

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos												
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	Ano	Cotização Aplic/Resg	Valor(R\$) (31/05/2021)	% Carteira	Limite % Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo	Limite % PL Fundo
Renda Fixa												
BANESTES DTVM	Banco BANESTES	FI BANESTES PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B	10,14%	1,14%	-4,56%	D0/D0	1.858.774,41	0,83%	100%	288.925.390,80	0,64%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI	5,83%	1,05%	-1,19%	D0/D+1	10.460.130,59	4,67%	100%	7.382.686.390,39	0,14%	15%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RF LP	5,82%	1,04%	-1,23%	D0/D0	11.007.704,65	4,91%	100%	5.804.299.790,87	0,19%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,44%	0,69%	1,36%	D0/D+1	34.084.037,26	15,21%	100%	5.747.060.006,20	0,59%	15%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL 2024 I TP RF	5,00%	0,53%	-1,98%	D0/D0	1.410.048,13	0,63%	100%	461.292.840,90	0,31%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,94%	0,48%	-0,79%	D0/D0	36.519.265,84	16,30%	100%	9.352.083.339,26	0,39%	15%
CAIXA	CAIXA	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	2,30%	0,24%	0,72%	D0/D0	18.249.269,83	8,15%	100%	15.989.068.973,83	0,11%	15%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP RF LP	2,44%	0,67%	1,31%	D0/D0	11.191.808,73	5,00%	100%	14.343.181.790,80	0,08%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5+ TP FI	9,11%	1,35%	-3,37%	D0/D+2	13.431.459,56	6,00%	100%	1.298.226.358,14	1,03%	15%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP RF LP	9,15%	1,39%	-3,40%	D0/D0	10.166.883,75	4,54%	100%	1.528.376.681,14	0,67%	15%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - FI 100% Títulos TN							148.379.382,77	66,24%				
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA ALIANÇA TP RF	0,24%	0,28%	0,78%	D0/D0	883.157,75	0,39%	20%	722.328.373,13	0,12%	15%
BANESTES DTVM	Banco BANESTES	BANESTES ESTRATÉGIA FIC FI RF	3,01%	0,53%	-1,05%	D0/D+1	4.706.388,04	2,10%	20%	146.313.204,88	3,22%	15%
BANESTES DTVM	Banco BANESTES	FI BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA	10,51%	1,29%	-4,79%	D0/D0	7.902.241,22	3,53%	20%	246.575.146,46	3,20%	15%
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - FI Renda Fixa - Geral							13.491.787,01	6,02%				
Sub-total Renda Fixa							161.871.169,77	72,26%				
Renda Variável												
CAIXA	CAIXA	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	21,94%	6,08%	5,87%	D+1/D+1	7.157.086,50	3,19%	30%	868.002.053,73	0,82%	15%
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a - FI de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações							7.157.086,50	3,19%				
BANESTES DTVM	Banco BANESTES	BANESTES FIC FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INST	21,03%	3,62%	3,12%	D+1/D+30	15.919.830,09	7,11%	20%	249.471.242,87	6,38%	15%
CAIXA	CAIXA	CAIXA FI AÇÕES DIVIDENDOS	21,73%	8,10%	3,88%	D+1/D+1	247.137,49	0,11%	20%	313.310.098,23	0,08%	15%
VINCI EQUITIES Gest Rec	CAIXA	FIC FIA CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	19,82%	5,95%	5,64%	D+1/D+30	23.060.222,95	10,29%	20%	1.038.685.440,44	2,22%	15%
CAIXA	CAIXA	CAIXA FIC FIA MULTIGESTOR	19,60%	5,02%	6,07%	D+1/D+23	4.590.932,90	2,05%	20%	1.117.209.950,25	0,41%	15%
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a - FI de Ações - Geral							43.818.123,43	19,56%				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos												
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	Ano	Cotização Aplic/Resg	Valor(R\$) (31/05/2021)	% Carteira	Limite % Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo	Limite % PL Fundo
RIO BRAVO Invest	CAIXA	CAIXA RIO BRAVO FII	0,00%	-2,97%	-31,08%	D0/D0	1.170.648,00	0,52%	5%	146.719.618,31	0,80%	5%
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b - FI Imobiliários							1.170.648,00	0,52%				
Sub-total Renda Variável							52.145.857,93	23,28%				
Investimentos no Exterior												
CAIXA	CAIXA	CAIXA FIA INSTITUCIONAL BDR NIVEL I	22,17%	-3,79%	0,27%	D+1/D+1	10.000.669,26	4,46%	10%	2.994.024.840,38	0,33%	15%
Sub-total Artigo 9 A III - Fundo de Ações BDR Nível 1							10.000.669,26	4,46%				
Sub-total Investimentos no Exterior							10.000.669,26	4,46%				
Total							224.017.696,96	100%				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira					
Artigo	Classe	Valor(R\$)	% Carteira	Política Investimento	Limite Res. 3.922/2010
Renda Fixa					
Artigo 7º I, Alínea b	FI 100% Títulos TN	148.379.382,77	66,24%	44,00%	100,00%
Artigo 7º IV, Alínea a	FI Renda Fixa - Geral	13.491.787,01	6,02%	3,00%	40,00%
Total Renda Fixa		161.871.169,78	72,26%		
Renda Variável					
Artigo 8º I, Alínea a	FI de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações	7.157.086,50	3,19%	3,00%	30,00%
Artigo 8º II, Alínea a	FI de Ações - Geral	43.818.123,43	19,56%	20,00%	20,00%
Artigo 8º IV, Alínea b	FI Imobiliários	1.170.648,00	0,52%	1,00%	5,00%
Total Renda Variável		52.145.857,93	23,27%		
Investimentos no Exterior					
Artigo 9 A III	Fundo de Ações BDR Nível 1	10.000.669,26	4,46%	10,00%	10,00%
Total Investimentos no Exterior		10.000.669,26	4,46%		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)

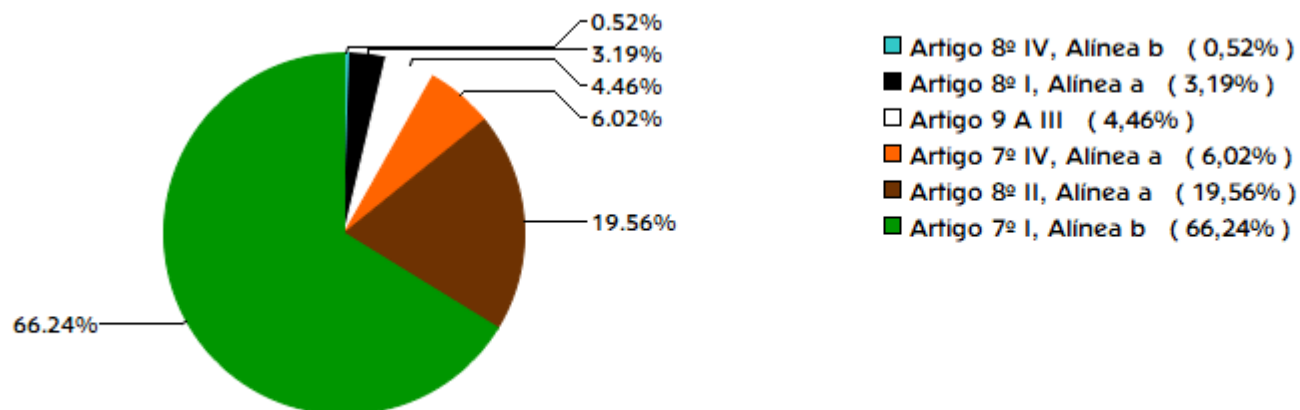
Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,74 277,9	-0,27 -27,8	7,40 339,9	15,79 220,3
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,96 357,5	-2,08 -216,0	4,68 214,9	8,21 114,5
Artigo 8º I, Alínea a % do CDI	6,08 2.274,6	5,87 610,6	43,63 2.004,3	29,32 409,1
Artigo 8º II, Alínea a % do CDI	5,01 1.872,2	4,55 473,9	34,46 1.582,7	34,26 478,0
Artigo 8º IV, Alínea b % do CDI	-3,58 -1.338,3	-31,52 -3.279,4	-24,29 -1.115,7	7,40 103,3
Artigo 9 A III Var. Dolar Comercial p.p	-3,79 -0,6	0,27 3,7	-- --	-- --

Ganhos Financeiros

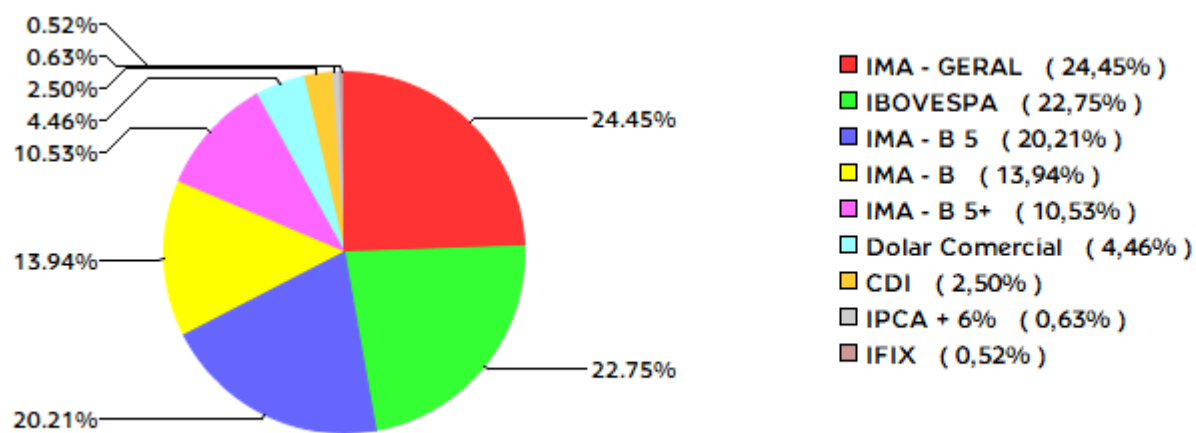
Estratégia	Ganho Bruto (R\$)
Artigo 7º I, Alínea b	1.094.537,34
Artigo 7º IV, Alínea a	127.757,80
Artigo 8º I, Alínea a	410.391,57
Artigo 8º II, Alínea a	2.088.091,23
Artigo 8º IV, Alínea b	-43.452,00
Artigo 9 A III	-334.681,30
Total	3.342.644,64

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia

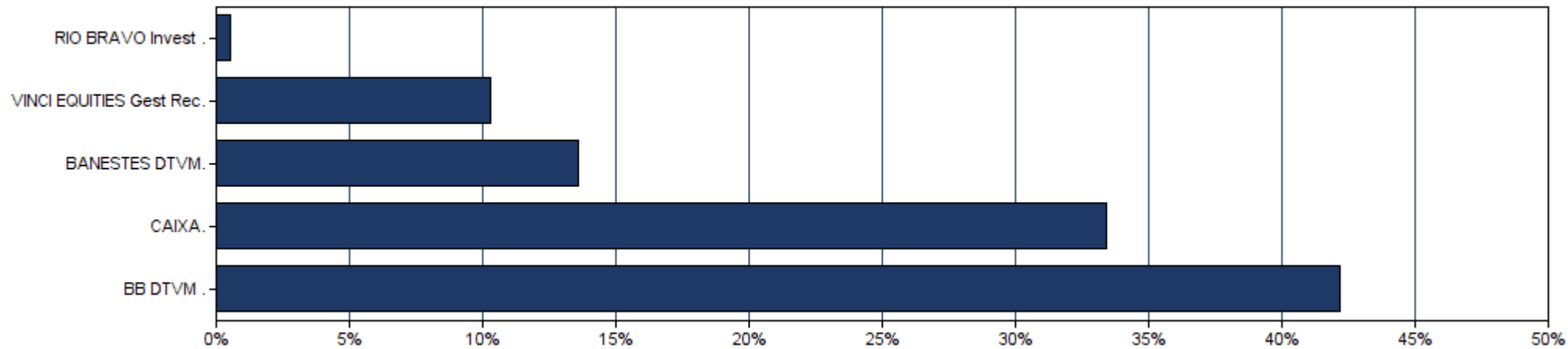


Indexadores



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor

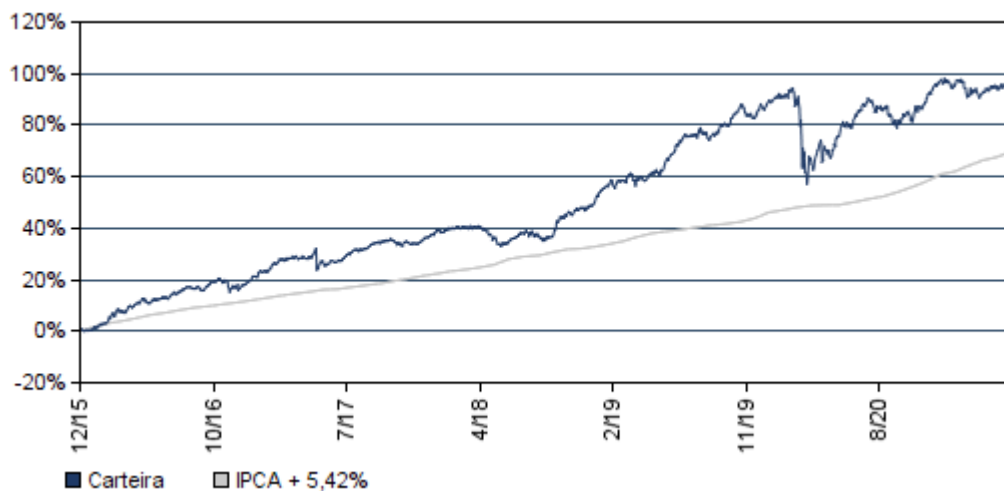


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

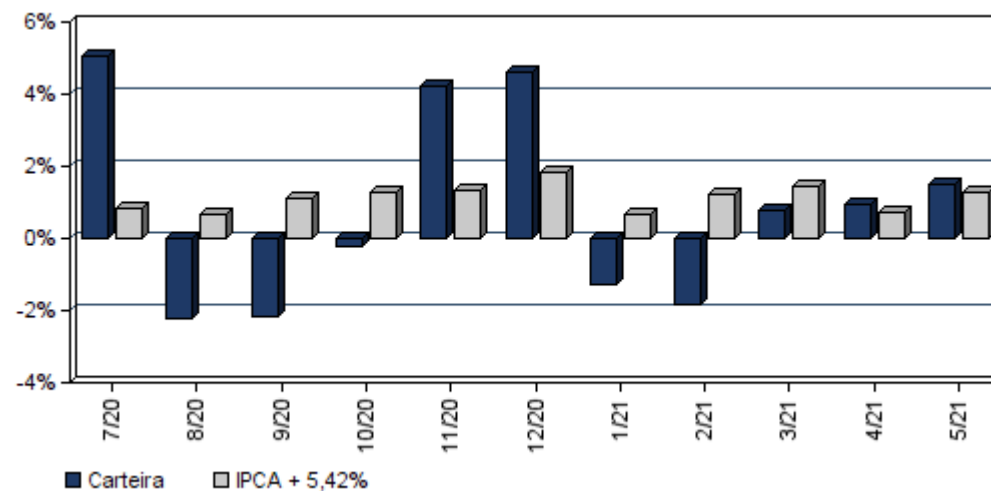
Rentabilidades da Carteira

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
2018	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
IPCA + 5,42%	0,75	0,70	0,53	0,66	0,84	1,71	0,79	0,39	0,88	0,91	0,21	0,57	9,32
p.p. Indx	2,12	-0,36	0,20	-0,67	-4,30	-2,59	1,60	-1,13	-0,90	5,47	1,38	0,99	1,65
2019	5,07	0,38	0,27	1,53	3,15	4,24	1,49	-0,20	2,82	3,60	-2,18	3,39	25,99
IPCA + 5,42%	0,78	0,85	1,15	1,01	0,59	0,41	0,67	0,57	0,40	0,58	0,93	1,60	9,98
p.p. Indx	4,29	-0,48	-0,88	0,52	2,56	3,83	0,82	-0,77	2,42	3,02	-3,11	1,79	16,01
2020	0,62	-1,33	-11,45	2,79	2,67	2,94	5,07	-2,24	-2,15	-0,24	4,20	4,59	4,35
IPCA + 5,42%	0,67	0,63	0,53	0,11	0,04	0,70	0,84	0,68	1,08	1,30	1,31	1,82	10,16
p.p. Indx	-0,06	-1,96	-11,98	2,68	2,63	2,24	4,23	-2,92	-3,24	-1,54	2,88	2,77	-5,81
2021	-1,27	-1,84	0,76	0,97	1,52	--	--	--	--	--	--	--	0,10
IPCA + 5,42%	0,67	1,24	1,42	0,73	1,27	--	--	--	--	--	--	--	5,45
p.p. Indx	-1,94	-3,08	-0,66	0,24	0,25	--	--	--	--	--	--	--	-5,35

Evolução da Rentabilidade



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco / Retorno da Carteira

	Qtd.	Perct.	Período	Rentabilidade (%)			Volat. Anual
				Carteira	IPCA + 5,42%	p.p. Indx.	
Meses acima do Benchmark	22	53,7%					
Meses abaixo do Benchmark	19	46,3%					
	Rentab.	Mês					
Maior rentabilidade da Carteira	6,39%	out/18	03 meses	3,29	3,46	-0,2	6,219
Menor rentabilidade da Carteira	-11,45%	mar/20	06 meses	4,69	7,36	-2,7	6,154
			12 meses	12,60	13,89	-1,3	7,250
			24 meses	18,82	22,29	-3,5	11,516
			36 meses	45,50	34,90	10,6	10,024
			Desde o início	97,62	69,70	27,9	8,536

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
FI BANESTES PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B Var. do IMA-B TOTAL p.p.	1,14 0,08	-4,56 -3,42	0,34 -0,91	3,02 -0,64	6,56 -2,60	8,87 -7,59	42,44 -1,65
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI Var. do IMA-B TOTAL p.p.	1,05 -0,00	-1,19 -0,05	1,22 -0,02	3,59 -0,07	8,90 -0,27	15,96 -0,50	43,05 -1,05
FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RF LP Var. do IMA-B TOTAL p.p.	1,04 -0,02	-1,23 -0,09	1,20 -0,05	3,55 -0,11	8,92 -0,25	15,71 -0,75	42,92 -1,18
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. do IMA-B 5 p.p.	0,69 -0,00	1,36 -0,06	1,89 -0,03	3,19 -0,09	7,12 -0,28	17,04 -0,51	22,13 -0,64
FI CAIXA BRASIL 2024 I TP RF Var. do IPCA + 6% p.p.	0,53 -0,79	-1,98 -7,66	2,10 -1,51	0,50 -7,15	1,57 -12,95	8,62 -15,01	21,22 -15,91
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. do IMA-GERAL TOTAL p.p.	0,48 -0,13	-0,79 -0,58	0,68 -0,05	1,57 -0,24	3,44 -0,76	11,29 -0,82	13,83 -0,65
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. do IMA-GERAL TOTAL p.p.	0,24 -0,38	0,72 0,93	1,21 0,48	1,38 0,49	1,38 0,49	1,38 0,49	1,38 0,49
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TP RF LP Var. do IMA-B 5 p.p.	0,67 -0,02	1,31 -0,11	1,85 -0,07	3,15 -0,12	3,72 -0,15	3,72 -0,15	3,72 -0,15

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.	1,35 -0,03	-3,37 -0,02	0,62 -0,03	3,85 -0,06	10,29 -0,40	14,80 -0,50	22,93 -0,80
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP RF LP Var. do IMA-B 5+ p.p.	1,39 0,01	-3,40 -0,05	0,63 -0,02	3,90 -0,00	10,54 -0,15	14,65 -0,65	50,39 -1,59
FI CAIXA ALIANÇA TP RF % do CDI	0,28 103,85	0,78 81,06	0,56 83,51	1,05 92,96	1,85 85,11	6,91 96,38	13,61 97,24
BANESTES ESTRATÉGIA FIC FI RF % do CDI	0,53 199,91	-1,05 -108,77	0,63 93,69	1,52 134,46	2,59 118,78	11,03 153,84	26,52 204,62
FI BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA Var. do IMA-B TOTAL p.p.	1,29 0,23	-4,79 -3,65	0,68 -0,56	2,91 -0,75	5,39 -3,78	6,74 -9,71	36,03 -8,06
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA Var. do IBOVESPA p.p.	6,08 -0,08	5,87 -0,18	14,52 -0,18	15,65 -0,26	43,63 -0,77	29,32 -0,76	62,71 -1,74
BANESTES FIC FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INST Var. do IBOVESPA p.p.	3,62 -2,54	3,12 -2,93	6,44 -8,26	8,46 -7,45	33,67 -10,74	38,26 8,19	88,71 24,27
CAIXA FI AÇÕES DIVIDENDOS Var. do IBOVESPA p.p.	8,10 1,94	3,88 -2,17	18,01 3,31	11,83 -4,07	25,48 -18,92	24,78 -5,30	68,35 -6,65
FIC FIA CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. do IBOVESPA p.p.	5,95 -0,21	5,64 -0,41	14,72 0,01	15,54 -0,37	36,82 -7,59	35,21 5,13	80,54 16,10
CAIXA FIC FIA MULTIGESTOR Var. do IBOVESPA p.p.	5,02 -1,13	6,07 0,02	12,00 -2,71	14,18 -1,73	38,19 -6,22	3,80 -7,23	3,80 -7,23
CAIXA RIO BRAVO FII Var. do Índice Fundos Imobiliários - IFIX p.p.	-2,97 -1,41	-31,08 -29,21	-4,81 -2,38	-34,18 -34,46	-24,22 -30,19	7,51 -2,83	15,27 -11,94
CAIXA FIA INSTITUCIONAL BDR NIVEL I Var. do Dolar Comercial p.p.	-3,79 -0,62	0,27 3,70	0,11 5,50	0,27 3,70	0,27 3,70	0,27 3,70	0,27 3,70
CDI	0,27	0,96	0,67	1,13	2,18	7,17	14,00
IMA - B	1,06	-1,14	1,25	3,66	9,17	16,46	44,09
IMA - B 5	0,69	1,42	1,92	3,27	7,39	17,55	33,09

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
IMA - B 5+	1,38	-3,35	0,65	3,91	10,69	15,30	52,84
IMA - GERAL	0,61	-0,21	0,73	1,81	4,20	12,11	27,53
IRF - M	0,20	-1,79	0,19	0,13	0,71	12,10	27,04
IRF - M 1	0,20	0,60	0,52	0,91	2,11	8,57	16,37
IRF - M 1+	0,20	-3,51	-0,14	-0,57	-0,28	13,33	31,30
IBOVESPA	6,16	6,05	14,70	15,91	44,41	30,08	64,44
IFIX	-1,56	-1,87	-2,43	0,28	5,97	10,33	27,21
SMALL CAP	6,32	10,00	16,04	18,26	57,75	55,08	97,90
IPCA + 6%	1,32	5,68	3,61	7,65	14,51	23,63	37,13
INPC + 6%	1,45	5,80	3,74	7,89	15,40	24,81	38,59
Dolar Comercial	-3,17	0,68	-5,39	-1,87	-3,58	32,77	40,01
IBRX 100	5,92	8,14	15,50	18,03	47,63	34,45	72,38
IBRX 50	6,18	8,39	15,91	18,61	49,33	32,34	65,03
IGPM	4,10	14,41	8,78	15,51	37,06	45,97	57,15
INPC	0,96	3,33	2,22	4,84	8,90	11,13	16,44

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
<i>IPCA</i>	0,83	3,22	2,08	4,61	8,06	10,08	15,21
<i>IPCA + 5,42%</i>	1,27	5,45	3,46	7,36	13,89	22,29	34,90