

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos										
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (30/08/2019)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
Renda Fixa										
TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	NTN-B 150850	0,00%	-1,12%	-1,74%	16,10%	552.610,65	1,15%	--	--
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a - Títulos Públicos de emissão do TN							552.610,65	1,15%		
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL TIT PUB RF LP	0,06%	0,49%	-0,13%	4,15%	373.946,27	0,78%	2.501.222.353,05	0,01%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	0,29%	0,52%	-0,02%	4,50%	3.059.007,84	6,37%	11.397.966.980,21	0,03%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP RF LP	7,70%	-0,79%	-0,02%	21,65%	8.858.735,19	18,46%	2.857.219.565,23	0,31%
Banco BNB	SANTANDER DTVM	BNB RPPS PREVIDENCIA FI RENDA FIXA	4,53%	-0,35%	0,05%	14,56%	438.356,54	0,91%	225.461.887,94	0,19%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI	5,21%	-0,42%	-0,01%	16,02%	1.217.631,77	2,54%	5.956.790.005,56	0,02%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RF LP	5,22%	-0,42%	-0,02%	16,06%	7.629.732,04	15,90%	11.125.833.388,91	0,07%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - FI 100% Títulos TN							21.577.409,66	44,96%		
CAIXA	CAIXA	CAIXA NOVO BRASIL FIC IMA-B RF LP	5,15%	-0,43%	-0,03%	15,90%	8.122.377,22	16,93%	2.936.440.451,82	0,28%
Sub-total Artigo 7º III, Alínea a - FI Renda Fixa "Referenciado"							8.122.377,22	16,93%		
BRAM	Banco BRADESCO	BRADESCO INST FIC FI RF IMA-GERAL	2,47%	0,05%	-0,11%	9,17%	8.215.236,21	17,12%	857.777.968,03	0,96%
ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ INST ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC FI	2,20%	0,32%	0,15%	4,83%	82.322,73	0,17%	5.084.742.954,71	0,00%
BRAM	Banco BRADESCO	BRADESCO FIC FI RF ALOCAÇÃO DINÂMICA	2,43%	0,10%	20,67%	8,82%	2.172.139,85	4,53%	810.382.093,50	0,27%
SANTANDER Gest Rec	Banco SANTANDER	SANTANDER FIC FI INSTIT RF REF DI	0,02%	0,50%	98,59%	2,70%	471.593,96	0,98%	4.607.155.342,37	0,01%
BRAM	Banco BRADESCO	BRADESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA	0,01%	0,49%	97,03%	4,06%	47.707,67	0,10%	9.093.573.111,46	0,00%
BRAM	Banco BRADESCO	BRADESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM	0,01%	0,50%	98,76%	4,14%	860.660,44	1,79%	6.376.477.804,17	0,01%
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - FI Renda Fixa - Geral							11.849.660,85	24,69%		
Sub-total Renda Fixa - FI Renda Fixa - Geral							42.102.058,39	87,73%		
Renda Variável										
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES GOVERNANÇA FI	20,63%	0,50%	1,17%	-2,28%	316.027,63	0,66%	589.771.442,43	0,05%
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a - FI de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações							316.027,63	0,66%		
ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC FI	19,51%	1,57%	2,23%	11,66%	446.528,99	0,93%	2.860.793.399,75	0,02%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos										
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (30/08/2019)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
ITAÚ UNIBANCO	ITAÚ UNIBANCO	ITAU INSTITUCIONAL AÇÕES PHOENIX FI	20,50%	1,58%	2,24%	22,68%	526.669,21	1,10%	1.936.669.944,57	0,03%
BRAM	BEM DTVM	BRABESCO FIA SELECTION	21,28%	2,76%	3,42%	16,31%	2.357.803,62	4,91%	782.118.799,97	0,30%
CAIXA	CAIXA	CAIXA FI AÇÕES DIVIDENDOS	15,52%	0,72%	1,39%	18,45%	2.001.581,54	4,17%	102.120.593,48	1,96%
SUL AMÉRICA Investimentos	BEM DTVM	SUL AMERICA EQUITIES FIA	19,48%	2,11%	0,19%	2,11%	11.916,39	0,02%	712.847.117,62	0,00%
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a - FI de Ações - Geral							5.344.499,75	11,14%		
CAIXA	CAIXA	CAIXA FIC FI CAP PROT BOL VAL MULTIM	1,37%	0,36%	1,02%	5,45%	225.842,61	0,47%	487.836.886,10	0,05%
Sub-total Artigo 8º III - FI Multimercado							225.842,61	0,47%		
Sub-total Renda Variável							5.886.369,99	12,27%		
Total							47.988.428,38	100%		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira					
Artigo	Classe	Valor(R\$)	% Carteira	Política Investimento	Limite Res. 4.604/17
Renda Fixa					
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos Públicos de emissão do TN	552.610,65	1,15%	5,00%	100,00%
Artigo 7º I, Alínea b	FI 100% Títulos TN	21.577.409,67	44,96%	40,00%	100,00%
Artigo 7º III, Alínea a	FI Renda Fixa "Referenciado"	8.122.377,22	16,93%	12,00%	60,00%
Artigo 7º IV, Alínea a	FI Renda Fixa - Geral	11.849.660,85	24,69%	20,00%	40,00%
Total Renda Fixa		42.102.058,40	87,73%		
Renda Variável					
Artigo 8º I, Alínea a	FI de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações	316.027,63	0,66%	3,00%	30,00%
Artigo 8º II, Alínea a	FI de Ações - Geral	5.344.499,75	11,14%	19,50%	20,00%
Artigo 8º III	FI Multimercado	225.842,61	0,47%	0,50%	10,00%
Total Renda Variável		5.886.369,99	12,27%		

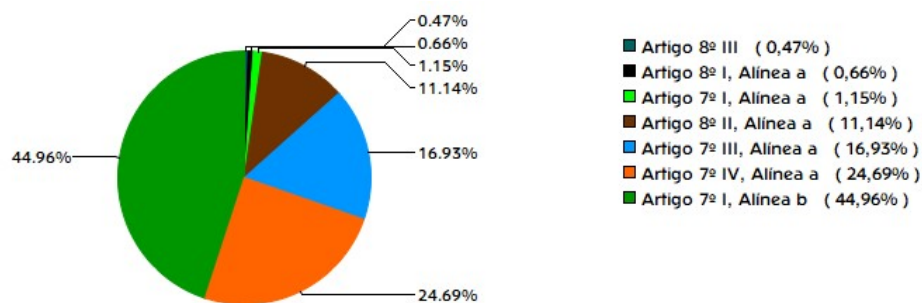
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)				
Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	-1,12 -221,8	13,61 517,7	-- --	-- --
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-0,42 -83,9	16,39 391,9	25,97 413,6	31,32 231,1
Artigo 7º III, Alínea a % do CDI	-0,43 -84,8	15,90 380,3	27,09 431,4	32,83 242,2
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,12 24,5	8,47 202,6	14,29 227,6	21,01 155,0
Artigo 8º I, Alínea a % do CDI	0,50 99,4	-2,28 -253,8	-- --	-- --
Artigo 8º II, Alínea a % do CDI	1,77 351,6	19,23 459,9	41,85 666,5	-- --
Artigo 8º III % do CDI	0,36 71,1	5,45 130,4	11,87 189,0	-- --

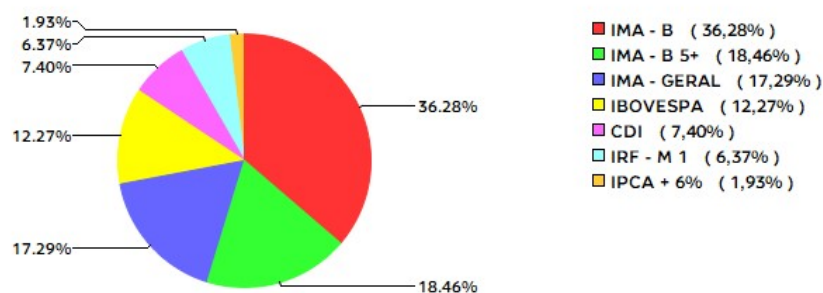
Ganhos Financeiros	
Estratégia	Ganho Bruto (R\$)
Artigo 7º I, Alínea a	-6.150,99
Artigo 7º I, Alínea b	-91.542,59
Artigo 7º III, Alínea a	-34.836,85
Artigo 7º IV, Alínea a	11.265,68
Artigo 8º I, Alínea a	1.573,58
Artigo 8º II, Alínea a	92.992,37
Artigo 8º III	805,89
Total	-25.892,92

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

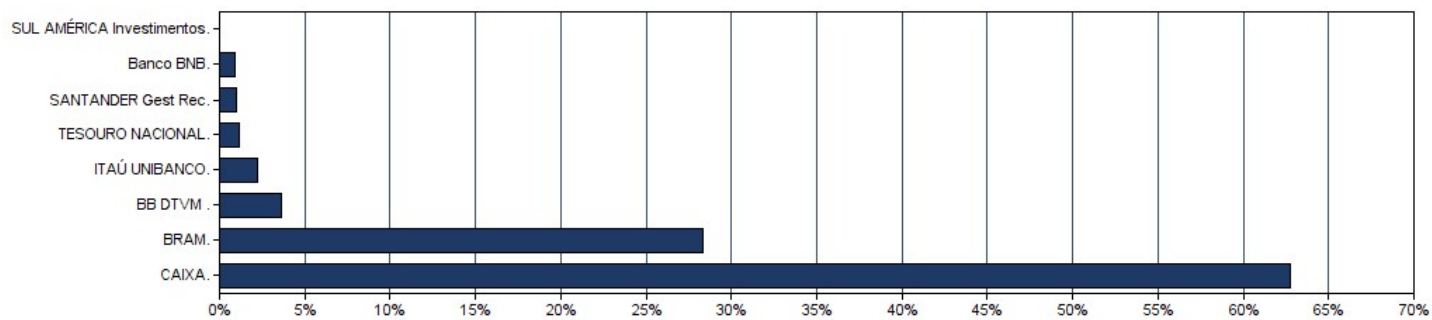
Alocação por Estratégia



Indexadores

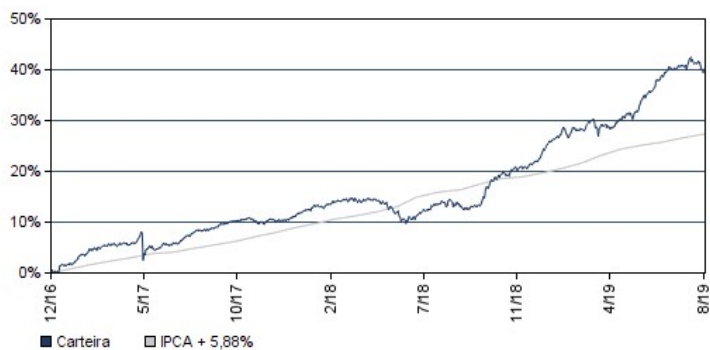
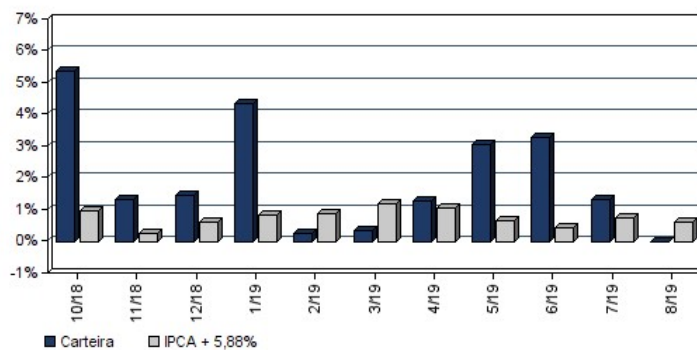


Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira													
Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
2017													
IPCA + 5,88%	1,64	2,87	1,05	0,03	-0,40	0,41	2,07	1,04	1,12	-0,01	-0,06	0,90	11,14
p.p. Índx	0,88	0,74	0,77	0,55	0,81	0,25	0,72	0,71	0,62	0,90	0,74	0,90	8,93
	0,76	2,13	0,27	-0,52	-1,21	0,16	1,35	0,33	0,51	-0,91	-0,80	0,00	2,21
2018													
IPCA + 5,88%	1,88	0,63	0,57	-0,12	-2,29	-0,47	1,98	-0,27	0,06	5,37	1,30	1,43	10,35
p.p. Índx	0,79	0,73	0,57	0,70	0,88	1,74	0,83	0,43	0,91	0,95	0,24	0,61	9,80
	1,09	-0,10	0,00	-0,82	-3,17	-2,21	1,15	-0,70	-0,86	4,42	1,06	0,83	0,56
2019													
IPCA + 5,88%	4,34	0,25	0,33	1,28	3,02	3,28	1,33	-0,04	--	--	--	--	14,55
p.p. Índx	0,82	0,89	1,18	1,05	0,63	0,44	0,71	0,61	--	--	--	--	6,52
	3,52	-0,64	-0,86	0,23	2,39	2,83	0,62	-0,65	--	--	--	--	8,03

Evolução da Rentabilidade

Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco / Retorno da Carteira				
	Qtd.	Perc.		
Meses acima do Benchmark	19	59,4%		
Meses abaixo do Benchmark	13	40,6%		
	Rentab.	Mês		
Maior rentabilidade da Carteira	5,37%	out/18		
Menor rentabilidade da Carteira	-2,29%	mai/18		

Período	Rentabilidade (%)			Volat. Anual
	Carteira	IPCA + 5,88%	p.p. Indx.	
03 meses	4,61	1,78	2,8	4,688
06 meses	9,51	4,72	4,8	5,202
12 meses	24,10	9,44	14,7	4,777
24 meses	28,88	20,67	8,2	4,148
36 meses	--	--	--	--
Desde o início	40,49	27,39	13,1	5,082

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 150850 Var. do IPCA + 6% p.p.	-1,12 -1,74	16,10 12,56	6,88 5,08	16,10 12,56	16,10 12,56	16,10 12,56	16,10 12,56
FI CAIXA BRASIL TIT PUB RF LP Var. do IPCA + 6% p.p.	0,49 -0,13	4,15 -2,45	1,54 -0,27	3,11 -1,67	6,20 -3,35	13,25 -7,69	21,54 -6,23
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF Var. do IRF-M 1 p.p.	0,52 -0,02	4,50 -0,13	1,81 -0,05	3,45 -0,10	7,24 -0,17	14,42 -0,39	23,81 -0,56
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP RF LP Var. do IMA-B 5+ p.p.	-0,79 -0,02	21,65 -0,35	5,75 -0,07	13,61 -0,21	37,44 -0,75	40,76 -1,07	57,26 -1,48
BNB RPPS PREVIDENCIA FI RENDA FIXA Var. do IMA-B TOTAL p.p.	-0,35 0,05	14,56 -1,66	4,31 -0,34	9,92 -0,83	23,97 -3,55	29,64 -3,71	43,44 -4,77
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI Var. do IMA-B TOTAL p.p.	-0,42 -0,01	16,02 -0,20	4,60 -0,05	10,63 -0,13	27,17 -0,36	32,66 -0,69	47,21 -1,00
FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RF LP Var. do IMA-B TOTAL p.p.	-0,42 -0,02	16,06 -0,16	4,57 -0,08	10,60 -0,15	27,30 -0,23	32,79 -0,56	47,39 -0,82
CAIXA NOVO BRASIL FIC IMA-B RF LP Var. do IMA-B TOTAL p.p.	-0,43 -0,03	15,90 -0,32	4,54 -0,11	10,50 -0,25	27,09 -0,44	32,83 -0,52	47,08 -1,13

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
BRDESCO INST FIC FI RF IMA-GERAL Var. do IMA-GERAL TOTAL p.p.	0,05 -0,11	9,17 0,05	3,19 0,03	6,57 0,01	16,02 0,19	22,85 -0,06	29,06 -0,05
ITAU INST ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FIC FI Var. do IMA-GERAL TOTAL p.p.	0,32 0,15	4,83 0,75	3,85 0,69	4,83 0,75	4,83 0,75	4,83 0,75	4,83 0,75
BRDESCO FIC FI RF ALOCAÇÃO DINÂMICA % do CDI	0,10 20,67	8,82 211,04	3,15 203,42	6,29 202,15	10,53 214,83	10,53 214,83	10,53 214,83
SANTANDER FIC FI INSTIT RF REF DI % do CDI	0,50 98,59	2,70 98,76	1,53 98,56	2,70 98,76	2,70 98,76	2,70 98,76	2,70 98,76
BRDESCO FI RF REF DI FEDERAL EXTRA % do CDI	0,49 97,03	4,06 97,09	1,50 97,10	3,02 97,12	6,10 97,13	11,30 96,93	11,30 96,93
BRDESCO FI REFERENCIADO DI PREMIUM % do CDI	0,50 98,76	4,14 99,01	1,54 99,20	3,09 99,31	6,21 98,89	12,78 98,81	12,78 98,81
BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. do IBOVESPA p.p.	0,50 1,17	-2,28 0,96	-2,28 0,96	-2,28 0,96	-2,28 0,96	-2,28 0,96	-2,28 0,96
ITAU AÇÕES DUNAMIS FIC FI Var. do IBOVESPA p.p.	1,57 2,23	11,66 9,40	12,99 8,76	11,66 9,40	11,66 9,40	11,66 9,40	11,66 9,40
ITAU INSTITUCIONAL AÇÕES PHOENIX FI Var. do IBOVESPA p.p.	1,58 2,24	22,68 7,61	11,81 7,58	15,00 9,20	31,67 13,68	31,67 13,68	31,67 13,68
BRDESCO FIA SELECTION Var. do IBOVESPA p.p.	2,76 3,42	16,31 1,23	8,38 4,15	11,01 5,20	19,30 3,41	19,30 3,41	19,30 3,41
CAIXA FI AÇÕES DIVIDENDOS Var. do IBOVESPA p.p.	0,72 1,39	18,45 3,38	7,85 3,62	7,86 2,05	41,81 9,92	31,57 -0,82	31,57 -0,82
SUL AMERICA EQUITIES FIA Var. do IBOVESPA p.p.	2,11 0,19	2,11 0,19	2,11 0,19	2,11 0,19	2,11 0,19	2,11 0,19	2,11 0,19
CAIXA FIC FI CAP PROT BOL VAL MULTIM Var. do IBOVESPA p.p.	0,36 1,02	5,45 -9,62	2,13 -2,10	4,21 -1,60	11,87 -20,03	12,92 -18,29	12,92 -18,29
<i>CDI</i>	<i>0,50</i>	<i>4,18</i>	<i>1,55</i>	<i>3,11</i>	<i>6,28</i>	<i>13,55</i>	<i>27,25</i>
<i>IMA - B</i>	<i>-0,40</i>	<i>16,22</i>	<i>4,65</i>	<i>10,75</i>	<i>27,53</i>	<i>33,35</i>	<i>54,00</i>

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
IMA - B 5	0,05	8,38	2,76	6,16	14,43	22,05	39,02
IMA - B 5+	-0,77	22,00	5,82	13,81	38,20	41,83	65,16
IMA - GERAL	0,16	9,12	3,16	6,56	15,82	22,91	41,39
IRF - M	0,26	8,42	3,54	6,63	16,67	23,59	45,83
IRF - M 1	0,55	4,63	1,86	3,55	7,40	14,81	29,91
IRF - M 1+	0,10	9,83	4,13	7,74	20,45	27,07	52,39
IBOVESPA	-0,67	15,07	4,23	5,81	31,90	42,77	74,67
IFIX	-0,11	12,97	4,07	9,12	24,18	27,48	50,35
SMALL CAP	0,48	--	14,76	19,08	51,06	47,54	101,51
IPCA + 4,61%	0,50	5,66	1,46	4,09	8,14	17,82	26,26
IPCA + 4,81%	0,52	5,80	1,51	4,19	8,34	18,27	26,98
IPCA + 5,06%	0,54	5,97	1,58	4,31	8,60	18,83	27,88
IPCA + 5,27%	0,56	6,11	1,63	4,42	8,81	19,30	28,65
IPCA + 5,43%	0,57	6,21	1,67	4,50	8,98	19,66	29,23
IPCA + 5,5%	0,58	6,26	1,68	4,53	9,05	19,82	29,48

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
IPCA + 5,54%	0,58	6,29	1,69	4,55	9,09	19,91	29,63
IPCA + 5,61%	0,59	6,34	1,71	4,59	9,16	20,07	29,89
IPCA + 5,67%	0,59	6,38	1,73	4,62	9,22	20,20	30,11
IPCA + 5,71%	0,60	6,40	1,73	4,64	9,26	20,29	30,25
IPCA + 5,74%	0,60	6,42	1,74	4,65	9,29	20,36	30,36
IPCA + 5,77%	0,60	6,44	1,75	4,67	9,32	20,43	30,47
IPCA + 5,78%	0,60	6,45	1,75	4,67	9,33	20,45	30,51
IPCA + 5,80%	0,60	6,46	1,76	4,68	9,35	20,49	30,58
IPCA + 5,81%	0,60	6,47	1,76	4,69	9,36	20,52	30,62
IPCA + 5,82%	0,61	6,48	1,76	4,69	9,37	20,54	30,66
IPCA + 5,83%	0,61	6,48	1,76	4,70	9,38	20,56	30,69
IPCA + 5,84%	0,61	6,49	1,77	4,70	9,40	20,58	30,73
IPCA + 5,85%	0,61	6,50	1,77	4,71	9,41	20,61	30,77
IPCA + 5,86%	0,61	6,50	1,77	4,71	9,42	20,63	30,80
IPCA + 5,87%	0,61	6,51	1,77	4,72	9,43	20,65	30,84

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
IPCA + 5,88%	0,61	6,52	1,78	4,72	9,44	20,67	30,88
IPCA + 5,89%	0,61	6,52	1,78	4,73	9,45	20,70	30,91
IPCA + 6%	0,62	6,60	1,81	4,78	9,56	20,95	31,32
INPC + 4,61%	0,51	5,81	1,38	4,08	7,99	17,04	24,53
INPC + 4,81%	0,53	5,94	1,43	4,18	8,19	17,48	25,24
INPC + 5,06%	0,55	6,11	1,49	4,30	8,45	18,04	26,13
INPC + 5,27%	0,57	6,25	1,55	4,41	8,66	18,50	26,88
INPC + 5,43%	0,58	6,36	1,59	4,49	8,82	18,86	27,46
INPC + 5,54%	0,59	6,44	1,61	4,54	8,94	19,11	27,85
INPC + 5,61%	0,60	6,48	1,63	4,58	9,01	19,26	28,11
INPC + 5,67%	0,60	6,52	1,64	4,61	9,07	19,40	28,32
INPC + 5,71%	0,61	6,55	1,65	4,63	9,11	19,49	28,47
INPC + 5,74%	0,61	6,57	1,66	4,64	9,14	19,55	28,58
INPC + 5,77%	0,61	6,59	1,67	4,65	9,17	19,62	28,69
INPC + 5,78%	0,61	6,60	1,67	4,66	9,18	19,64	28,72

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
INPC + 5,80%	0,61	6,61	1,68	4,67	9,20	19,69	28,79
INPC + 5,81%	0,61	6,62	1,68	4,67	9,21	19,71	28,83
INPC + 5,82%	0,62	6,62	1,68	4,68	9,22	19,73	28,87
INPC + 5,83%	0,62	6,63	1,68	4,68	9,23	19,76	28,90
INPC + 5,84%	0,62	6,64	1,69	4,69	9,24	19,78	28,94
INPC + 5,85%	0,62	6,64	1,69	4,69	9,25	19,80	28,98
INPC + 5,86%	0,62	6,65	1,69	4,70	9,26	19,82	29,01
INPC + 5,87%	0,62	6,66	1,69	4,70	9,27	19,85	29,05
INPC + 5,88%	0,62	6,66	1,70	4,71	9,28	19,87	29,08
INPC + 5,89%	0,62	6,67	1,70	4,71	9,29	19,89	29,12
INPC + 6%	0,63	6,75	1,72	4,77	9,41	20,14	29,52