

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Posição de Ativos										
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (29/05/2020)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
<b>Renda Fixa</b>										
BANESTES DTVM	Banco BANESTES	FI BANESTES PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B	22,64%	0,71%	-0,81%	-10,47%	1.744.319,00	0,91%	260.165.233,98	0,67%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI	12,41%	1,50%	-0,02%	-3,69%	15.192.176,11	7,94%	5.454.809.775,70	0,28%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RF LP	12,48%	1,50%	-0,02%	-3,82%	32.499.116,01	16,99%	5.962.762.833,75	0,55%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA II FI	1,22%	0,80%	0,79%	-0,14%	1.086.703,25	0,57%	219.410.044,45	0,50%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL 2024 I TP RF	9,30%	3,16%	3,14%	0,19%	1.388.319,14	0,73%	454.184.206,37	0,31%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,10%	1,07%	0,05%	0,79%	37.835.152,68	19,78%	10.653.642.517,78	0,36%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5+ TP FI	19,00%	1,00%	-0,03%	-7,95%	16.966.563,29	8,87%	1.970.647.318,20	0,86%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP RF LP	19,11%	1,00%	-0,02%	-8,04%	13.823.355,44	7,23%	1.931.164.845,98	0,72%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP FIC FI	4,97%	2,11%	-0,01%	1,99%	13.683.894,26	7,15%	4.431.593.608,10	0,31%
<b>Sub-total 4604 - Artigo 7º I, Alínea b - FI 100% Títulos TN</b>							<b>134.219.599,19</b>	<b>70,18%</b>		
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA ALIANÇA TP RF	0,25%	0,25%	105,45%	1,65%	11.964,58	0,01%	291.781.776,92	0,00%
BANESTES DTVM	Banco BANESTES	BANESTES ESTRATÉGIA FIC FI RF	2,56%	0,37%	154,20%	-1,90%	4.587.753,36	2,40%	177.142.920,74	2,59%
BANESTES DTVM	Banco BANESTES	FI BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA	25,86%	1,49%	-0,03%	-10,32%	11.473.335,77	6,00%	225.670.767,85	5,08%
<b>Sub-total 4604 - Artigo 7º IV, Alínea a - FI Renda Fixa - Geral</b>							<b>16.073.053,70</b>	<b>8,40%</b>		
<b>Sub-total Renda Fixa - FI Renda Fixa - Geral</b>							<b>150.292.652,89</b>	<b>78,58%</b>		
<b>Renda Variável</b>										
CAIXA	CAIXA	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	42,94%	8,49%	-0,08%	-24,27%	4.982.858,10	2,61%	577.291.375,77	0,86%
<b>Sub-total 4604 - Artigo 8º I, Alínea a - FI de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações</b>							<b>4.982.858,10</b>	<b>2,61%</b>		
BANESTES DTVM	Banco BANESTES	BANESTES FIC FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INST	44,65%	10,24%	1,68%	-16,86%	7.468.245,79	3,90%	141.474.377,54	5,28%
CAIXA	CAIXA	CAIXA FI AÇÕES DIVIDENDOS	37,65%	3,16%	-5,40%	-22,96%	196.947,10	0,10%	254.712.289,30	0,08%
VINCI EQUITIES Gest Rec	CAIXA	FIC FIA CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	38,47%	7,50%	-1,06%	-20,43%	23.327.882,49	12,20%	768.284.939,45	3,04%
CAIXA	CAIXA	CAIXA FIC FIA MULTIGESTOR	33,60%	7,64%	-0,93%	-24,89%	3.322.281,48	1,74%	675.158.975,61	0,49%
<b>Sub-total 4604 - Artigo 8º II, Alínea a - FI de Ações - Geral</b>							<b>34.315.356,87</b>	<b>17,94%</b>		

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Posição de Ativos										
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (29/05/2020)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
RIO BRAVO Invest	CAIXA	CAIXA RIO BRAVO FII	0,00%	4,59%	2,51%	-8,16%	1.661.400,00	0,87%	155.729.883,63	1,07%
<b>Sub-total 4604 - Artigo 8º IV, Alínea b - FI Imobiliários</b>							<b>1.661.400,00</b>	<b>0,87%</b>		
<b>Sub-total Renda Variável</b>							<b>40.959.614,96</b>	<b>21,42%</b>		
<b>Total</b>							<b>191.252.267,85</b>	<b>100%</b>		

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

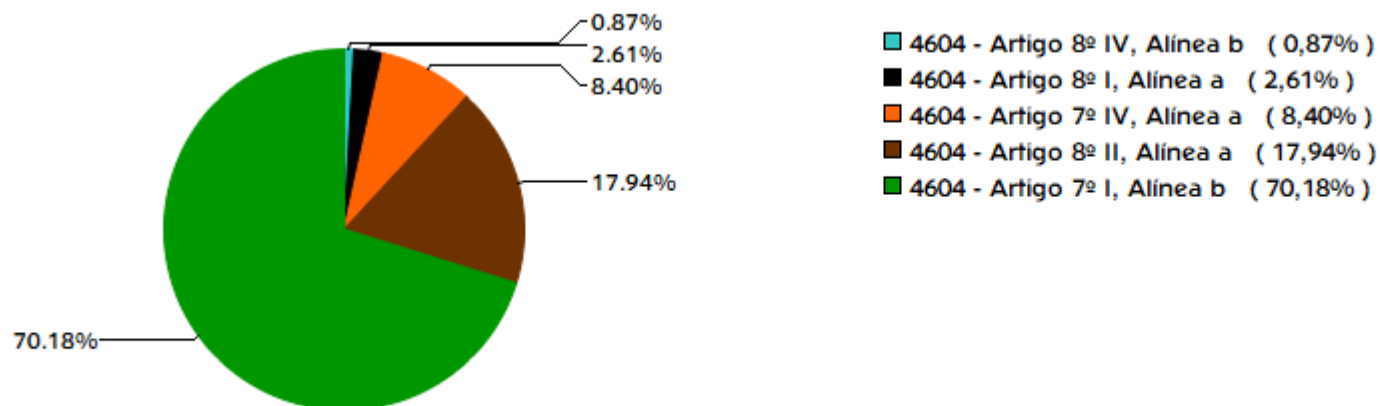
Enquadramento da Carteira					
Artigo	Classe	Valor(R\$)	% Carteira	Política Investimento	Limite Res. 4.604/17
<b>Renda Fixa</b>					
4604 - Artigo 7º I, Alínea b	FI 100% Títulos TN	134.219.599,19	70,18%	<b>63,50%</b>	100,00%
4604 - Artigo 7º IV, Alínea a	FI Renda Fixa - Geral	16.073.053,71	8,40%	9,50%	40,00%
<b>Total Renda Fixa</b>		<b>150.292.652,90</b>	<b>78,58%</b>		
<b>Renda Variável</b>					
4604 - Artigo 8º I, Alínea a	FI de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações	4.982.858,10	2,61%	6,00%	30,00%
4604 - Artigo 8º II, Alínea a	FI de Ações - Geral	34.315.356,87	17,94%	20,00%	20,00%
4604 - Artigo 8º IV, Alínea b	FI Imobiliários	1.661.400,00	0,87%	1,00%	5,00%
<b>Total Renda Variável</b>		<b>40.959.614,96</b>	<b>21,42%</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	1,33 557,4	-2,91 -188,7	7,81 160,0	30,96 267,7
<b>4604 - Artigo 7º IV, Alínea a</b> % do CDI	1,17 488,7	-7,45 -482,6	3,37 69,0	20,88 180,5
<b>4604 - Artigo 8º I, Alínea a</b> % do CDI	8,49 3.557,1	-24,27 -1.571,2	-9,96 -204,0	13,28 114,8
<b>4604 - Artigo 8º II, Alínea a</b> % do CDI	8,06 3.375,9	-19,64 -1.271,5	-0,15 -3,0	33,91 293,2
<b>4604 - Artigo 8º IV, Alínea b</b> % do CDI	4,59 1.920,9	-8,16 -528,1	41,86 857,0	53,15 459,5

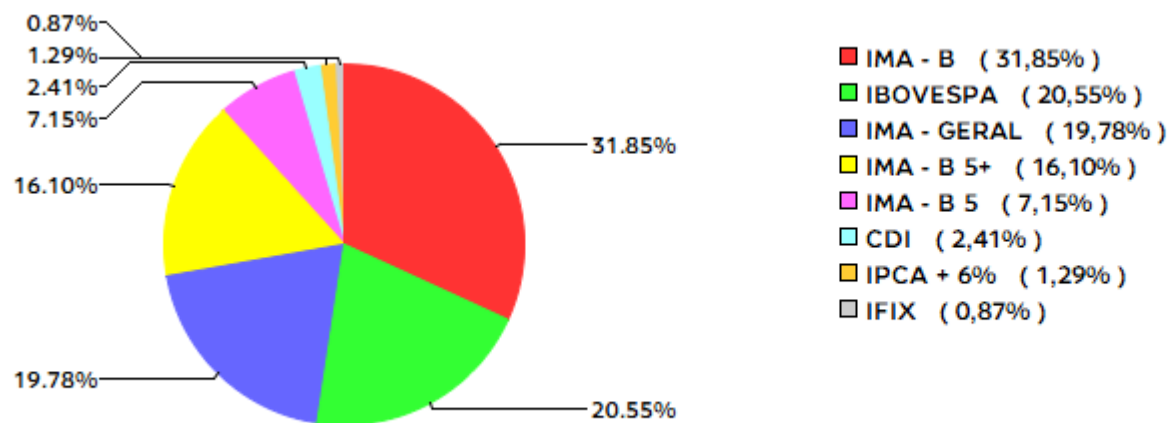
Ganhos Financeiros	
Estratégia	Ganho Bruto (R\$)
<b>4604 - Artigo 7º I, Alínea b</b>	1.764.932,03
<b>4604 - Artigo 7º IV, Alínea a</b>	185.323,81
<b>4604 - Artigo 8º I, Alínea a</b>	389.968,02
<b>4604 - Artigo 8º II, Alínea a</b>	2.556.514,48
<b>4604 - Artigo 8º IV, Alínea b</b>	72.769,32
<b>Total</b>	<b>4.969.507,65</b>

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

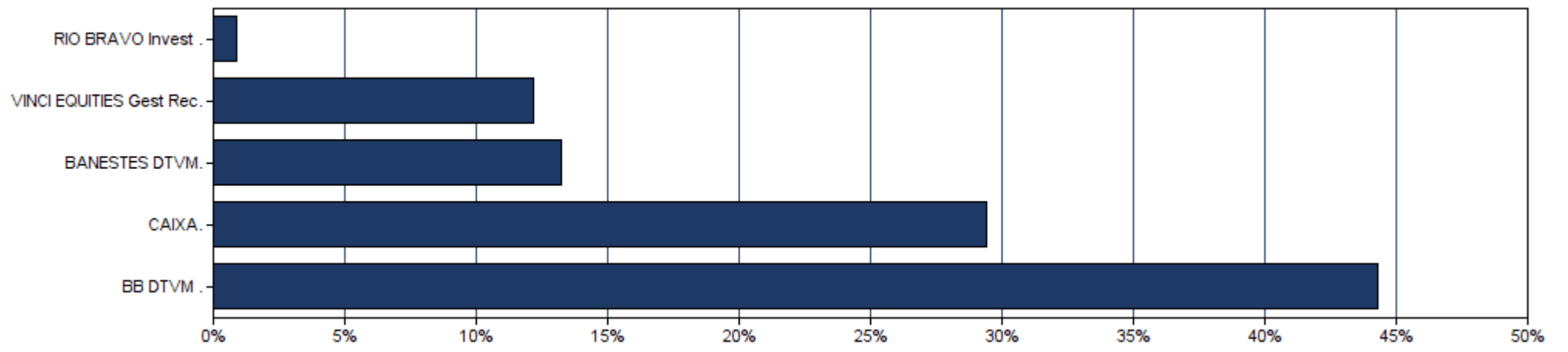
**Alocação por Estratégia**



**Indexadores**



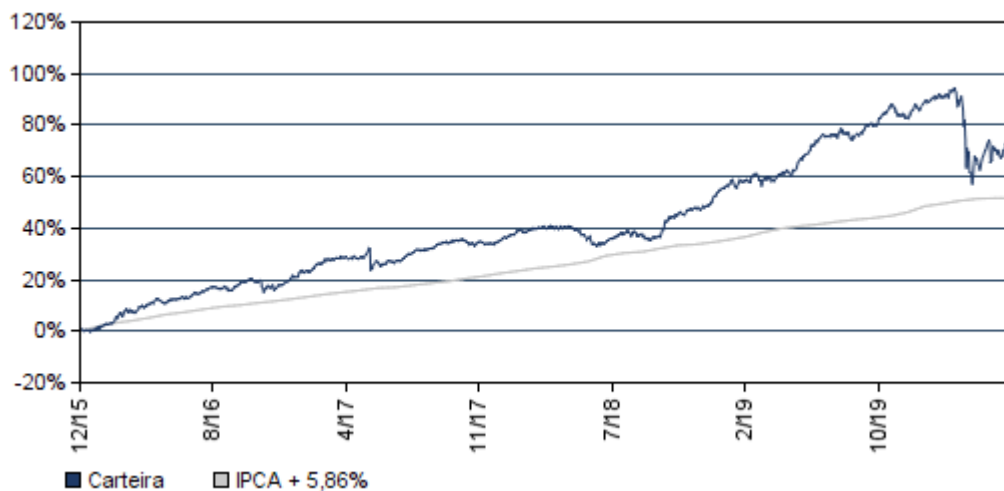
**Alocação por Gestor**



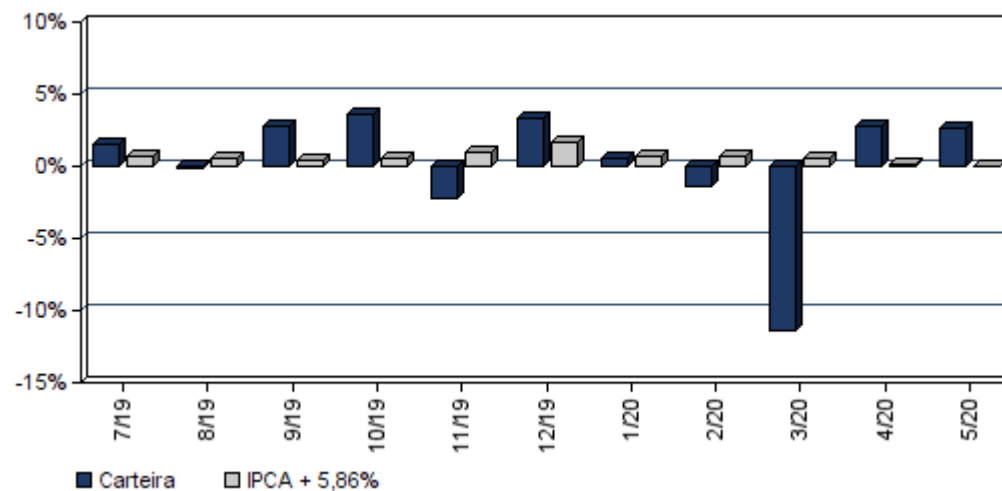
### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira													
Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
<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 + 5,86%</b>	0,88	0,74	0,77	0,55	0,81	0,24	0,72	0,71	0,61	0,90	0,73	0,89	8,91
<b>p.p. Indx</b>	1,01	2,95	0,08	-0,76	-2,01	-0,01	2,08	0,57	1,04	-0,96	-1,30	0,29	3,14
<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 + 5,86%</b>	0,79	0,73	0,57	0,70	0,88	1,74	0,83	0,43	0,91	0,95	0,24	0,60	9,78
<b>p.p. Indx</b>	2,08	-0,39	0,17	-0,71	-4,33	-2,62	1,56	-1,16	-0,94	5,44	1,35	0,96	1,20
<b>2019</b>	5,07	0,38	0,27	1,53	3,15	4,24	1,49	-0,20	2,82	3,60	-2,18	3,39	25,99
<b>IPCA + 5,86%</b>	0,82	0,88	1,18	1,05	0,63	0,44	0,71	0,61	0,44	0,62	0,97	1,63	10,44
<b>p.p. Indx</b>	4,25	-0,51	-0,91	0,48	2,52	3,80	0,78	-0,80	2,39	2,98	-3,15	1,76	15,55
<b>2020</b>	0,62	-1,33	-11,45	2,79	2,67	--	--	--	--	--	--	--	-7,23
<b>IPCA + 5,86%</b>	0,71	0,66	0,57	0,14	0,00	--	--	--	--	--	--	--	2,09
<b>p.p. Indx</b>	-0,09	-1,99	-12,02	2,65	2,67	--	--	--	--	--	--	--	-9,32

### 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 + 5,86%	p.p. Indx.	
Meses <b>acima</b> do Benchmark	23	56,1%					
Meses <b>abaixo</b> do Benchmark	18	43,9%					
	Rentab.	Mês					
<b>Maior</b> rentabilidade da Carteira	6,39%	out/18	<b>03 meses</b>	-6,55	0,71	-7,3	27,346
<b>Menor</b> rentabilidade da Carteira	-11,45%	mar/20	<b>06 meses</b>	-4,09	3,76	-7,8	20,012
			<b>12 meses</b>	5,53	7,75	-2,2	14,581
			<b>24 meses</b>	29,22	19,35	9,9	11,155
			<b>36 meses</b>	38,36	29,86	8,5	9,310
			<b>Desde o início</b>	75,51	51,64	23,9	8,802

#### 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.	0,71 -0,81	-10,47 -6,83	-11,02 -6,71	-8,17 -6,46	2,16 -4,52	33,67 1,67	42,63 -0,88
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI Var. do IMA-B TOTAL p.p.	1,50 -0,02	-3,69 -0,06	-4,36 -0,04	-1,79 -0,09	6,48 -0,20	31,36 -0,64	42,46 -1,05
FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RF LP Var. do IMA-B TOTAL p.p.	1,50 -0,02	-3,82 -0,19	-4,48 -0,16	-1,91 -0,20	6,23 -0,45	31,21 -0,78	42,33 -1,17
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA II FI Var. do IPCA + 6% p.p.	0,80 0,79	-0,14 -2,29	-0,36 -1,10	0,64 -3,19	4,63 -3,26	14,62 -5,04	25,84 -4,54
FI CAIXA BRASIL 2024 I TP RF Var. do IPCA + 6% p.p.	3,16 3,14	0,19 -1,96	1,08 0,33	1,68 -2,14	6,95 -0,94	19,35 -0,31	23,60 -6,77
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. do IMA-GERAL TOTAL p.p.	1,07 0,05	0,79 -0,08	-0,15 -0,02	1,76 -0,02	7,59 0,00	10,04 0,19	10,04 0,19
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5+ TP FI Var. do IMA-B 5+ p.p.	1,00 -0,03	-7,95 -0,07	-8,27 -0,06	-5,45 0,04	4,09 -0,07	11,47 -0,32	11,47 -0,32
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP RF LP Var. do IMA-B 5+ p.p.	1,00 -0,02	-8,04 -0,15	-8,27 -0,06	-5,68 -0,20	3,72 -0,45	36,06 -1,25	36,06 -1,25

**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.	2,11 -0,01	1,99 -0,04	0,77 -0,05	3,20 -0,09	9,26 -0,20	14,01 -0,30	14,01 -0,30
FI CAIXA ALIANÇA TP RF % do CDI	0,25 105,45	1,65 106,54	0,96 110,73	2,03 105,13	4,96 101,61	11,54 99,79	19,84 98,51
BANESTES ESTRATÉGIA FIC FI RF % do CDI	0,37 154,20	-1,90 -122,96	-2,91 -335,95	-0,78 -40,61	8,23 168,46	23,34 221,06	23,34 221,06
FI BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA Var. do IMA-B TOTAL p.p.	1,49 -0,03	-10,32 -6,68	-11,15 -6,83	-8,19 -6,49	1,29 -5,39	29,08 -2,91	38,10 -5,41
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA Var. do IBOVESPA p.p.	8,49 -0,08	-24,27 0,15	-16,01 0,08	-19,09 0,16	-9,96 -0,04	13,28 -0,60	37,64 -1,73
BANESTES FIC FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INST Var. do IBOVESPA p.p.	10,24 1,68	-16,86 7,56	-12,28 3,82	-10,89 8,35	3,44 13,36	41,18 27,31	37,82 22,90
CAIXA FI AÇÕES DIVIDENDOS Var. do IBOVESPA p.p.	3,16 -5,40	-22,96 1,46	-17,17 -1,08	-13,55 5,69	-0,56 9,36	34,16 12,98	34,16 12,98
FIC FIA CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. do IBOVESPA p.p.	7,50 -1,06	-20,43 3,99	-16,30 -0,21	-13,65 5,59	-1,18 8,74	31,96 18,08	43,26 3,88
CAIXA FIC FIA MULTIGESTOR Var. do IBOVESPA p.p.	7,64 -0,93	-24,89 -1,77	-17,48 -1,38	-24,89 -1,77	-24,89 -1,77	-24,89 -1,77	-24,89 -1,77
CAIXA RIO BRAVO FII Var. do Índice Fundos Imobiliários - IFIX p.p.	4,59 2,51	-8,16 8,73	-10,00 0,33	2,55 10,60	41,86 37,75	52,10 32,07	69,87 40,60
CDI	0,24	1,54	0,87	1,93	4,88	11,57	20,14
IMA - B	1,52	-3,64	-4,32	-1,70	6,68	31,99	43,51
IMA - B 5	2,12	2,03	0,82	3,29	9,46	23,93	36,10
IMA - B 5+	1,02	-7,88	-8,21	-5,48	4,17	38,08	48,04
IMA - GERAL	1,02	0,88	-0,13	1,78	7,59	22,39	33,68



**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	1,42	4,05	2,47	4,69	11,31	26,14	39,22
IRF - M 1	0,42	2,31	1,47	2,74	6,33	13,97	23,28
IRF - M 1+	1,92	4,94	2,96	5,70	13,65	31,67	46,28
IBOVESPA	8,57	-24,42	-16,10	-19,25	-9,92	13,87	39,37
IFIX	2,08	-16,88	-10,33	-8,05	4,11	20,03	29,26
SMALL CAP	5,07	-30,73	-24,82	-21,96	-1,69	25,45	48,98
IPCA + 4,61%	-0,09	1,60	0,42	3,16	6,48	16,56	25,34
IPCA + 4,81%	-0,08	1,68	0,47	3,26	6,68	17,00	26,06
IPCA + 5,06%	-0,06	1,78	0,52	3,38	6,94	17,56	26,96
IPCA + 5,27%	-0,04	1,86	0,57	3,48	7,15	18,03	27,72
IPCA + 5,43%	-0,03	1,93	0,61	3,55	7,31	18,38	28,29
IPCA + 5,5%	-0,03	1,95	0,63	3,59	7,38	18,54	28,55
IPCA + 5,54%	-0,02	1,97	0,64	3,61	7,42	18,63	28,69
IPCA + 5,61%	-0,02	2,00	0,65	3,64	7,49	18,79	28,95
IPCA + 5,67%	-0,01	2,02	0,67	3,67	7,55	18,92	29,17

**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 + 5,71%	-0,01	2,04	0,68	3,69	7,60	19,01	29,31
IPCA + 5,74%	-0,01	2,05	0,68	3,70	7,63	19,08	29,42
IPCA + 5,77%	-0,01	2,06	0,69	3,72	7,66	19,15	29,53
IPCA + 5,78%	-0,01	2,06	0,69	3,72	7,67	19,17	29,57
IPCA + 5,80%	-0,00	2,07	0,70	3,73	7,69	19,21	29,64
IPCA + 5,81%	-0,00	2,08	0,70	3,74	7,70	19,24	29,68
IPCA + 5,82%	-0,00	2,08	0,70	3,74	7,71	19,26	29,71
IPCA + 5,83%	-0,00	2,08	0,71	3,75	7,72	19,28	29,75
IPCA + 5,84%	-0,00	2,09	0,71	3,75	7,73	19,30	29,79
IPCA + 5,85%	0,00	2,09	0,71	3,76	7,74	19,33	29,82
IPCA + 5,86%	0,00	2,09	0,71	3,76	7,75	19,35	29,86
IPCA + 5,87%	0,00	2,10	0,71	3,76	7,76	19,37	29,90
IPCA + 5,88%	0,00	2,10	0,72	3,77	7,77	19,39	29,93
IPCA + 5,89%	0,00	2,11	0,72	3,77	7,78	19,42	29,97
IPCA + 6%	0,01	2,15	0,74	3,83	7,89	19,66	30,37

**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 + 4,61%	0,36	2,16	1,06	3,79	7,00	17,27	24,77
INPC + 4,81%	0,37	2,24	1,11	3,89	7,21	17,72	25,48
INPC + 5,06%	0,39	2,33	1,17	4,01	7,46	18,28	26,37
INPC + 5,27%	0,41	2,42	1,22	4,11	7,68	18,75	27,13
INPC + 5,43%	0,42	2,48	1,26	4,19	7,84	19,11	27,71
INPC + 5,54%	0,43	2,52	1,28	4,24	7,95	19,35	28,10
INPC + 5,61%	0,43	2,55	1,30	4,27	8,02	19,51	28,36
INPC + 5,67%	0,44	2,57	1,32	4,30	8,08	19,65	28,57
INPC + 5,71%	0,44	2,59	1,32	4,32	8,12	19,74	28,72
INPC + 5,74%	0,44	2,60	1,33	4,34	8,15	19,81	28,83
INPC + 5,77%	0,45	2,61	1,34	4,35	8,19	19,87	28,94
INPC + 5,78%	0,45	2,62	1,34	4,36	8,20	19,90	28,97
INPC + 5,80%	0,45	2,63	1,35	4,37	8,22	19,94	29,05
INPC + 5,81%	0,45	2,63	1,35	4,37	8,23	19,96	29,08
INPC + 5,82%	0,45	2,63	1,35	4,38	8,24	19,99	29,12

**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>
INPC + 5,83%	0,45	2,64	1,35	4,38	8,25	20,01	29,16
INPC + 5,84%	0,45	2,64	1,36	4,39	8,26	20,03	29,19
INPC + 5,85%	0,45	2,64	1,36	4,39	8,27	20,05	29,23
INPC + 5,86%	0,45	2,65	1,36	4,40	8,28	20,08	29,26
INPC + 5,87%	0,45	2,65	1,36	4,40	8,29	20,10	29,30
INPC + 5,88%	0,45	2,66	1,36	4,40	8,30	20,12	29,34
INPC + 5,89%	0,46	2,66	1,37	4,41	8,31	20,14	29,37
INPC + 6%	0,46	2,70	1,39	4,46	8,42	20,39	29,77