

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos											
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	VAR	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (29/03/2019)	% 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	3,49%	0,40	0,57%	-0,02%	2,22%	31.518.677,67	4,72%	5.377.416.934,86	0,59%
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,55%	0,08	0,44%	-0,03%	1,46%	7.002.212,31	1,05%	10.181.411.879,74	0,07%
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF IMA-B TP	5,93%	0,67	0,56%	-0,02%	5,46%	114.731.598,99	17,17%	4.887.849.428,33	2,35%
BRADESCO	BRADESCO	BRADESCO FI RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS	5,96%	0,67	0,56%	-0,02%	5,46%	54.397.211,41	8,14%	706.792.784,92	7,70%
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF	0,55%	0,08	0,44%	-0,03%	1,45%	10.801.077,32	1,62%	307.906.607,18	3,51%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IRFM 1 TP FI RF	0,55%	0,08	0,44%	-0,03%	1,47%	76.120.093,99	11,39%	15.289.754.586,12	0,50%
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF ALOCACAO ATIVA FICFI	2,98%	0,35	0,52%	-0,02%	2,94%	68.565.625,91	10,26%	5.854.681.523,58	1,17%
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI	4,67%	0,58	0,76%	-0,43%	3,10%	14.600.292,17	2,18%	491.481.177,59	2,97%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	4,13%	0,44	0,98%	-0,21%	2,58%	13.587.840,00	2,03%	78.907.682,59	17,22%
BRADESCO	BRADESCO	BRADESCO FI RF IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS	0,55%	0,08	0,45%	-0,02%	1,46%	6.114.472,93	0,91%	1.288.250.914,24	0,47%
BB	BB	BB RPPS RF IMA B5+ FI	8,70%	0,97	0,41%	-0,02%	7,52%	33.303.685,93	4,98%	1.460.761.923,78	2,28%
SANTANDER	SANTANDER	SANTANDER FIC IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF	3,07%	0,35	0,77%	-0,02%	2,84%	10.560.349,81	1,58%	1.303.513.436,22	0,81%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IMA B 5+ TP RF LP	8,65%	0,96	0,43%	0,00%	0,16%	30.046.896,39	4,50%	1.787.394.613,51	1,68%
BB	BB	BB IMA-B 5 FIC RF PREVIDENCIÁRIO LP	3,06%	0,35	0,76%	-0,03%	2,83%	29.087.859,17	4,35%	3.346.293.317,56	0,87%
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII	2,11%	0,26	0,66%	0,08%	2,54%	5.309.235,22	0,79%	658.743.010,56	0,81%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - 4604 - Fundos 100% Títulos Públicos - Referenciado				0,49				505.747.129,22	75,68%		
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Renda Fixa											
BB	BB	BB RPPS RF PERFIL FIC	0,04%	0,03	0,46%	98,32%	1,48%	79.081.984,11	11,83%	3.939.931.377,26	2,01%
ITAU	ITAU	ITAU INST ALOCACAO DINAMICA II FIC RF	1,89%	0,23	0,39%	-0,36%	3,12%	24.226.569,53	3,63%	2.885.249.673,01	0,84%
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Renda Fixa				0,08				103.308.553,64	15,46%		
Artigo 7º VII, Alínea a - 4604 - Cota Sênior de FIDC											
BRPP	BRPP	FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER III ..	-0%	-	-10,77%	-2.297,95%	-29,02%	4.262,07	0,00%	0,01	58.116.706,03%
VOTORANTIM	VOTORANTIM	FIDC SANASA-SEN..	4,46%	0,46	1,12%	238,55%	3,32%	5.324.440,22	0,80%	1,20	442.869.104,37%

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Posição de Ativos											
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	VAR	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (29/03/2019)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
VILA RICA	BRL DTVM	FIDC ITALIA SENIOR	0,00%	0,00	106,02%	22.614,09%	946,65%	15.590,74	0,00%	0,43	3.601.412,96%
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea a - 4604 - Cota Sênior de FIDC				0,46				5.344.293,03	0,80%		
Artigo 7º VII, Alínea b - 4604 - Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"											
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI	3,00%	0,35	0,80%	-0,39%	2,90%	2.022.077,49	0,30%	534.243.232,35	0,38%
ACRUX	ACRUX	URCA FI RF CRÉDITO PRIVADO PREVIDENCIÁRIO	0,00%	0,00	-2,28%	-487,06%	0,53%	261.416,53	0,04%	1,00	26.077.034,63%
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b - 4604 - Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"				0,31				2.283.494,02	0,34%		
Sub-total Renda Fixa				0,42				616.683.469,91	92,28%		
Renda Variável											
Artigo 8º II, Alínea a - 4604 - Fundos de Ações											
BRABESCO	BEM	BRABESCO FIA SELECTION	21,90%	2,33	0,24%	0,41%	-0,63%	9.936.921,40	1,49%	618.907.408,96	1,61%
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FI DE AÇÕES	20,29%	2,17	-1,42%	-1,24%	-0,99%	2.970.154,45	0,44%	903.663.757,93	0,33%
BBM	BBM	BAHIA AM VALUATION FC DE FIA	21,48%	2,30	0,52%	0,70%	7,76%	11.521.591,68	1,72%	896.881.500,73	1,28%
NAVI	BEM	NAVI INSTITUCIONAL FIA	19,60%	2,13	-0,72%	-0,54%	9,81%	12.395.706,86	1,85%	947.054.654,83	1,31%
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a - 4604 - Fundos de Ações				2,24				36.824.374,39	5,51%		
Artigo 8º III - 4604 - Fundos Multimercados											
AZ QUEST	BNY MELLON	AZ QUEST EQUITY HEDGE FC FI MULTI	2,46%	0,28	0,09%	19,84%	0,49%	4.156.640,45	0,62%	301.852.392,88	1,38%
XP	BNY MELLON	XP MACRO INSTITUCIONAL FIC FIM	1,83%	0,21	0,24%	50,72%	2,45%	4.208.181,99	0,63%	100.285.151,45	4,20%
Sub-total Artigo 8º III - 4604 - Fundos Multimercados				0,25				8.364.822,44	1,25%		
Artigo 8º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Participações											
ROMA	RJI	FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES LSH	0,00%	0,00	-0,04%	-8,59%	-0,13%	3.972.130,08	0,59%	415.786.938,31	0,96%
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Participações				0,00				3.972.130,08	0,59%		
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604 - Fundos de Investimentos Imobiliários											
RB CAPITAL INVESTIMENTOS LTDA	VOTORANTIM	RBRD11	0,00%	0,00	-0,95%	-0,77%	0,94%	2.407.153,43	0,36%	1,19	202.744.888,91%
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b - 4604 - Fundos de Investimentos Imobiliários				0,00				2.407.153,43	0,36%		
Sub-total Renda Variável				1,64				51.568.480,34	7,72%		
Total								668.251.950,25	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	505.747.129,22	75,68%	100,00%	100,00%
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604	Fundos de Renda Fixa	103.308.553,64	15,46%	40,00%	40,00%
Artigo 7º VII, Alínea a - 4604	Cota Sênior de FIDC	5.344.293,03	0,80%	5,00%	5,00%
Artigo 7º VII, Alínea b - 4604	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	2.283.494,02	0,34%	5,00%	5,00%
Total Renda Fixa		616.683.469,91	92,28%		
Renda Variável					
Artigo 8º II, Alínea a - 4604	Fundos de Ações	36.824.374,39	5,51%	15,00%	20,00%
Artigo 8º III - 4604	Fundos Multimercados	8.364.822,44	1,25%	10,00%	10,00%
Artigo 8º IV, Alínea a - 4604	Fundos de Participações	3.972.130,08	0,59%	5,00%	5,00%
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604	Fundos de Investimentos Imobiliários	2.407.153,43	0,36%	5,00%	5,00%
Total Renda Variável		51.568.480,34	7,71%		

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)				
Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
Artigo 7º I, Alínea b - 4604 % do CDI	0,55 116,9	3,15 207,9	9,04 142,5	-- --
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 % do CDI	0,51 108,7	2,18 144,2	7,37 116,3	-- --
Artigo 7º VII, Alínea a - 4604 % do CDI	1,26 268,3	3,85 254,3	37,21 586,7	-- --
Artigo 7º VII, Alínea b - 4604 % do CDI	0,44 93,4	2,62 173,3	3,63 57,3	-- --
Artigo 8º II, Alínea a - 4604 Var. IBOVESPA p.p	-0,13 0,0	8,90 0,3	-- --	-- --
Artigo 8º III - 4604 Var. IBOVESPA p.p	0,17 0,3	1,47 -7,1	-- --	-- --
Artigo 8º IV, Alínea a - 4604 Var. IBOVESPA p.p	0,00 0,2	0,00 -8,6	0,00 -11,8	-- --
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604 Var. IBOVESPA p.p	0,00 0,2	0,00 -8,6	0,00 -11,8	-- --

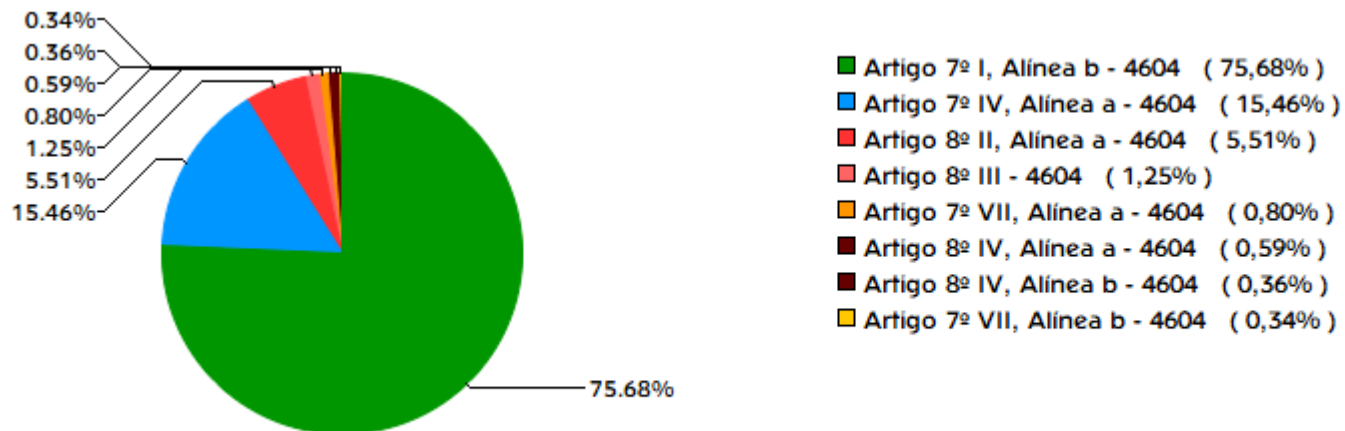
Ganhos Financeiros	
Estratégia	No Mês(R\$)
Artigo 7º I, Alínea b - 4604	2.756.669,33
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604	455.147,24
Artigo 7º VII, Alínea a - 4604	68.159,74
Artigo 7º VII, Alínea b - 4604	9.960,30
Artigo 8º II, Alínea a - 4604	-48.669,36
Artigo 8º III - 4604	13.844,88
Artigo 8º IV, Alínea a - 4604	-1.599,43
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604	-23.051,58
<b>Total</b>	<b>3.230.461,12</b>

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS****Análise da Disponibilidade Financeira**

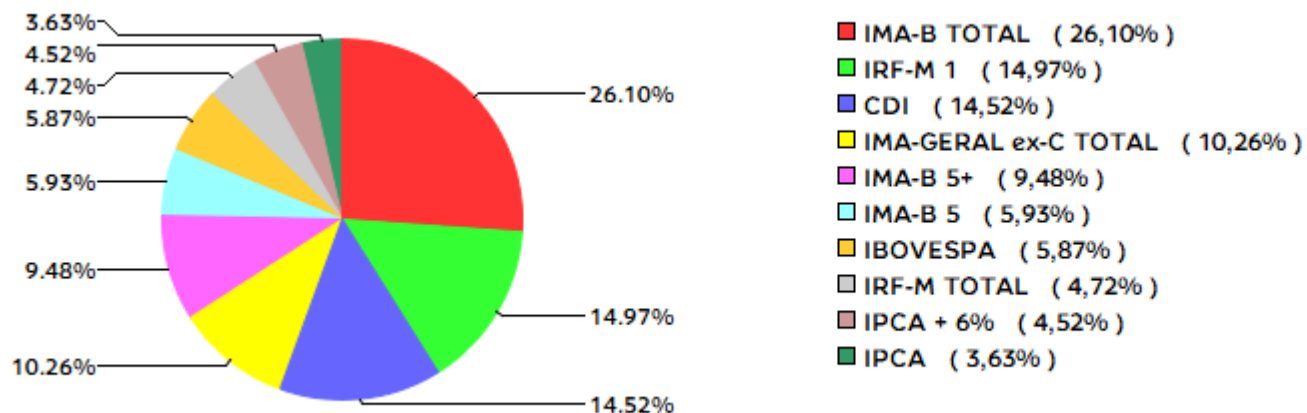
<b>Período</b>	<b>Valor (R\$)</b>	<b>(%)</b>	<b>Valor Acum. Bruto (R\$)</b>	<b>(%) Acum.</b>
de 0 a 30 dias	630.766.862,04	94	630.766.862,04	94
acima de 365 dias	37.485.088,21	6	668.251.950,25	100

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia

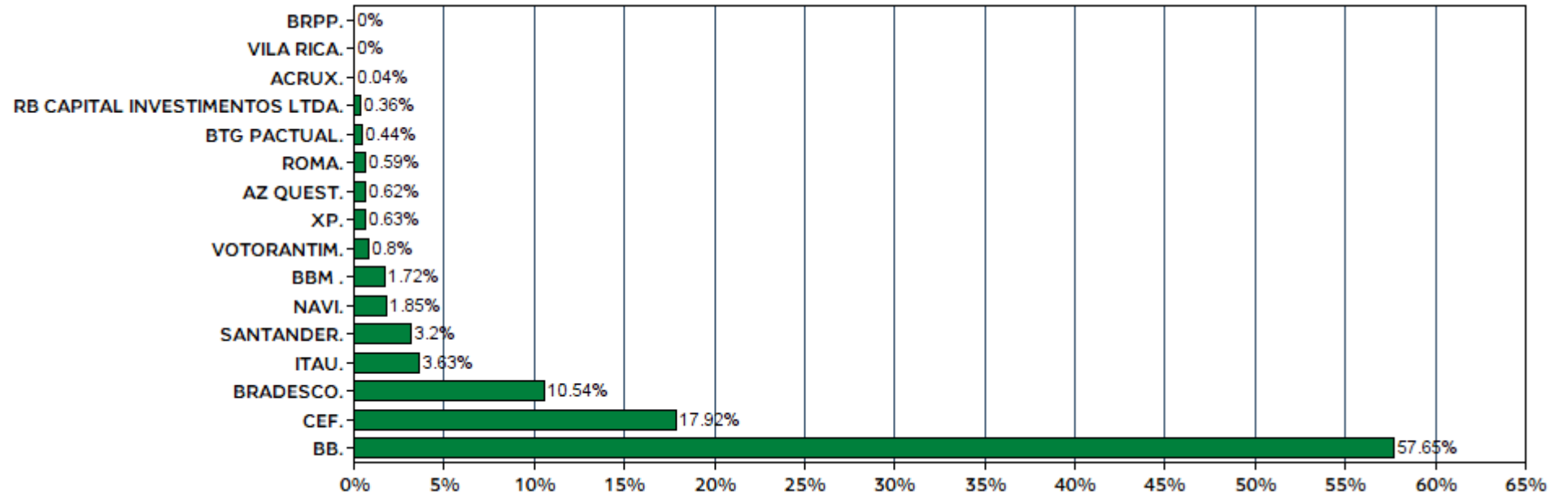


Indexadores



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

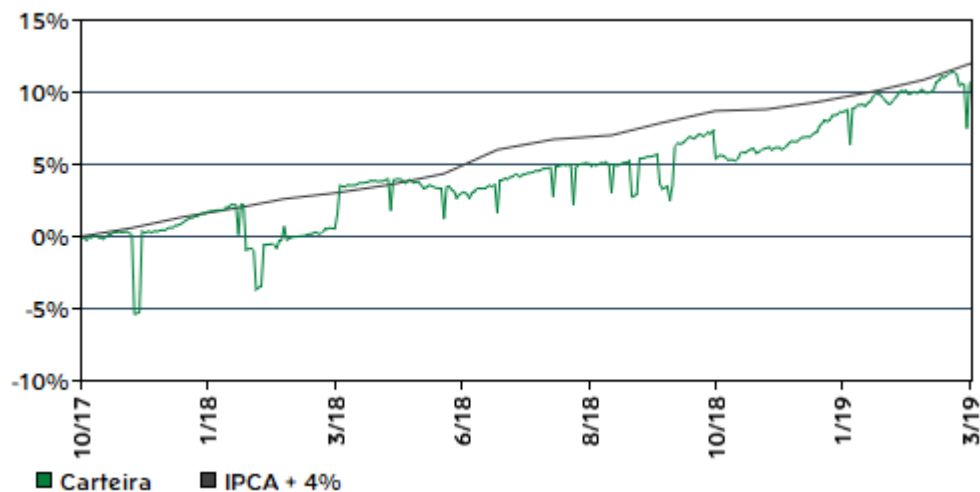
Alocação por Gestor



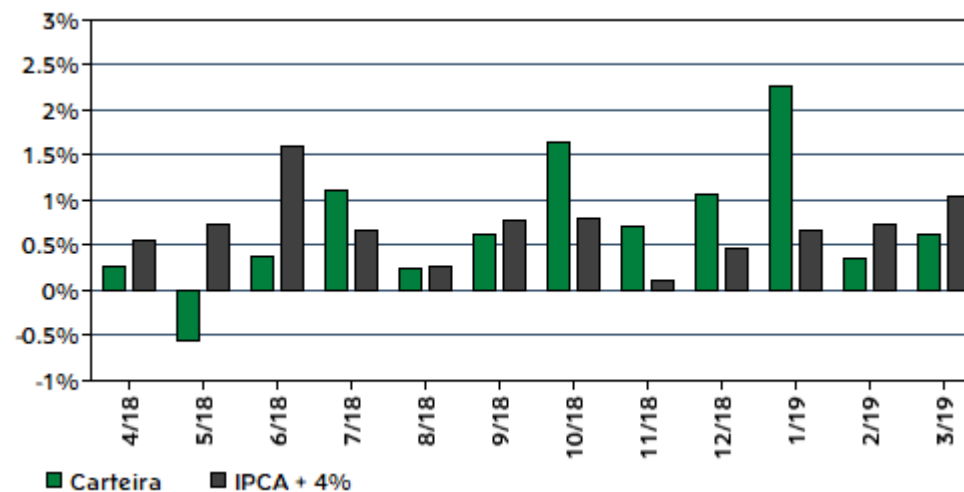
**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Rentabilidades da Carteira													
Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
2017	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	0,18	0,74	0,92
IPCA + 4%	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	0,59	0,75	1,35
p.p. Indx	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	-0,41	-0,02	-0,43
2018	-0,79	0,57	0,88	0,27	-0,56	0,38	1,10	0,24	0,62	1,65	0,70	1,07	6,28
IPCA + 4%	0,63	0,60	0,42	0,55	0,73	1,59	0,67	0,27	0,78	0,79	0,10	0,46	7,86
p.p. Indx	-1,42	-0,03	0,46	-0,27	-1,29	-1,21	0,43	-0,03	-0,16	0,86	0,60	0,61	-1,58
2019	2,26	0,36	0,63	--	--	--	--	--	--	--	--	--	3,27
IPCA + 4%	0,66	0,74	1,05	--	--	--	--	--	--	--	--	--	2,48
p.p. Indx	1,60	-0,38	-0,42	--	--	--	--	--	--	--	--	--	0,80

**Evolução da Rentabilidade**



**Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses**





**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Análise de Risco / Retorno da Carteira**

	Qtd.	Perct.
Meses acima do Benchmark	6	35,3%
Meses abaixo do Benchmark	11	64,7%

	Rentab.	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	2,26%	jan/19
Menor rentabilidade da Carteira	-0,79%	jan/18

Período	Rentabilidade (%)			Volat. Anual
	Carteira	IPCA + 4%	p.p. Indx.	
03 meses	3,27	2,48	0,8	10,720
06 meses	6,84	3,87	3,0	9,531
12 meses	9,05	8,72	0,3	10,720
24 meses	--	--	--	--
36 meses	--	--	--	--
Desde o início	10,77	12,02	-1,3	12,470

**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.	0,76 -0,03	2,83 -0,07	2,83 -0,07	7,56 -0,13	8,97 -0,22	21,82 -0,44	38,78 -0,73
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,66 0,08	2,54 -3,01	2,54 -3,01	6,49 -9,50	9,39 -4,32	21,05 -4,86	38,40 -14,67
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,44 -0,03	1,46 -0,07	1,46 -0,07	3,49 -0,09	6,45 -0,24	16,15 -0,50	32,20 -0,87
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI % do Var. IPCA + 6% p.p.	0,76 -0,43	3,10 0,15	3,10 0,15	8,90 4,06	18,43 7,63	28,96 8,51	43,21 9,66
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FICFI % do Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,52 -0,02	2,94 0,02	2,94 0,02	8,60 0,06	9,29 -0,01	20,53 -0,60	-- --
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,56 -0,02	5,46 -0,09	5,46 -0,09	15,78 -0,20	13,40 -0,31	25,24 -0,67	51,95 -1,12
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M TP % do Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,57 -0,02	2,22 -0,06	2,22 -0,06	8,54 -0,11	8,92 -0,22	22,62 -0,57	48,30 -0,82
BB RPPS RF IMA B5+ FI % do Var. IMA-B 5+ p.p.	0,41 -0,02	7,52 -0,14	7,52 -0,14	22,95 -0,28	16,98 -0,30	28,38 -0,91	61,43 -1,57

## 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
BRADESCO FI RF IMA B TÍTULOS PÚBLICOS % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,56 -0,02	5,46 -0,08	5,46 -0,08	15,79 -0,20	13,28 -0,43	24,89 -1,03	51,38 -1,68
BRADESCO FI RF IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,45 -0,02	1,46 -0,06	1,46 -0,06	3,47 -0,12	6,42 -0,27	16,15 -0,49	32,23 -0,84
CAIXA FI BRASIL IMA B 5+ TP RF LP % do Var. IMA-B 5+ p.p.	0,43 0,00	7,54 -0,12	7,54 -0,12	22,78 -0,45	16,82 -0,46	28,55 -0,74	61,39 -1,61
CAIXA FI BRASIL IRFM 1 TP FI RF % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,44 -0,03	1,47 -0,06	1,47 -0,06	3,51 -0,07	6,50 -0,18	16,26 -0,39	32,45 -0,62
FI CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS RF % do Var. IPCA + 6% p.p.	0,98 -0,21	2,58 -0,37	2,58 -0,37	4,68 -0,17	10,35 -0,44	16,78 -3,67	22,39 -11,16
SANTANDER FI IRFM 1 TÍTULOS PÚBLICOS RF % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,44 -0,03	1,45 -0,07	1,45 -0,07	3,57 -0,01	6,54 -0,15	16,34 -0,30	32,72 -0,35
SANTANDER FIC IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF % do Var. IMA-B 5 p.p.	0,77 -0,02	2,84 -0,05	2,84 -0,05	7,59 -0,09	8,98 -0,22	21,78 -0,48	38,72 -0,79
BB RPPS RF PERFIL FIC % do % do CDI	0,46 98,32	1,48 98,03	1,48 98,03	3,00 97,59	6,23 98,17	15,23 99,64	31,13 99,92
ITAU INST ALOCACAO DINAMICA II FIC RF % do Var. IPCA p.p.	0,39 -0,36	3,12 1,62	3,12 1,62	5,99 4,09	8,05 3,47	18,72 11,35	-- --
FIDC ITALIA SENIOR % do % do CDI	106,02 22.614,09	946,65 62.569,23	946,65 62.569,23	422,52 13.744,35	133,75 2.108,80	407,08 2.662,87	33,39 107,17
FIDC MULTISSETORIAL BVA MASTER III .. % do % do CDI	-10,77 -2.297,95	-29,02 -1.918,30	-29,02 -1.918,30	-49,72 -1.617,50	-42,43 -668,95	-18,08 -118,24	-56,67 -181,91
FIDC SANASA-SEN.. % do % do CDI	1,12 238,55	3,32 219,53	3,32 219,53	6,73 219,01	15,13 238,58	18,98 124,16	-- --
BB PREVIDENCIÁRIO RF CRÉDITO PRIVADO IPCA III FI % do Var. IPCA + 6% p.p.	0,80 -0,39	2,90 -0,05	2,90 -0,05	7,39 2,55	10,02 -0,78	24,44 3,98	46,59 13,04
URCA FI RF CRÉDITO PRIVADO PREVIDENCIÁRIO % do % do CDI	-2,28 -487,06	0,53 34,71	0,53 34,71	-34,40 -1.119,03	-30,23 -476,60	-23,23 -151,95	-13,59 -43,62
BAHIA AM VALUATION FC DE FIA % do Var. IBOVESPA p.p.	0,52 0,70	7,76 -0,81	7,76 -0,81	18,91 -1,34	15,36 3,59	52,22 5,40	104,77 14,15

## 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
BRDESCO FIA SELECTION % do Var. IBOVESPA p.p.	0,24 0,41	5,02 -3,54	5,02 -3,54	18,80 -1,46	13,05 1,28	64,29 17,47	111,22 20,60
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FI DE AÇÕES % do Var. IBOVESPA p.p.	-1,42 -1,24	4,12 -4,44	4,12 -4,44	25,19 4,94	14,40 2,63	50,91 4,08	75,20 -15,42
NAVI INSTITUCIONAL FIA % do Var. IBOVESPA p.p.	-0,72 -0,54	9,81 1,24	9,81 1,24	29,28 9,02	23,79 12,01	67,47 20,64	154,65 64,03
AZ QUEST EQUITY HEDGE FC FI MULTI % do % do CDI	0,09 19,84	0,49 32,27	0,49 32,27	3,37 109,74	6,77 106,69	17,02 111,34	40,52 130,07
XP MACRO INSTITUCIONAL FIC FIM % do % do CDI	0,24 50,72	2,45 162,03	2,45 162,03	4,13 134,45	5,13 80,94	16,20 105,97	-- --
FUNDO DE INVESTIMENTO EM PARTICIPAÇÕES LSH % do % do CDI	-0,04 -8,59	-0,13 -8,50	-0,13 -8,50	-0,26 -8,45	-16,40 -258,61	-- --	-- --
RBRD11 % do Var. IBOVESPA p.p.	-0,95 -0,77	0,94 -7,63	0,94 -7,63	11,98 -8,28	10,42 -1,35	-- --	-- --
CDI	0,47	1,51	1,51	3,07	6,34	15,29	31,15
IBOVESPA	-0,18	8,56	8,56	20,26	11,77	46,83	90,62
DOLAR COMERCIAL	4,23	0,57	0,57	-2,68	17,24	22,99	9,49
INPC + 6%	1,21	3,12	3,12	4,91	10,90	19,24	32,20
IPCA + 6%	1,19	2,95	2,95	4,84	10,80	20,46	33,55