

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Posição de Ativos										
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (31/05/2019)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
<b>Renda Fixa</b>										
BANESTES DTVM	Banco BANESTES	FI BANESTES PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B	8,45%	5,56%	1,90%	14,84%	1.707.401,04	0,99%	280.714.593,35	0,61%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M 1 TP FIC FI	0,52%	0,65%	-0,03%	2,62%	0,00	0,00%	9.642.034.622,42	0,00%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI	5,81%	3,63%	-0,04%	10,92%	32.174.109,42	18,60%	5.232.773.054,08	0,61%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RF LP	5,83%	3,63%	-0,03%	10,98%	30.592.052,25	17,69%	10.160.570.915,80	0,30%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,96%	1,37%	-0,01%	4,35%	4.061.698,55	2,35%	3.880.154.750,39	0,10%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA II FI	1,42%	0,55%	-0,09%	3,72%	1.098.885,34	0,64%	221.869.362,09	0,50%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL 2024 I TP RF	6,91%	2,40%	-1,27%	4,69%	1.298.154,32	0,75%	424.687.222,73	0,31%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,94%	2,02%	0,17%	2,28%	9.205.113,29	5,32%	6.585.019.923,99	0,14%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5+ TP FI	8,48%	5,12%	-0,08%	7,08%	33.815.292,37	19,55%	2.203.291.902,48	1,53%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP RF LP	8,42%	5,11%	-0,09%	15,03%	8.973.008,18	5,19%	2.455.566.753,69	0,37%
<b>Sub-total 4604 - Artigo 7º I, Alínea b - FI 100% Títulos TN</b>							<b>122.925.714,75</b>	<b>71,06%</b>		
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA ALIANÇA TP RF	0,06%	0,57%	105,05%	2,57%	2.379.662,05	1,38%	289.178.409,83	0,82%
BANESTES DTVM	Banco BANESTES	BANESTES ESTRATÉGIA FIC FI RF	--%	2,26%	416,51%	7,00%	2.301.812,29	1,33%	58.111.651,16	3,96%
BANESTES DTVM	Banco BANESTES	FI BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA	7,52%	5,49%	1,82%	13,97%	11.414.336,04	6,60%	249.593.857,00	4,57%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC FI	0,04%	0,53%	97,50%	2,54%	-0,00	-0,00%	3.682.471.718,05	-0,00%
<b>Sub-total 4604 - Artigo 7º IV, Alínea a - FI Renda Fixa - Geral</b>							<b>16.095.810,38</b>	<b>9,31%</b>		
<b>Sub-total Renda Fixa - FI Renda Fixa - Geral</b>							<b>139.021.525,13</b>	<b>80,37%</b>		
<b>Renda Variável</b>										
CAIXA	CAIXA	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	22,10%	0,72%	0,01%	10,19%	5.534.319,11	3,20%	374.997.874,79	1,48%
<b>Sub-total 4604 - Artigo 8º I, Alínea a - FI de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações</b>							<b>5.534.319,11</b>	<b>3,20%</b>		
BANESTES DTVM	Banco BANESTES	BANESTES FIC FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INST	20,04%	3,29%	2,59%	11,84%	5.430.695,18	3,14%	50.521.403,54	10,75%
CAIXA	CAIXA	FIA CAIXA DIVIDENDOS	16,26%	1,21%	0,50%	9,82%	198.062,54	0,11%	75.118.611,25	0,26%
VINCI EQUITIES Gest Rec	CAIXA	FIC FIA CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	18,24%	0,10%	-0,61%	14,39%	21.489.935,92	12,42%	599.177.335,82	3,59%

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Posição de Ativos										
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (31/05/2019)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
<b>Sub-total 4604 - Artigo 8º II, Alínea a - FI de Ações - Geral</b>							<b>27.118.693,63</b>	<b>15,68%</b>		
RIO BRAVO Invest	CAIXA	CAIXA RIO BRAVO FII	0,00%	1,18%	1,05%	4,87%	1.303.521,66	0,75%	172.574.049,41	0,76%
<b>Sub-total 4604 - Artigo 8º IV, Alínea b - FI Imobiliários</b>							<b>1.303.521,66</b>	<b>0,75%</b>		
<b>Sub-total Renda Variável</b>							<b>33.956.534,40</b>	<b>19,63%</b>		
<b>Total</b>							<b>172.978.059,53</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>					
4604 - Artigo 7º I, Alínea b	FI 100% Títulos TN	122.925.714,75	71,06%	<b>68,00%</b>	100,00%
4604 - Artigo 7º IV, Alínea a	FI Renda Fixa - Geral	16.095.810,38	9,31%	<b>9,00%</b>	40,00%
<b>Total Renda Fixa</b>		<b>139.021.525,13</b>	<b>80,37%</b>		
<b>Renda Variável</b>					
4604 - Artigo 8º I, Alínea a	FI de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações	5.534.319,11	3,20%	4,00%	30,00%
4604 - Artigo 8º II, Alínea a	FI de Ações - Geral	27.118.693,63	15,68%	18,00%	20,00%
4604 - Artigo 8º IV, Alínea b	FI Imobiliários	1.303.521,66	0,75%	1,00%	5,00%
<b>Total Renda Variável</b>		<b>33.956.534,40</b>	<b>19,63%</b>		

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

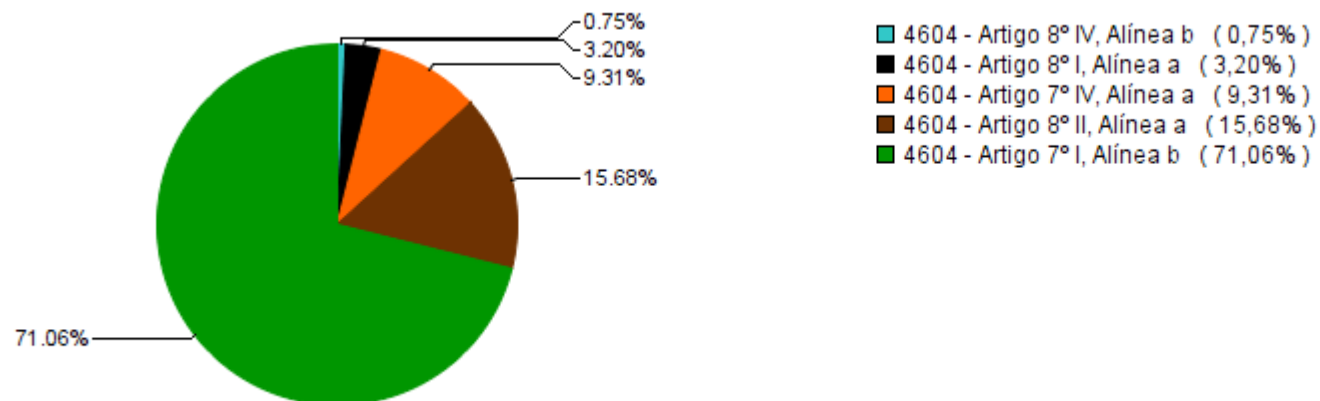
Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
<b>4604 - Artigo 7º I, Alínea b</b> % do CDI	3,74 689,3	10,49 404,6	21,47 337,0	30,33 208,6
<b>4604 - Artigo 7º IV, Alínea a</b> % do CDI	3,92 722,4	9,30 358,7	16,94 265,9	25,09 172,5
<b>4604 - Artigo 8º I, Alínea a</b> % do CDI	0,72 131,9	10,19 392,9	25,82 405,2	52,88 363,6
<b>4604 - Artigo 8º II, Alínea a</b> % do CDI	0,58 106,7	14,13 544,9	34,10 535,4	50,54 347,5
<b>4604 - Artigo 8º IV, Alínea b</b> % do CDI	1,18 217,5	5,59 215,7	7,96 124,9	20,57 141,4

**Ganhos Financeiros**

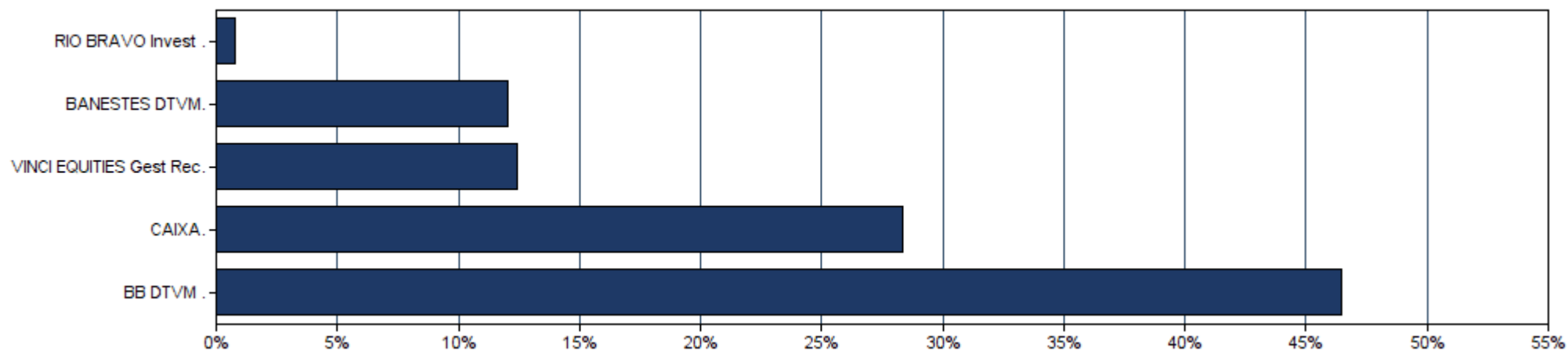
Estratégia	Ganho Bruto (R\$)
<b>4604 - Artigo 7º I, Alínea b</b>	4.336.680,51
<b>4604 - Artigo 7º IV, Alínea a</b>	670.278,21
<b>4604 - Artigo 8º I, Alínea a</b>	39.360,34
<b>4604 - Artigo 8º II, Alínea a</b>	154.099,55
<b>4604 - Artigo 8º IV, Alínea b</b>	15.310,44
<b>Total</b>	<b>5.215.729,05</b>

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Alocação por Estratégia**



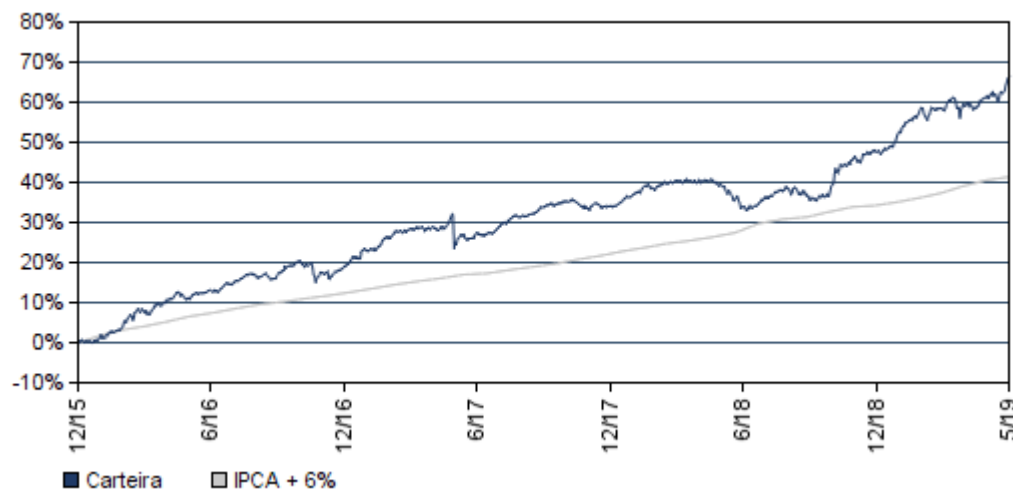
**Alocação por Gestor**



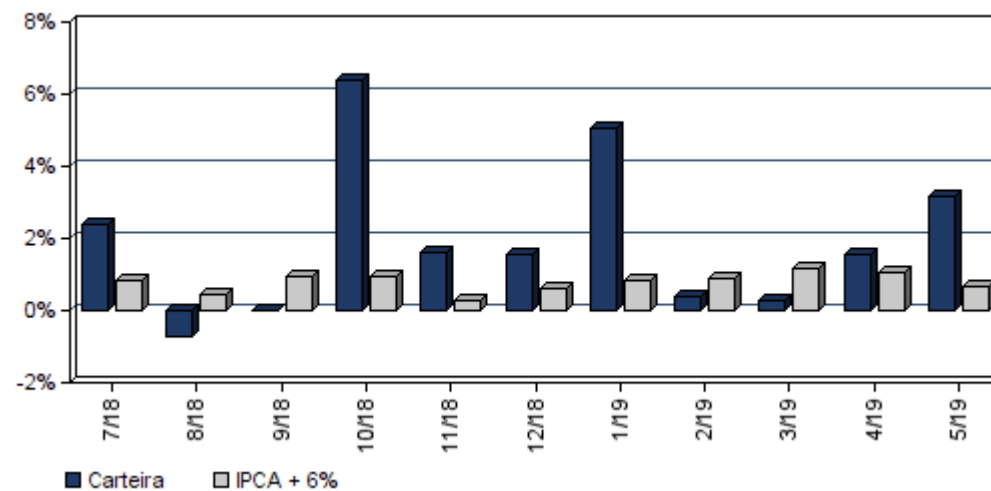
### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira													
Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
<b>2016</b>	1,34	1,97	4,06	3,03	0,07	1,69	2,33	0,88	1,50	1,07	-1,32	2,51	20,77
<b>IPCA + 6%</b>	1,74	1,34	0,94	1,08	1,27	0,86	1,01	0,98	0,57	0,72	0,64	0,81	12,64
<b>p.p. Indx</b>	-0,40	0,63	3,12	1,95	-1,20	0,83	1,32	-0,10	0,93	0,34	-1,96	1,70	8,13
<b>2017</b>	1,89	3,69	0,85	-0,21	-1,20	0,24	2,79	1,28	1,65	-0,06	-0,56	1,19	12,05
<b>IPCA + 6%</b>	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
<b>p.p. Indx</b>	1,00	2,94	0,06	-0,77	-2,02	-0,02	2,07	0,56	1,03	-0,97	-1,31	0,28	3,00
<b>2018</b>	2,87	0,34	0,73	-0,01	-3,46	-0,88	2,39	-0,73	-0,02	6,39	1,59	1,56	10,97
<b>IPCA + 6%</b>	0,80	0,74	0,58	0,71	0,89	1,75	0,84	0,44	0,92	0,96	0,25	0,61	9,92
<b>p.p. Indx</b>	2,07	-0,40	0,16	-0,72	-4,34	-2,63	1,55	-1,18	-0,95	5,43	1,34	0,95	1,05
<b>2019</b>	5,07	0,38	0,27	1,53	3,15	--	--	--	--	--	--	--	10,76
<b>IPCA + 6%</b>	0,83	0,90	1,19	1,06	0,64	--	--	--	--	--	--	--	4,71
<b>p.p. Indx</b>	4,24	-0,52	-0,92	0,47	2,51	--	--	--	--	--	--	--	6,05

### Evolução da Rentabilidade



### Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses





**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 IMA-B5+ TP FI Var. do IMA-B 5+ p.p.	5,12 -0,08	7,08 -0,23	7,40 -0,14	7,08 -0,23	7,08 -0,23	7,08 -0,23	7,08 -0,23
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP RF LP Var. do IMA-B 5+ p.p.	5,11 -0,09	15,03 -0,26	7,43 -0,12	17,10 -0,35	31,18 -0,63	31,18 -0,63	31,18 -0,63
FI CAIXA ALIANÇA TP RF % 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
BANESTES ESTRATÉGIA FIC FI RF % do CDI	2,26 416,51	7,00 270,08	4,20 273,24	7,92 255,67	13,96 258,13	13,96 258,13	13,96 258,13
FI BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA Var. do IMA-B TOTAL p.p.	5,49 1,82	13,97 2,92	7,27 1,44	16,54 3,65	27,44 3,71	36,34 1,82	57,74 2,62
BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL FIC FI % do CDI	0,53 97,50	2,54 97,87	1,51 97,87	3,02 97,37	6,24 97,93	14,47 99,51	29,72 99,98
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA Var. do IBOVESPA p.p.	0,72 0,01	10,19 -0,22	1,46 -0,05	8,26 -0,14	25,82 -0,60	52,88 -1,85	96,46 -3,72
BANESTES FIC FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INST Var. do IBOVESPA p.p.	3,29 2,59	11,84 1,44	5,90 4,38	15,14 6,74	36,48 10,07	33,23 5,65	33,23 5,65
FIA CAIXA DIVIDENDOS Var. do IBOVESPA p.p.	1,21 0,50	9,82 -0,58	0,01 -1,51	11,59 3,18	34,92 0,39	34,92 0,39	34,92 0,39
FIC FIA CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. do IBOVESPA p.p.	0,10 -0,61	14,39 3,98	1,52 0,01	18,08 9,67	33,53 7,11	44,97 -9,76	64,06 -36,12
CAIXA RIO BRAVO FII Var. do IPCA p.p.	1,18 1,05	4,87 2,65	0,77 -0,69	4,91 2,54	7,22 2,56	19,74 12,10	44,02 32,51
IPCA + 5,5%	0,60	4,50	2,80	5,10	10,39	19,71	30,84
CDI	0,54	2,59	1,54	3,10	6,37	14,54	29,73
IMA-B 5	1,39	5,47	3,31	6,91	13,22	24,34	39,72
IMA-B 5+	5,20	15,29	7,55	17,45	32,56	42,12	66,88

**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>
IMA-B TOTAL	3,66	11,06	5,83	12,89	23,73	34,52	55,13
IMA-GERAL TOTAL	1,84	5,78	3,30	7,02	13,76	24,25	43,33
IRF-M 1	0,68	2,72	1,66	3,30	7,19	15,95	31,81
IRF-M 1+	2,17	5,48	3,48	7,51	15,86	28,71	53,77
IRF-M TOTAL	1,77	4,72	2,99	6,33	13,33	25,08	47,18
IBOVESPA	0,70	10,40	1,51	8,41	26,42	54,73	100,18
IFIX	1,76	8,55	4,85	10,96	15,29	24,16	58,36
SMALL CAP	1,97	--	3,77	13,81	27,61	51,54	119,98
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