

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 a - Títulos do Tesouro Nacional											
TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	NTN-B 150535	0,00%	0,00	4,55%	0,81%	20,48%	111.620.940,23	21,58%	--	--
TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	NTN-B 150824	0,00%	0,00	3,00%	-0,73%	10,79%	10.016.743,04	1,94%	--	--
TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850	0,00%	0,00	6,03%	6,02%	25,53%	12.732.522,32	2,46%	--	--
TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545	0,00%	0,00	5,56%	5,55%	23,59%	9.458.266,73	1,83%	--	--
TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523	0,00%	0,00	2,39%	-1,35%	9,36%	21.207.795,16	4,10%	--	--
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a - Títulos do Tesouro Nacional				0,00				165.036.267,48	31,90%		
Artigo 7º I, Alínea b - 4604 - Fundos 100% Títulos Públicos - Referenciado											
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF TIT PUBL IPCA FI	4,05%	0,49	2,37%	1,92%	9,26%	15.840.184,13	3,06%	329.162.080,10	4,81%
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII	1,79%	0,23	1,02%	-2,71%	5,64%	16.146.146,28	3,12%	678.685.754,82	2,38%
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF ALOCACAO ATIVA FICFI	2,77%	0,35	2,17%	0,22%	8,23%	5.824.968,01	1,13%	7.006.317.796,94	0,08%
CEF	CEF	FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 II TP RF..	7,39%	0,86	3,66%	-0,08%	16,31%	16.424.401,20	3,17%	65.721.287,79	24,99%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF..	6,35%	0,72	2,98%	-0,75%	10,67%	19.116.825,00	3,70%	207.583.261,40	9,21%
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI	5,12%	0,60	1,59%	1,14%	7,23%	9.219.606,56	1,78%	873.175.893,18	1,06%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - 4604 - Fundos 100% Títulos Públicos - Referenciado				0,57				82.572.131,18	15,96%		
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%	33.136.515,26	6,41%	4.715.980.751,05	0,70%
ITAU	ITAU	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RENDA FIXA FUNDO DE INVESTIMENTO EM COTAS DE FI	2,15%	0,27	2,55%	2,54%	8,36%	95.686.802,77	18,50%	4.747.724.011,50	2,02%
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Renda Fixa				0,21				128.823.318,03	24,90%		
Artigo 7º VII, Alínea b - 4604 - Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"											
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	2,31%	0,30	1,31%	0,86%	6,74%	3.659.794,66	0,71%	556.528.091,89	0,66%
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b - 4604 - Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"				0,30				3.659.794,66	0,71%		
Sub-total Renda Fixa				0,20				380.091.511,35	73,47%		
Renda Variável											

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
Artigo 8º I, Alínea a - 4604 - Fundos de Ações Referenciados											
ITAU	ITAU	ITAU FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	19,31%	2,14	4,68%	0,62%	14,51%	37.063.447,82	7,16%	868.670.247,55	4,27%
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a - 4604 - Fundos de Ações Referenciados				2,14				37.063.447,82	7,16%		
Artigo 8º II, Alínea a - 4604 - Fundos de Ações											
AZ QUEST	BNY MELLON	AZ QUEST ACOES FC FIA	20,64%	2,27	3,39%	-0,67%	9,97%	10.743.565,46	2,08%	846.353.914,80	1,27%
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES	18,50%	2,07	4,92%	0,87%	17,97%	6.942.857,95	1,34%	63.952.296,59	10,86%
AZ QUEST	BNY MELLON	AZ QUEST SMALL MID CAPS FC FI DE ACOES	20,47%	2,26	5,50%	1,45%	11,30%	15.666.817,86	3,03%	970.942.755,01	1,61%
WESTERN	WESTERN	WA ASSET VALUATION FIA	20,16%	2,22	5,27%	1,21%	14,64%	7.879.541,96	1,52%	126.797.038,34	6,21%
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FI DE AÇÕES	19,23%	2,15	4,85%	0,79%	17,29%	40.625.670,27	7,85%	1.166.691.586,42	3,48%
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALAOR DIVIDENDOS RPPS ..	16,45%	1,87	5,82%	2,71%	21,05%	3.311.085,40	0,64%	654.515.196,78	0,51%
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a - 4604 - Fundos de Ações				2,17				85.169.538,90	16,46%		
Artigo 8º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Participações											
KINEA	KINEA	FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II..	--%	--	-0,05%	-11,66%	-19,55%	8.206.965,35	1,59%	58.235.593,11	14,09%
KINEA	LIONS TRUST	KINEA PE IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP ME	0,00%	0,00	-0,50%	-0,95%	15,90%	6.790.712,17	1,31%	108.311.858,91	6,27%
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Participações				0,00				14.997.677,52	2,90%		
Sub-total Renda Variável				1,93				137.230.664,24	26,53%		
Total								517.322.175,59	100%		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira					
Artigo	Classe	Valor(R\$)	% Carteira	Política Investimento	Limite Res. 3.922/10
Renda Fixa					
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	165.036.267,48	31,90%	31,00%	100,00%
Artigo 7º I, Alínea b - 4604	Fundos 100% Títulos Públicos - Referenciado	82.572.131,18	15,96%	16,00%	100,00%
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604	Fundos de Renda Fixa	128.823.318,03	24,90%	22,00%	40,00%
Artigo 7º VII, Alínea b - 4604	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	3.659.794,66	0,71%	1,00%	5,00%
Total Renda Fixa		380.091.511,35	73,47%		
Renda Variável					
Artigo 8º I, Alínea a - 4604	Fundos de Ações Referenciados	37.063.447,82	7,16%	7,00%	30,00%
Artigo 8º II, Alínea a - 4604	Fundos de Ações	85.169.538,90	16,46%	20,00%	20,00%
Artigo 8º IV, Alínea a - 4604	Fundos de Participações	14.997.677,52	2,90%	3,00%	5,00%
Total Renda Variável		137.230.664,24	26,52%		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)				
Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	4,34 925,3	18,83 612,6	35,58 563,0	45,26 319,8
Artigo 7º I, Alínea b - 4604 % do CDI	2,39 510,7	9,87 320,9	20,17 319,1	30,71 217,0
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 % do CDI	2,00 426,2	6,87 223,6	10,58 167,5	-- --
Artigo 7º VII, Alínea b - 4604 % do CDI	1,31 278,4	6,74 219,2	14,93 236,3	-- --
Artigo 8º I, Alínea a - 4604 Var. IBOVESPA p.p	4,68 0,6	14,51 -0,4	38,04 -0,7	-- --
Artigo 8º II, Alínea a - 4604 Var. IBOVESPA p.p	4,86 0,8	15,31 0,4	40,10 1,3	-- --
Artigo 8º IV, Alínea a - 4604 Var. IBOVESPA p.p	-0,26 -4,3	-25,25 -40,1	-35,94 -74,7	1.051.572,19 1.051.511,7

Ganhos Financeiros	
Estratégia	No Mês(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a	6.861.894,74
Artigo 7º I, Alínea b - 4604	1.930.814,05
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604	2.532.457,36
Artigo 7º VII, Alínea b - 4604	47.157,88
Artigo 8º I, Alínea a - 4604	1.656.981,90
Artigo 8º II, Alínea a - 4604	3.949.064,85
Artigo 8º IV, Alínea a - 4604	-38.612,74
Total	16.939.758,04

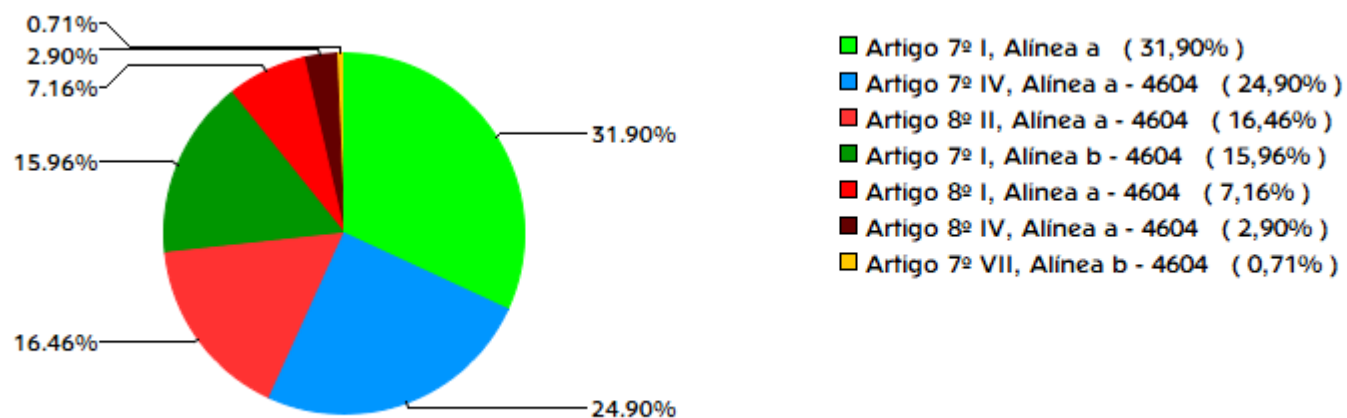
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise da Disponibilidade Financeira

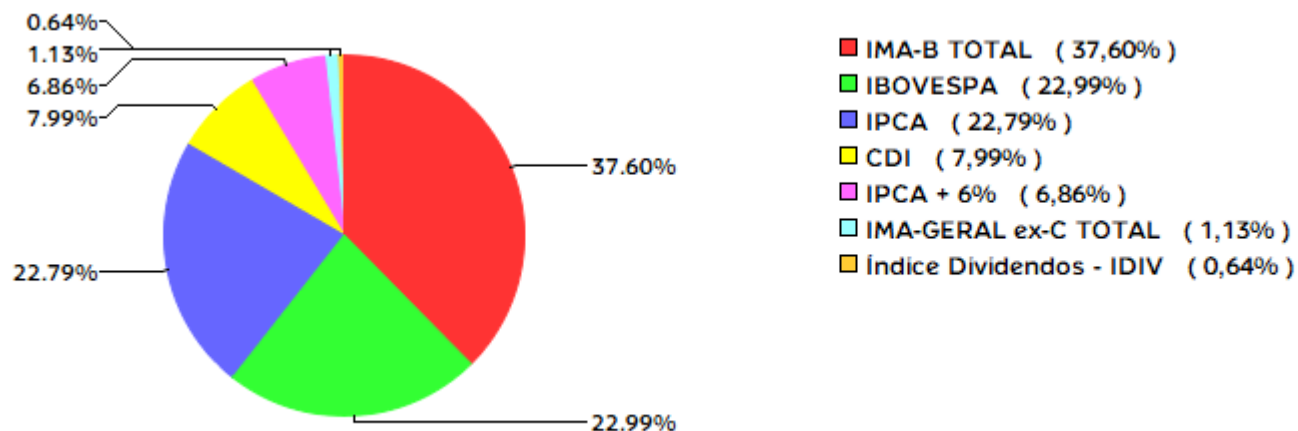
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acum. Bruto (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	291.963.146,14	56	291.963.146,14	56
acima de 365 dias	225.359.029,45	44	517.322.175,59	100

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia

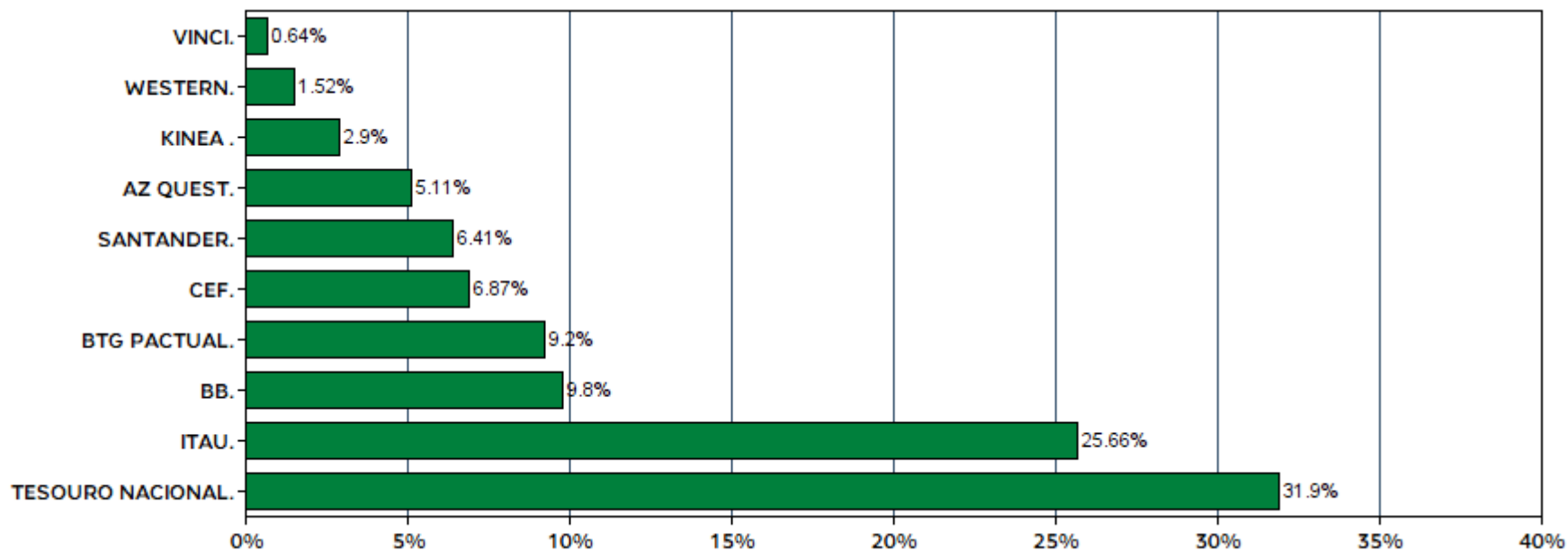


Indexadores



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

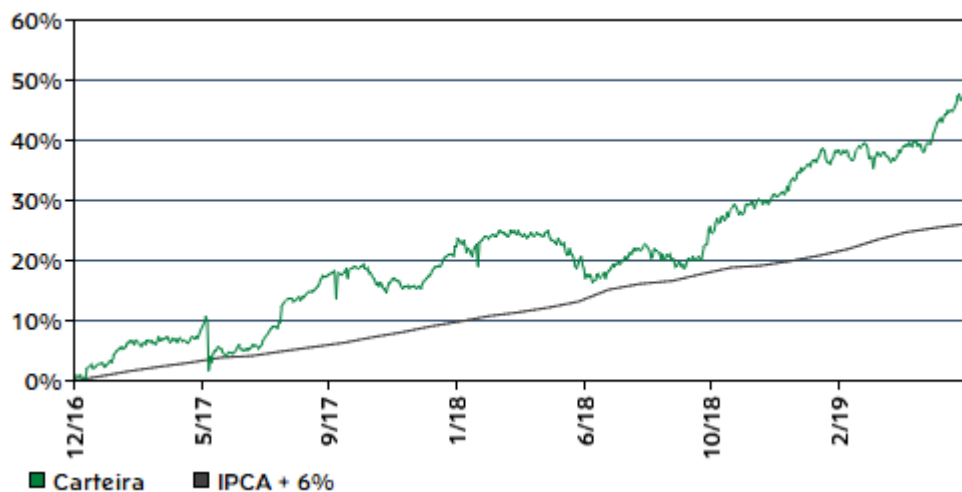
Alocação por Gestor



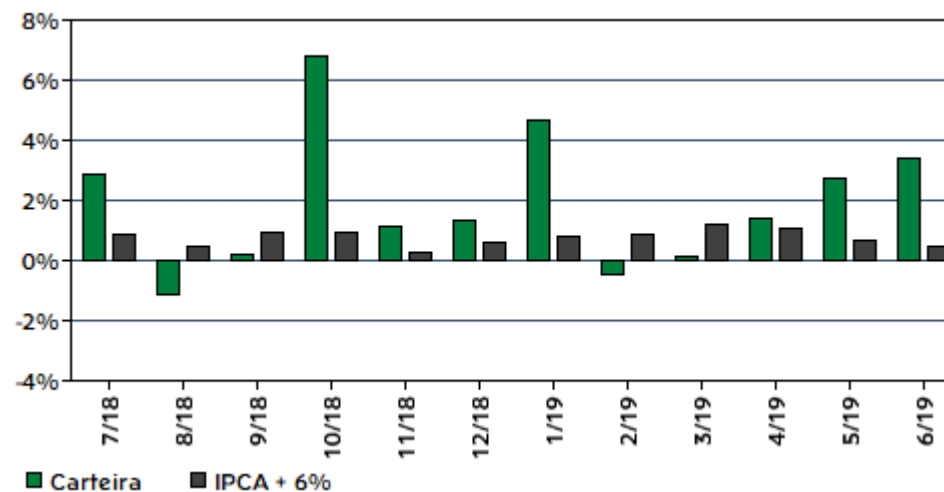
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira													
Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
2017	2,46	3,79	0,60	-0,18	-1,48	0,41	6,44	2,39	2,45	-0,71	-1,44	1,85	17,56
IPCA + 6%	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
p.p. Indx	1,57	3,04	-0,19	-0,74	-2,30	0,16	5,71	1,67	1,83	-1,62	-2,18	0,95	8,52
2018	4,47	0,74	0,98	-0,04	-4,30	-1,08	2,86	-1,15	0,17	6,78	1,10	1,36	12,08
IPCA + 6%	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
p.p. Indx	3,67	-0,00	0,40	-0,75	-5,19	-2,83	2,02	-1,60	-0,75	5,82	0,85	0,75	2,16
2019	4,65	-0,50	0,15	1,38	2,73	3,38	-	-	-	-	-	-	12,30
IPCA + 6%	0,83	0,90	1,19	1,06	0,64	0,45	-	-	-	-	-	-	5,18
p.p. Indx	3,82	-1,39	-1,04	0,32	2,09	2,93	-	-	-	-	-	-	7,12

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	56,7%
Meses abaixo do Benchmark	13	43,3%

	Rentab.	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	6,78%	out/18
Menor rentabilidade da Carteira	-4,30%	mai/18

Período	Rentabilidade (%)			Volat. Anual
	Carteira	IPCA + 6%	p.p. Indx.	
03 meses	7,68	2,17	5,5	5,668
06 meses	12,30	5,18	7,1	6,591
12 meses	25,16	9,49	15,7	6,990
24 meses	40,07	21,07	19,0	8,536
36 meses	--	--	--	--
Desde o início	47,97	26,07	21,9	9,546

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
NTN-B 150523 % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,39 -1,35	9,36 -5,84	5,62 -3,54	9,36 -5,84	19,68 -9,08	31,18 -8,14	48,86 -9,01
NTN-B 150535 % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	4,55 0,81	20,48 5,27	11,87 2,72	20,48 5,27	38,16 9,40	47,47 8,16	68,94 11,06
NTN-B 150545 % do Var. IPCA p.p.	5,56 5,55	23,59 21,37	13,93 13,22	23,59 21,37	46,05 42,68	55,03 47,12	78,75 67,60
NTN-B 150824 % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	3,00 -0,73	10,79 -4,41	6,76 -2,39	10,79 -4,41	21,57 -7,19	32,66 -6,66	50,62 -7,26
NTN-B 150850 % do Var. IPCA p.p.	6,03 6,02	25,53 23,30	15,17 14,46	25,53 23,30	49,91 46,55	57,35 49,45	81,68 70,54
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,02 -2,71	5,64 -9,56	3,03 -6,13	5,64 -9,56	11,98 -16,79	22,93 -16,38	37,67 -20,20
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FICFI % do Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	2,17 0,22	8,23 0,49	5,14 0,45	8,23 0,49	15,98 0,34	25,74 0,55	-- --
BB PREVIDENCIÁRIO RF TIT PUBL IPCA FI % do Var. IPCA + 6% p.p.	2,37 1,92	9,26 4,08	5,56 3,40	9,26 4,08	19,45 9,95	30,57 9,50	47,89 15,74

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 TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI % do Var. IPCA + 6% p.p.	1,59 1,14	7,23 2,05	4,17 2,01	7,23 2,05	20,06 10,56	32,13 11,06	45,32 13,16
CAIXA FI BRASIL 2024 VI TP RF.. % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,98 -0,75	10,67 -4,54	6,70 -2,46	10,67 -4,54	21,29 -7,47	32,04 -7,27	45,56 -12,31
FUNDO DE INVESTIMENTO CAIXA BRASIL 2030 II TP RF.. % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	3,66 -0,08	16,31 1,10	9,41 0,26	16,31 1,10	32,06 3,30	40,89 1,57	54,87 -3,01
ITAU 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
BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI % do Var. IPCA + 6% p.p.	1,31 0,86	6,74 1,56	3,73 1,57	6,74 1,56	14,93 5,44	27,15 6,08	46,32 14,16
ITAU FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES % do Var. IBOVESPA p.p.	4,68 0,62	14,51 -0,37	6,76 0,94	14,51 -0,37	38,04 -0,72	57,96 -2,56	86,74 -9,21
AZ QUEST ACOES FC FIA % do Var. IBOVESPA p.p.	3,39 -0,67	9,97 -4,91	5,70 -0,12	9,97 -4,91	32,46 -6,30	71,65 11,13	103,33 7,37
AZ QUEST SMALL MID CAPS FC FI DE ACOES % do Var. IBOVESPA p.p.	5,50 1,45	11,30 -3,58	9,50 3,68	11,30 -3,58	35,83 -2,94	80,50 19,98	116,22 20,26
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FI DE AÇÕES % do Var. IBOVESPA p.p.	4,85 0,79	17,29 2,41	12,65 6,83	17,29 2,41	45,85 7,09	66,10 5,58	81,72 -14,23
BTG PACTUAL INSTITUCIONAL DIVIDENDOS FI DE AÇÕES % do Var. IBOVESPA p.p.	4,92 0,87	17,97 3,09	11,94 6,12	17,97 3,09	41,39 2,63	42,85 -17,67	51,24 -44,71
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALAOR DIVIDENDOS RPPS .. % do Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	5,82 2,71	21,05 -	8,19 -1,45	21,05 -	49,27 1,53	56,67 -4,16	72,76 -47,05
WA ASSET VALUATION FIA % do Var. IBOVESPA p.p.	5,27 1,21	14,64 -0,25	5,58 -0,24	14,64 -0,25	32,79 -5,97	45,24 -15,29	86,52 -9,44
FICFIP KINEA PRIVATE EQUITY II.. % do % do CDI	-0,05 -11,66	-19,55 -636,00	0,00 0,13	-19,55 -636,00	-30,82 -487,68	65,22 460,86	49,41 171,34
KINEA PE IV FEEDER INSTITUCIONAL I FIP ME % do Var. IPCA + 6% p.p.	-0,50 -0,95	15,90 10,72	26,50 24,33	15,90 10,72	34,82 25,33	- -	- -

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
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