

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos										
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (30/09/2019)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
Renda Fixa										
BANESTES DTVM	Banco BANESTES	FI BANESTES PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B	7,88%	5,00%	2,14%	27,37%	1.893.755,39	0,98%	308.416.662,17	0,61%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI	5,19%	2,85%	-0,01%	19,32%	34.643.554,62	18,00%	6.210.669.016,03	0,56%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RF LP	5,20%	2,85%	-0,01%	19,37%	32.902.377,56	17,10%	11.475.861.578,54	0,29%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA II FI	0,99%	0,70%	0,25%	6,12%	1.093.245,32	0,57%	220.730.947,01	0,50%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL 2024 I TP RF	5,49%	2,19%	-0,67%	8,61%	1.346.771,91	0,70%	440.592.175,00	0,31%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,51%	1,50%	0,03%	7,23%	7.613.533,53	3,96%	8.760.808.473,08	0,09%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5+ TP FI	7,72%	3,71%	-0,02%	17,45%	37.090.968,91	19,28%	2.952.067.514,60	1,26%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP RF LP	7,67%	3,69%	-0,04%	26,14%	15.849.448,93	8,24%	3.083.627.058,43	0,51%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP FIC FI	2,13%	1,72%	-0,02%	9,03%	4.243.854,96	2,21%	4.532.246.367,34	0,09%
Sub-total 4604 - Artigo 7º I, Alínea b - FI 100% Títulos TN							136.677.511,12	71,03%		
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA ALIANÇA TP RF	0,06%	0,49%	105,27%	4,66%	262.375,05	0,14%	297.660.184,61	0,09%
BANESTES DTVM	Banco BANESTES	BANESTES ESTRATÉGIA FIC FI RF	2,61%	2,06%	442,30%	14,00%	4.516.165,42	2,35%	106.090.504,71	4,26%
BANESTES DTVM	Banco BANESTES	FI BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA	7,34%	4,69%	1,83%	26,31%	12.649.439,55	6,57%	296.774.651,50	4,26%
Sub-total 4604 - Artigo 7º IV, Alínea a - FI Renda Fixa - Geral							17.427.980,02	9,06%		
Sub-total Renda Fixa - FI Renda Fixa - Geral							154.105.491,14	80,09%		
Renda Variável										
CAIXA	CAIXA	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	20,40%	3,52%	-0,05%	18,71%	5.962.245,95	3,10%	444.574.917,12	1,34%
Sub-total 4604 - Artigo 8º I, Alínea a - FI de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações							5.962.245,95	3,10%		
BANESTES DTVM	Banco BANESTES	BANESTES FIC FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INST	18,80%	1,25%	-2,32%	26,56%	7.060.039,74	3,67%	87.535.122,01	8,07%
CAIXA	CAIXA	FIA CAIXA DIVIDENDOS	15,32%	1,40%	-2,17%	20,11%	216.620,41	0,11%	118.589.325,75	0,18%
VINCI EQUITIES Gest Rec	CAIXA	FIC FIA CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	16,94%	1,05%	-2,52%	25,88%	23.648.292,24	12,29%	707.345.831,99	3,34%
Sub-total 4604 - Artigo 8º II, Alínea a - FI de Ações - Geral							30.924.952,40	16,07%		
RIO BRAVO Invest	CAIXA	CAIXA RIO BRAVO FII	0,00%	1,85%	1,89%	17,20%	1.418.605,56	0,74%	171.335.586,77	0,83%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos										
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (30/09/2019)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
Sub-total 4604 - Artigo 8º IV, Alínea b - FI Imobiliários							1.418.605,56	0,74%		
Sub-total Renda Variável							38.305.803,91	19,91%		
Total							192.411.295,04	100%		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

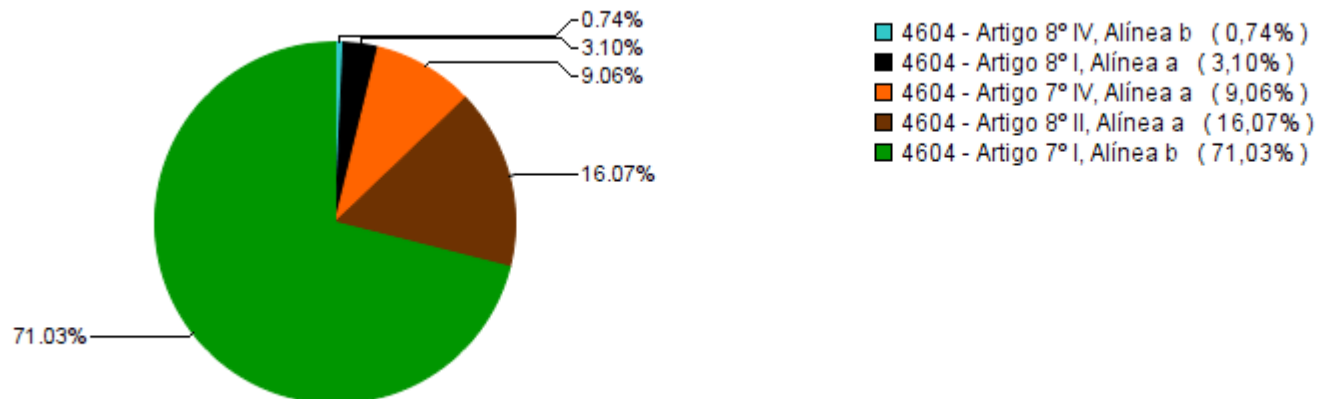
Enquadramento da Carteira					
Artigo	Classe	Valor(R\$)	% Carteira	Política Investimento	Limite Res. 4.604/17
Renda Fixa					
4604 - Artigo 7º I, Alínea b	FI 100% Títulos TN	136.677.511,12	71,03%	68,00%	100,00%
4604 - Artigo 7º IV, Alínea a	FI Renda Fixa - Geral	17.427.980,02	9,06%	9,00%	40,00%
Total Renda Fixa		154.105.491,14	80,09%		
Renda Variável					
4604 - Artigo 8º I, Alínea a	FI de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações	5.962.245,95	3,10%	4,00%	30,00%
4604 - Artigo 8º II, Alínea a	FI de Ações - Geral	30.924.952,40	16,07%	18,00%	20,00%
4604 - Artigo 8º IV, Alínea b	FI Imobiliários	1.418.605,56	0,74%	1,00%	5,00%
Total Renda Variável		38.305.803,91	19,91%		

Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)				
Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
4604 - Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	3,07 659,2	19,37 415,0	29,53 470,5	33,07 247,7
4604 - Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	3,83 821,9	19,28 413,2	25,85 411,9	30,69 229,8
4604 - Artigo 8º I, Alínea a % do CDI	3,52 755,0	18,71 400,9	31,29 498,6	39,55 296,2
4604 - Artigo 8º II, Alínea a % do CDI	1,09 235,1	26,36 564,8	54,54 869,0	43,06 322,5
4604 - Artigo 8º IV, Alínea b % do CDI	1,85 396,3	18,01 386,0	27,44 437,2	20,17 151,1

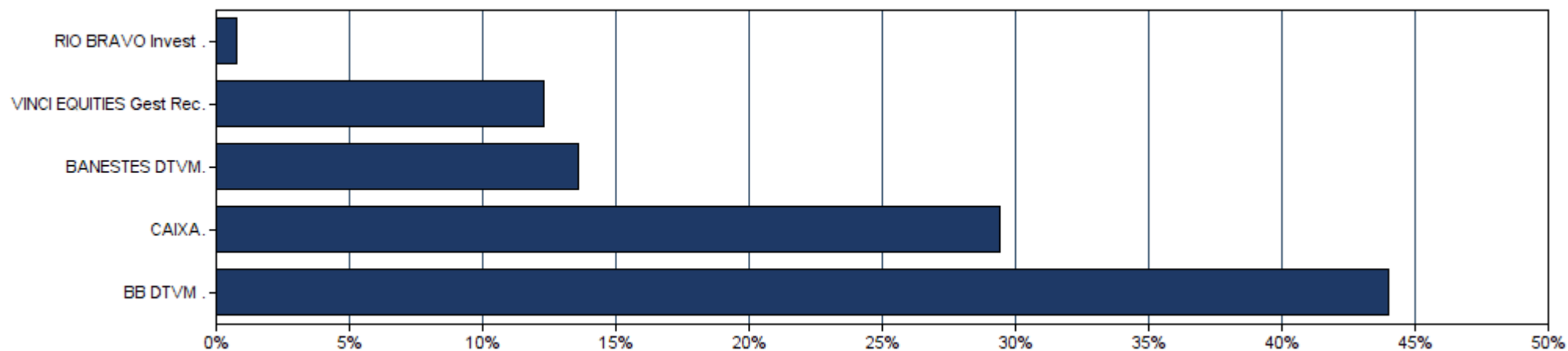
Ganhos Financeiros	
Estratégia	Ganho Bruto (R\$)
4604 - Artigo 7º I, Alínea b	4.060.571,38
4604 - Artigo 7º IV, Alínea a	660.828,86
4604 - Artigo 8º I, Alínea a	202.488,02
4604 - Artigo 8º II, Alínea a	333.473,91
4604 - Artigo 8º IV, Alínea b	25.585,56
Total	5.282.947,73

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia



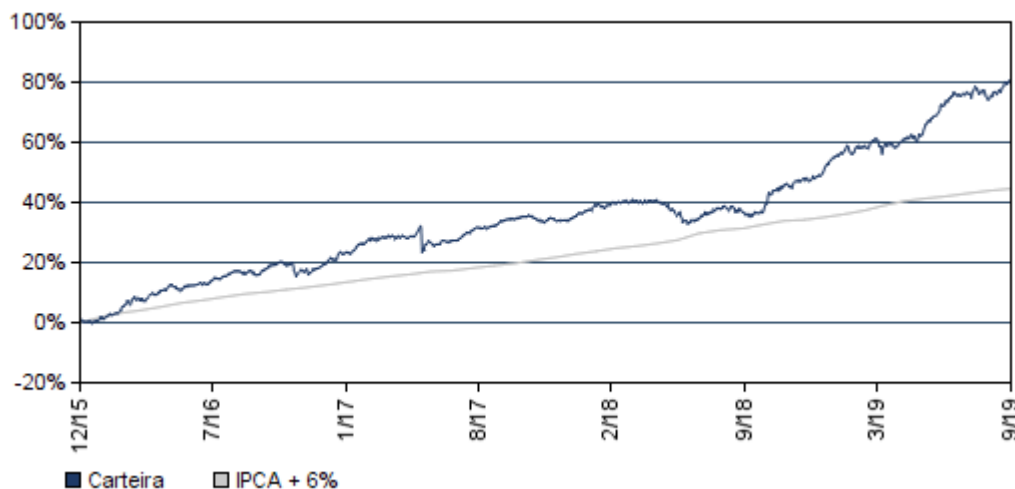
Alocação por Gestor



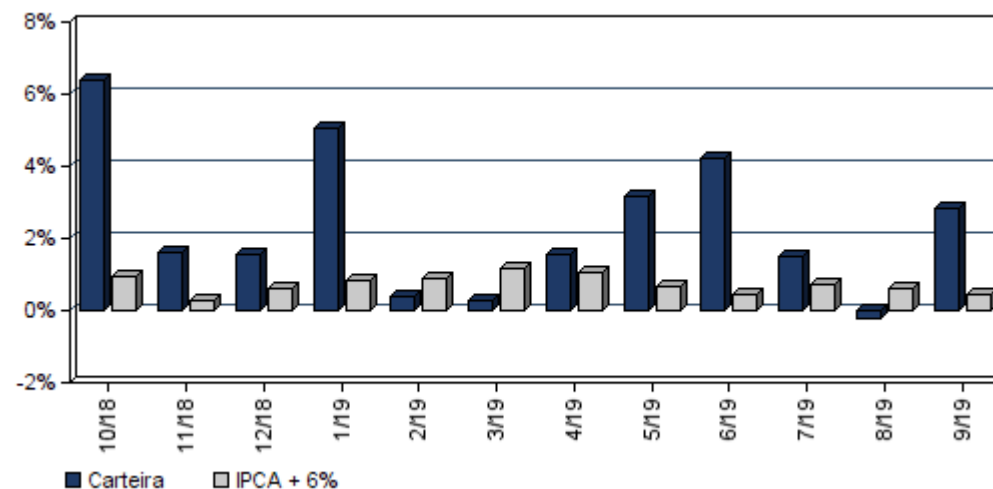
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira													
Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
2016	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
IPCA + 6%	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
p.p. Indx	-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
2017	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
IPCA + 6%	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
p.p. Indx	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
2018	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
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
p.p. Indx	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
2019	5,07	0,38	0,27	1,53	3,15	4,24	1,49	-0,20	2,82	--	--	--	20,25
IPCA + 6%	0,83	0,90	1,19	1,06	0,64	0,45	0,72	0,62	0,45	--	--	--	7,07
p.p. Indx	4,24	-0,52	-0,92	0,47	2,51	3,79	0,77	-0,82	2,38	--	--	--	13,17

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 acima do Benchmark	27	60,0%					
Meses abaixo do Benchmark	18	40,0%					
	Rentab.	Mês					
Maior rentabilidade da Carteira	6,39%	out/18					
Menor rentabilidade da Carteira	-3,46%	mai/18					
			03 meses	4,15	1,80	2,4	5,545
			06 meses	13,71	4,01	9,7	5,503
			12 meses	31,99	9,04	23,0	5,955
			24 meses	34,19	20,73	13,5	5,238
			36 meses	52,90	31,16	21,7	6,367
			Desde o início	80,56	44,57	36,0	6,092

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.	5,00 2,14	27,37 7,83	5,35 1,58	18,85 5,59	44,35 12,97	42,82 8,09	52,82 7,89
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI Var. do IMA-B TOTAL p.p.	2,85 -0,01	19,32 -0,22	3,72 -0,04	13,15 -0,12	31,00 -0,37	34,05 -0,68	54,78 -1,19
FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RF LP Var. do IMA-B TOTAL p.p.	2,85 -0,01	19,37 -0,18	3,72 -0,05	13,12 -0,15	31,16 -0,21	34,16 -0,56	55,13 -0,83
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA II FI Var. do IPCA + 6% p.p.	0,70 0,25	6,12 -0,95	1,69 -0,12	3,84 -0,16	9,06 0,01	17,64 -3,09	32,36 1,20
FI CAIXA BRASIL 2024 I TP RF Var. do IMA-B TOTAL p.p.	2,19 -0,67	8,61 -10,93	0,74 -3,03	7,49 -5,78	17,51 -13,86	14,70 -20,03	25,95 -30,02
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. do IMA-GERAL TOTAL p.p.	1,50 0,03	7,23 0,36	2,62 0,00	7,23 0,36	7,23 0,36	7,23 0,36	7,23 0,36
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5+ TP FI Var. do IMA-B 5+ p.p.	3,71 -0,02	17,45 -0,34	4,42 -0,06	17,32 -0,22	17,45 -0,34	17,45 -0,34	17,45 -0,34
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP RF LP Var. do IMA-B 5+ p.p.	3,69 -0,04	26,14 -0,41	4,43 -0,05	17,29 -0,26	44,00 -0,84	43,84 -0,85	43,84 -0,85

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.	1,72 -0,02	9,03 -0,16	2,74 -0,04	7,07 -0,10	9,03 -0,16	9,03 -0,16	9,03 -0,16
FI CAIXA ALIANÇA TP RF % do CDI	0,49 105,27	4,66 99,96	1,55 100,29	3,16 101,76	6,24 99,45	13,01 97,45	25,93 98,06
BANESTES ESTRATÉGIA FIC FI RF % do CDI	2,06 442,30	14,00 300,05	4,15 268,91	9,91 318,94	20,28 323,07	21,41 284,06	21,41 284,06
FI BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA Var. do IMA-B TOTAL p.p.	4,69 1,83	26,31 6,76	5,27 1,50	18,73 5,47	40,87 9,50	39,43 4,70	62,73 6,77
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA Var. do IBOVESPA p.p.	3,52 -0,05	18,71 -0,47	3,60 -0,14	9,53 -0,25	31,29 -0,73	39,55 -1,44	76,59 -2,87
BANESTES FIC FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INST Var. do IBOVESPA p.p.	1,25 -2,32	26,56 7,38	7,94 4,20	21,56 11,78	52,20 20,18	50,77 13,05	50,77 13,05
FIA CAIXA DIVIDENDOS Var. do IBOVESPA p.p.	1,40 -2,17	20,11 0,93	5,72 1,98	11,92 2,14	44,49 12,47	47,56 2,33	47,56 2,33
FIC FIA CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. do IBOVESPA p.p.	1,05 -2,52	25,88 6,69	3,99 0,25	12,51 2,73	54,32 22,30	41,14 0,15	66,09 -13,37
CAIXA RIO BRAVO FII Var. do IPCA p.p.	1,85 1,89	17,20 14,71	9,70 9,44	13,08 12,11	26,57 23,68	19,35 11,80	45,39 35,11
IPCA + 5,5%	0,41	6,69	1,68	3,76	8,53	19,60	29,33
CDI	0,47	4,67	1,54	3,11	6,28	13,35	26,45
IMA-B 5	1,74	10,27	2,78	7,17	15,40	22,93	39,47
IMA-B 5+	3,73	26,55	4,48	17,54	44,85	43,66	68,51
IMA-B TOTAL	2,86	19,55	3,77	13,27	31,37	34,72	55,96
IMA-GERAL TOTAL	1,46	10,72	2,61	7,52	16,78	23,07	41,30

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
IRF-M 1	0,64	5,31	1,92	3,72	7,44	14,70	29,21
IRF-M 1+	1,87	11,89	3,27	9,07	20,81	27,25	51,71
IRF-M TOTAL	1,44	9,99	2,81	7,53	16,83	23,54	45,09
IBOVESPA	3,57	19,18	3,74	9,78	32,02	40,99	79,46
IFIX	1,04	14,15	2,21	8,11	25,74	20,86	47,81
SMALL CAP	2,08	--	9,49	21,44	57,29	45,27	105,52
INPC + 6%	0,44	7,21	1,71	3,96	9,07	20,13	29,35
IPCA + 6%	0,45	7,07	1,80	4,01	9,04	20,73	31,16