

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos											
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	VAR	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (31/05/2019)	% 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	3,36%	0,40	1,75%	-0,02%	4,62%	5.585.610,69	3,19%	4.965.905.251,75	0,11%
BANESTES	BANESTES	BANESTES PREVIDENCIARIO FI RF REF IMA-B	8,45%	0,98	5,56%	1,90%	14,84%	2.388.995,65	1,37%	280.714.593,35	0,85%
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,52%	0,08	0,65%	-0,03%	2,62%	7.707.353,83	4,40%	9.642.034.622,42	0,08%
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF IMA-B TP	5,81%	0,69	2,33%	-0,01%	2,33%	8.186.035,08	4,68%	5.232.773.054,08	0,16%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IMAB TP FI RF LP	5,83%	0,69	2,31%	-0,02%	2,31%	5.115.495,00	2,92%	10.160.570.915,80	0,05%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IRFM 1 TP FI RF	0,52%	0,08	0,65%	-0,02%	2,64%	36.724.533,48	20,99%	15.240.544.601,45	0,24%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IMA B 5+ TP RF LP	8,42%	0,98	3,24%	-0,05%	3,24%	8.259.426,07	4,72%	2.455.566.753,69	0,34%
CEF	CEF	CAIXA BRASIL IDKa IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RF LP	2,29%	0,28	1,06%	-0,31%	4,70%	9.332.360,42	5,33%	8.833.466.098,85	0,11%
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF ALOCACAO ATIVA FICFI	2,94%	0,36	2,02%	0,19%	5,93%	12.758.482,88	7,29%	6.585.019.923,99	0,19%
CEF	CEF	CAIXA BRASIL GESTAO ESTRATEGICA FI RF	3,43%	0,41	2,72%	2,59%	7,97%	42.057.405,30	24,04%	5.707.989.219,32	0,74%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - 4604 - Fundos 100% Títulos Públicos - Referenciado				0,36				138.115.698,40	78,94%		
Artigo 7º IV, Alínea a - RF e REFERENCIAL LIVRE											
CEF	CEF	CAIXA FI ALIANÇA RF	0,06%	0,03	0,57%	105,05%	2,15%	2.032.507,73	1,16%	289.178.409,83	0,70%
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - RF e REFERENCIAL LIVRE				0,03				2.032.507,73	1,16%		
Artigo 7º VII, Alínea b - 4604 - Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"											
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IPCA XVI RF CRED PRIV	3,03%	0,36	2,42%	1,78%	6,93%	2.399.643,00	1,37%	153.709.090,48	1,56%
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b - 4604 - Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"				0,36				2.399.643,00	1,37%		
Sub-total Renda Fixa				0,36				142.547.849,13	81,47%		
Renda Variável											
Artigo 8º I, Alínea a - 4604 - Fundos de Ações Referenciados											
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO ACOES GOVERNANCA FI	21,41%	2,33	1,28%	0,57%	10,37%	5.598.663,61	3,20%	514.539.367,98	1,09%
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a - 4604 - Fundos de Ações Referenciados				2,33				5.598.663,61	3,20%		
Artigo 8º II, Alínea a - 4604 - Fundos de Ações											

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos											
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	VAR	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (31/05/2019)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
BB	BB	BB AÇÕES DIVIDENDOS FIC FI	19,18%	2,11	3,14%	2,44%	10,99%	1.543.960,90	0,88%	865.126.221,25	0,18%
CEF	CEF	Caixa FI Ações Institucional BDR Nível I	18,04%	1,91	-6,70%	-7,40%	11,25%	4.736.320,21	2,71%	504.348.175,80	0,94%
BANESTES	BANESTES	BANESTES FIC DE FI ACOES BTG ABSOL. INST	20,04%	2,21	3,29%	0,15%	11,84%	2.467.191,81	1,41%	50.521.403,54	4,88%
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES ALOCAÇÃO FIC DE FI	20,51%	2,23	0,75%	0,05%	9,62%	2.137.016,32	1,22%	289.848.112,92	0,74%
BB	BB	BB ACOES GLOBAIS FC FIA BDR NIVEL I	18,28%	1,92	-6,92%	-7,62%	10,11%	3.091.880,76	1,77%	55.451.132,33	5,58%
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO ACOES VALOR FC FIA	22,91%	2,53	1,80%	1,10%	18,48%	5.061.752,92	2,89%	143.974.063,43	3,52%
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALAOR DIVIDENDOS RPPS	18,24%	2,02	0,10%	-3,04%	14,39%	3.410.278,55	1,95%	599.177.335,82	0,57%
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a - 4604 - Fundos de Ações				2,14				22.448.401,47	12,83%		
Artigo 8º III - 4604 - Fundos Multimercados											
CEF	CEF	FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES MULTIMERCADO	0,00%	0,00	1,17%	0,47%	3,26%	2.743.165,82	1,57%	477.665.207,45	0,57%
Sub-total Artigo 8º III - 4604 - Fundos Multimercados				0,00				2.743.165,82	1,57%		
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604 - Fundos de Investimentos Imobiliários											
CEF	CEF	CXCE11B	0,00%	0,00	5,54%	4,84%	8,84%	969.920,00	0,55%	1,13	85.626.289,94%
RB CAPITAL	VOTORANTIM	RBRD11	0,00%	0,00	7,61%	6,91%	12,79%	664.143,70	0,38%	1,33	50.060.025,87%
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b - 4604 - Fundos de Investimentos Imobiliários				0,00				1.634.063,70	0,93%		
Sub-total Renda Variável				1,89				32.424.294,60	18,53%		
Total								174.972.143,73	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	138.115.698,40	78,94%	94,23%	100,00%
Artigo 7º IV, Alínea a	RF e REFERENCIAL LIVRE	2.032.507,73	1,16%	0,00%	30,00%
Artigo 7º VII, Alínea b - 4604	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	2.399.643,00	1,37%	1,38%	5,00%
	Total Renda Fixa	142.547.849,13	81,47%		
Renda Variável					
Artigo 8º I, Alínea a - 4604	Fundos de Ações Referenciados	5.598.663,61	3,20%	0,00%	30,00%
Artigo 8º II, Alínea a - 4604	Fundos de Ações	22.448.401,47	12,83%	2,86%	20,00%
Artigo 8º III - 4604	Fundos Multimercados	2.743.165,82	1,57%	0,00%	10,00%
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604	Fundos de Investimentos Imobiliários	1.634.063,70	0,93%	0,91%	5,00%
	Total Renda Variável	32.424.294,60	18,53%		

**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	1,93 354,7	5,24 201,9	10,94 171,7	16,06 110,4
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,57 105,1	2,15 83,1	2,15 33,8	7,26 50,0
Artigo 7º VII, Alínea b - 4604 % do CDI	2,42 445,2	6,93 267,3	13,35 209,6	-- --
Artigo 8º I, Alínea a - 4604 Var. IBOVESPA p.p	1,28 0,6	10,37 -0,0	-- --	-- --
Artigo 8º II, Alínea a - 4604 Var. IBOVESPA p.p	-1,47 -2,2	13,20 2,8	21,53 -4,9	35,71 -19,0
Artigo 8º III - 4604 Var. IBOVESPA p.p	0,00 -0,7	1,64 -8,8	-- --	-- --
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604 Var. IBOVESPA p.p	6,37 5,7	10,42 0,0	26,50 0,1	-- --

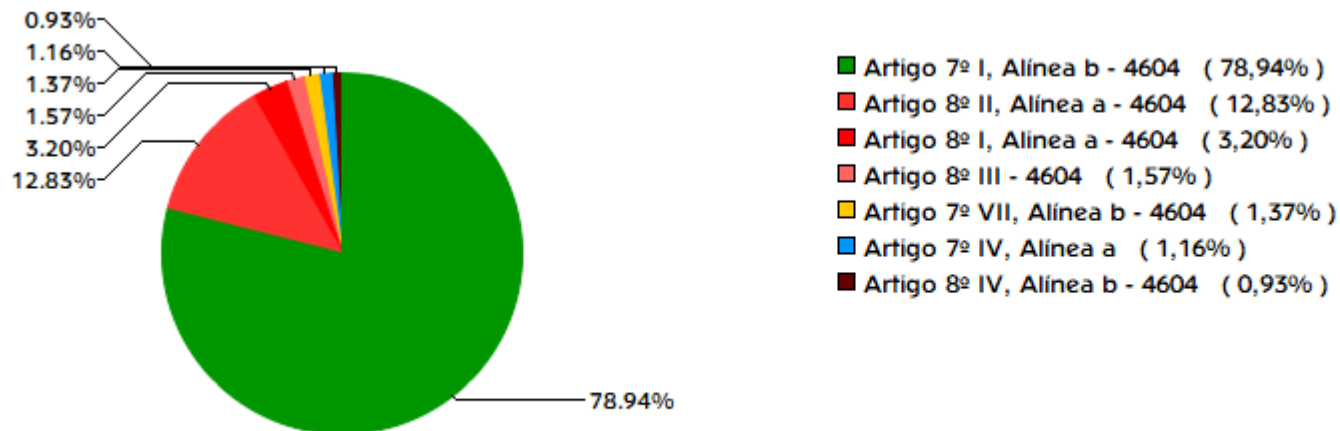
Ganhos Financeiros	
Estratégia	No Mês(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b - 4604	2.590.575,01
Artigo 7º IV, Alínea a	11.900,15
Artigo 7º VII, Alínea a - 4604	56.646,00
Artigo 8º I, Alínea a - 4604	70.594,85
Artigo 8º II, Alínea a - 4604	-335.728,59
Artigo 8º III - 4604	31.838,87
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604	97.909,94
Total	2.523.736,23

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS****Análise da Disponibilidade Financeira**

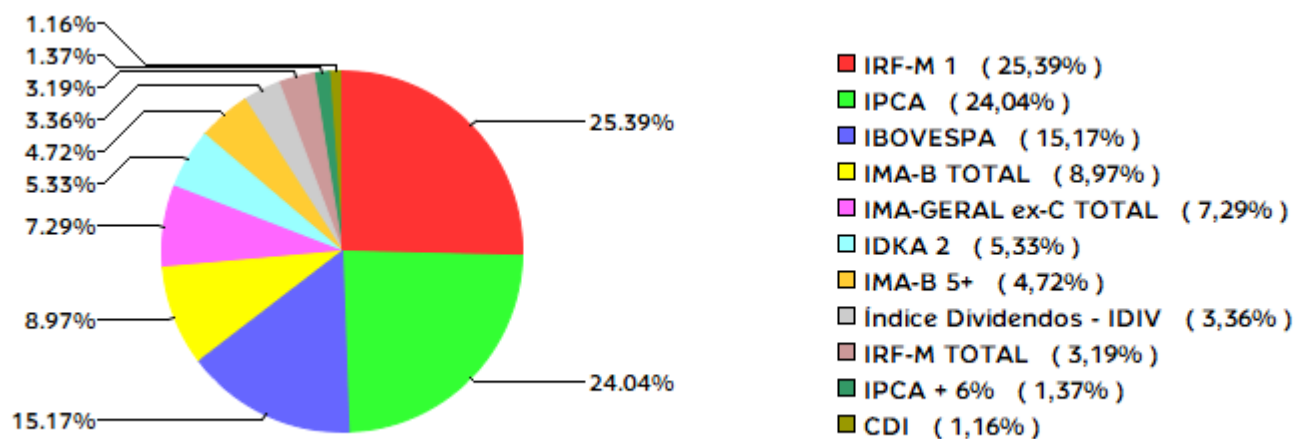
<b>Período</b>	<b>Valor (R\$)</b>	<b>(%)</b>	<b>Valor Acum. Bruto (R\$)</b>	<b>(%) Acum.</b>
de 0 a 30 dias	172.228.977,91	98	172.228.977,91	98
acima de 365 dias	2.743.165,82	2	174.972.143,73	100

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia

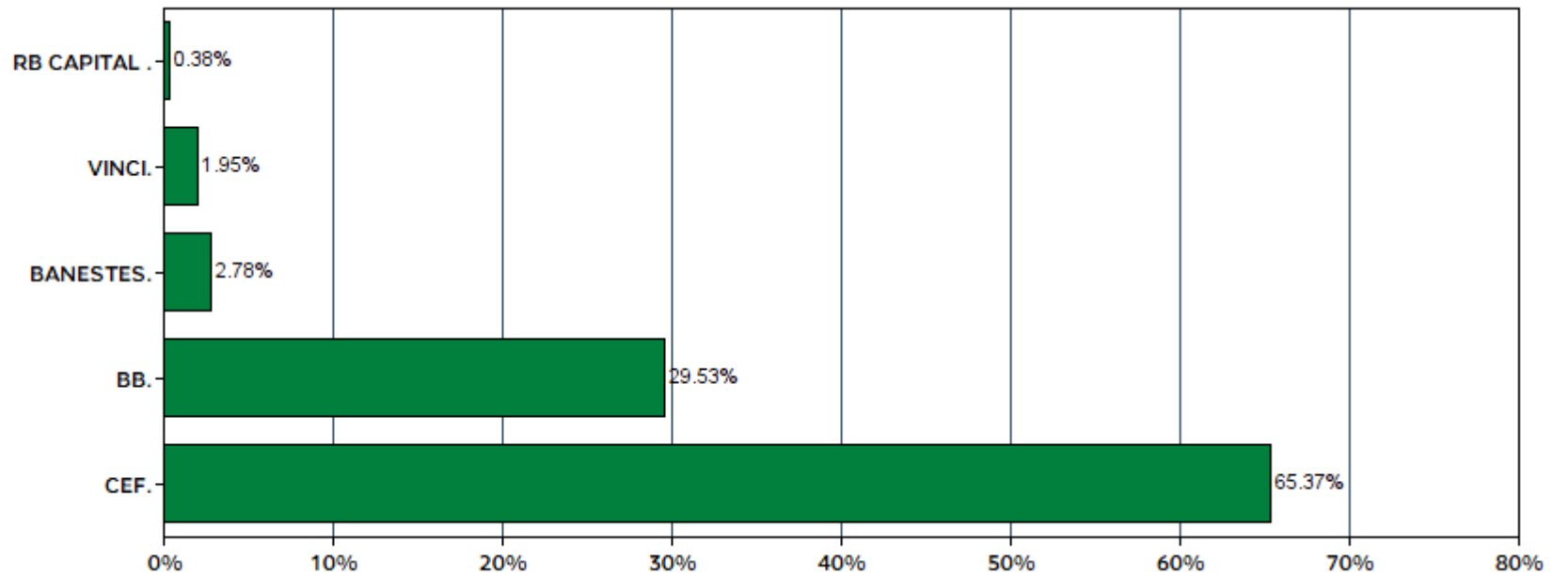


Indexadores



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

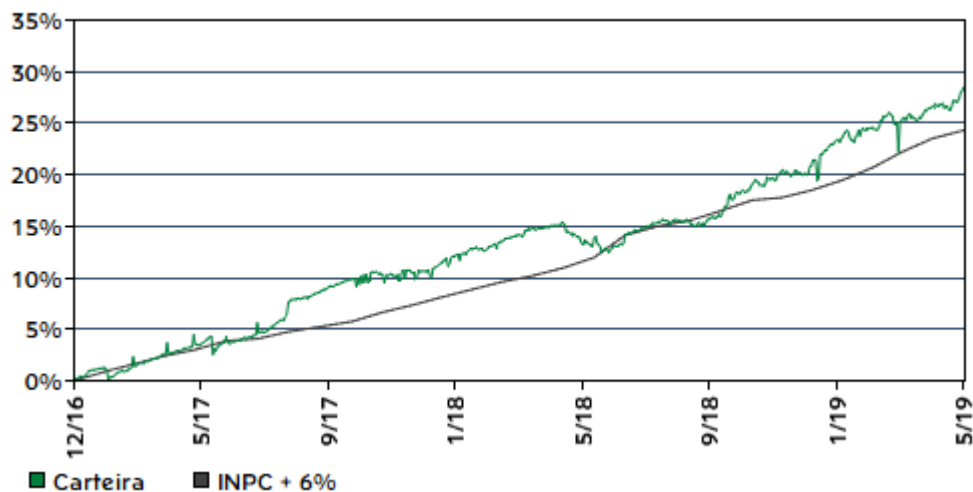
Alocação por Gestor



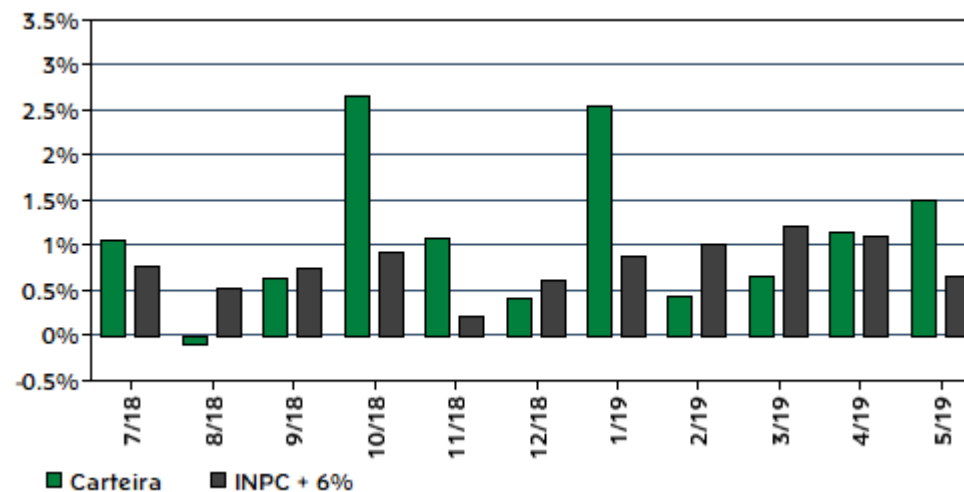
**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Rentabilidades da Carteira													
Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
2017	1,21	1,17	1,22	0,80	-0,24	1,39	1,86	1,05	1,01	0,45	0,10	0,85	11,41
INPC + 6%	0,93	0,66	0,85	0,50	0,87	0,19	0,66	0,50	0,44	0,86	0,64	0,72	8,12
p.p. Indx	0,28	0,51	0,36	0,30	-1,11	1,21	1,20	0,55	0,56	-0,41	-0,54	0,13	3,30
2018	1,29	0,58	1,16	0,41	-1,31	0,30	1,07	-0,09	0,62	2,66	1,08	0,41	8,45
INPC + 6%	0,74	0,60	0,56	0,70	0,92	1,92	0,76	0,53	0,74	0,91	0,21	0,60	9,59
p.p. Indx	0,55	-0,02	0,61	-0,29	-2,22	-1,62	0,30	-0,63	-0,12	1,75	0,86	-0,19	-1,14
2019	2,53	0,43	0,66	1,14	1,49	-	-	-	-	-	-	-	6,39
INPC + 6%	0,87	1,01	1,21	1,09	0,66	-	-	-	-	-	-	-	4,94
p.p. Indx	1,66	-0,58	-0,55	0,05	0,83	-	-	-	-	-	-	-	1,46

**Evolução da Rentabilidade**



**Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses**





**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Análise de Risco / Retorno da Carteira**

	Qtd.	Perct.
Meses acima do Benchmark	17	58,6%
Meses abaixo do Benchmark	12	41,4%

	Rentab.	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,66%	out/18
Menor rentabilidade da Carteira	-1,31%	mai/18

Período	Rentabilidade (%)			Volat. Anual
	Carteira	INPC + 6%	p.p. Indx.	
03 meses	3,32	2,99	0,3	7,178
06 meses	6,84	5,57	1,3	6,578
12 meses	12,98	11,04	1,9	5,068
24 meses	23,35	19,70	3,7	4,606
36 meses	--	--	--	--
Desde o início	28,55	24,33	4,2	4,718

**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
BANESTES PREVIDENCIARIO FI RF REF IMA-B % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	5,56 1,90	14,84 3,78	7,44 1,61	17,26 4,37	30,84 7,11	39,61 5,09	60,30 5,17
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,65 -0,03	2,62 -0,10	1,59 -0,07	3,17 -0,12	6,96 -0,23	15,46 -0,49	30,88 -0,93
BB PREVIDENCIARIO RF ALOCACAO ATIVA FICFI % do Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	2,02 0,19	5,93 0,25	3,44 0,20	7,17 0,24	13,73 0,19	24,05 0,20	-- --
BB PREVIDENCIARIO RF IMA-B TP % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	3,63 -0,04	10,92 -0,14	5,76 -0,07	12,71 -0,18	23,36 -0,37	33,78 -0,74	53,99 -1,14
BB PREVIDENCIARIO RF IRF-M TP % do Var. IRF-M TOTAL p.p.	1,75 -0,02	4,62 -0,10	2,93 -0,06	6,20 -0,13	13,10 -0,23	24,56 -0,52	46,22 -0,97
CAIXA BRASIL GESTAO ESTRATEGICA FI RF % do Var. IPCA p.p.	2,72 2,59	7,97 5,75	4,42 2,97	9,40 7,03	14,14 9,48	23,38 15,74	-- --
CAIXA BRASIL IDKa IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RF LP % do Var. IDKA 2 p.p.	1,06 -0,31	4,70 -0,25	2,82 -0,28	5,91 -0,36	11,05 -1,00	22,36 -1,64	37,50 -2,66
CAIXA FI BRASIL IMA B 5+ TP RF LP % do Var. IMA-B 5+ p.p.	5,11 -0,09	15,03 -0,26	7,43 -0,12	17,10 -0,35	31,79 -0,76	40,99 -1,12	65,28 -1,60

## 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
CAIXA FI BRASIL IMAB TP FI RF LP % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	3,63 -0,03	10,98 -0,08	5,77 -0,07	12,79 -0,10	23,51 -0,22	33,98 -0,54	54,31 -0,81
CAIXA FI BRASIL IRFM 1 TP FI RF % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,65 -0,02	2,64 -0,08	1,61 -0,05	3,20 -0,10	7,01 -0,18	15,56 -0,39	31,14 -0,68
FUNDO DE INVESTIMENTO BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS-RENTA FIXA % do Var. IRF-M 1 p.p.	1,77 1,09	4,10 1,37	2,86 1,20	4,99 1,69	9,47 2,28	19,58 3,63	36,05 4,24
CAIXA FI ALIANÇA RF % do % do CDI	0,57 105,05	2,57 99,10	1,55 100,96	3,06 98,86	6,27 98,39	14,17 97,44	29,10 97,88
CAIXA FI BRASIL IPCA XVI RF CRED PRIV % do Var. IPCA + 6% p.p.	2,42 1,78	6,93 2,23	4,51 1,59	8,19 2,84	13,35 2,44	20,55 -0,29	34,20 1,50
BB PREVIDENCIARIO ACOES GOVERNANCA FI % do Var. IBOVESPA p.p.	1,28 0,57	10,37 -0,03	1,79 0,28	9,41 1,00	29,45 3,04	49,68 -5,05	90,38 -9,80
BANESTES FIC DE FI ACOES BTG ABSOL. INST % do Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	3,29 0,15	11,84 --	5,90 1,46	15,14 -0,69	36,48 -0,60	61,29 7,23	73,47 -56,10
BB AÇÕES DIVIDENDOS FIC FI % do Var. IBOVESPA p.p.	3,14 2,44	10,99 0,59	4,54 3,03	11,37 2,96	30,80 4,38	47,30 -7,42	72,52 -27,66
BB ACOES GLOBAIS FC FIA BDR NIVEL I % do Var. IBOVESPA p.p.	-6,92 -7,62	10,11 -0,29	2,58 1,07	-0,28 -8,69	5,54 -20,88	35,87 -18,86	36,98 -63,20
BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES ALOCAÇÃO FIC DE FI % do Var. IBOVESPA p.p.	0,75 0,05	9,62 -0,79	1,89 0,38	7,56 -0,84	25,09 -1,32	52,37 -2,36	84,15 -16,03
BB PREVIDENCIARIO ACOES VALOR FC FIA % do Var. IBOVESPA p.p.	1,80 1,10	18,48 8,07	6,13 4,61	17,67 9,26	42,05 15,63	-- --	-- --
Caixa FI Ações Institucional BDR Nivel I % do Var. IBOVESPA p.p.	-6,70 -7,40	11,25 0,84	4,46 2,95	2,56 -5,85	8,05 -18,37	40,41 -14,31	45,63 -54,55
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALAOR DIVIDENDOS RPPS .. % do Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	0,10 -3,04	14,39 --	1,52 -2,91	18,08 2,25	33,53 -3,55	47,86 -6,21	67,34 -62,23
FIC FI CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES MULTIMERCADO % do Var. IBOVESPA p.p.	1,17 0,47	3,26 -7,15	2,04 0,52	4,69 -3,72	-- --	-- --	-- --
CXCE11B % do Var. IBOVESPA p.p.	5,54 4,84	8,84 -1,56	7,77 6,26	10,46 2,05	22,74 -3,67	-- --	-- --

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
RBRD11 % do Var. IBOVESPA p.p.	7,61 6,91	12,79 2,39	10,68 9,17	17,50 9,09	32,15 5,73	-- --	-- --
CDI	0,54	2,59	1,54	3,10	6,37	14,54	29,73
IBOVESPA	0,70	10,40	1,51	8,41	26,42	54,73	100,18
DOLAR COMERCIAL	-0,12	1,70	5,41	2,00	5,45	21,49	9,61
INPC + 6%	0,66	4,94	2,99	5,57	11,04	19,70	31,13
IPCA + 6%	0,64	4,71	2,92	5,35	10,91	20,84	32,70