

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 IMA-B TP	5,81%	0,69	3,63%	-0,04%	10,92%	3.696.106,30	3,19%	5.232.773.054,08	0,07%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IMAB TP FI RF LP	5,83%	0,69	3,63%	-0,03%	10,98%	20.605.751,07	17,80%	10.160.570.915,80	0,20%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IRFM 1 TP FI RF	0,52%	0,08	0,65%	-0,02%	2,64%	19.114.529,51	16,52%	15.240.544.601,45	0,13%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IMA GERAL TP RF LP	2,81%	0,34	1,81%	-0,03%	5,55%	61.637,41	0,05%	1.470.663.325,13	0,00%
ITAU	ITAU	ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI	8,48%	0,99	5,16%	-0,04%	15,03%	3.035.043,78	2,62%	47.325.240,08	6,41%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IMA B 5+ TP RF LP	8,42%	0,98	5,11%	-0,09%	15,03%	13.003.857,63	11,24%	2.455.566.753,69	0,53%
CEF	CEF	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RF LP	2,29%	0,28	1,06%	-0,31%	4,70%	8.647.724,92	7,47%	8.833.466.098,85	0,10%
CEF	CEF	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 II TP RF	7,86%	0,89	4,18%	0,52%	9,47%	1.722.306,00	1,49%	63.403.714,18	2,72%
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF ALOCACAO ATIVA FICFI	2,94%	0,36	2,02%	0,19%	5,93%	11.357.892,84	9,81%	6.585.019.923,99	0,17%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - 4604 - Fundos 100% Títulos Públicos - Referenciado				0,52				81.244.849,46	70,20%		
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Renda Fixa											
BRADESCO	BRADESCO	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	0,01%	0,03	0,54%	99,60%	2,56%	723.562,18	0,63%	6.722.517.924,18	0,01%
ITAU	ITAU	ITAÚ SOBERANO REFERENCIADO DI LP	0,00%	0,02	0,53%	97,64%	0,55%	406.777,56	0,35%	11.472.241.724,13	0,00%
BRADESCO	BRADESCO	BRADESCO FI RF IMA-B5+	8,46%	0,99	5,17%	-0,03%	15,08%	3.051.572,09	2,64%	327.390.689,61	0,93%
BRADESCO	BRADESCO	BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA - B 5	3,12%	0,37	1,39%	0,01%	5,37%	13.828.897,14	11,95%	697.895.785,29	1,98%
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Renda Fixa				0,46				18.010.808,97	15,56%		
Artigo 7º VII, Alínea b - 4604 - Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"											
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV	0,03%	0,03	0,53%	97,17%	2,51%	132.240,65	0,11%	2.472.061.397,76	0,01%
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b - 4604 - Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"				0,03				132.240,65	0,11%		
Sub-total Renda Fixa				0,51				99.387.899,08	85,88%		
Renda Variável											
Artigo 8º II, Alínea a - 4604 - Fundos de Ações											
BRADESCO	BRADESCO	BRADESCO FI EM AÇÕES DIVIDENDOS	20,14%	2,20	0,68%	-2,46%	8,15%	2.366.760,64	2,05%	2.566.714.432,15	0,09%

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
AZ QUEST	BNY MELLON	AZ QUEST ACOES FC FIA	21,94%	2,37	0,48%	-0,23%	6,37%	253.578,65	0,22%	860.840.536,40	0,03%
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	19,93%	2,16	2,13%	1,42%	11,80%	3.704.374,76	3,20%	98.594.944,68	3,76%
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FI DE AÇÕES	20,18%	2,23	3,30%	2,59%	11,87%	3.168.525,28	2,74%	1.034.547.286,29	0,31%
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	18,24%	2,00	1,81%	1,11%	18,16%	2.841.982,40	2,46%	236.945.180,92	1,20%
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a - 4604 - Fundos de Ações				2,15				12.335.221,73	10,66%		
Artigo 8º III - 4604 - Fundos Multimercados											
SAFRA	SAFRA	SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	1,30%	0,16	0,60%	109,98%	2,54%	2.285.186,74	1,97%	1.728.177.967,34	0,13%
SAFRA	BANCO J SAFRA SA	SAFRA S P REAIS PB FI MULT	13,72%	1,45	-6,35%	-7,05%	10,94%	1.723.126,97	1,49%	343.811.801,76	0,50%
Sub-total Artigo 8º III - 4604 - Fundos Multimercados				0,71				4.008.313,71	3,46%		
Sub-total Renda Variável				1,80				16.343.535,44	14,12%		
Total								115.731.434,52	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	81.244.849,46	70,20%	60,00%	100,00%
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604	Fundos de Renda Fixa	18.010.808,97	15,56%	10,00%	40,00%
Artigo 7º VII, Alínea b - 4604	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	132.240,65	0,11%	2,00%	5,00%
Total Renda Fixa		99.387.899,08	85,87%		
Renda Variável					
Artigo 8º II, Alínea a - 4604	Fundos de Ações	12.335.221,73	10,66%	10,00%	20,00%
Artigo 8º III - 4604	Fundos Multimercados	4.008.313,71	3,46%	3,00%	10,00%
Total Renda Variável		16.343.535,44	14,12%		

Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)				
Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
Artigo 7º I, Alínea b - 4604 % do CDI	2,71 499,4	8,38 323,1	17,87 280,5	27,81 191,2
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 % do CDI	1,96 361,1	6,73 259,6	15,43 242,1	- -
Artigo 7º VII, Alínea b - 4604 % do CDI	0,53 97,2	2,51 96,8	6,17 96,8	14,18 97,5
Artigo 8º II, Alínea a - 4604 Var. IBOVESPA p.p	2,02 1,3	12,71 2,3	23,98 -2,4	- -
Artigo 8º III - 4604 Var. IBOVESPA p.p	-2,51 -3,2	4,46 -5,9	6,37 -20,1	- -

Ganhos Financeiros	
Estratégia	No Mês(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b - 4604	2.124.786,86
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604	346.232,75
Artigo 7º VII, Alínea b - 4604	694,13
Artigo 8º II, Alínea a - 4604	244.420,45
Artigo 8º III - 4604	-103.255,16
Total	2.612.879,04

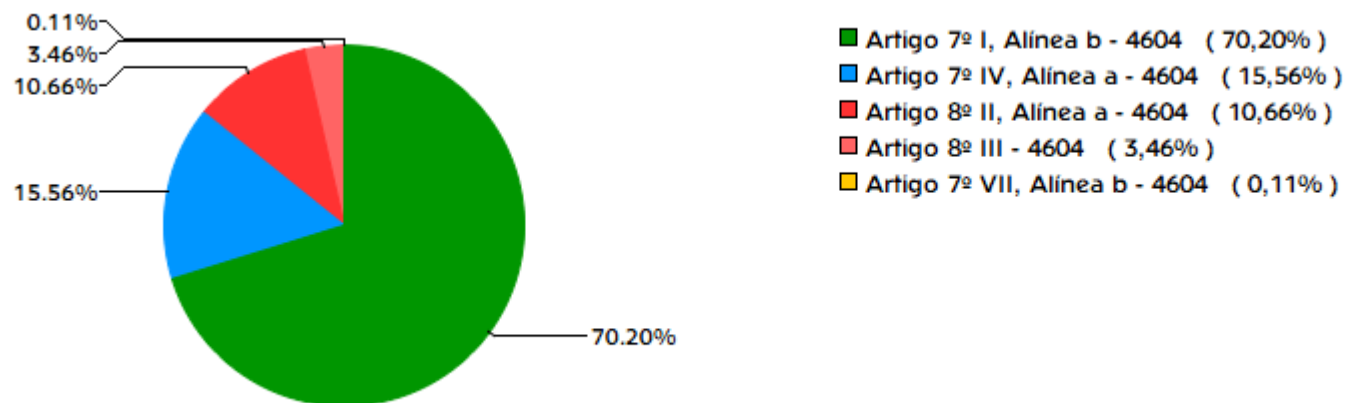
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise da Disponibilidade Financeira

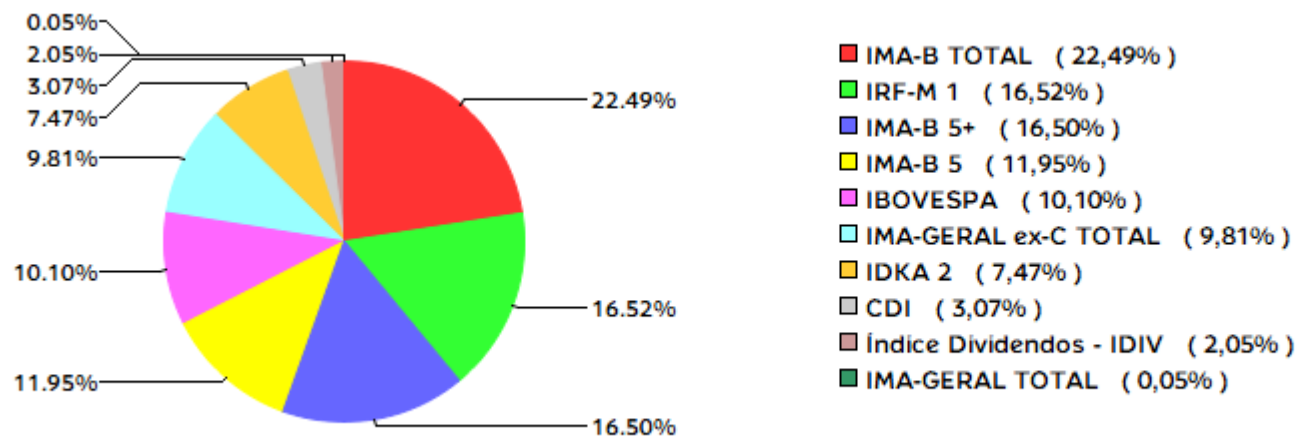
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acum. Bruto (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	114.009.128,52	99	114.009.128,52	99
acima de 365 dias	1.722.306,00	1	115.731.434,52	100

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia

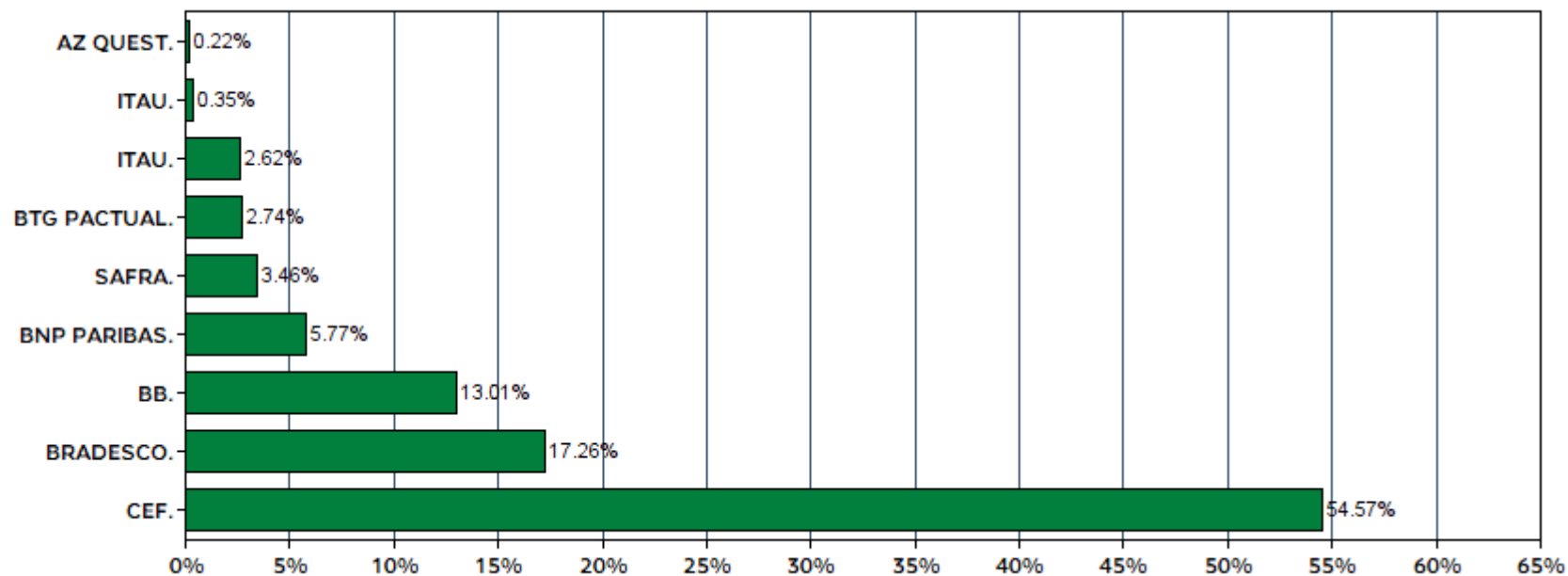


Indexadores



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

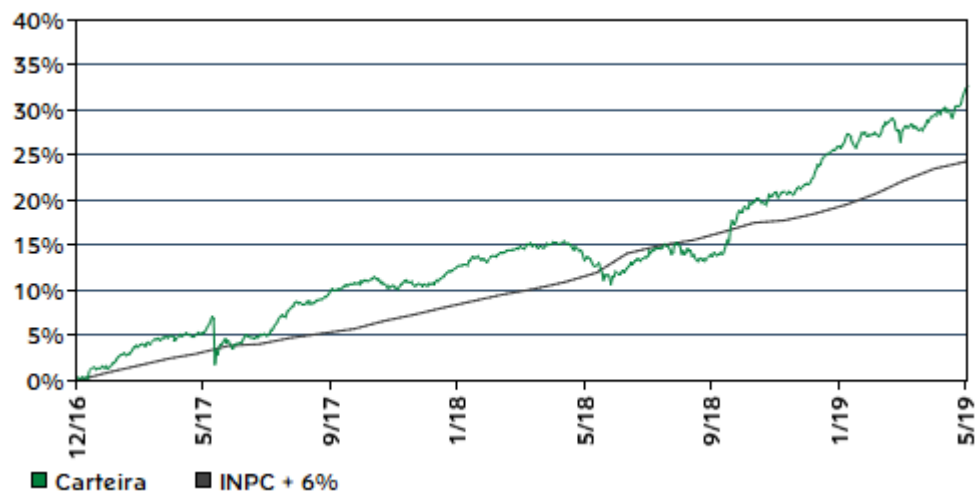
Alocação por Gestor



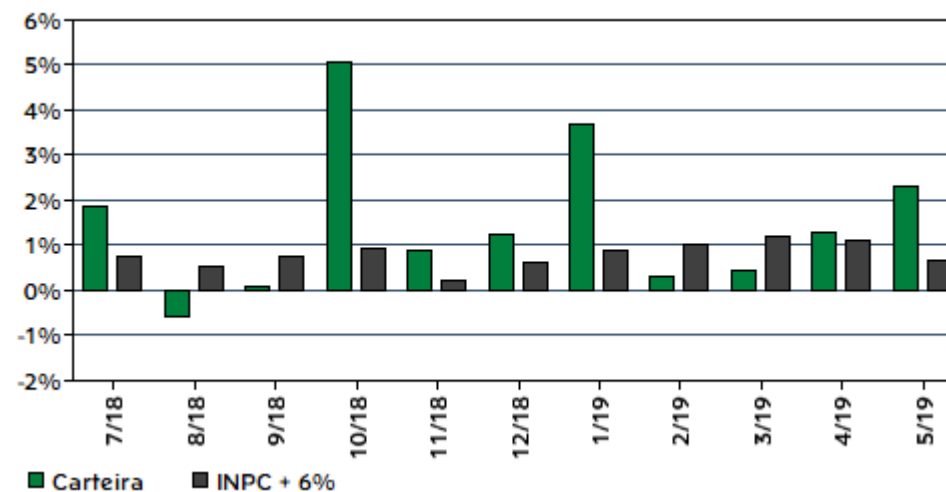
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira													
Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
2017	1,43	2,24	1,15	0,15	-0,53	0,43	2,86	1,21	1,36	0,03	-0,23	0,89	11,50
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	0,50	1,58	0,29	-0,34	-1,40	0,24	2,21	0,71	0,91	-0,83	-0,88	0,16	3,39
2018	1,94	0,46	0,85	0,19	-2,24	-0,23	1,89	-0,59	0,08	5,08	0,90	1,27	9,83
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	1,20	-0,14	0,29	-0,51	-3,16	-2,15	1,12	-1,12	-0,66	4,16	0,69	0,66	0,24
2019	3,68	0,31	0,43	1,28	2,33	-	-	-	-	-	-	-	8,24
INPC + 6%	0,87	1,01	1,21	1,09	0,66	-	-	-	-	-	-	-	4,94
p.p. Indx	2,81	-0,70	-0,78	0,19	1,67	-	-	-	-	-	-	-	3,31

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	5,08%	out/18
Menor rentabilidade da Carteira	-2,24%	mai/18

Período	Rentabilidade (%)			Volat. Anual
	Carteira	INPC + 6%	p.p. Indx.	
03 meses	4,09	2,99	1,1	4,806
06 meses	9,61	5,57	4,0	4,075
12 meses	17,54	11,04	6,5	4,511
24 meses	26,84	19,70	7,1	3,685
36 meses	--	--	--	--
Desde o início	32,56	24,33	8,2	4,832

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 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
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
CAIXA FI BRASIL IMA GERAL TP RF LP % do Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	1,81 -0,03	5,55 -0,23	3,16 -0,14	6,77 -0,24	13,35 -0,41	23,29 -0,96	42,39 -0,94
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 CAIXA BRASIL 2030 II TP RF % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	4,18 0,52	9,47 -1,59	6,18 0,34	11,03 -1,86	19,74 -3,99	23,03 -11,49	34,94 -20,19

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
ITAÚ RF IMAB5+ FIC DE FI % do Var. IMA-B 5+ p.p.	5,16 -0,04	15,03 -0,25	7,44 -0,11	17,14 -0,31	31,77 -0,79	40,58 -1,54	64,18 -2,70
BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM % do % do CDI	0,54 99,60	2,56 98,91	1,53 99,42	3,06 98,82	6,28 98,51	14,67 100,88	30,37 102,16
BRADESCO FI RF IMA-B5+ % do Var. IMA-B 5+ p.p.	5,17 -0,03	15,08 -0,21	7,41 -0,14	17,21 -0,24	32,13 -0,43	41,08 -1,03	65,50 -1,38
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA – B 5 % do Var. IMA-B 5 p.p.	1,39 0,01	5,37 -0,10	3,23 -0,08	6,81 -0,10	13,03 -0,19	23,91 -0,43	39,16 -0,56
ITAÚ SOBERANO REFERENCIADO DI LP % do % do CDI	0,53 97,64	2,53 97,60	1,50 97,63	3,03 97,60	6,22 97,64	14,29 98,27	29,24 98,36
BNPP MATCH DI FI REFERENCIADO CRED PRIV % do % do CDI	0,53 97,17	2,51 96,83	1,51 98,37	3,01 97,15	6,17 96,80	14,18 97,48	29,60 99,55
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES % do Var. IBOVESPA p.p.	2,13 1,42	11,80 1,40	3,63 2,11	15,91 7,50	20,38 -6,04	36,42 -18,31	95,38 -4,80
AZ QUEST ACOES FC FIA % do Var. IBOVESPA p.p.	0,48 -0,23	6,37 -4,03	1,43 -0,08	6,34 -2,07	22,54 -3,88	66,38 11,65	104,30 4,12
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES % do Var. IBOVESPA p.p.	1,81 1,11	18,16 7,76	3,94 2,43	19,43 11,02	29,52 3,10	31,80 -22,93	63,70 -36,49
BRADESCO FI EM AÇÕES DIVIDENDOS % do Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	0,68 -2,46	8,15 –	0,59 -3,84	8,42 -7,41	27,28 -9,81	55,35 1,29	107,24 -22,33
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FI DE AÇÕES % do Var. IBOVESPA p.p.	3,30 2,59	11,87 1,47	5,91 4,40	15,09 6,69	36,46 10,04	61,71 6,99	84,02 -16,16
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO % do % do CDI	0,60 109,98	2,54 97,86	1,35 87,64	2,91 93,76	6,92 108,69	15,40 105,89	29,99 100,89
SAFRA S P REAIS PB FI MULT % do Var. IBOVESPA p.p.	-6,35 -7,05	10,94 0,54	-0,26 -1,77	1,83 -6,58	4,77 -21,65	25,27 -29,45	62,20 -37,99
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

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
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