

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos

Gestor	CNPJ	Ativos	Vol*	VAR	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (31/07/2019)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
Renda Fixa											
ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B" - FUNDOS 100% TÍTULOS PÚBLICOS											
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	11.328.882/0001-35	BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,32%	0,06	0,70%	-0,02%	3,93%	3.558.158,79	7,04%	8.127.407.176,13	0,04%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	10.986.880/0001-70	BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	5,44%	0,66	1,25%	-0,03%	12,86%	5.191.716,62	10,27%	861.723.072,70	0,60%
CEF	10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5,44%	0,66	1,27%	-0,01%	16,55%	5.073.844,78	10,03%	10.634.242.466,28	0,05%
CEF	10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,31%	0,06	0,70%	-0,02%	3,95%	2.670.097,82	5,28%	11.753.865.364,60	0,02%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	11.484.558/0001-06	BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,31%	0,06	0,69%	-0,03%	3,91%	203.072,44	0,40%	965.823.547,76	0,02%
CEF	11.060.913/0001-10	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,42%	0,30	0,95%	-0,03%	8,18%	8.700.017,88	17,20%	10.008.819.414,19	0,09%
SANTANDER	14.504.578/0001-90	SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP	5,44%	0,66	1,26%	-0,03%	16,48%	2.133.297,28	4,22%	934.435.141,42	0,23%
CEF	14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,73%	0,22	0,92%	-0,10%	6,95%	8.823.663,52	17,45%	8.765.081.386,67	0,10%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	03.543.447/0001-03	BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2,41%	0,30	0,97%	-0,01%	8,20%	3.095.781,74	6,12%	4.114.827.361,37	0,08%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	25.078.994/0001-90	BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,73%	0,34	1,02%	0,05%	7,87%	5.336.207,01	10,55%	7.419.279.081,84	0,07%
Sub-total ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B" - FUNDOS 100% TÍTULOS PÚBLICOS								44.785.857,86	88,55%		
ARTIGO 7º, INCISO IV, ALÍNEA "A" - FUNDOS RENDA FIXA (LIVRE)											
CEF	03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,02%	0,03	0,55%	96,93%	3,58%	479.097,80	0,95%	5.297.287.700,56	0,01%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	08.702.798/0001-25	BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	5,66%	0,69	1,23%	-0,06%	16,60%	5.309.430,68	10,50%	1.666.046.629,40	0,32%
Sub-total ARTIGO 7º, INCISO IV, ALÍNEA "A" - FUNDOS RENDA FIXA (LIVRE)								5.788.528,48	11,45%		
Sub-total Renda Fixa								50.574.386,34	100,00%		
Total								50.574.386,34	100%		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Classe	Valor(R\$)	% Carteira	Política Investimento	Limite Res. 4.604/17
Renda Fixa					
ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	FUNDOS 100% TÍTULOS PÚBLICOS	44.785.857,88	88,55%	90,00%	100,00%
ARTIGO 7º, INCISO IV, ALÍNEA "A"	FUNDOS RENDA FIXA (LIVRE)	5.788.528,49	11,45%	40,00%	40,00%
Total Renda Fixa		50.574.386,37	100,00%		

Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)

Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B" % do CDI	1,00 176,1	8,98 245,5	14,28 225,0	-- --
ARTIGO 7º, INCISO IV, ALÍNEA "A" % do CDI	1,17 206,7	9,42 257,4	13,69 215,8	-- --

Ganhos Financeiros

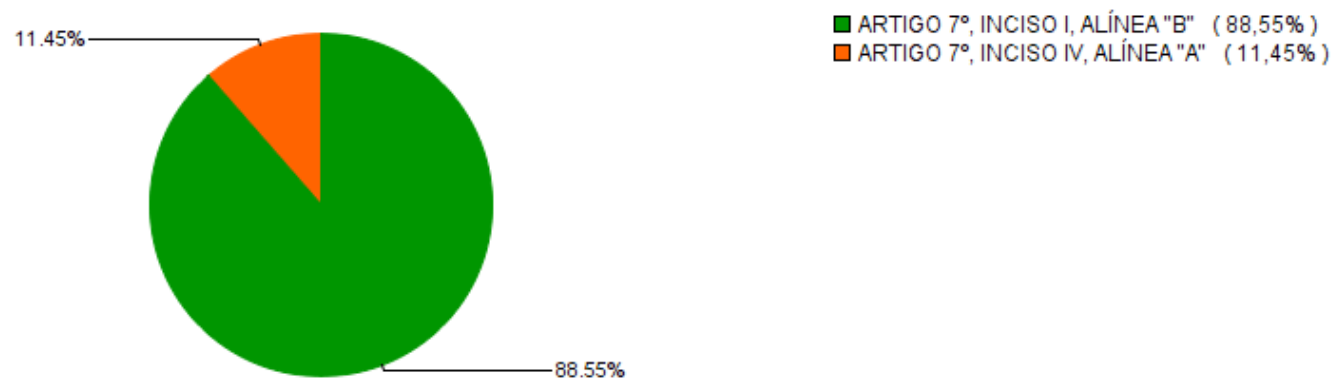
Estratégia	Ganho Bruto (R\$)
ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	442.664,13
ARTIGO 7º, INCISO IV, ALÍNEA "A"	67.146,98
Total	509.811,11

Análise da Disponibilidade Financeira

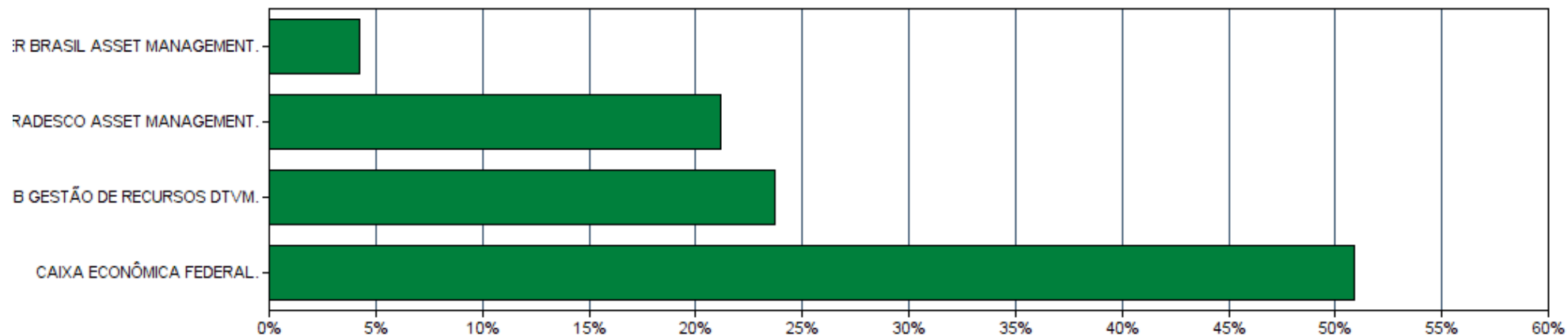
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acum. Bruto (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	50.574.386,34	100	50.574.386,34	100

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia



Alocação por Gestor

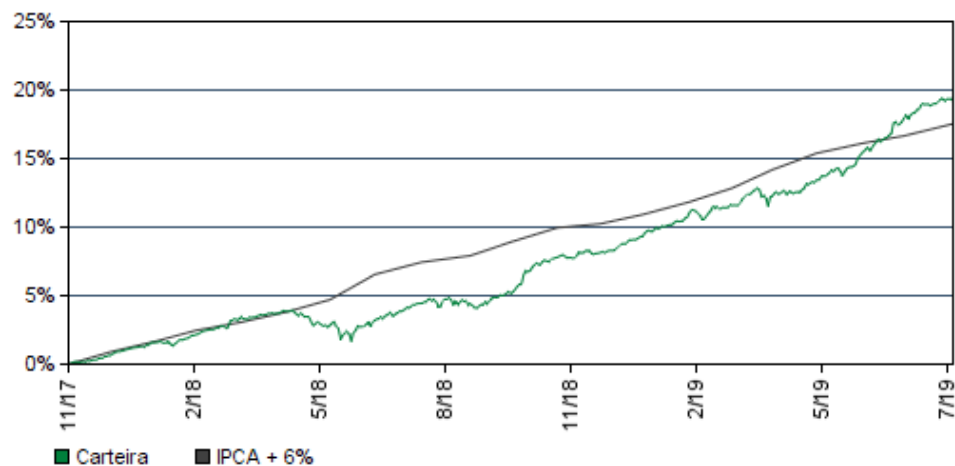


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

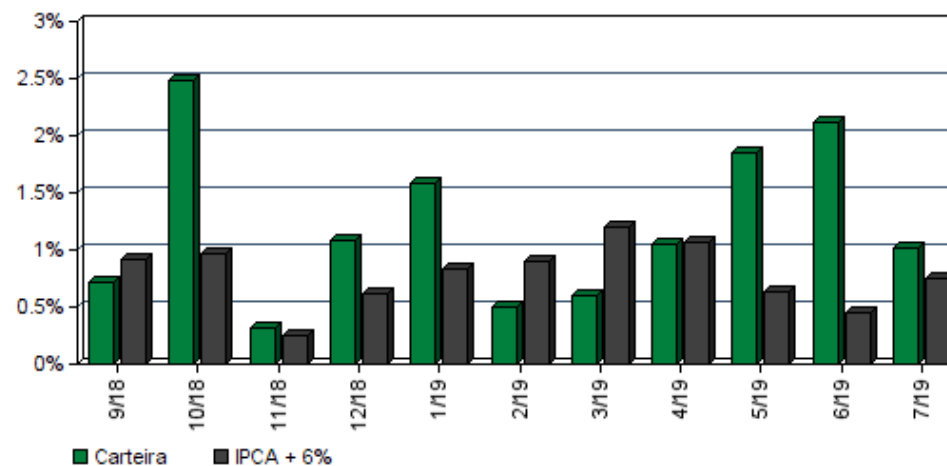
Rentabilidades da Carteira

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano	
2017													0,66	0,66
IPCA + 6%	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	0,91	0,91
p.p. Indx	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	-0,24	-0,24
2018	0,94	0,54	1,22	0,46	-0,99	0,33	1,21	-0,01	0,72	2,49	0,31	1,09	8,59	8,59
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	9,92
p.p. Indx	0,14	-0,20	0,64	-0,25	-1,88	-1,42	0,37	-0,45	-0,20	1,53	0,06	0,48	-1,33	-1,33
2019	1,58	0,50	0,60	1,05	1,85	2,12	1,02	--	--	--	--	--	9,03	9,03
IPCA + 6%	0,83	0,90	1,19	1,06	0,64	0,45	0,75	--	--	--	--	--	5,97	5,97
p.p. Indx	0,75	-0,40	-0,59	-0,01	1,21	1,67	0,27	--	--	--	--	--	3,06	3,06

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	50,0%
Meses abaixo do Benchmark	10	50,0%

	Rentab.	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,49%	out/18
Menor rentabilidade da Carteira	-0,99%	mai/18

Período	Rentabilidade (%)			Volat. Anual
	Carteira	IPCA + 6%	p.p. Indx.	
03 meses	5,07	1,86	3,2	2,201
06 meses	7,34	5,10	2,2	2,443
12 meses	14,12	9,40	4,7	2,231
24 meses	--	--	--	--
36 meses	--	--	--	--
Desde o início	19,18	17,54	1,6	2,168

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 IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO Var. do IRF-M 1 p.p.	0,70 -0,02	3,93 -0,13	1,93 -0,06	3,34 -0,12	7,06 -0,23	11,57 -0,37	11,57 -0,37
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA Var. do IMA-B TOTAL p.p.	1,25 -0,03	12,86 -0,21	8,81 -0,11	11,61 -0,20	12,86 -0,21	12,86 -0,21	12,86 -0,21
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP Var. do IMA-B TOTAL p.p.	1,27 -0,01	16,55 -0,14	8,83 -0,09	11,64 -0,16	27,24 -0,22	32,57 -0,45	32,57 -0,45
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA Var. do IRF-M 1 p.p.	0,70 -0,02	3,95 -0,11	1,94 -0,05	3,37 -0,10	7,11 -0,18	11,66 -0,29	11,66 -0,29
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA Var. do IRF-M 1 p.p.	0,69 -0,03	3,91 -0,16	1,92 -0,07	3,33 -0,13	7,02 -0,27	10,03 -0,40	10,03 -0,40
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP Var. do IMA-B 5 p.p.	0,95 -0,03	8,18 -0,15	4,07 -0,06	6,55 -0,14	13,88 -0,20	19,67 -0,40	19,67 -0,40
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP Var. do IMA-B TOTAL p.p.	1,26 -0,03	16,48 -0,21	8,81 -0,10	11,64 -0,17	27,14 -0,33	32,43 -0,59	32,43 -0,59
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP Var. do IDKA 2 p.p.	0,92 -0,10	6,95 -0,38	3,23 -0,43	5,61 -0,38	11,87 -0,73	17,92 -1,25	17,92 -1,25

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 IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP Var. do IMA-B 5 p.p.	0,97 -0,01	8,20 -0,13	4,09 -0,04	6,58 -0,11	13,86 -0,22	17,01 -0,35	17,01 -0,35
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO Var. do IMA-GERAL TOTAL p.p.	1,02 0,05	7,87 0,33	5,29 0,40	7,17 0,27	7,87 0,33	7,87 0,33	7,87 0,33
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,55 96,93	3,58 97,80	1,55 97,50	3,03 97,89	6,19 97,60	10,61 97,21	10,61 97,21
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA Var. do IMA-B TOTAL p.p.	1,23 -0,06	16,60 -0,09	8,86 -0,06	11,61 -0,20	27,49 0,02	32,71 -0,31	32,71 -0,31
<i>CDI</i>	<i>0,57</i>	<i>3,66</i>	<i>1,59</i>	<i>3,10</i>	<i>6,35</i>	<i>13,89</i>	<i>28,15</i>
<i>IBOVESPA</i>	<i>0,84</i>	<i>15,84</i>	<i>5,67</i>	<i>4,54</i>	<i>28,52</i>	<i>54,45</i>	<i>77,66</i>
<i>DOLAR COMERCIAL</i>	<i>-1,76</i>	<i>-2,84</i>	<i>-4,57</i>	<i>3,09</i>	<i>0,27</i>	<i>20,26</i>	<i>16,24</i>
<i>INPC + 6%</i>	<i>0,53</i>	<i>5,97</i>	<i>1,65</i>	<i>5,05</i>	<i>9,19</i>	<i>19,86</i>	<i>29,67</i>
<i>IPCA + 6%</i>	<i>0,75</i>	<i>5,97</i>	<i>1,86</i>	<i>5,10</i>	<i>9,40</i>	<i>21,11</i>	<i>31,82</i>