

**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 a - Títulos do Tesouro Nacional											
TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	NTNB 15/05/2055 IPCA+4.46000%	0,00%	0,00	0,74%	0,61%	0,83%	41.137.259,55	6,82%	0,00	0,00%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a - Títulos do Tesouro Nacional				0,00				41.137.259,55	6,82%		
Artigo 7º I, Alínea b - 4604 - Fundos 100% Títulos Públicos - Referenciado											
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF IRF-M TP	3,36%	0,40	1,75%	-0,02%	4,62%	39.602.848,28	6,57%	4.965.905.251,75	0,80%
BANESTES	BANESTES	BANESTES PREVIDENCIARIO FI RF REF IMA-B	8,45%	0,98	5,56%	1,90%	14,84%	33.709.113,33	5,59%	280.714.593,35	12,01%
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,52%	0,08	0,65%	-0,03%	2,62%	12.360.515,36	2,05%	9.642.034.622,42	0,13%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IMAB TP FI RF LP	5,83%	0,69	3,63%	-0,03%	10,98%	46.627.738,20	7,73%	10.160.570.915,80	0,46%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IRFM 1 TP FI RF	0,52%	0,08	0,65%	-0,02%	2,64%	5.499.807,17	0,91%	15.240.544.601,45	0,04%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP FI RF LP	2,97%	0,36	1,37%	-0,02%	5,38%	113.707.992,53	18,86%	9.698.474.109,36	1,17%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	6,91%	0,76	2,40%	-1,27%	7,47%	6.356.412,00	1,05%	424.687.222,73	1,50%
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2 FI	2,28%	0,28	0,95%	-0,42%	4,60%	15.581.575,27	2,58%	7.660.132.429,79	0,20%
BB	BB	BB IMA-B 5 FIC RF PREVIDENCIÁRIO LP	2,96%	0,36	1,37%	-0,01%	5,37%	20.831.630,74	3,45%	3.880.154.750,39	0,54%
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI	4,31%	0,51	1,71%	1,07%	6,34%	9.161.670,68	1,52%	481.209.958,49	1,90%
BANESTES	BANESTES	FUNDO DE INVESTIMENTO BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS-RENDA FIXA	1,39%	0,18	1,77%	1,09%	4,10%	2.527.324,44	0,42%	124.348.636,91	2,03%
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII	2,08%	0,26	0,93%	-2,73%	4,58%	2.353.757,45	0,39%	671.832.054,66	0,35%
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF ALOCACAO ATIVA FICFI	2,94%	0,36	2,02%	0,19%	5,93%	52.879.569,27	8,77%	6.585.019.923,99	0,80%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - 4604 - Fundos 100% Títulos Públicos - Referenciado				0,45				361.199.954,72	59,89%		
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Renda Fixa											
BANESTES	BANESTES	FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP	0,04%	0,03	0,53%	97,86%	2,56%	9.131.288,11	1,51%	466.877.595,01	1,96%
BANESTES	BANESTES	FI BANESTES INVESTIDOR CURTO PRAZO	0,00%	0,01	0,28%	52,18%	1,35%	539.119,03	0,09%	485.822.749,76	0,11%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL RF REF DI LP	0,02%	0,03	0,54%	98,69%	2,55%	7.861.439,60	1,30%	6.460.963.640,43	0,12%
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF IMAB FI	5,79%	0,68	3,61%	-0,05%	10,89%	68.370.652,11	11,34%	1.352.759.647,87	5,05%
BANESTES	BANESTES	FI BANESTES INSTITUCIONAL RF	7,52%	0,87	5,49%	1,82%	13,97%	31.936.513,52	5,30%	249.593.857,00	12,80%

## 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
BB	BB	BB RPPS RF PERFIL FIC	0,04%	0,03	0,53%	97,50%	2,54%	1.605.451,10	0,27%	3.682.471.718,05	0,04%
BANESTES	BANESTES	BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI	0,04%	0,03	0,59%	108,36%	2,84%	48.635.031,27	8,06%	1.208.006.812,82	4,03%
BANESTES	BANESTES	BANESTES ESTRATEGIA FIC DE FI RF	—%	—	2,26%	416,51%	7,00%	8.213.361,95	1,36%	58.111.651,16	14,13%
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Renda Fixa				0,44				176.292.856,69	29,23%		
Sub-total Renda Fixa				0,42				578.630.070,96	95,95%		
Renda Variável											
Artigo 8º II, Alínea a - 4604 - Fundos de Ações											
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	18,24%	2,02	0,10%	-3,04%	14,39%	7.385.584,98	1,22%	599.177.335,82	1,23%
CEF	CEF	Caixa FI Ações Institucional BDR Nivel I	18,04%	1,91	-6,70%	-7,40%	11,25%	3.447.493,87	0,57%	504.348.175,80	0,68%
BANESTES	BANESTES	BANESTES FIC DE FI ACOES BTG ABSOL. INST	20,04%	2,21	3,29%	0,15%	11,84%	7.677.514,61	1,27%	50.521.403,54	15,20%
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a - 4604 - Fundos de Ações				2,08				18.510.593,46	3,07%		
Artigo 8º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Participações											
RIO BRAVO	CEF	BRASIL ENERGIA RENOVAVEL - FIP MULTIESTRATÉGIA	0,00%	0,00	-0,17%	-31,41%	-0,50%	1.922.922,48	0,32%	263.344.233,79	0,73%
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Participações				0,00				1.922.922,48	0,32%		
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604 - Fundos de Investimentos Imobiliários											
RIO BRAVO	RIO BRAVO	CAIXA RIO BRAVO FII	0,00%	0,00	0,00%	-1,76%	2,56%	2.170.640,00	0,36%	1,08	200.899.178,01%
RIO BRAVO	RIO BRAVO	BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	0,00%	0,00	1,24%	-0,53%	3,26%	1.821.740,79	0,30%	1,03	177.052.118,78%
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b - 4604 - Fundos de Investimentos Imobiliários				0,00				3.992.380,79	0,66%		
Sub-total Renda Variável				1,58				24.425.896,73	4,05%		
Total								603.055.967,69	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 a	Títulos do Tesouro Nacional	41.137.259,55	6,82%	10,00%	100,00%
Artigo 7º I, Alínea b - 4604	Fundos 100% Títulos Públicos - Referenciado	361.199.954,72	59,89%	55,00%	100,00%
Artigo 7º IV, Alínea a	RF e REFERENCIAL LIVRE	0,01	0,00%	0,00%	30,00%
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604	Fundos de Renda Fixa	176.292.856,69	29,23%	19,00%	40,00%
Total Renda Fixa		578.630.070,97	95,94%		
Renda Variável					
Artigo 8º II, Alínea a - 4604	Fundos de Ações	18.510.593,46	3,07%	3,00%	20,00%
Artigo 8º IV, Alínea a - 4604	Fundos de Participações	1.922.922,48	0,32%	0,50%	5,00%
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604	Fundos de Investimentos Imobiliários	3.992.380,79	0,66%	0,00%	5,00%
Total Renda Variável		24.425.896,73	4,05%		

**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	0,74 135,5	5,98 230,7	12,40 194,6	– –
Artigo 7º I, Alínea b - 4604 % do CDI	2,15 395,2	6,23 240,4	14,02 220,1	22,16 152,4
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 % do CDI	2,65 488,8	7,97 307,3	16,58 260,3	– –
Artigo 8º II, Alínea a - 4604 Var. IBOVESPA p.p	-0,55 -1,2	12,42 2,0	30,11 3,7	43,71 -11,0
Artigo 8º IV, Alínea a - 4604 Var. IBOVESPA p.p	0,00 -0,7	0,00 -10,4	0,00 -26,4	– –
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604 Var. IBOVESPA p.p	0,56 -0,1	2,88 -7,5	4,18 -22,2	– –

**Ganhos Financeiros**

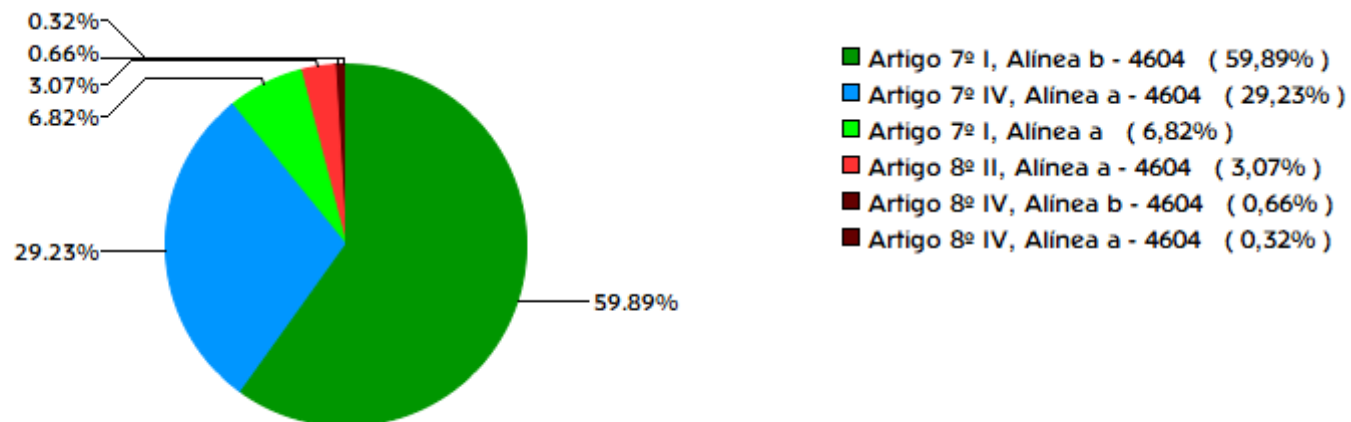
Estratégia	No Mês(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a	304.747,92
Artigo 7º I, Alínea b - 4604	7.644.491,74
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604	4.569.594,15
Artigo 7º VII, Alínea a - 4604	-93.932,80
Artigo 8º II, Alínea a - 4604	-12.977,36
Artigo 8º IV, Alínea a - 4604	-3.285,30
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604	22.244,56
<b>Total</b>	<b>12.430.882,90</b>

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

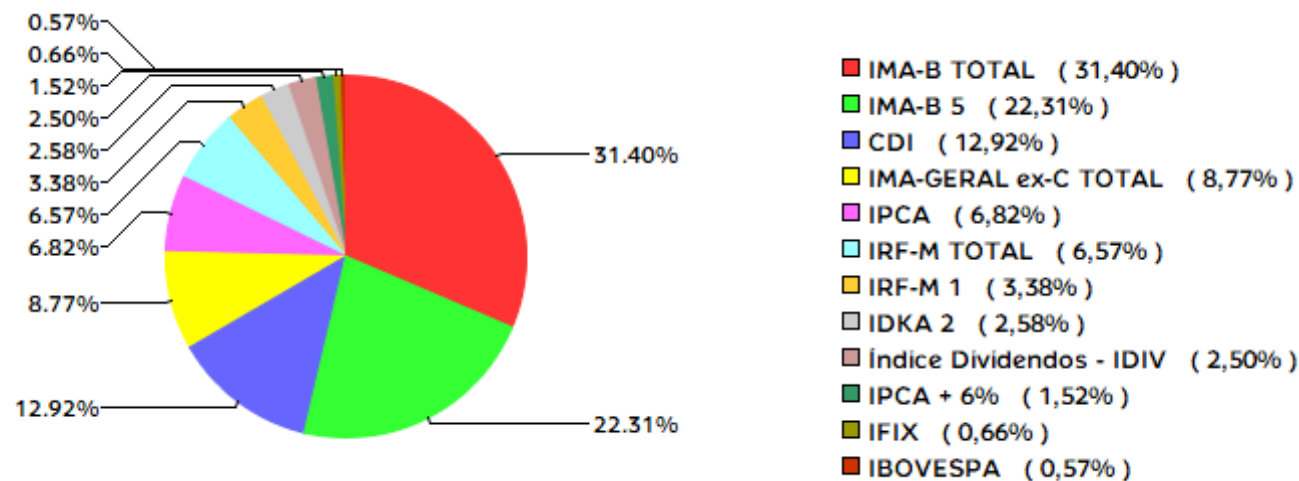
Análise da Disponibilidade Financeira				
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acum. Bruto (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	540.302.204,74	90	540.302.204,74	90
acima de 365 dias	62.753.762,95	10	603.055.967,69	100

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia

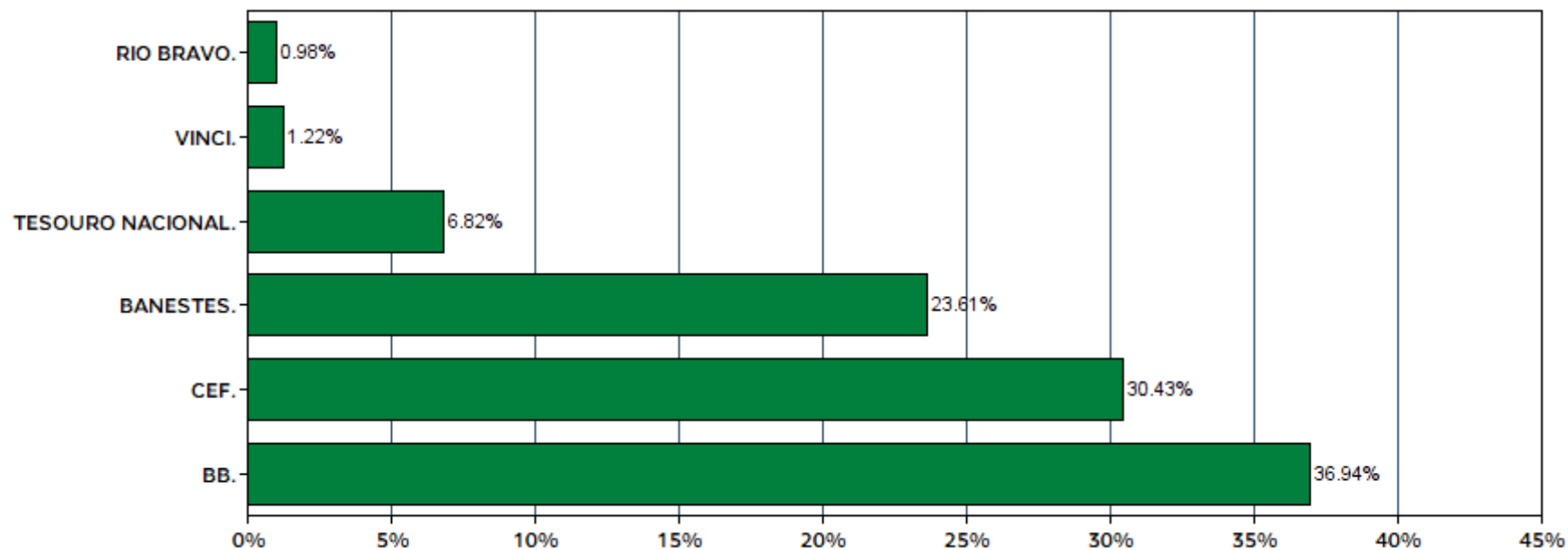


Indexadores



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

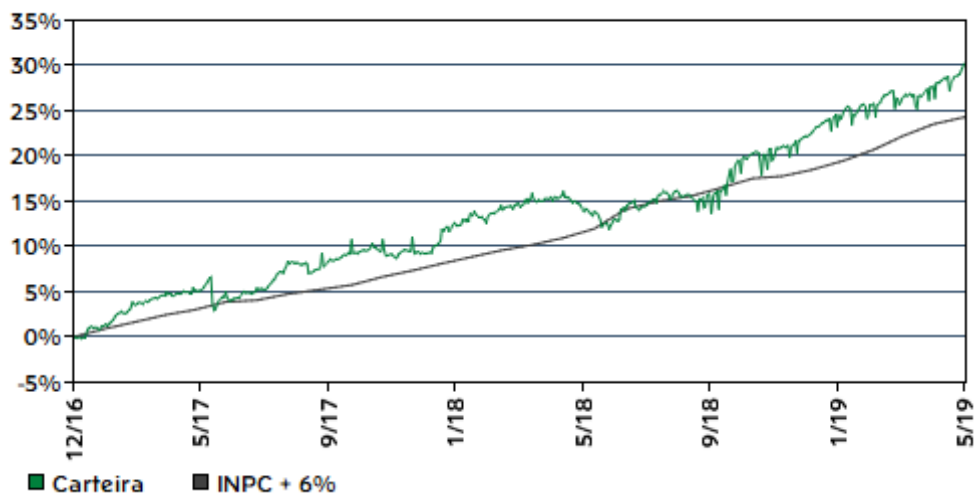
Alocação por Gestor



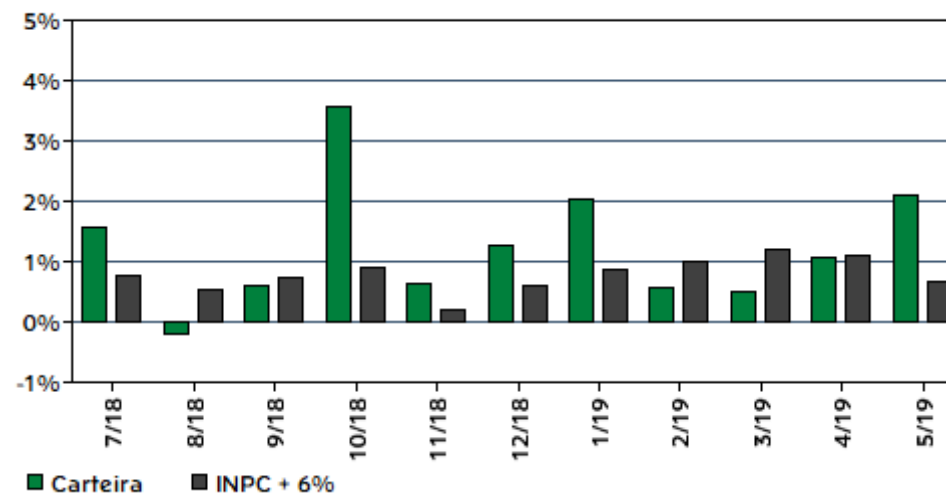
**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Rentabilidades da Carteira													
Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
2017	1,54	2,35	1,09	0,27	-0,39	0,55	2,69	0,89	1,33	0,09	0,10	0,83	11,90
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	0,61	1,69	0,24	-0,22	-1,26	0,36	2,04	0,39	0,89	-0,77	-0,55	0,10	3,78
2018	1,75	0,64	1,04	0,29	-1,93	0,01	1,56	-0,20	0,59	3,57	0,63	1,25	9,50
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	1,01	0,04	0,49	-0,41	-2,84	-1,92	0,80	-0,74	-0,15	2,66	0,42	0,65	-0,09
2019	2,04	0,56	0,52	1,07	2,09	-	-	-	-	-	-	-	6,42
INPC + 6%	0,87	1,01	1,21	1,09	0,66	-	-	-	-	-	-	-	4,94
p.p. Indx	1,17	-0,45	-0,70	-0,02	1,43	-	-	-	-	-	-	-	1,49

**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	INPC + 6%	p.p. Indx.	
Meses acima do Benchmark	17	58,6%	03 meses	3,71	2,99	0,7	8,087
Meses abaixo do Benchmark	12	41,4%	06 meses	7,76	5,57	2,2	7,922
			12 meses	14,50	11,04	3,5	8,605
			24 meses	24,27	19,70	4,6	7,142
			36 meses	-	-	-	-
			Desde o início	30,40	24,33	6,1	6,862

	Rentab.	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	3,57%	out/18
Menor rentabilidade da Carteira	-1,93%	mai/18

**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
NTNB 15/05/2055 IPCA+4.46000% % do Var. IPCA p.p.	0,74 0,61	0,83 0,64	- -	- -	- -	- -	- -
BB IMA-B 5 FIC RF PREVIDENCIÁRIO LP % do Var. IMA-B 5 p.p.	1,37 -0,01	5,37 -0,10	3,25 -0,06	6,79 -0,12	12,98 -0,24	23,85 -0,48	38,94 -0,77
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,93 -2,73	4,58 -6,48	2,66 -3,18	5,79 -7,10	11,49 -12,24	22,33 -12,19	37,68 -17,45
BANESTES PREVIDENCIARIO FI RF REF IMA-B % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	5,56 1,90	14,84 3,78	7,44 1,61	17,26 4,37	30,84 7,11	39,61 5,09	60,30 5,17
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,65 -0,03	2,62 -0,10	1,59 -0,07	3,17 -0,12	6,96 -0,23	15,46 -0,49	30,88 -0,93
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 IDKA 2 FI % do Var. IDKA 2 p.p.	0,95 -0,42	4,60 -0,35	2,73 -0,38	5,88 -0,39	11,07 -0,98	22,22 -1,77	37,28 -2,88
BB PREVIDENCIARIO RF IRF-M TP % do Var. IRF-M TOTAL p.p.	1,75 -0,02	4,62 -0,10	2,93 -0,06	6,20 -0,13	13,10 -0,23	24,56 -0,52	46,22 -0,97

**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 I FI % do Var. IPCA + 6% p.p.	1,71 1,07	6,34 1,63	3,80 0,88	8,07 2,72	15,63 4,72	27,15 6,31	44,18 11,48
CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP FI RF LP % do Var. IMA-B 5 p.p.	1,37 -0,02	5,38 -0,10	3,25 -0,06	6,83 -0,08	13,03 -0,19	23,86 -0,48	38,94 -0,78
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
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,40 -1,27	7,47 -3,59	4,56 -1,28	9,40 -3,49	17,77 -5,96	25,10 -9,42	34,99 -20,13
FUNDO DE INVESTIMENTO BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS-RENDA FIXA % do Var. IRF-M 1 p.p.	1,77 1,09	4,10 1,37	2,86 1,20	4,99 1,69	9,47 2,28	19,58 3,63	36,05 4,24
FI BANESTES INVESTIDOR CURTO PRAZO % do % do CDI	0,28 52,18	1,35 51,91	0,80 52,03	1,61 51,84	3,28 51,47	8,01 55,11	18,78 63,19
BANESTES ESTRATEGIA FIC DE FI RF % do % do CDI	2,26 416,51	7,00 270,08	4,20 273,24	7,92 255,67	- -	- -	- -
BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI % do % do CDI	0,59 108,36	2,84 109,38	1,69 109,88	3,40 109,60	6,88 107,96	15,77 108,42	32,15 108,15
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMAB FI % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	3,61 -0,05	10,89 -0,17	5,72 -0,11	12,64 -0,25	23,39 -0,34	34,07 -0,45	54,63 -0,50
BB RPPS RF PERFIL FIC % do % do CDI	0,53 97,50	2,54 97,87	1,51 97,87	3,02 97,37	6,24 97,93	14,47 99,51	29,72 99,98
CAIXA FI BRASIL RF REF DI LP % do % do CDI	0,54 98,69	2,55 98,20	1,52 98,60	3,04 98,07	6,22 97,58	14,24 97,90	29,40 98,89
FI BANESTES INSTITUCIONAL RF % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	5,49 1,82	13,97 2,92	7,27 1,44	16,54 3,65	27,44 3,71	36,34 1,82	57,74 2,62
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP % do % do CDI	0,53 97,86	2,56 98,74	1,53 99,27	3,07 98,94	6,19 97,19	14,30 98,33	29,88 100,53
FIDC CASAN SANEAMENTO SEN % do % do CDI	-2,76 -508,97	-6,76 -260,69	-6,34 -412,25	-5,96 -192,15	2,16 33,91	0,64 4,39	0,44 1,48

**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
BANESTES FIC DE FI ACOES BTG ABSOL. INST % do Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	3,29 0,15	11,84 -	5,90 1,46	15,14 -0,69	36,48 -0,60	61,29 7,23	73,47 -56,10
Caixa FI Ações Institucional BDR Nível I % do Var. IBOVESPA p.p.	-6,70 -7,40	11,25 0,84	4,46 2,95	2,56 -5,85	8,05 -18,37	40,41 -14,31	45,63 -54,55
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS % do Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	0,10 -3,04	14,39 -	1,52 -2,91	18,08 2,25	33,53 -3,55	44,97 -9,10	64,06 -65,51
BRASIL ENERGIA RENOVÁVEL - FIP MULTISTRATÉGIA % do % do CDI	-0,17 -31,41	-0,50 -19,40	-0,33 -21,62	-0,22 -6,99	-0,85 -13,32	20,58 141,53	18,68 62,82
BB RECEBIVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO % do Var. IFIX p.p.	1,24 -0,53	3,26 -5,29	0,17 -4,68	5,14 -5,82	0,74 -14,55	-6,30 -30,46	-4,84 -63,19
CAIXA RIO BRAVO FII % do Var. IFIX p.p.	0,00 -1,76	2,56 -5,99	1,04 -3,82	5,06 -5,90	9,48 -5,81	- -	- -
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
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