	0,45 83,55	0,45 83,55	2,43 157,74	6,14 195,00	14,40 225,75	15,85 96,75	-- --
BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI % do Var. IPCA + 6% p.p.	1,46 0,63	1,46 0,63	2,92 1,21	6,44 2,34	11,08 1,13	27,60 7,80	51,08 17,27
URCA FI RF CRÉDITO PRIVADO PREVIDENCIÁRIO % do % do CDI	1,57 289,27	1,57 289,27	-33,02 -2.146,68	-34,20 -1.086,23	-29,00 -454,52	-19,70 -120,21	-10,58 -32,32
BAHIA AM VALUATION FC DE FIA % do Var. IBOVESPA p.p.	8,71 -2,10	8,71 -2,10	10,20 -1,20	20,32 -2,62	20,68 5,98	56,10 5,50	133,53 -7,52

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
NAVI INSTITUCIONAL FIA % do Var. IBOVESPA p.p.	12,37 1,55	12,37 1,55	17,60 6,20	27,34 4,40	33,32 18,62	75,13 24,52	203,31 62,26
AZ QUEST EQUITY HEDGE FC FI MULTI % do % do CDI	0,50 92,78	0,50 92,78	1,97 128,28	3,83 121,49	8,40 131,66	19,11 116,64	40,88 124,93
XP MACRO INSTITUCIONAL FIC FIM % do % do CDI	1,93 354,80	1,93 354,80	3,09 201,02	4,58 145,37	6,65 104,19	18,45 112,63	-- --
FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES LSH % do % do CDI	-0,04 -7,45	-0,04 -7,45	-0,13 -8,77	-0,27 -8,73	-16,45 -257,76	-- --	-- --
RBRD11 % do Var. IBOVESPA p.p.	0,49 -10,33	0,49 -10,33	7,40 -4,01	12,60 -10,34	21,31 6,61	-- --	-- --
CDI	0,54	0,54	1,54	3,15	6,38	16,38	32,72
IBOVESPA	10,82	10,82	11,40	22,94	14,70	50,60	141,04
DOLAR COMERCIAL	-5,75	-5,75	-1,77	-2,74	15,48	16,79	-9,67
INPC + 6%	0,87	0,87	1,70	3,94	9,73	18,41	32,37
IPCA + 6%	0,83	0,83	1,71	4,09	9,95	19,79	33,81