

**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											
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF IRF-M TP	2,99%	0,37	2,14%	-0,02%	4,45%	1.044.452,66	3,91%	5.039.967.565,13	0,02%
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF IMA-B TP	5,50%	0,67	3,71%	-0,02%	15,04%	4.044.276,65	15,12%	5.680.713.627,62	0,07%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IMAB TP FI RF LP	5,52%	0,67	3,69%	-0,04%	8,73%	4.893.004,94	18,30%	11.442.831.147,38	0,04%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP FI RF LP	2,45%	0,31	1,70%	-0,02%	7,17%	4.921.344,80	18,40%	9.928.411.976,46	0,05%
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2 FI	1,74%	0,23	1,11%	-0,13%	5,76%	2.117.857,64	7,92%	7.591.725.749,08	0,03%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IRF M 1+ TP RF LP	4,16%	0,50	2,71%	-0,01%	5,56%	1.038.289,07	3,88%	2.064.641.180,94	0,05%
CEF	CEF	CAIXA BRASIL IDka IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RF LP	1,75%	0,23	1,22%	-0,01%	3,62%	3.626.629,69	13,56%	8.682.626.787,59	0,04%
BB	BB	BB IMA-B 5 FIC RF PREVIDENCIÁRIO LP	2,44%	0,31	1,70%	-0,02%	4,23%	3.960.655,75	14,81%	3.911.936.273,19	0,10%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - 4604 - Fundos 100% Títulos Públicos - Referenciado				0,43				25.646.511,20	95,90%		
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Renda Fixa											
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF FLUXO FC FI	0,01%	0,02	0,39%	82,36%	2,53%	1.097.658,55	4,10%	1.335.732.610,21	0,08%
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Renda Fixa				0,02				1.097.658,55	4,10%		
Sub-total Renda Fixa				0,41				26.744.169,75	100,00%		
Total								26.744.169,75	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	25.646.511,20	95,90%	95,00%	100,00%
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604	Fundos de Renda Fixa	1.097.658,55	4,10%	5,00%	40,00%
Total Renda Fixa		26.744.169,75	100,00%		

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

Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
Artigo 7º I, Alínea b - 4604 % do CDI	2,33 496,7	8,93 290,6	17,02 269,3	-- --
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 % do CDI	0,39 82,4	2,53 82,4	5,19 82,2	-- --

**Ganhos Financeiros**

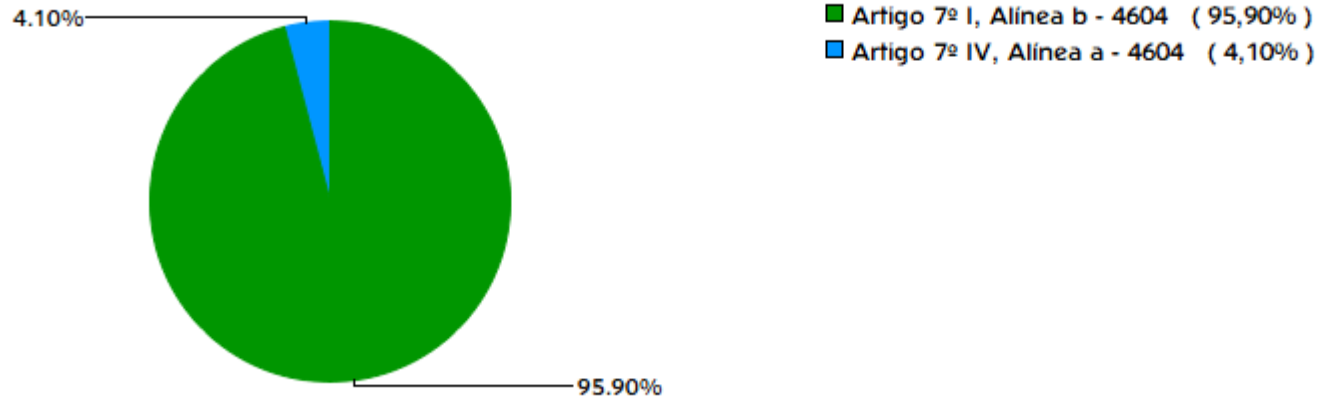
Estratégia	No Mês(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b - 4604	583.653,73
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604	3.618,48
Total	587.272,21

**Análise da Disponibilidade Financeira**

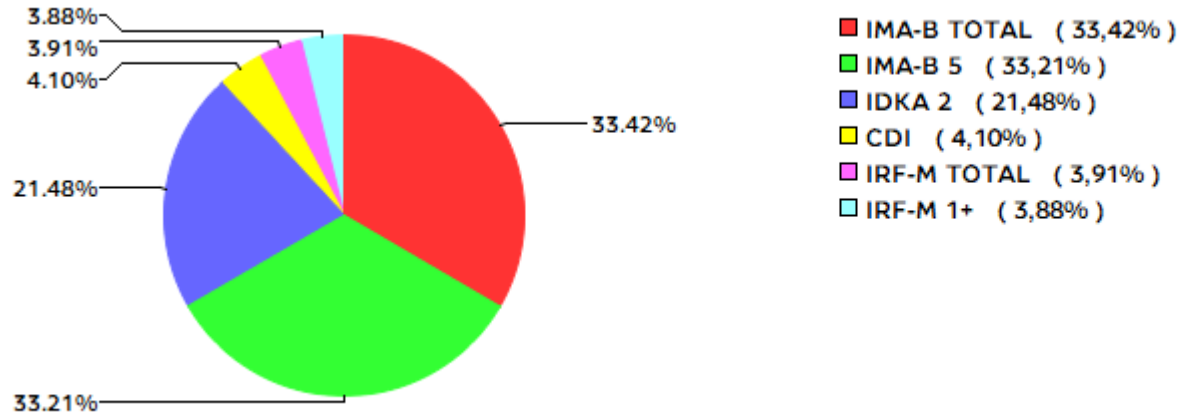
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acum. Bruto (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	26.744.169,75	100	26.744.169,75	100

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia

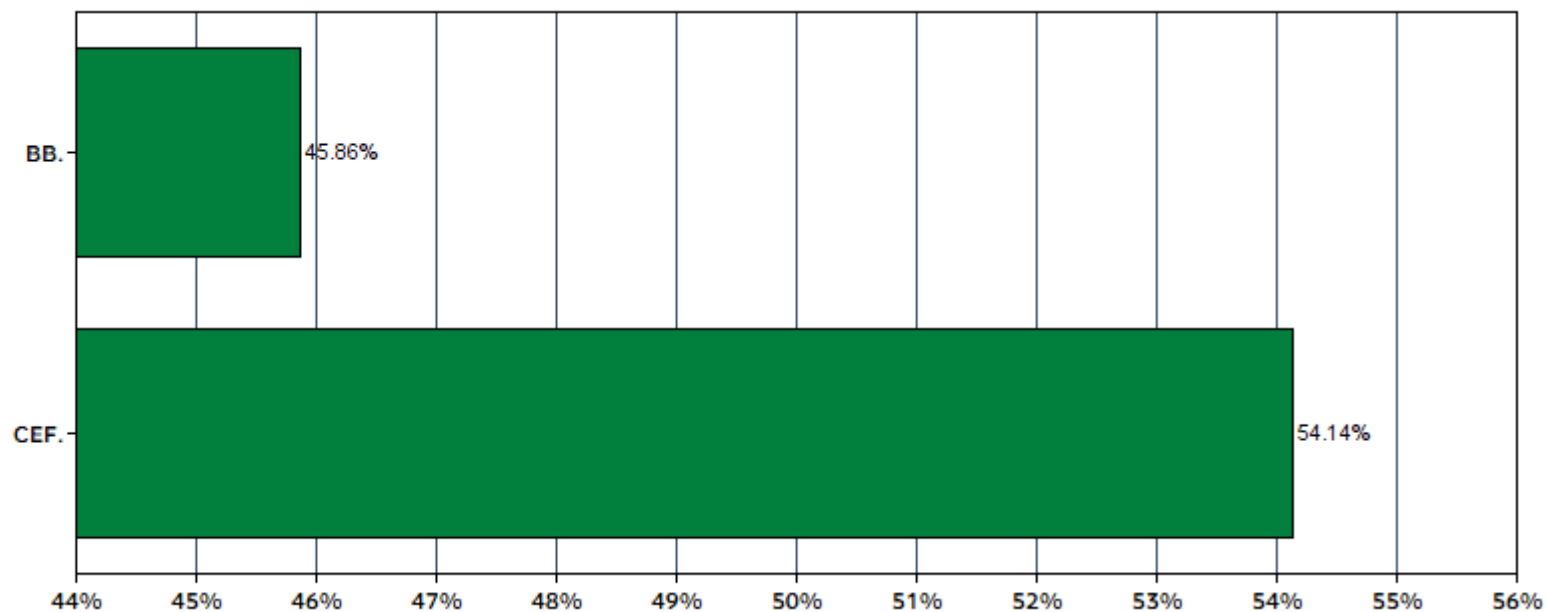


Indexadores



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor

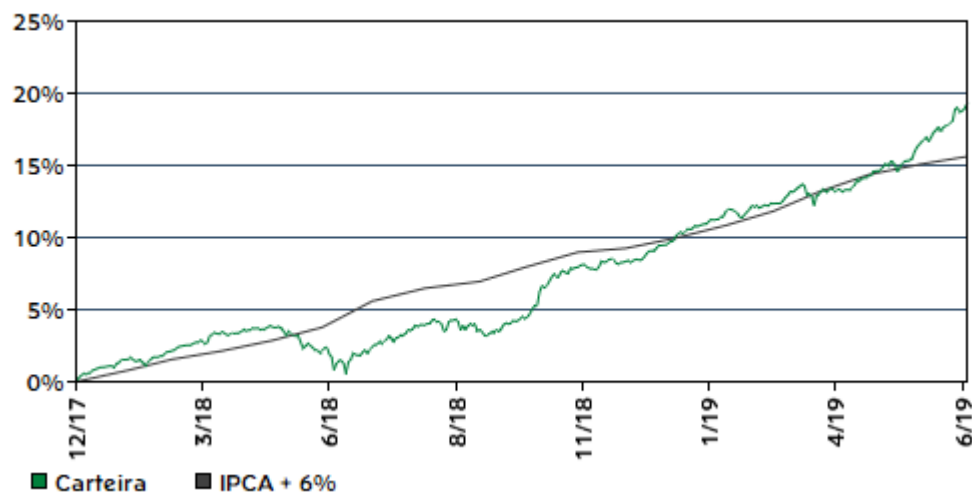


**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

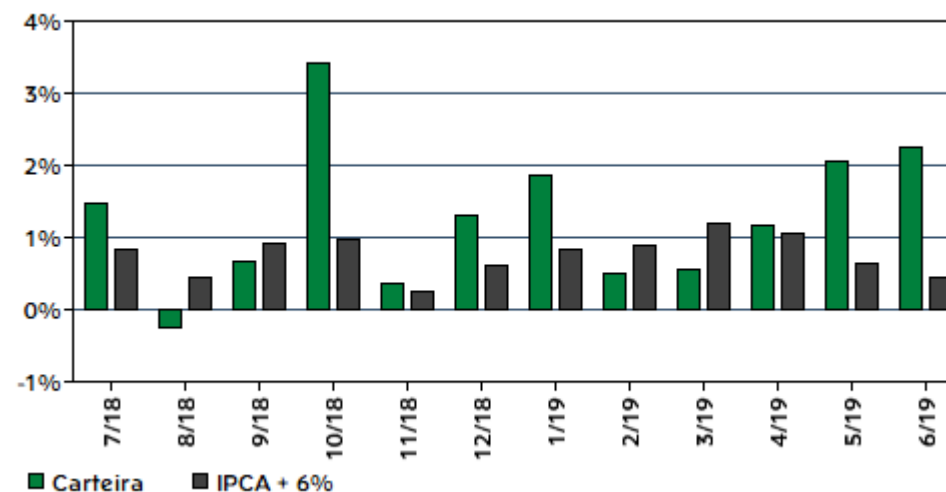
**Rentabilidades da Carteira**

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
2018	1,57	0,56	1,30	0,33	-1,60	0,25	1,48	-0,24	0,68	3,41	0,37	1,30	9,74
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	0,76	-0,17	0,73	-0,38	-2,49	-1,50	0,64	-0,69	-0,24	2,45	0,11	0,69	-0,18
2019	1,86	0,50	0,56	1,16	2,05	2,26	-	-	-	-	-	-	8,67
IPCA + 6%	0,83	0,90	1,19	1,06	0,64	0,45	-	-	-	-	-	-	5,18
p.p. Indx	1,03	-0,39	-0,63	0,10	1,41	1,81	-	-	-	-	-	-	3,49

**Evolução da Rentabilidade**



**Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses**



**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Análise de Risco / Retorno da Carteira**

	Qtd.	Perct.
Meses acima do Benchmark	10	55,6%
Meses abaixo do Benchmark	8	44,4%

	Rentab.	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	3,41%	out/18
Menor rentabilidade da Carteira	-1,60%	mai/18

Período	Rentabilidade (%)			Volat. Anual
	Carteira	IPCA + 6%	p.p. Indx.	
03 meses	5,56	2,17	3,4	2,510
06 meses	8,67	5,18	3,5	2,643
12 meses	16,45	9,49	7,0	2,776
24 meses	--	--	--	--
36 meses	--	--	--	--
Desde o início	19,26	15,61	3,6	2,876

**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 IMA-B 5 FIC RF PREVIDENCIÁRIO LP % do Var. IMA-B 5 p.p.	1,70 -0,02	7,16 -0,12	4,22 -0,05	7,16 -0,12	14,42 -0,23	25,32 -0,49	40,03 -0,76
BB PREVIDENCIARIO 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 PREVIDENCIARIO 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
BB PREVIDENCIARIO RF IRF-M TP % do Var. IRF-M TOTAL p.p.	2,14 -0,02	6,86 -0,12	4,54 -0,06	6,86 -0,12	15,51 -0,22	25,56 -0,51	46,33 -0,88
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RF LP % do Var. IDKA 2 p.p.	1,22 -0,01	5,98 -0,27	3,39 -0,29	5,98 -0,27	12,17 -1,07	23,08 -1,46	37,97 -2,61
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 IMAB TP FI RF LP % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	3,69 -0,04	15,08 -0,12	9,06 -0,09	15,08 -0,12	28,54 -0,22	38,72 -0,59	57,00 -0,88
CAIXA FI BRASIL IRF M 1+ TP RF LP % do Var. IRF-M 1+ p.p.	2,71 -0,01	8,12 -0,23	5,50 -0,12	8,12 -0,23	19,04 -0,14	29,61 -0,63	52,91 -0,94

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise dos Fundos &amp; 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 FLUXO FC FI % do % do CDI	0,39 82,36	2,53 82,39	1,27 82,58	2,53 82,39	5,19 82,20	11,74 82,97	25,09 87,00
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