

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Posição de Ativos										
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (30/06/2020)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
<b>Renda Fixa</b>										
BANESTES DTVM	Banco BANESTES	FI BANESTES PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B	22,66%	2,29%	0,24%	-8,42%	1.784.264,58	0,90%	273.434.802,05	0,65%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI	12,40%	2,02%	-0,03%	-1,75%	15.498.989,40	7,83%	5.526.503.185,82	0,28%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RF LP	12,47%	2,03%	-0,02%	-1,88%	33.157.286,58	16,76%	5.979.262.081,07	0,55%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA II FI	1,21%	0,89%	0,13%	0,75%	1.096.393,42	0,55%	221.366.532,03	0,50%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL 2024 I TP RF	9,22%	1,24%	0,48%	1,43%	1.405.490,59	0,71%	459.801.943,88	0,31%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,07%	0,95%	-0,04%	1,75%	38.194.091,70	19,31%	10.783.491.196,95	0,35%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5+ TP FI	19,05%	2,80%	-0,04%	-5,38%	17.441.635,23	8,82%	1.945.603.761,47	0,90%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP RF LP	19,16%	2,83%	-0,02%	-5,44%	14.214.175,16	7,19%	1.967.228.116,14	0,72%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP FIC FI	4,92%	1,08%	-0,04%	3,08%	13.831.101,89	6,99%	4.025.627.854,04	0,34%
<b>Sub-total 4604 - Artigo 7º I, Alínea b - FI 100% Títulos TN</b>							<b>136.623.428,56</b>	<b>69,06%</b>		
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA ALIANÇA TP RF	0,25%	0,21%	97,89%	1,86%	861.643,81	0,44%	414.919.341,93	0,21%
BANESTES DTVM	Banco BANESTES	BANESTES ESTRATÉGIA FIC FI RF	2,52%	0,60%	280,09%	-1,31%	4.615.411,70	2,33%	164.480.013,81	2,81%
BANESTES DTVM	Banco BANESTES	FI BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA	25,86%	2,19%	0,15%	-8,35%	11.725.073,48	5,93%	257.794.723,23	4,55%
<b>Sub-total 4604 - Artigo 7º IV, Alínea a - FI Renda Fixa - Geral</b>							<b>17.202.128,99</b>	<b>8,70%</b>		
<b>Sub-total Renda Fixa - FI Renda Fixa - Geral</b>							<b>153.825.557,55</b>	<b>77,76%</b>		
<b>Renda Variável</b>										
CAIXA	CAIXA	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	43,22%	8,61%	-0,15%	-17,75%	5.411.860,52	2,74%	625.376.500,86	0,87%
<b>Sub-total 4604 - Artigo 8º I, Alínea a - FI de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações</b>							<b>5.411.860,52</b>	<b>2,74%</b>		
BANESTES DTVM	Banco BANESTES	BANESTES FIC FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INST	44,74%	10,23%	1,47%	-8,36%	8.339.787,11	4,22%	158.247.917,35	5,27%
CAIXA	CAIXA	CAIXA FI AÇÕES DIVIDENDOS	38,14%	2,45%	-6,30%	-21,07%	201.777,16	0,10%	265.683.359,38	0,08%
VINCI EQUITIES Gest Rec	CAIXA	FIC FIA CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	38,85%	4,58%	-4,17%	-16,79%	24.396.987,63	12,33%	799.344.501,83	3,05%
CAIXA	CAIXA	CAIXA FIC FIA MULTIGESTOR	33,31%	9,88%	1,12%	-17,47%	3.650.429,03	1,85%	767.311.521,81	0,48%
<b>Sub-total 4604 - Artigo 8º II, Alínea a - FI de Ações - Geral</b>							<b>36.588.980,94</b>	<b>18,50%</b>		

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Posição de Ativos										
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (30/06/2020)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
RIO BRAVO Invest	CAIXA	CAIXA RIO BRAVO FII	0,00%	20,92%	15,33%	11,06%	1.993.680,00	1,01%	155.729.883,63	1,28%
<b>Sub-total 4604 - Artigo 8º IV, Alínea b - FI Imobiliários</b>							<b>1.993.680,00</b>	<b>1,01%</b>		
<b>Sub-total Renda Variável</b>							<b>43.994.521,47</b>	<b>22,24%</b>		
<b>Total</b>							<b>197.820.079,02</b>	<b>100%</b>		

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

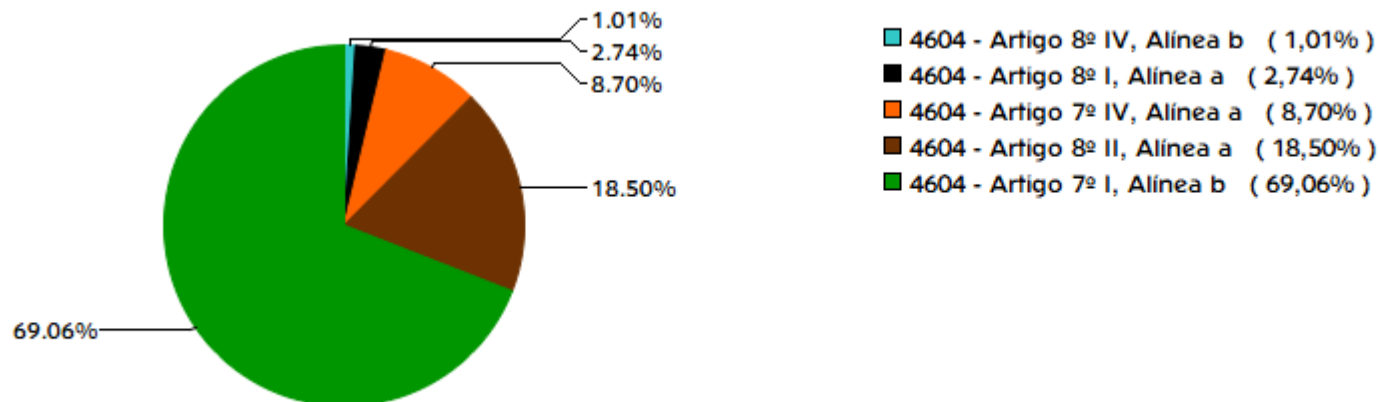
Enquadramento da Carteira					
Artigo	Classe	Valor(R\$)	% Carteira	Política Investimento	Limite Res. 4.604/17
<b>Renda Fixa</b>					
4604 - Artigo 7º I, Alínea b	FI 100% Títulos TN	136.623.428,56	69,06%	<b>63,50%</b>	100,00%
4604 - Artigo 7º IV, Alínea a	FI Renda Fixa - Geral	17.202.128,99	8,70%	9,50%	40,00%
<b>Total Renda Fixa</b>		<b>153.825.557,55</b>	<b>77,76%</b>		
<b>Renda Variável</b>					
4604 - Artigo 8º I, Alínea a	FI de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações	5.411.860,52	2,74%	6,00%	30,00%
4604 - Artigo 8º II, Alínea a	FI de Ações - Geral	36.588.980,94	18,50%	20,00%	20,00%
4604 - Artigo 8º IV, Alínea b	FI Imobiliários	1.993.680,00	1,01%	<b>1,00%</b>	5,00%
<b>Total Renda Variável</b>		<b>43.994.521,47</b>	<b>22,25%</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	1,79 832,1	-1,18 -66,7	5,54 119,9	33,52 298,5
<b>4604 - Artigo 7º IV, Alínea a</b> % do CDI	1,74 806,1	-5,85 -331,7	0,98 21,2	23,14 206,1
<b>4604 - Artigo 8º I, Alínea a</b> % do CDI	8,61 4.000,0	-17,75 -1.006,6	-5,96 -129,1	29,82 265,5
<b>4604 - Artigo 8º II, Alínea a</b> % do CDI	6,31 2.933,8	-14,57 -826,1	0,52 11,3	49,57 441,4
<b>4604 - Artigo 8º IV, Alínea b</b> % do CDI	20,00 9.291,9	10,21 579,2	67,10 1.452,3	106,86 951,5

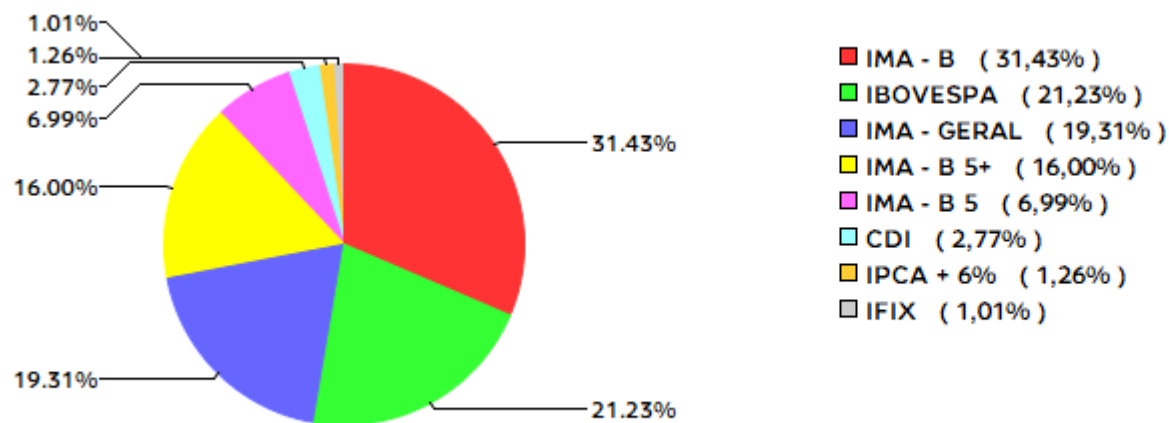
Ganhos Financeiros	
Estratégia	Ganho Bruto (R\$)
<b>4604 - Artigo 7º I, Alínea b</b>	2.403.829,37
<b>4604 - Artigo 7º IV, Alínea a</b>	280.075,28
<b>4604 - Artigo 8º I, Alínea a</b>	429.002,43
<b>4604 - Artigo 8º II, Alínea a</b>	2.165.434,60
<b>4604 - Artigo 8º IV, Alínea b</b>	332.280,00
<b>Total</b>	<b>5.610.621,68</b>

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

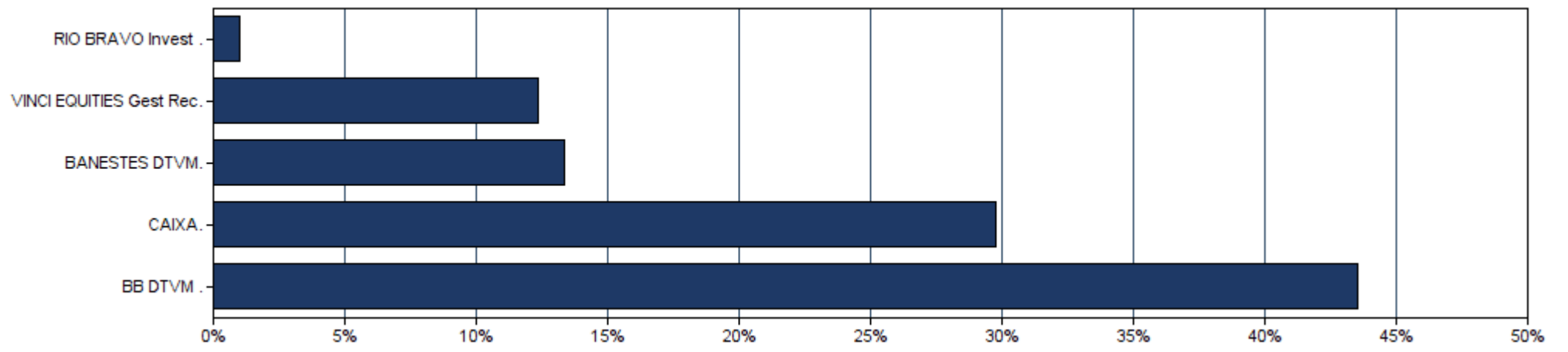
**Alocação por Estratégia**



**Indexadores**



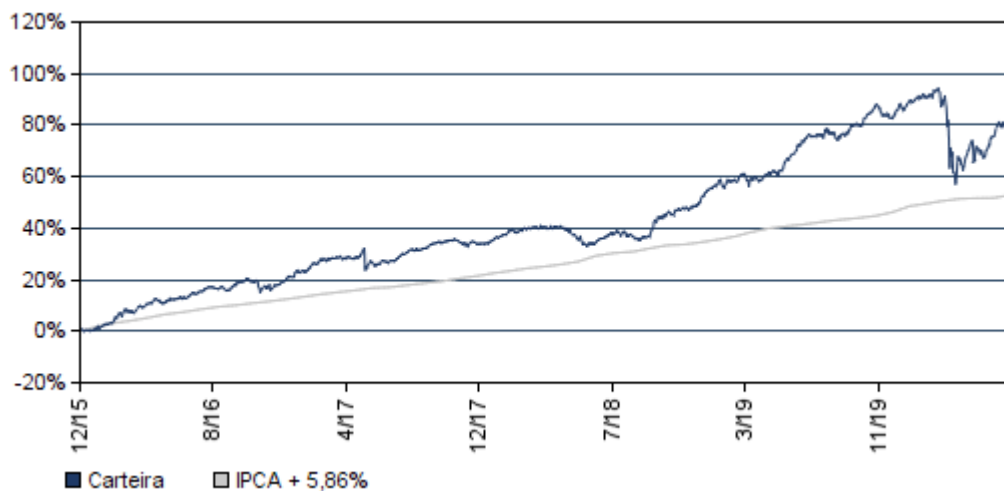
**Alocação por Gestor**



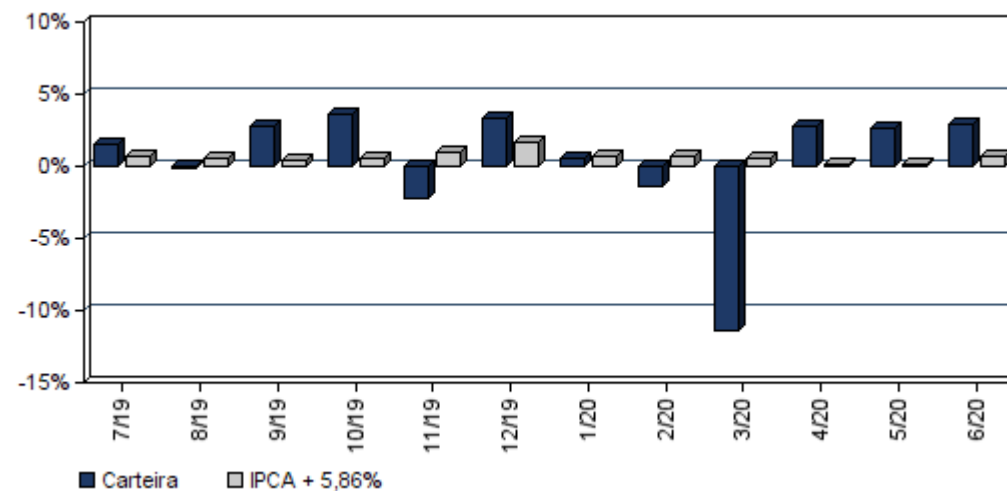
**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

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	2,93	--	--	--	--	--	--	-4,51
<b>IPCA + 5,86%</b>	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,75	--	--	--	--	--	--	2,93
<b>p.p. Indx</b>	-0,09	-1,99	-12,02	2,65	2,60	2,18	--	--	--	--	--	--	-7,44

**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	24	57,1%					
Meses <b>abaixo</b> do Benchmark	18	42,9%					
	Rentab.	Mês					
<b>Maior</b> rentabilidade da Carteira	6,39%	out/18	<b>03 meses</b>	8,62	0,96	7,7	13,416
<b>Menor</b> rentabilidade da Carteira	-11,45%	mar/20	<b>06 meses</b>	-4,51	2,93	-7,4	20,151
			<b>12 meses</b>	4,20	8,15	-3,9	14,613
			<b>24 meses</b>	34,19	18,26	15,9	11,184
			<b>36 meses</b>	42,07	30,60	11,5	9,379
			<b>Desde o início</b>	80,65	52,88	27,8	8,786

#### 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.	2,29 0,24	-8,42 -6,75	4,76 -0,20	-8,42 -6,75	-0,74 -5,69	38,52 3,39	45,40 -0,80
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI Var. do IMA-B TOTAL p.p.	2,02 -0,03	-1,75 -0,08	4,90 -0,06	-1,75 -0,08	4,74 -0,20	34,48 -0,65	45,12 -1,09
FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RF LP Var. do IMA-B TOTAL p.p.	2,03 -0,02	-1,88 -0,21	4,91 -0,05	-1,88 -0,21	4,52 -0,42	34,35 -0,78	45,00 -1,21
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA II FI Var. do IPCA + 6% p.p.	0,89 0,13	0,75 -2,25	1,68 0,68	0,75 -2,25	4,92 -3,38	14,92 -3,65	26,24 -4,88
FI CAIXA BRASIL 2024 I TP RF Var. do IPCA + 6% p.p.	1,24 0,48	1,43 -1,56	5,16 4,16	1,43 -1,56	5,13 -3,16	20,83 2,26	24,94 -6,18
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. do IMA-GERAL TOTAL p.p.	0,95 -0,04	1,75 -0,12	2,96 0,07	1,75 -0,12	6,31 -0,21	11,09 0,15	11,09 0,15
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5+ TP FI Var. do IMA-B 5+ p.p.	2,80 -0,04	-5,38 -0,11	5,82 -0,17	-5,38 -0,11	1,87 -0,10	14,59 -0,37	14,59 -0,37
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP RF LP Var. do IMA-B 5+ p.p.	2,83 -0,02	-5,44 -0,17	5,88 -0,11	-5,44 -0,17	1,57 -0,40	39,90 -1,31	39,90 -1,31

**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.	1,08 -0,04	3,08 -0,09	3,71 -0,06	3,08 -0,09	8,59 -0,22	15,24 -0,35	15,24 -0,35
FI CAIXA ALIANÇA TP RF % do CDI	0,21 97,89	1,86 105,48	0,78 105,47	1,86 105,48	4,68 101,22	11,21 99,78	19,13 98,47
BANESTES ESTRATÉGIA FIC FI RF % do CDI	0,60 280,09	-1,31 -74,18	-0,59 -79,99	-1,31 -74,18	6,44 139,46	24,08 223,07	24,08 223,07
FI BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA Var. do IMA-B TOTAL p.p.	2,19 0,15	-8,35 -6,69	5,85 0,89	-8,35 -6,69	-1,68 -6,62	33,55 -1,58	40,67 -5,54
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA Var. do IBOVESPA p.p.	8,61 -0,15	-17,75 0,06	29,78 -0,40	-17,75 0,06	-5,96 -0,11	29,82 -0,82	49,23 -1,90
BANESTES FIC FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INST Var. do IBOVESPA p.p.	10,23 1,47	-8,36 9,44	41,46 11,28	-8,36 9,44	8,76 14,61	58,50 27,86	51,91 26,93
CAIXA FI AÇÕES DIVIDENDOS Var. do IBOVESPA p.p.	2,45 -6,30	-21,07 -3,27	17,18 -13,00	-21,07 -3,27	-1,52 4,33	39,42 8,79	37,45 5,65
FIC FIA CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. do IBOVESPA p.p.	4,58 -4,17	-16,79 1,02	20,57 -9,61	-16,79 1,02	-2,34 3,52	45,78 15,15	50,01 -1,11
CAIXA FIC FIA MULTIGESTOR Var. do IBOVESPA p.p.	9,88 1,12	-17,47 -1,08	33,22 3,04	-17,47 -1,08	-17,47 -1,08	-17,47 -1,08	-17,47 -1,08
CAIXA RIO BRAVO FII Var. do Índice Fundos Imobiliários - IFIX p.p.	20,92 15,33	11,06 23,30	36,34 23,82	11,06 23,30	68,38 61,52	107,02 74,98	92,40 57,10
CDI	0,22	1,76	0,74	1,76	4,62	11,23	19,43
IMA - B	2,05	-1,66	4,96	-1,66	4,95	35,13	46,21
IMA - B 5	1,12	3,17	3,77	3,17	8,81	24,75	36,90
IMA - B 5+	2,84	-5,26	5,99	-5,26	1,97	43,55	52,33
IMA - GERAL	0,99	1,87	2,89	1,87	6,52	23,45	33,90



**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	0,79	4,86	3,39	4,86	9,81	27,08	38,44
IRF - M 1	0,28	2,60	1,15	2,60	6,01	13,67	22,54
IRF - M 1+	1,04	6,03	4,53	6,03	11,80	33,23	45,60
IBOVESPA	8,76	-17,80	30,18	-17,80	-5,85	30,64	51,12
IFIX	5,59	-12,24	12,52	-12,24	6,86	32,05	35,31
SMALL CAP	14,43	-20,73	32,49	-20,73	5,15	49,01	69,83
IPCA + 4,61%	0,65	2,33	0,67	2,33	6,87	15,50	26,06
IPCA + 4,81%	0,66	2,43	0,72	2,43	7,08	15,94	26,78
IPCA + 5,06%	0,68	2,55	0,78	2,55	7,33	16,49	27,68
IPCA + 5,27%	0,70	2,65	0,83	2,65	7,55	16,95	28,45
IPCA + 5,43%	0,71	2,73	0,86	2,73	7,71	17,31	29,03
IPCA + 5,5%	0,72	2,76	0,88	2,76	7,78	17,46	29,28
IPCA + 5,54%	0,72	2,78	0,89	2,78	7,82	17,55	29,43
IPCA + 5,61%	0,73	2,81	0,90	2,81	7,90	17,71	29,69
IPCA + 5,67%	0,73	2,84	0,92	2,84	7,96	17,84	29,91

**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%	0,74	2,86	0,93	2,86	8,00	17,93	30,05
IPCA + 5,74%	0,74	2,87	0,93	2,87	8,03	18,00	30,16
IPCA + 5,77%	0,74	2,89	0,94	2,89	8,06	18,06	30,27
IPCA + 5,78%	0,74	2,89	0,94	2,89	8,07	18,09	30,31
IPCA + 5,80%	0,74	2,90	0,95	2,90	8,09	18,13	30,38
IPCA + 5,81%	0,74	2,91	0,95	2,91	8,10	18,15	30,42
IPCA + 5,82%	0,74	2,91	0,95	2,91	8,11	18,18	30,46
IPCA + 5,83%	0,74	2,92	0,95	2,92	8,12	18,20	30,49
IPCA + 5,84%	0,75	2,92	0,96	2,92	8,13	18,22	30,53
IPCA + 5,85%	0,75	2,92	0,96	2,92	8,14	18,24	30,57
IPCA + 5,86%	0,75	2,93	0,96	2,93	8,15	18,26	30,60
IPCA + 5,87%	0,75	2,93	0,96	2,93	8,16	18,29	30,64
IPCA + 5,88%	0,75	2,94	0,97	2,94	8,17	18,31	30,68
IPCA + 5,89%	0,75	2,94	0,97	2,94	8,18	18,33	30,71
IPCA + 6%	0,76	3,00	0,99	3,00	8,30	18,58	31,12

**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%	0,38	2,28	0,61	2,28	6,76	15,33	24,83
INPC + 4,81%	0,39	2,38	0,66	2,38	6,97	15,77	25,54
INPC + 5,06%	0,41	2,50	0,72	2,50	7,22	16,32	26,44
INPC + 5,27%	0,43	2,60	0,77	2,60	7,44	16,78	27,19
INPC + 5,43%	0,44	2,67	0,80	2,67	7,60	17,13	27,77
INPC + 5,54%	0,45	2,73	0,83	2,73	7,72	17,38	28,17
INPC + 5,61%	0,46	2,76	0,84	2,76	7,79	17,53	28,42
INPC + 5,67%	0,46	2,79	0,86	2,79	7,85	17,67	28,64
INPC + 5,71%	0,46	2,81	0,87	2,81	7,89	17,75	28,78
INPC + 5,74%	0,47	2,82	0,87	2,82	7,92	17,82	28,89
INPC + 5,77%	0,47	2,84	0,88	2,84	7,95	17,89	29,00
INPC + 5,78%	0,47	2,84	0,88	2,84	7,96	17,91	29,04
INPC + 5,80%	0,47	2,85	0,89	2,85	7,98	17,95	29,11
INPC + 5,81%	0,47	2,86	0,89	2,86	7,99	17,98	29,15
INPC + 5,82%	0,47	2,86	0,89	2,86	8,00	18,00	29,18

**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 + 5,83%	0,47	2,86	0,90	2,86	8,01	18,02	29,22
INPC + 5,84%	0,47	2,87	0,90	2,87	8,02	18,04	29,26
INPC + 5,85%	0,47	2,87	0,90	2,87	8,03	18,06	29,29
INPC + 5,86%	0,48	2,88	0,90	2,88	8,04	18,09	29,33
INPC + 5,87%	0,48	2,88	0,90	2,88	8,05	18,11	29,37
INPC + 5,88%	0,48	2,89	0,91	2,89	8,06	18,13	29,40
INPC + 5,89%	0,48	2,89	0,91	2,89	8,08	18,15	29,44
INPC + 6%	0,49	2,95	0,93	2,95	8,19	18,40	29,84