

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Posição de Ativos										
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (31/07/2019)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
<b>Renda Fixa</b>										
BANESTES DTVM	Banco BANESTES	FI BANESTES PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B	8,09%	2,51%	1,22%	23,94%	1.842.709,30	0,99%	328.089.112,80	0,56%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI	5,44%	1,27%	-0,01%	16,50%	33.794.047,53	18,23%	5.842.140.278,42	0,58%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RF LP	5,44%	1,27%	-0,01%	16,55%	32.126.202,17	17,33%	10.634.242.466,28	0,30%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA II FI	1,19%	0,74%	0,01%	5,13%	1.113.797,65	0,60%	224.880.218,11	0,50%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL 2024 I TP RF	6,26%	0,95%	-0,33%	8,85%	1.349.642,53	0,73%	441.531.327,85	0,31%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,73%	1,02%	0,05%	5,56%	7.494.746,76	4,04%	7.419.279.081,84	0,10%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5+ TP FI	8,03%	1,49%	-0,02%	14,16%	36.049.507,15	19,44%	2.950.319.569,85	1,22%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP RF LP	7,96%	1,51%	0,00%	22,61%	12.734.210,20	6,87%	2.894.716.398,57	0,44%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,41%	0,97%	-0,01%	7,15%	4.170.656,54	2,25%	4.114.827.361,37	0,10%
<b>Sub-total 4604 - Artigo 7º I, Alínea b - FI 100% Títulos TN</b>							<b>130.675.519,83</b>	<b>70,47%</b>		
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA ALIANÇA TP RF	0,06%	0,56%	98,68%	3,65%	1.199.742,64	0,65%	313.939.049,20	0,38%
BANESTES DTVM	Banco BANESTES	BANESTES ESTRATÉGIA FIC FI RF	2,53%	1,43%	251,36%	11,02%	4.397.912,42	2,37%	72.389.977,87	6,08%
BANESTES DTVM	Banco BANESTES	FI BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA	7,44%	2,53%	1,24%	23,02%	12.320.073,47	6,64%	290.834.366,70	4,24%
<b>Sub-total 4604 - Artigo 7º IV, Alínea a - FI Renda Fixa - Geral</b>							<b>17.917.728,53</b>	<b>9,66%</b>		
<b>Sub-total Renda Fixa - FI Renda Fixa - Geral</b>							<b>148.593.248,36</b>	<b>80,14%</b>		
<b>Renda Variável</b>										
CAIXA	CAIXA	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	21,10%	0,78%	-0,06%	15,48%	5.800.015,85	3,13%	407.231.348,12	1,42%
<b>Sub-total 4604 - Artigo 8º I, Alínea a - FI de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações</b>							<b>5.800.015,85</b>	<b>3,13%</b>		
BANESTES DTVM	Banco BANESTES	BANESTES FIC FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INST	19,05%	4,59%	3,76%	22,64%	6.464.946,26	3,49%	69.873.081,07	9,25%
CAIXA	CAIXA	FIA CAIXA DIVIDENDOS	15,06%	3,51%	2,67%	17,60%	212.086,37	0,11%	95.487.742,32	0,22%
VINCI EQUITIES Gest Rec	CAIXA	FIC FIA CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	16,24%	1,04%	0,20%	22,30%	22.977.152,19	12,39%	696.683.771,42	3,30%
<b>Sub-total 4604 - Artigo 8º II, Alínea a - FI de Ações - Geral</b>							<b>29.654.184,82</b>	<b>15,99%</b>		
RIO BRAVO Invest	CAIXA	CAIXA RIO BRAVO FII	0,00%	5,07%	4,88%	12,26%	1.376.482,68	0,74%	174.745.937,86	0,79%

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Posição de Ativos										
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (31/07/2019)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
							<b>Sub-total 4604 - Artigo 8º IV, Alínea b - FI Imobiliários</b>	<b>1.376.482,68</b>	<b>0,74%</b>	
							<b>Sub-total Renda Variável</b>	<b>36.830.683,35</b>	<b>19,86%</b>	
<b>Total</b>							<b>185.423.931,71</b>	<b>100%</b>		

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

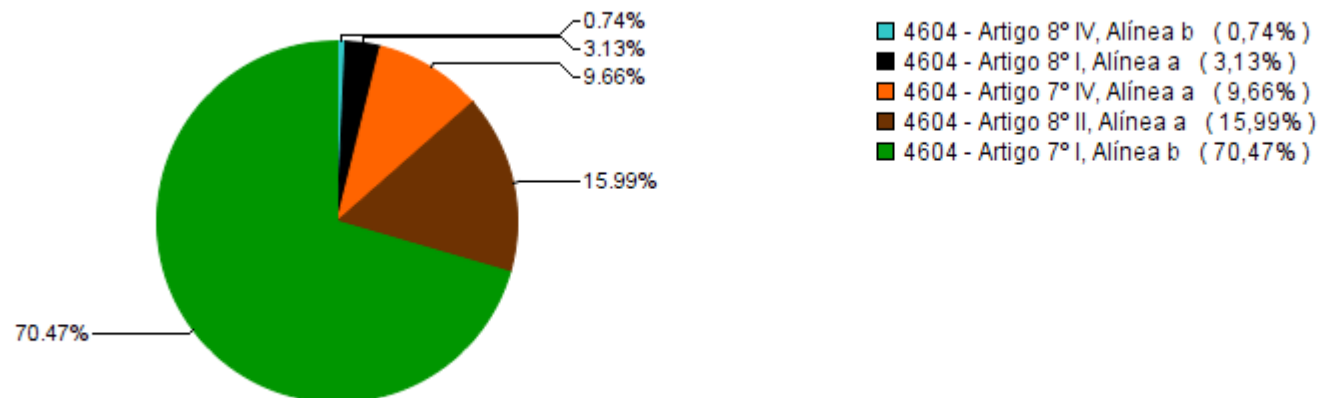
Enquadramento da Carteira					
Artigo	Classe	Valor(R\$)	% Carteira	Política Investimento	Limite Res. 4.604/17
<b>Renda Fixa</b>					
4604 - Artigo 7º I, Alínea b	FI 100% Títulos TN	130.675.519,83	70,47%	<b>68,00%</b>	100,00%
4604 - Artigo 7º IV, Alínea a	FI Renda Fixa - Geral	17.917.728,53	9,66%	<b>9,00%</b>	40,00%
<b>Total Renda Fixa</b>		<b>148.593.248,37</b>	<b>80,13%</b>		
<b>Renda Variável</b>					
4604 - Artigo 8º I, Alínea a	FI de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações	5.800.015,85	3,13%	4,00%	30,00%
4604 - Artigo 8º II, Alínea a	FI de Ações - Geral	29.654.184,82	15,99%	18,00%	20,00%
4604 - Artigo 8º IV, Alínea b	FI Imobiliários	1.376.482,68	0,74%	1,00%	5,00%
<b>Total Renda Variável</b>		<b>36.830.683,35</b>	<b>19,86%</b>		

Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)				
Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
<b>4604 - Artigo 7º I, Alínea b</b> % do CDI	1,34 236,0	16,43 449,0	25,70 405,0	33,13 238,6
<b>4604 - Artigo 7º IV, Alínea a</b> % do CDI	2,13 375,2	16,26 444,2	22,99 362,4	30,19 217,4
<b>4604 - Artigo 8º I, Alínea a</b> % do CDI	0,78 137,7	15,48 423,0	27,92 440,0	52,68 379,3
<b>4604 - Artigo 8º II, Alínea a</b> % do CDI	1,80 317,8	22,71 620,5	44,12 695,3	54,55 392,8
<b>4604 - Artigo 8º IV, Alínea b</b> % do CDI	5,07 892,6	13,03 356,0	20,69 326,0	16,81 121,0

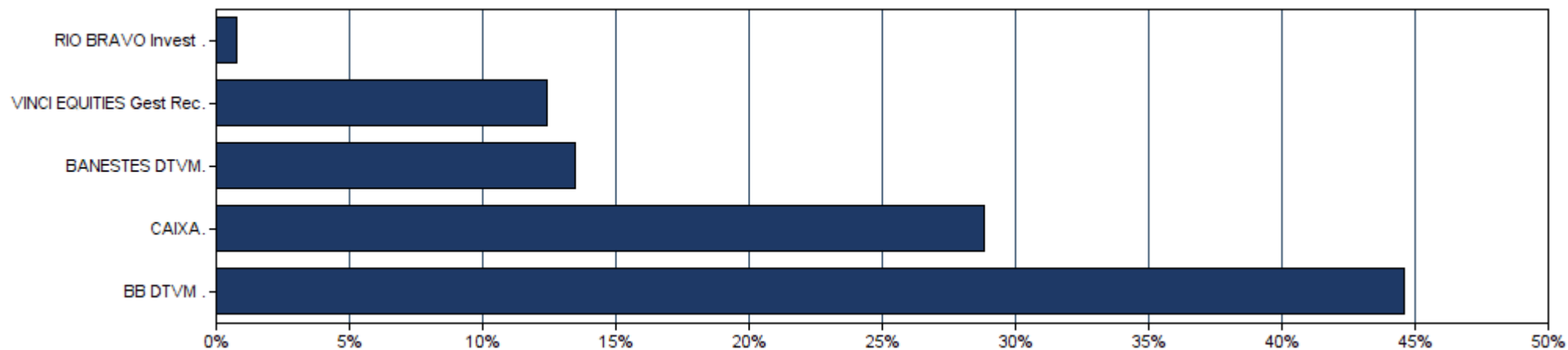
Ganhos Financeiros	
Estratégia	Ganho Bruto (R\$)
<b>4604 - Artigo 7º I, Alínea b</b>	1.725.508,73
<b>4604 - Artigo 7º IV, Alínea a</b>	355.934,57
<b>4604 - Artigo 8º I, Alínea a</b>	44.994,00
<b>4604 - Artigo 8º II, Alínea a</b>	513.109,29
<b>4604 - Artigo 8º IV, Alínea b</b>	66.519,90
<b>Total</b>	<b>2.706.066,49</b>

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Alocação por Estratégia**



**Alocação por Gestor**

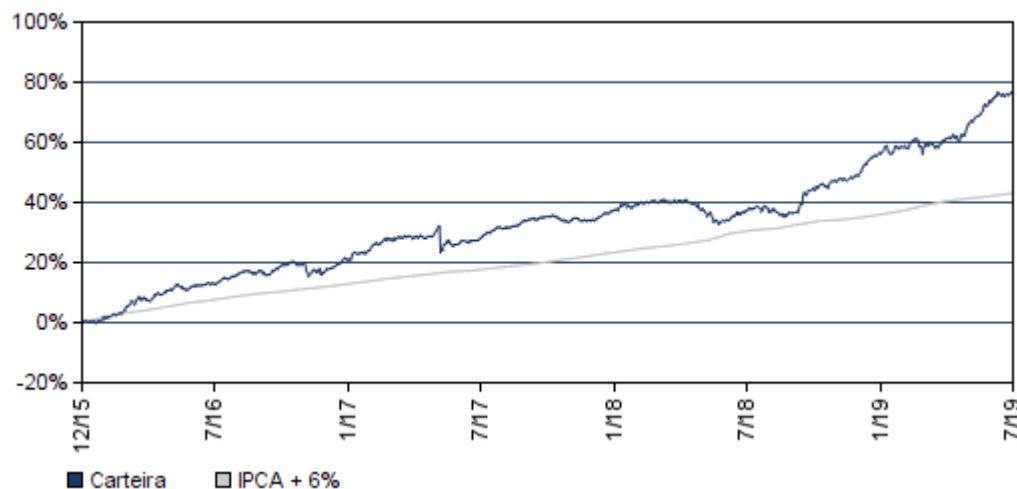


### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

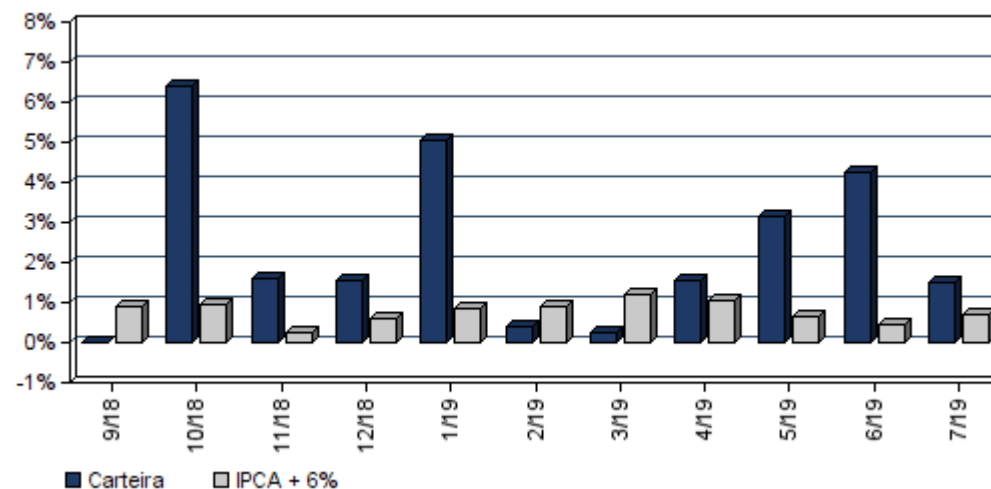
#### Rentabilidades da Carteira

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
<b>2016</b>	1,34	1,97	4,06	3,03	0,07	1,69	2,33	0,88	1,50	1,07	-1,32	2,51	20,77
<b>IPCA + 6%</b>	1,74	1,34	0,94	1,08	1,27	0,86	1,01	0,98	0,57	0,72	0,64	0,81	12,64
<b>p.p. Indx</b>	-0,40	0,63	3,12	1,95	-1,20	0,83	1,32	-0,10	0,93	0,34	-1,96	1,70	8,13
<b>2017</b>	1,89	3,69	0,85	-0,21	-1,20	0,24	2,79	1,28	1,65	-0,06	-0,56	1,19	12,05
<b>IPCA + 6%</b>	0,89	0,75	0,78	0,56	0,82	0,26	0,73	0,72	0,62	0,91	0,74	0,91	9,05
<b>p.p. Indx</b>	1,00	2,94	0,06	-0,77	-2,02	-0,02	2,07	0,56	1,03	-0,97	-1,31	0,28	3,00
<b>2018</b>	2,87	0,34	0,73	-0,01	-3,46	-0,88	2,39	-0,73	-0,02	6,39	1,59	1,56	10,97
<b>IPCA + 6%</b>	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
<b>p.p. Indx</b>	2,07	-0,40	0,16	-0,72	-4,34	-2,63	1,55	-1,18	-0,95	5,43	1,34	0,95	1,05
<b>2019</b>	5,07	0,38	0,27	1,53	3,15	4,24	1,49	--	--	--	--	--	17,17
<b>IPCA + 6%</b>	0,83	0,90	1,19	1,06	0,64	0,45	0,72	--	--	--	--	--	5,94
<b>p.p. Indx</b>	4,24	-0,52	-0,92	0,47	2,51	3,79	0,77	--	--	--	--	--	11,24

#### 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	IPCA + 6%	p.p. Indx.	
Meses <b>acima</b> do Benchmark	26	60,5%					
Meses <b>abaixo</b> do Benchmark	17	39,5%					
	Rentab.	Mês					
<b>Maior</b> rentabilidade da Carteira	6,39%	out/18	<b>03 meses</b>	9,13	1,83	7,3	5,200
<b>Menor</b> rentabilidade da Carteira	-3,46%	mai/18	<b>06 meses</b>	11,52	5,07	6,5	5,975
			<b>12 meses</b>	27,65	9,36	18,3	5,904
			<b>24 meses</b>	34,62	21,07	13,5	4,939
			<b>36 meses</b>	52,52	31,78	20,7	6,251
			<b>Desde o início</b>	75,95	43,03	32,9	6,085

#### 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
FI BANESTES PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B Var. do IMA-B TOTAL p.p.	2,51 1,22	23,94 7,25	13,93 5,01	17,64 5,83	38,55 11,09	44,02 8,33	48,70 7,23
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI Var. do IMA-B TOTAL p.p.	1,27 -0,01	16,50 -0,19	8,84 -0,08	11,64 -0,17	27,11 -0,36	34,97 -0,71	54,85 -1,15
FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RF 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	35,12 -0,56	55,15 -0,85
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA II FI Var. do IPCA + 6% p.p.	0,74 0,01	5,13 -0,81	1,91 0,08	4,04 -1,03	9,55 0,18	18,50 -2,57	34,36 2,58
FI CAIXA BRASIL 2024 I TP RF Var. do IMA-B TOTAL p.p.	0,95 -0,33	8,85 -7,84	6,46 -2,46	6,27 -5,53	13,51 -13,96	15,56 -20,13	25,91 -30,08
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. do IMA-GERAL TOTAL p.p.	1,02 0,05	5,56 0,40	5,29 0,40	5,56 0,40	5,56 0,40	5,56 0,40	5,56 0,40
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5+ TP FI Var. do IMA-B 5+ p.p.	1,49 -0,02	14,16 -0,29	12,07 -0,12	14,16 -0,29	14,16 -0,29	14,16 -0,29	14,16 -0,29
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP RF LP Var. do IMA-B 5+ p.p.	1,51 0,00	22,61 -0,33	12,04 -0,15	15,10 -0,22	39,82 -0,75	39,82 -0,75	39,82 -0,75

**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 IMA-B 5 LP FIC FI Var. do IMA-B 5 p.p.	0,97 -0,01	7,15 -0,12	4,09 -0,04	6,58 -0,11	7,15 -0,12	7,15 -0,12	7,15 -0,12
FI CAIXA ALIANÇA TP RF % do CDI	0,56 98,68	3,65 99,62	1,63 102,34	3,10 100,10	6,27 98,74	13,52 97,33	27,57 97,94
BANESTES ESTRATÉGIA FIC FI RF % do CDI	1,43 251,36	11,02 301,05	6,10 383,96	9,03 291,24	18,07 284,72	18,23 280,37	18,23 280,37
FI BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA Var. do IMA-B TOTAL p.p.	2,53 1,24	23,02 6,33	13,86 4,94	17,41 5,60	35,93 8,46	40,94 5,25	62,04 6,04
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA Var. do IBOVESPA p.p.	0,78 -0,06	15,48 -0,37	5,55 -0,11	4,39 -0,15	27,92 -0,60	52,68 -1,77	74,77 -2,89
BANESTES FIC FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INST Var. do IBOVESPA p.p.	4,59 3,76	22,64 6,79	13,26 7,60	13,97 9,43	43,81 15,30	46,10 12,23	46,10 12,23
FIA CAIXA DIVIDENDOS Var. do IBOVESPA p.p.	3,51 2,67	17,60 1,76	8,37 2,71	3,75 -0,79	37,57 9,05	44,47 3,31	44,47 3,31
FIC FIA CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. do IBOVESPA p.p.	1,04 0,20	22,30 6,46	7,02 1,36	8,97 4,44	43,74 15,22	52,55 -1,89	62,80 -14,85
CAIXA RIO BRAVO FII Var. do IPCA p.p.	5,07 4,88	12,26 9,83	8,31 7,98	7,36 5,27	19,86 16,64	16,01 8,16	46,61 35,83
IPCA + 5,5%	0,68	5,65	1,70	4,82	8,85	19,94	29,94
CDI	0,57	3,66	1,59	3,10	6,35	13,89	28,15
IMA-B 5	0,97	8,33	4,13	6,69	14,08	23,52	40,47
IMA-B 5+	1,51	22,95	12,19	15,32	38,55	44,87	67,90
IMA-B TOTAL	1,29	16,69	8,92	11,81	27,47	35,68	56,00
IMA-GERAL TOTAL	0,97	8,95	4,89	6,90	15,39	24,03	42,61

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Análise dos Fundos & Ativos da Carteira**

**Rentabilidades em Períodos Fechados (%)**

<b>Fundo / Indexador</b>	<b>No Mês</b>	<b>No Ano</b>	<b>3 meses</b>	<b>6 meses</b>	<b>12 meses</b>	<b>24 meses</b>	<b>36 meses</b>
<i>IRF-M 1</i>	0,72	4,06	1,99	3,46	7,29	15,22	30,75
<i>IRF-M 1+</i>	1,27	9,72	6,27	7,88	18,56	28,35	53,56
<i>IRF-M TOTAL</i>	1,09	8,14	5,09	6,66	15,28	24,57	46,87
<i>IBOVESPA</i>	0,84	15,84	5,67	4,54	28,52	54,45	77,66
<i>IFIX</i>	1,27	13,10	6,02	10,37	23,45	28,73	53,29
<i>SMALL CAP</i>	6,75	--	16,46	16,36	43,96	59,44	100,91
<i>INPC + 6%</i>	0,63	6,08	1,75	5,16	9,30	19,98	29,80
<i>IPCA + 6%</i>	0,72	5,94	1,83	5,07	9,36	21,07	31,78