

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Posição de Ativos										
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (31/10/2019)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
<b>Renda Fixa</b>										
BANESTES DTVM	Banco BANESTES	FI BANESTES PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B	7,21%	4,85%	1,49%	33,56%	1.985.678,74	0,99%	324.178.386,61	0,61%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI	4,65%	3,35%	-0,01%	23,33%	35.805.392,52	17,89%	6.543.426.643,45	0,55%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RF LP	4,65%	3,33%	-0,04%	23,33%	33.996.495,54	16,99%	7.228.652.052,11	0,47%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA II FI	0,88%	0,74%	0,13%	6,91%	1.101.345,22	0,55%	222.366.350,96	0,50%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL 2024 I TP RF	5,09%	2,39%	1,77%	11,21%	1.378.928,76	0,69%	451.112.145,70	0,31%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,26%	1,80%	0,08%	9,16%	7.750.495,03	3,87%	8.931.824.899,36	0,09%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5+ TP FI	6,87%	4,66%	-0,00%	22,93%	38.820.673,52	19,40%	3.222.349.506,29	1,20%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP RF LP	6,82%	4,65%	-0,02%	31,99%	16.585.669,21	8,29%	3.319.372.416,38	0,50%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP FIC FI	1,95%	1,64%	-0,01%	10,82%	4.313.510,45	2,16%	4.676.887.165,88	0,09%
<b>Sub-total 4604 - Artigo 7º I, Alínea b - FI 100% Títulos TN</b>							<b>141.738.188,99</b>	<b>70,82%</b>		
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA ALIANÇA TP RF	0,06%	0,50%	104,65%	5,19%	1.048.017,68	0,52%	293.165.776,09	0,36%
BANESTES DTVM	Banco BANESTES	BANESTES ESTRATÉGIA FIC FI RF	2,38%	2,39%	496,79%	16,73%	4.624.116,74	2,31%	148.242.078,71	3,12%
BANESTES DTVM	Banco BANESTES	FI BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA	6,91%	4,22%	0,85%	31,63%	13.182.851,04	6,59%	347.920.517,62	3,79%
<b>Sub-total 4604 - Artigo 7º IV, Alínea a - FI Renda Fixa - Geral</b>							<b>18.854.985,46</b>	<b>9,42%</b>		
<b>Sub-total Renda Fixa - FI Renda Fixa - Geral</b>							<b>160.593.174,45</b>	<b>80,24%</b>		
<b>Renda Variável</b>										
CAIXA	CAIXA	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	18,31%	2,29%	-0,07%	21,43%	6.099.020,58	3,05%	458.570.488,52	1,33%
<b>Sub-total 4604 - Artigo 8º I, Alínea a - FI de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações</b>							<b>6.099.020,58</b>	<b>3,05%</b>		
BANESTES DTVM	Banco BANESTES	BANESTES FIC FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INST	17,36%	2,34%	-0,02%	29,52%	7.225.211,39	3,61%	93.628.596,86	7,72%
CAIXA	CAIXA	FIA CAIXA DIVIDENDOS	14,60%	1,49%	-0,87%	21,90%	219.844,84	0,11%	134.568.076,35	0,16%
VINCI EQUITIES Gest Rec	CAIXA	FIC FIA CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	16,56%	3,46%	1,09%	30,23%	24.465.697,57	12,22%	749.627.403,36	3,26%
<b>Sub-total 4604 - Artigo 8º II, Alínea a - FI de Ações - Geral</b>							<b>31.910.753,80</b>	<b>15,95%</b>		
RIO BRAVO Invest	CAIXA	CAIXA RIO BRAVO FII	0,00%	8,33%	4,31%	26,97%	1.525.932,00	0,76%	171.335.586,77	0,89%

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Posição de Ativos										
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (31/10/2019)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
Sub-total 4604 - Artigo 8º IV, Alínea b - FI Imobiliários							1.525.932,00	0,76%		
Sub-total Renda Variável							39.535.706,37	19,76%		
<b>Total</b>							<b>200.128.880,82</b>	<b>100%</b>		

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

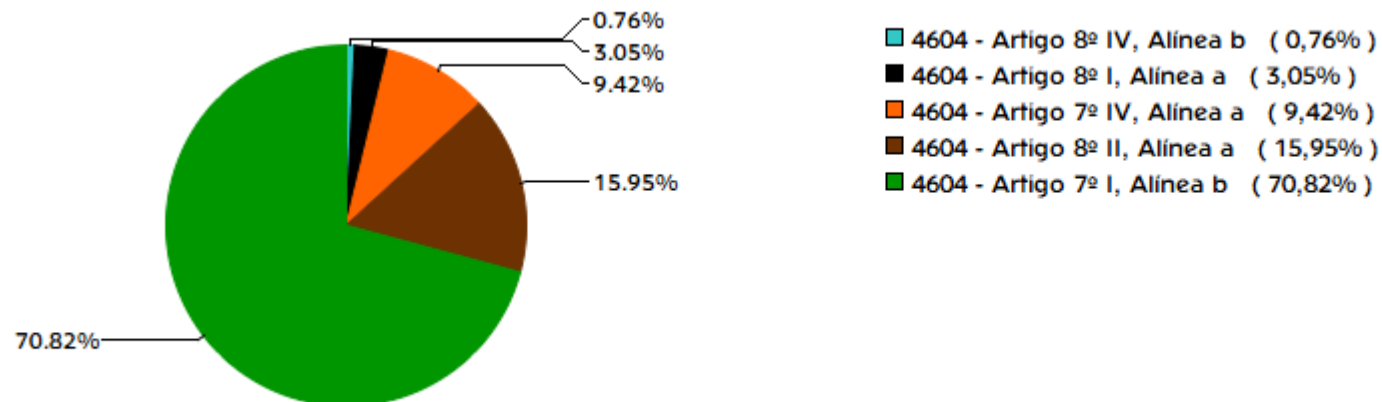
Enquadramento da Carteira					
Artigo	Classe	Valor(R\$)	% Carteira	Política Investimento	Limite Res. 4.604/17
<b>Renda Fixa</b>					
4604 - Artigo 7º I, Alínea b	FI 100% Títulos TN	141.738.188,99	70,82%	<b>68,00%</b>	100,00%
4604 - Artigo 7º IV, Alínea a	FI Renda Fixa - Geral	18.854.985,46	9,42%	<b>9,00%</b>	40,00%
<b>Total Renda Fixa</b>		<b>160.593.174,45</b>	<b>80,24%</b>		
<b>Renda Variável</b>					
4604 - Artigo 8º I, Alínea a	FI de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações	6.099.020,58	3,05%	4,00%	30,00%
4604 - Artigo 8º II, Alínea a	FI de Ações - Geral	31.910.753,80	15,95%	18,00%	20,00%
4604 - Artigo 8º IV, Alínea b	FI Imobiliários	1.525.932,00	0,76%	1,00%	5,00%
<b>Total Renda Variável</b>		<b>39.535.706,37</b>	<b>19,76%</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	3,70 769,5	23,79 460,1	26,95 433,9	38,01 288,6
<b>4604 - Artigo 7º IV, Alínea a</b> % do CDI	3,58 745,0	23,56 455,7	25,87 416,5	35,08 266,4
<b>4604 - Artigo 8º I, Alínea a</b> % do CDI	2,29 476,8	21,43 414,5	22,09 355,7	42,76 324,7
<b>4604 - Artigo 8º II, Alínea a</b> % do CDI	3,19 662,5	30,39 587,7	41,60 669,7	48,82 370,7
<b>4604 - Artigo 8º IV, Alínea b</b> % do CDI	8,33 1.730,8	27,84 538,5	33,54 540,0	31,68 240,6

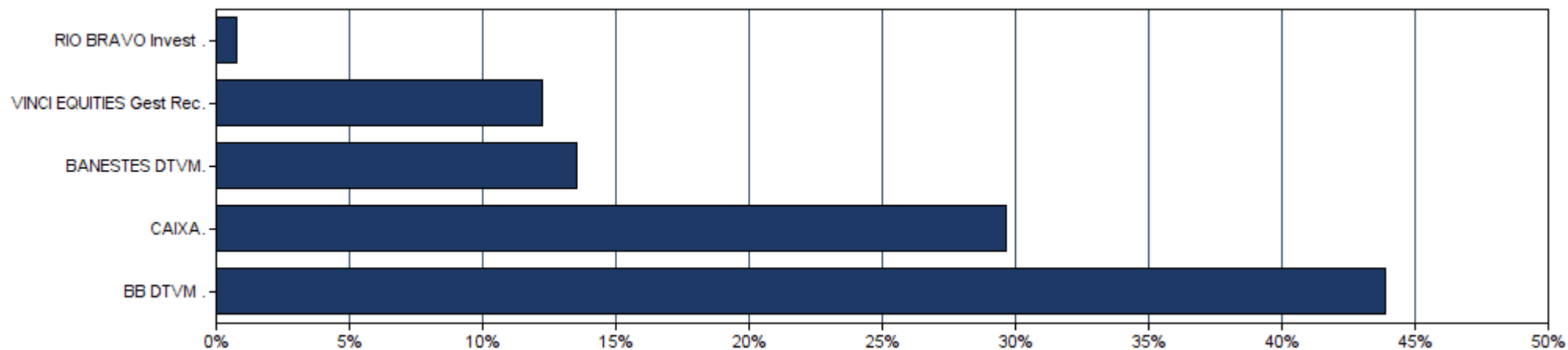
Ganhos Financeiros	
Estratégia	Ganho Bruto (R\$)
<b>4604 - Artigo 7º I, Alínea b</b>	5.060.677,88
<b>4604 - Artigo 7º IV, Alínea a</b>	645.005,44
<b>4604 - Artigo 8º I, Alínea a</b>	136.774,63
<b>4604 - Artigo 8º II, Alínea a</b>	985.801,40
<b>4604 - Artigo 8º IV, Alínea b</b>	117.550,44
<b>Total</b>	<b>6.945.809,78</b>

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Alocação por Estratégia**



**Alocação por Gestor**

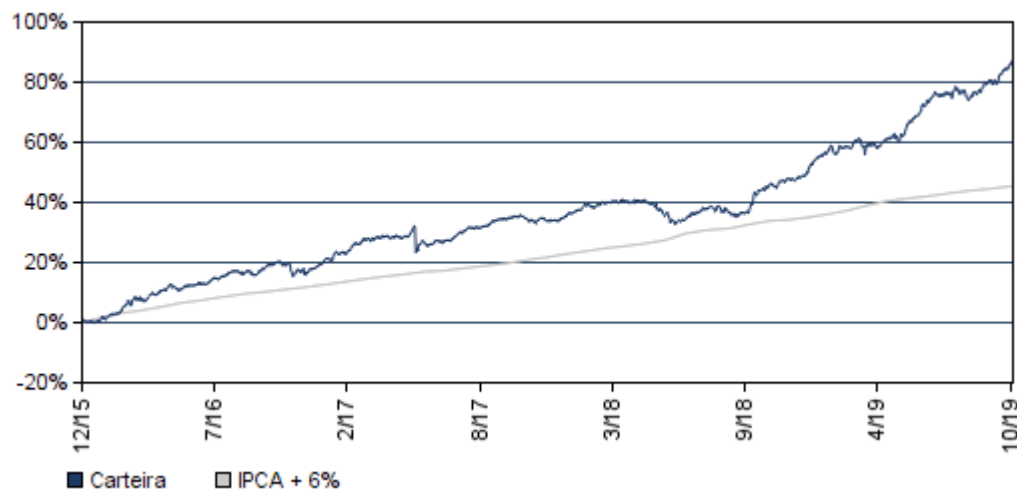


### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

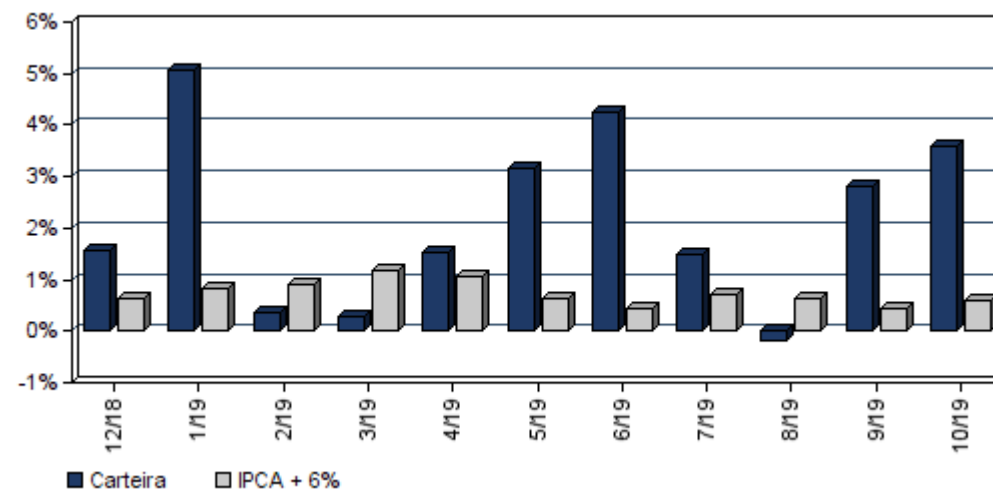
#### Rentabilidades da Carteira

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	-0,20	2,82	3,60	--	--	24,58
<b>IPCA + 6%</b>	0,83	0,90	1,19	1,06	0,64	0,45	0,72	0,62	0,45	0,61	--	--	7,73
<b>p.p. Indx</b>	4,24	-0,52	-0,92	0,47	2,51	3,79	0,77	-0,82	2,38	2,99	--	--	16,85

#### 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	28	60,9%					
Meses <b>abaixo</b> do Benchmark	18	39,1%					
	Rentab.	Mês					
<b>Maior</b> rentabilidade da Carteira	6,39%	out/18	<b>03 meses</b>	6,32	1,69	4,6	5,944
<b>Menor</b> rentabilidade da Carteira	-3,46%	mai/18	<b>06 meses</b>	16,02	3,55	12,5	5,583
			<b>12 meses</b>	28,53	8,67	19,9	5,564
			<b>24 meses</b>	39,10	20,38	18,7	5,327
			<b>36 meses</b>	56,67	31,02	25,7	6,392
			<b>Desde o início</b>	87,06	45,45	41,6	6,074

#### 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.	4,85 1,49	33,56 9,99	7,76 1,87	22,77 7,43	38,00 11,26	50,81 11,02	60,23 10,43
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI Var. do IMA-B TOTAL p.p.	3,35 -0,01	23,33 -0,24	5,86 -0,04	15,22 -0,12	26,46 -0,28	39,10 -0,68	58,98 -1,20
FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RF LP Var. do IMA-B TOTAL p.p.	3,33 -0,04	23,33 -0,23	5,82 -0,07	15,17 -0,17	26,47 -0,27	39,19 -0,59	59,26 -0,92
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA II FI Var. do IPCA + 6% p.p.	0,74 0,13	6,91 -0,82	1,69 -0,00	3,63 0,09	8,02 -0,65	17,55 -2,83	32,77 1,75
FI CAIXA BRASIL 2024 I TP RF Var. do IPCA + 6% p.p.	2,39 1,77	11,21 3,48	2,17 0,48	8,77 5,22	13,34 4,68	17,56 -2,82	28,62 -2,40
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. do IMA-GERAL TOTAL p.p.	1,80 0,08	9,16 0,45	3,41 0,04	8,88 0,45	9,16 0,45	9,16 0,45	9,16 0,45
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5+ TP FI Var. do IMA-B 5+ p.p.	4,66 -0,00	22,93 -0,36	7,69 -0,04	20,68 -0,18	22,93 -0,36	22,93 -0,36	22,93 -0,36
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP RF LP Var. do IMA-B 5+ p.p.	4,65 -0,02	31,99 -0,46	7,65 -0,08	20,61 -0,25	36,37 -0,63	50,52 -0,92	50,52 -0,92

**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.	1,64 -0,01	10,82 -0,17	3,43 -0,05	7,66 -0,09	10,82 -0,17	10,82 -0,17	10,82 -0,17
FI CAIXA ALIANÇA TP RF % do CDI	0,50 104,65	5,19 100,42	1,49 102,38	3,14 102,38	6,20 99,75	12,85 97,56	25,26 98,17
BANESTES ESTRATÉGIA FIC FI RF % do CDI	2,39 496,79	16,73 323,53	5,14 352,91	11,55 376,54	18,59 299,37	24,31 301,84	24,31 301,84
FI BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA Var. do IMA-B TOTAL p.p.	4,22 0,85	31,63 8,07	7,00 1,11	21,83 6,49	35,94 9,20	46,20 6,41	68,17 7,99
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA Var. do IBOVESPA p.p.	2,29 -0,07	21,43 -0,57	5,16 -0,16	10,99 -0,28	22,09 -0,55	42,76 -1,53	62,83 -2,32
BANESTES FIC FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INST Var. do IBOVESPA p.p.	2,34 -0,02	29,52 7,52	5,61 0,30	19,62 8,34	37,91 15,26	60,76 16,47	54,30 13,32
FIA CAIXA DIVIDENDOS Var. do IBOVESPA p.p.	1,49 -0,87	21,90 -0,10	3,66 -1,65	12,34 1,06	30,60 7,96	49,76 1,10	49,76 1,10
FIC FIA CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. do IBOVESPA p.p.	3,46 1,09	30,23 8,23	6,48 1,17	13,96 2,68	41,82 19,17	47,05 2,76	61,29 -3,86
CAIXA RIO BRAVO FII Var. do Índice Fundos Imobiliários - IFIX p.p.	8,33 4,31	26,97 8,24	13,10 8,12	22,50 11,20	32,62 8,12	30,78 5,35	47,18 -0,93
IPCA + 5,5%	0,57	7,30	1,56	3,29	8,15	19,25	29,18
CDI	0,48	5,17	1,46	3,07	6,21	13,17	25,74
IMA-B 5	1,65	12,09	3,47	7,74	13,78	24,36	41,13
IMA-B 5+	4,67	32,45	7,73	20,86	37,00	51,90	75,09
IMA-B TOTAL	3,36	23,57	5,89	15,34	26,74	39,79	60,18
IMA-GERAL TOTAL	1,72	12,62	3,38	8,43	14,80	25,02	42,44

**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>	0,62	5,96	1,83	3,85	7,13	14,70	28,80
<i>IRF-M 1+</i>	2,22	14,38	4,24	10,78	17,94	30,17	53,02
<i>IRF-M TOTAL</i>	1,70	11,85	3,43	8,70	14,69	25,51	45,78
<i>IBOVESPA</i>	2,36	22,00	5,31	11,28	22,64	44,29	65,15
<i>IFIX</i>	4,01	18,73	4,98	11,30	24,51	25,43	48,12
<i>SMALL CAP</i>	2,28	--	4,91	22,18	42,89	50,82	96,44
<i>INPC + 6%</i>	0,53	7,78	1,61	3,39	8,66	19,74	29,22
<i>IPCA + 6%</i>	0,61	7,73	1,69	3,55	8,67	20,38	31,02