

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Posição de Ativos**

| Gestor  | CNPJ               | Ativos   | Vol*  | VAR  | Mês   | % Índice | Ano   | Valor(R\$)<br>(31/10/2018) | % Carteira     | PL do Fundo       | % no PL<br>do Fundo |
|---|--------------------|--|-------|------|-------|----------|-------|----------------------------|----------------|-------------------|---------------------|
| <b>Renda Fixa</b>   |                    |  |       |      |       |          |       |                            |                |                   |                     |
| <b>ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B" - FUNDOS 100% TÍTULOS PÚBLICOS</b>           |                    |  |       |      |       |          |       |                            |                |                   |                     |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM  | 11.328.882/0001-35 | BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO        | 0,55% | 0,08 | 0,93% | 0,02%    | 5,64% | 3.370.769,46               | 7,65%          | 12.885.880.277,28 | 0,03%               |
| CEF   | 10.740.670/0001-06 | CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA              | 0,55% | 0,08 | 0,94% | 0,02%    | 5,67% | 2.139.128,19               | 4,85%          | 19.282.041.339,97 | 0,01%               |
| BRADERCO ASSET MANAGEMENT   | 11.484.558/0001-06 | BRADERCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA                  | 0,57% | 0,09 | 0,90% | -0,02%   | 4,78% | 846.589,74                 | 1,92%          | 1.717.634.720,61  | 0,05%               |
| CEF   | 11.060.913/0001-10 | CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP           | 3,05% | 0,35 | 3,10% | -0,00%   | 8,03% | 12.161.849,39              | 27,58%         | 9.298.896.034,42  | 0,13%               |
| SANTANDER   | 14.504.578/0001-90 | SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP | 5,49% | 0,61 | 7,11% | -0,03%   | 9,96% | 1.785.629,47               | 4,05%          | 614.993.137,90    | 0,29%               |
| CEF   | 14.386.926/0001-71 | CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP      | 2,33% | 0,28 | 2,08% | 0,14%    | 7,91% | 8.145.073,77               | 18,47%         | 6.974.089.248,73  | 0,12%               |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM  | 03.543.447/0001-03 | BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP                      | 3,03% | 0,35 | 3,07% | -0,03%   | 6,57% | 6.864.179,63               | 15,57%         | 2.809.621.968,16  | 0,24%               |
| <b>Sub-total ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B" - FUNDOS 100% TÍTULOS PÚBLICOS</b> |                    |  |       |      |       |          |       | <b>35.313.219,64</b>       | <b>80,10%</b>  |                   |                     |
| <b>ARTIGO 7º, INCISO IV, ALÍNEA "A" - FUNDOS RENDA FIXA (LIVRE)</b>             |                    |  |       |      |       |          |       |                            |                |                   |                     |
| BRADERCO ASSET MANAGEMENT   | 03.399.411/0001-90 | BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI                   | 0,03% | 0,03 | 0,54% | 98,79%   | 5,31% | 6.954.577,26               | 15,77%         | 7.898.846.795,17  | 0,09%               |
| BRADERCO ASSET MANAGEMENT   | 08.702.798/0001-25 | BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA                      | 5,75% | 0,63 | 7,43% | 0,29%    | 9,93% | 1.821.327,33               | 4,13%          | 1.195.772.333,52  | 0,15%               |
| <b>Sub-total ARTIGO 7º, INCISO IV, ALÍNEA "A" - FUNDOS RENDA FIXA (LIVRE)</b>   |                    |  |       |      |       |          |       | <b>8.775.904,58</b>        | <b>19,90%</b>  |                   |                     |
| <b>Sub-total Renda Fixa</b>   |                    |  |       |      |       |          |       | <b>44.089.124,22</b>       | <b>100,00%</b> |                   |                     |
| <b>Total</b>  |                    |  |       |      |       |          |       | <b>44.089.124,22</b>       | <b>100%</b>    |                   |                     |

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

#### Enquadramento da Carteira

| Artigo                           | Classe                       | Valor(R\$)           | % Carteira     | Política Investimento | Limite Res. 4.604/17 |
|----------------------------------|------------------------------|----------------------|----------------|-----------------------|----------------------|
| <b>Renda Fixa</b>                |                              |                      |                |                       |                      |
| ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"  | FUNDOS 100% TÍTULOS PÚBLICOS | 35.313.219,65        | 80,10%         | 100,00%               | 100,00%              |
| ARTIGO 7º, INCISO IV, ALÍNEA "A" | FUNDOS RENDA FIXA (LIVRE)    | 8.775.904,59         | 19,90%         | 40,00%                | 40,00%               |
| <b>Total Renda Fixa</b>          |                              | <b>44.089.124,24</b> | <b>100,00%</b> |                       |                      |

#### Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)

| Estratégia                              | No Mês | No Ano | 12 meses | 24 meses |
|---|--------|--------|----------|----------|
| <b>ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"</b>  | 2,64   | 7,38   | --       | --       |
| % do CDI                                | 485,6  | 137,1  | --       | --       |
| <b>ARTIGO 7º, INCISO IV, ALÍNEA "A"</b> | 1,89   | 5,92   | --       | --       |
| % do CDI                                | 348,6  | 110,0  | --       | --       |

#### Ganhos Financeiros

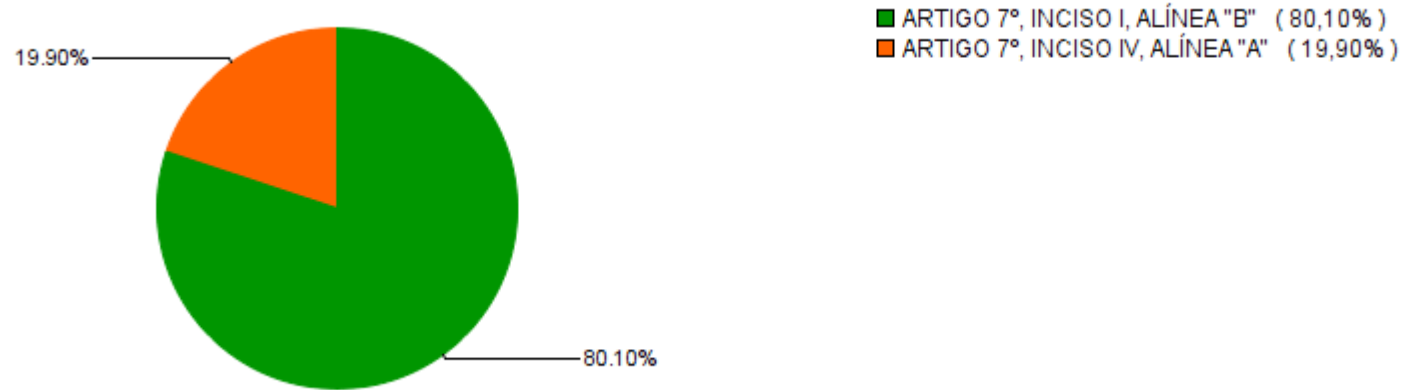
| Estratégia                              | Ganho Bruto (R\$)   |
|---|---------------------|
| <b>ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"</b>  | 907.087,36          |
| <b>ARTIGO 7º, INCISO IV, ALÍNEA "A"</b> | 163.016,59          |
| <b>Total</b>                            | <b>1.070.103,94</b> |

#### Análise da Disponibilidade Financeira

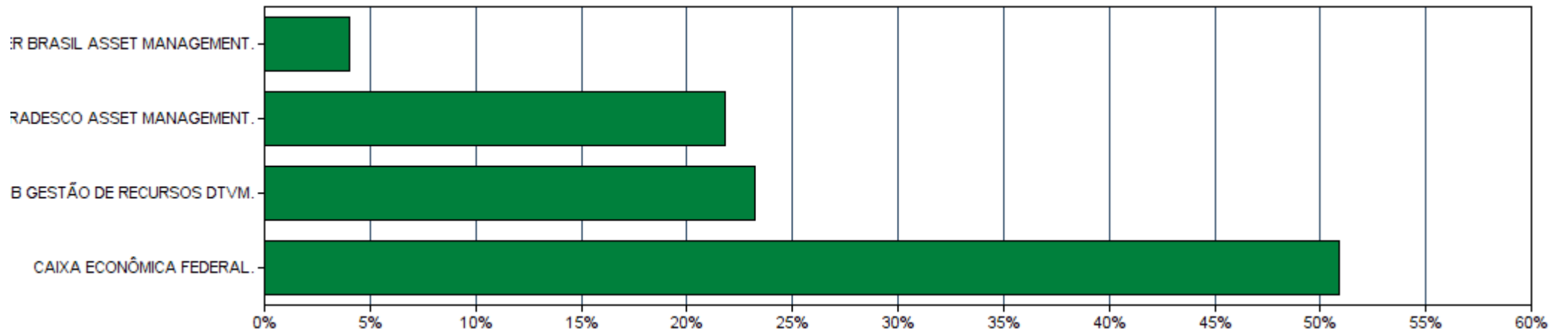
| Período        | Valor (R\$)   | (%) | Valor Acum. Bruto (R\$) | (%) Acum. |
|----------------|---------------|-----|-------------------------|-----------|
| de 0 a 30 dias | 44.089.124,22 | 100 | 44.089.124,22           | 100       |

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Alocação por Estratégia**



**Alocação por Gestor**

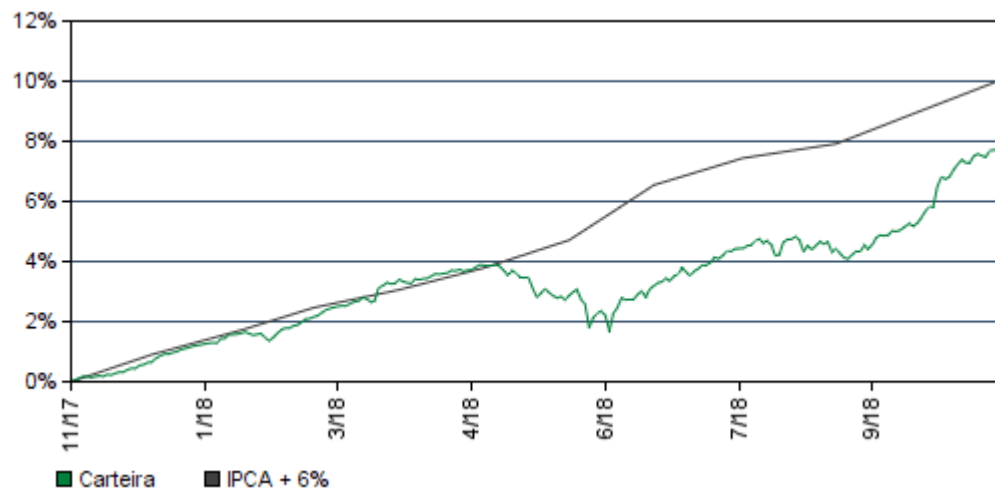


### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

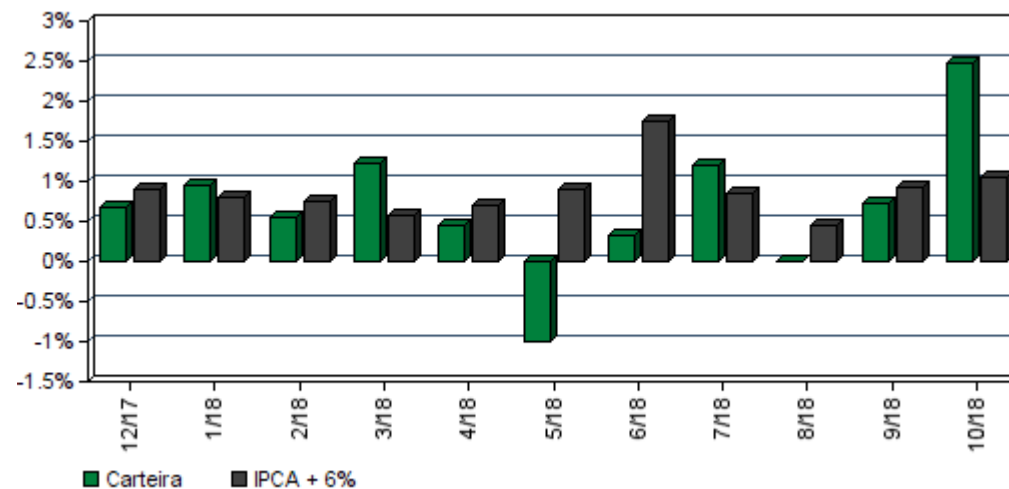
#### Rentabilidades da Carteira

| Ano              | Jan  | Fev   | Mar  | Abr   | Mai   | Jun   | Jul  | Ago   | Set   | Out  | Nov | Dez   | Rent.Ano |
|------------------|------|-------|------|-------|-------|-------|------|-------|-------|------|-----|-------|----------|
| <b>2017</b>      |      |       |      |       |       |       |      |       |       |      |     |       |          |
| <b>IPCA + 6%</b> | --   | --    | --   | --    | --    | --    | --   | --    | --    | --   | --  | 0,66  | 0,66     |
| <b>p.p. Indx</b> | --   | --    | --   | --    | --    | --    | --   | --    | --    | --   | --  | -0,24 | -0,24    |
| <b>2018</b>      |      |       |      |       |       |       |      |       |       |      |     |       |          |
| <b>IPCA + 6%</b> | 0,94 | 0,54  | 1,22 | 0,46  | -0,99 | 0,33  | 1,21 | -0,01 | 0,72  | 2,49 | --  | --    | 7,09     |
| <b>p.p. Indx</b> | 0,80 | 0,74  | 0,58 | 0,71  | 0,89  | 1,75  | 0,84 | 0,44  | 0,92  | 1,05 | --  | --    | 9,07     |
|                  | 0,14 | -0,20 | 0,64 | -0,25 | -1,88 | -1,42 | 0,37 | -0,45 | -0,20 | 1,43 | --  | --    | -1,98    |

#### Evolução da Rentabilidade



#### Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

#### Análise de Risco / Retorno da Carteira

|                                  | Qtd. | Perct. |
|----------------------------------|------|--------|
| Meses <b>acima</b> do Benchmark  | 4    | 36,4%  |
| Meses <b>abaixo</b> do Benchmark | 7    | 63,6%  |

|  | Rentab. | Mês    |
|--|---------|--------|
| <b>Maior</b> rentabilidade da Carteira | 2,49%   | out/18 |
| <b>Menor</b> rentabilidade da Carteira | -0,99%  | mai/18 |

| Período               | Rentabilidade (%) |           |            | Volat. Anual |
|-----------------------|-------------------|-----------|------------|--------------|
|                       | Carteira          | IPCA + 6% | p.p. Indx. |              |
| <b>03 meses</b>       | 3,22              | 2,44      | 0,8        | 2,551        |
| <b>06 meses</b>       | 3,78              | 6,04      | -2,3       | 2,810        |
| <b>12 meses</b>       | --                | --        | --         | --           |
| <b>24 meses</b>       | --                | --        | --         | --           |
| <b>36 meses</b>       | --                | --        | --         | --           |
| <b>Desde o início</b> | 7,80              | 10,06     | -2,3       | 2,202        |

#### 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 IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO<br>Var. do IRF-M 1 p.p.            | 0,93<br>0,02  | 5,64<br>-0,17 | 1,93<br>-0,04 | 3,32<br>-0,09 | 6,23<br>-0,18  | 6,23<br>-0,18  | 6,23<br>-0,18  |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA<br>Var. do IRF-M 1 p.p.                  | 0,94<br>0,02  | 5,67<br>-0,14 | 1,94<br>-0,03 | 3,35<br>-0,06 | 6,27<br>-0,13  | 6,27<br>-0,13  | 6,27<br>-0,13  |
| BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA<br>Var. do IRF-M 1 p.p.                      | 0,90<br>-0,02 | 4,78<br>-0,18 | 1,91<br>-0,07 | 3,26<br>-0,15 | 4,78<br>-0,18  | 4,78<br>-0,18  | 4,78<br>-0,18  |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP<br>Var. do IMA-B 5 p.p.               | 3,10<br>-0,00 | 8,03<br>-0,20 | 3,70<br>-0,05 | 3,98<br>-0,12 | 8,97<br>-0,22  | 8,97<br>-0,22  | 8,97<br>-0,22  |
| SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP<br>Var. do IMA-B TOTAL p.p. | 7,11<br>-0,03 | 9,96<br>-0,27 | 6,42<br>-0,08 | 5,01<br>-0,17 | 10,85<br>-0,29 | 10,85<br>-0,29 | 10,85<br>-0,29 |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP<br>Var. do IDKA 2 p.p.           | 2,08<br>0,14  | 7,91<br>-0,30 | 3,27<br>-0,16 | 3,89<br>-0,30 | 8,85<br>-0,62  | 8,85<br>-0,62  | 8,85<br>-0,62  |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP<br>Var. do IMA-B 5 p.p.                          | 3,07<br>-0,03 | 6,57<br>-0,16 | 3,70<br>-0,05 | 4,01<br>-0,10 | 6,57<br>-0,16  | 6,57<br>-0,16  | 6,57<br>-0,16  |
| BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI<br>% do CDI                                   | 0,54<br>98,79 | 5,31<br>98,62 | 1,56<br>98,59 | 3,13<br>97,92 | 5,87<br>98,59  | 5,87<br>98,59  | 5,87<br>98,59  |

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Análise dos Fundos & Ativos da Carteira**

**Rentabilidades em Períodos Fechados (%)**

| <b>Fundo / Indexador</b>   | <b>No Mês</b> | <b>No Ano</b> | <b>3 meses</b> | <b>6 meses</b> | <b>12 meses</b> | <b>24 meses</b> | <b>36 meses</b> |
|--|---------------|---------------|----------------|----------------|-----------------|-----------------|-----------------|
| BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA<br>Var. do IMA-B TOTAL p.p. | 7,43<br>0,29  | 9,93<br>-0,30 | 6,50<br>-0,00  | 4,93<br>-0,26  | 10,86<br>-0,28  | 10,86<br>-0,28  | 10,86<br>-0,28  |
| 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%  | 0,51          | 8,27          | 1,80           | 5,50           | 9,75            | 18,44           | 36,20           |
| IPCA + 6%  | 1,05          | 9,07          | 2,44           | 6,04           | 10,88           | 20,68           | 37,96           |