

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos											
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	VAR	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (28/06/2019)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
Renda Fixa											
Artigo 7º I, Alínea b - 4604 - Fundos 100% Títulos Públicos - Referenciado											
ITAU	ITAU	ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FUNDO DE INVESTIMENTO	0,34%	0,06	0,57%	-0,01%	3,19%	30.315.146,15	8,71%	223.926.405,52	13,54%
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	5,49%	0,67	3,71%	-0,02%	14,99%	22.451.266,71	6,45%	411.945.374,31	5,45%
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,34%	0,06	0,57%	-0,01%	3,21%	957.727,65	0,28%	8.658.506.681,68	0,01%
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF IMA-B TP	5,50%	0,67	3,71%	-0,02%	15,04%	45.927.849,91	13,19%	5.680.713.627,62	0,81%
BRADESCO	BRADESCO	BRADESCO FI RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS	5,50%	0,67	3,71%	-0,03%	15,00%	66.911.273,50	19,21%	820.142.345,19	8,16%
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,33%	0,06	0,57%	-0,01%	3,21%	741.257,68	0,21%	230.345.702,25	0,32%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IRFM 1 TP FI RF	0,33%	0,06	0,57%	-0,01%	3,23%	43.822.291,85	12,58%	14.698.908.177,11	0,30%
BRADESCO	BRADESCO	BRADESCO FI RF IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS	0,33%	0,06	0,56%	-0,02%	3,19%	599.891,60	0,17%	1.044.281.523,16	0,06%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IMA GERAL TP RF LP	2,56%	0,32	1,92%	-0,08%	7,58%	1.085.586,75	0,31%	1.490.732.072,01	0,07%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP FI RF LP	2,45%	0,31	1,70%	-0,02%	7,17%	38.691.125,45	11,11%	9.928.411.976,46	0,39%
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2 FI	1,74%	0,23	1,11%	-0,13%	5,76%	35.045.679,06	10,06%	7.591.725.749,08	0,46%
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	5,50%	0,67	3,71%	-0,03%	15,03%	41.556.525,37	11,93%	1.015.720.207,38	4,09%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - 4604 - Fundos 100% Títulos Públicos - Referenciado				0,44				328.105.621,68	94,22%		
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Renda Fixa											
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	0,02%	0,03	0,46%	98,73%	3,09%	15.589,17	0,00%	4.715.980.751,05	0,00%
BB	BB	BB RPPS RF PERFIL FIC	0,04%	0,03	0,46%	97,56%	2,31%	320.086,22	0,09%	3.283.915.059,19	0,01%
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	2,15%	0,27	2,55%	2,54%	3,63%	17.736.506,51	5,09%	4.747.724.011,50	0,37%
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Renda Fixa				0,27				18.072.181,90	5,19%		
Sub-total Renda Fixa				0,43				346.177.803,58	99,41%		
Renda Variável											
Artigo 8º II, Alínea a - 4604 - Fundos de Ações											
CEF	CEF	FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL	25,33%	2,84	14,72%	3.139,52%	23,64%	2.059.926,23	0,59%	30.574.631,13	6,74%
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a - 4604 - Fundos de Ações				2,84				2.059.926,23	0,59%		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos											
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	VAR	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (28/06/2019)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
		Sub-total Renda Variável		2,84				2.059.926,23	0,59%		
Total								348.237.729,81	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	328.105.621,68	94,22%	81,00%	100,00%
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604	Fundos de Renda Fixa	18.072.181,90	5,19%	14,00%	40,00%
Total Renda Fixa		346.177.803,58	99,41%		
Renda Variável					
Artigo 8º II, Alínea a - 4604	Fundos de Ações	2.059.926,23	0,59%	5,00%	20,00%
Total Renda Variável		2.059.926,23	0,59%		

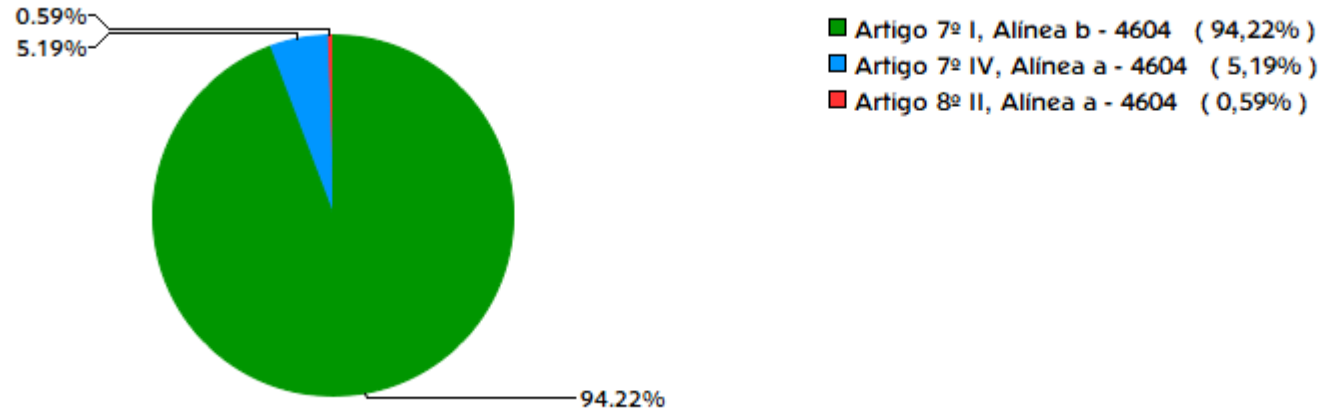
Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)				
Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
Artigo 7º I, Alínea b - 4604 % do CDI	2,39 509,4	6,74 219,1	-- --	-- --
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 % do CDI	2,31 492,8	6,62 215,4	-- --	-- --
Artigo 8º II, Alínea a - 4604 Var. IBOVESPA p.p	14,72 10,7	23,64 8,8	-- --	-- --

Ganhos Financeiros	
Estratégia	No Mês(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b - 4604	7.682.915,33
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604	450.743,08
Artigo 8º II, Alínea a - 4604	264.292,61
Total	8.397.951,02

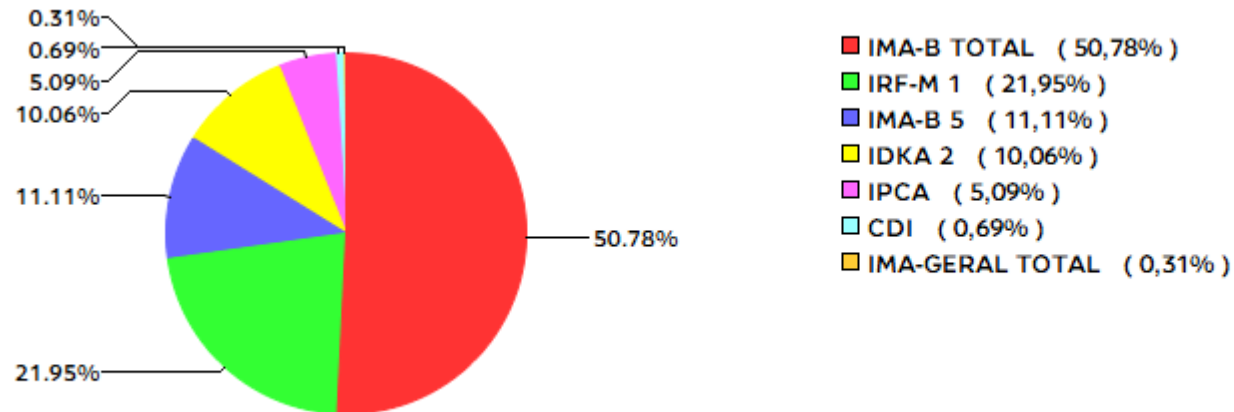
Análise da Disponibilidade Financeira				
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acum. Bruto (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	348.237.729,81	100	348.237.729,81	100

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia

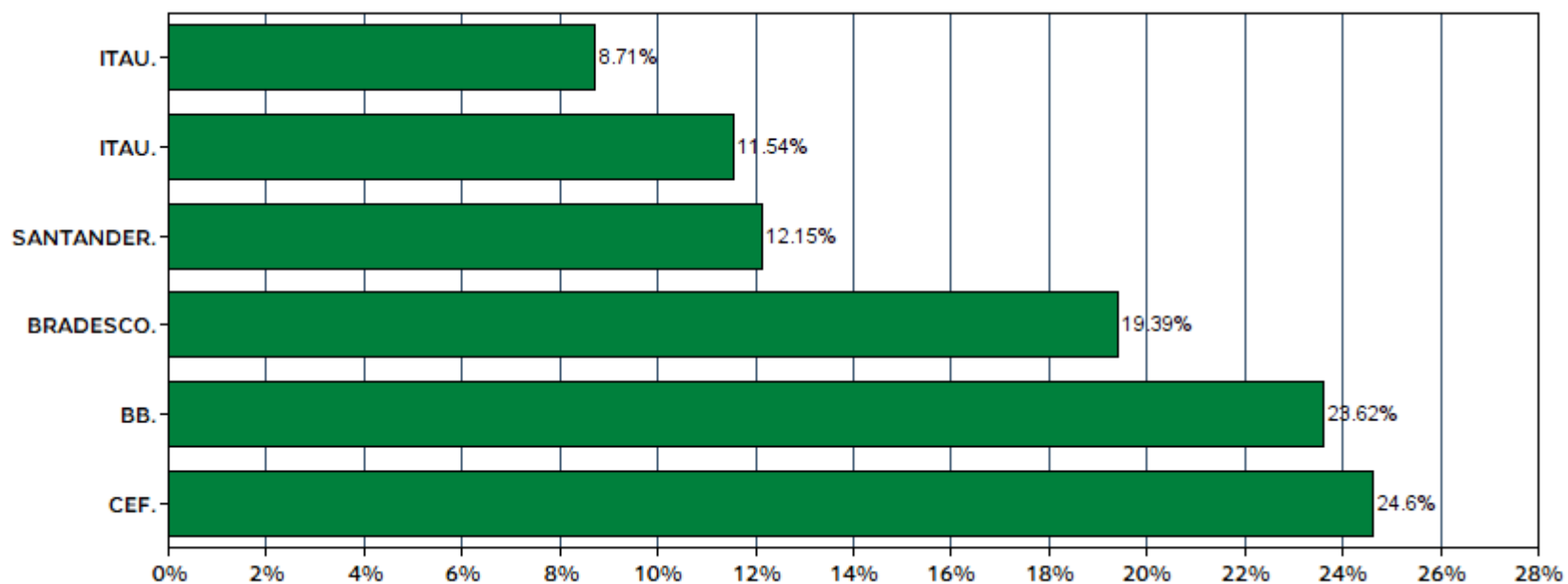


Indexadores



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor

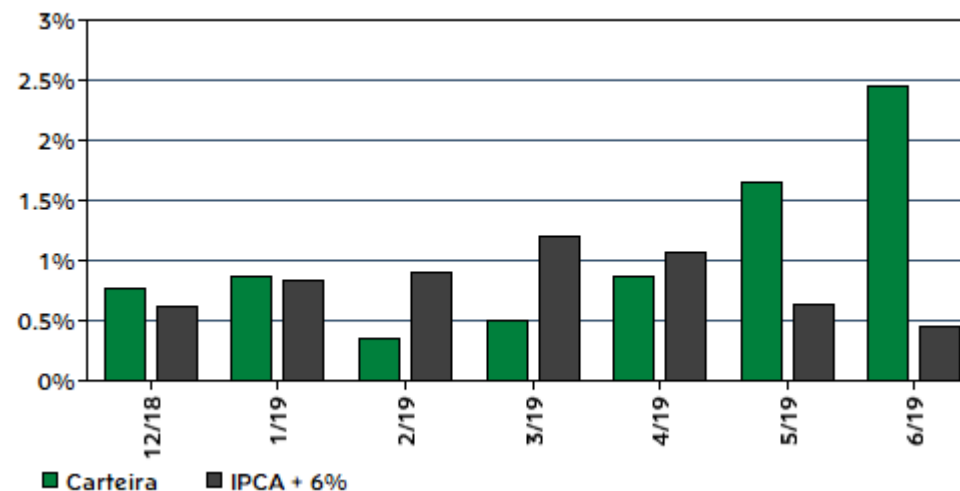
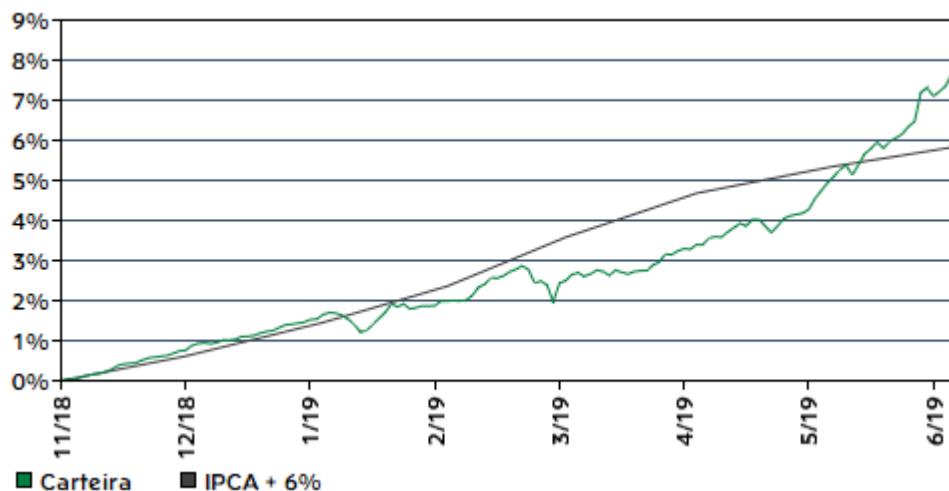


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira													
Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
2018	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	0,76	0,76
IPCA + 6%	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	0,61	0,61
p.p. Indx	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	0,15	0,15
2019	0,87	0,34	0,50	0,87	1,64	2,45	--	--	--	--	--	--	6,85
IPCA + 6%	0,83	0,90	1,19	1,06	0,64	0,45	--	--	--	--	--	--	5,18
p.p. Indx	0,04	-0,55	-0,69	-0,19	1,00	2,00	--	--	--	--	--	--	1,67

Evolução da Rentabilidade

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco / Retorno da Carteira

	Qtd.	Perct.
Meses acima do Benchmark	4	57,1%
Meses abaixo do Benchmark	3	42,9%

	Rentab.	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,45%	jun/19
Menor rentabilidade da Carteira	0,34%	fev/19

Período	Rentabilidade (%)			Volat. Anual
	Carteira	IPCA + 6%	p.p. Indx.	
03 meses	5,04	2,17	2,9	2,166
06 meses	6,85	5,18	1,7	2,059
12 meses	--	--	--	--
24 meses	--	--	--	--
36 meses	--	--	--	--
Desde o início	7,67	5,82	1,8	1,917

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 RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,57 -0,01	3,21 -0,11	1,73 -0,04	3,21 -0,11	7,04 -0,19	15,12 -0,47	30,28 -0,88
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 FI % do Var. IDKA 2 p.p.	1,11 -0,13	5,76 -0,49	3,19 -0,49	5,76 -0,49	11,97 -1,27	22,82 -1,71	37,67 -2,91
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	3,71 -0,02	15,04 -0,17	9,08 -0,07	15,04 -0,17	28,39 -0,37	38,55 -0,77	56,73 -1,15
BRADESCO FI RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	3,71 -0,03	15,00 -0,20	9,05 -0,11	15,00 -0,20	28,30 -0,46	38,35 -0,96	56,20 -1,68
BRADESCO FI RF IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,56 -0,02	3,19 -0,13	1,70 -0,06	3,19 -0,13	6,98 -0,25	15,08 -0,52	30,30 -0,86
CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP FI RF LP % do Var. IMA-B 5 p.p.	1,70 -0,02	7,17 -0,12	4,20 -0,06	7,17 -0,12	14,47 -0,18	25,32 -0,49	40,02 -0,78
CAIXA FI BRASIL IMA GERAL TP RF LP % do Var. IMA-GERAL TOTAL p.p.	1,92 -0,08	7,58 -0,32	4,61 -0,16	7,58 -0,32	15,44 -0,46	24,63 -1,08	42,61 -0,98
CAIXA FI BRASIL IRFM 1 TP FI RF % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,57 -0,01	3,23 -0,09	1,74 -0,03	3,23 -0,09	7,09 -0,13	15,23 -0,37	30,51 -0,65

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
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	3,71 -0,02	14,99 -0,22	9,09 -0,06	14,99 -0,22	28,13 -0,63	38,00 -1,32	55,64 -2,24
ITAÚ SOBERANO RENDA FIXA IRFM 1 FUNDO DE INVESTIMENTO % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,57 -0,01	3,19 -0,13	1,69 -0,08	3,19 -0,13	6,99 -0,24	15,09 -0,51	30,22 -0,94
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,57 -0,01	3,21 -0,11	1,73 -0,04	3,21 -0,11	7,14 -0,09	15,24 -0,36	30,75 -0,41
SANTANDER FIC FI IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS RF LP % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	3,71 -0,03	15,03 -0,18	9,06 -0,09	15,03 -0,18	28,44 -0,32	38,61 -0,70	56,83 -1,04
BB RPPS RF PERFIL FIC % do % do CDI	0,46 97,56	3,01 97,82	1,50 97,64	3,01 97,82	6,19 98,00	14,07 99,38	28,94 100,35
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI % do Var. IPCA p.p.	2,55 2,54	8,36 6,13	5,08 4,37	8,36 6,13	12,90 9,53	24,68 16,77	42,29 31,15
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI % do % do CDI	0,46 98,73	3,09 100,38	1,52 98,78	3,09 100,38	6,31 99,89	14,14 99,90	29,16 101,11
FUNDO DE INVESTIMENTO EM AÇÕES CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL % do % do CDI	14,72 3.139,52	23,64 768,83	23,05 1.498,72	23,64 768,83	62,40 987,55	49,08 346,82	63,52 220,24
CDI	0,47	3,07	1,54	3,07	6,32	14,15	28,84
IBOVESPA	4,06	14,88	5,82	14,88	38,76	60,52	95,95
DOLAR COMERCIAL	-2,75	-1,10	-1,66	-1,10	-0,61	15,84	19,39
INPC + 6%	0,45	5,41	2,22	5,41	9,44	20,01	30,44
IPCA + 6%	0,45	5,18	2,17	5,18	9,49	21,07	32,16