

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos										
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (31/08/2020)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
Renda Fixa										
BANESTES DTVM	Banco BANESTES	FI BANESTES PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B	22,96%	-3,55%	-1,75%	-5,04%	1.849.973,38	0,91%	288.523.008,49	0,64%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI	12,54%	-1,85%	-0,06%	0,64%	15.875.294,68	7,81%	5.638.549.883,16	0,28%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RF LP	12,61%	-1,83%	-0,03%	0,54%	33.974.462,41	16,72%	6.019.680.821,86	0,56%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA II FI	1,18%	0,18%	-0,55%	1,00%	1.099.170,14	0,54%	152.377.069,87	0,72%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL 2024 I TP RF	9,18%	-2,49%	-3,21%	0,66%	1.394.784,17	0,69%	456.299.202,88	0,31%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,12%	-0,89%	-0,29%	2,63%	38.523.824,20	18,95%	10.897.747.304,90	0,35%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5+ TP FI	19,35%	-3,69%	-0,07%	-2,23%	18.020.946,11	8,87%	1.987.566.192,50	0,91%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP RF LP	19,46%	-3,64%	-0,02%	-2,24%	14.695.013,99	7,23%	1.873.284.904,48	0,78%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP FIC FI	4,92%	0,37%	-0,06%	4,46%	14.016.093,70	6,90%	4.251.005.212,54	0,33%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - FI 100% Títulos TN							139.449.562,79	68,61%		
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA ALIANÇA TP RF	0,26%	0,14%	88,68%	2,20%	263.335,30	0,13%	413.635.630,02	0,06%
BANESTES DTVM	Banco BANESTES	BANESTES ESTRATÉGIA FIC FI RF	2,58%	-0,64%	-398,90%	-0,11%	4.671.295,94	2,30%	184.359.376,17	2,53%
BANESTES DTVM	Banco BANESTES	FI BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA	26,14%	-3,63%	-1,83%	-5,86%	12.044.117,55	5,93%	275.989.890,48	4,36%
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - FI Renda Fixa - Geral							16.978.748,78	8,35%		
Sub-total Renda Fixa - FI Renda Fixa - Geral							156.428.311,57	76,96%		
Renda Variável										
CAIXA	CAIXA	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	43,48%	-3,43%	0,01%	-14,10%	5.651.788,38	2,78%	683.983.509,09	0,83%
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a - FI de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações							5.651.788,38	2,78%		
BANESTES DTVM	Banco BANESTES	BANESTES FIC FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INST	44,85%	-0,43%	3,01%	-1,13%	9.731.405,79	4,79%	157.969.354,10	6,16%
CAIXA	CAIXA	CAIXA FI AÇÕES DIVIDENDOS	38,54%	-6,01%	-2,57%	-22,50%	198.137,33	0,10%	270.846.204,75	0,07%
VINCI EQUITIES Gest Rec	CAIXA	FIC FIA CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	39,07%	-3,82%	-0,38%	-13,31%	25.415.874,31	12,50%	819.770.596,51	3,10%
CAIXA	CAIXA	CAIXA FIC FIA MULTIGESTOR	32,07%	-3,45%	-0,01%	-12,97%	3.849.363,40	1,89%	869.683.651,69	0,44%
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a - FI de Ações - Geral							39.194.780,83	19,28%		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos										
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (31/08/2020)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
RIO BRAVO Invest	CAIXA	CAIXA RIO BRAVO FII	0,00%	-10,03%	-11,82%	12,31%	1.980.900,00	0,97%	154.350.188,72	1,28%
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b - FI Imobiliários							1.980.900,00	0,97%		
Sub-total Renda Variável							46.827.469,22	23,04%		
Total							203.255.780,78	100%		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Classe	Valor(R\$)	% Carteira	Política Investimento	Limite Res. 4.604/17
Renda Fixa					
Artigo 7º I, Alínea b	FI 100% Títulos TN	139.449.562,79	68,61%	63,50%	100,00%
Artigo 7º IV, Alínea a	FI Renda Fixa - Geral	16.978.748,78	8,35%	9,50%	40,00%
Total Renda Fixa		156.428.311,57	76,96%		
Renda Variável					
Artigo 8º I, Alínea a	FI de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações	5.651.788,38	2,78%	6,00%	30,00%
Artigo 8º II, Alínea a	FI de Ações - Geral	39.194.780,83	19,28%	20,00%	20,00%
Artigo 8º IV, Alínea b	FI Imobiliários	1.980.900,00	0,97%	1,00%	5,00%
Total Renda Variável		46.827.469,22	23,03%		

Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)

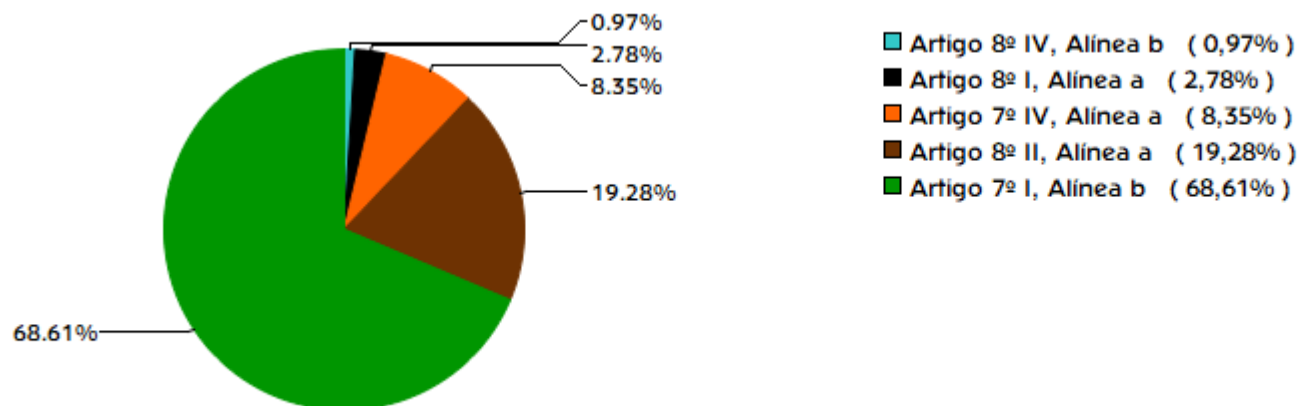
Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
Artigo 7º I, Alínea b	-1,81	0,87	6,87	34,19
% do CDI	-1.127,0	40,9	177,2	328,8
Artigo 7º IV, Alínea a	-2,77	-3,83	2,20	24,19
% do CDI	-1.720,8	-180,0	56,8	232,6
Artigo 8º I, Alínea a	-3,43	-14,10	-1,87	28,69
% do CDI	-2.132,0	-663,6	-48,4	275,9
Artigo 8º II, Alínea a	-2,98	-10,14	1,96	54,16
% do CDI	-1.852,7	-477,2	50,5	520,8
Artigo 8º IV, Alínea b	-10,03	12,31	58,08	101,07
% do CDI	-6.235,7	579,2	1.498,4	972,0

Ganhos Financeiros

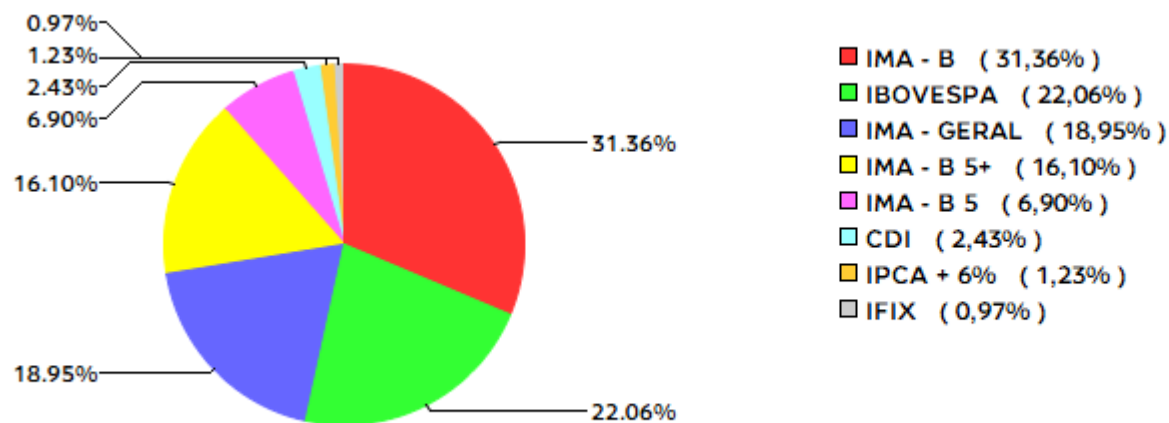
Estratégia	Ganho Bruto (R\$)
Artigo 7º I, Alínea b	-2.542.661,31
Artigo 7º IV, Alínea a	-483.363,94
Artigo 8º I, Alínea a	-200.715,44
Artigo 8º II, Alínea a	-1.201.493,13
Artigo 8º IV, Alínea b	-221.094,00
Total	-4.649.327,82

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

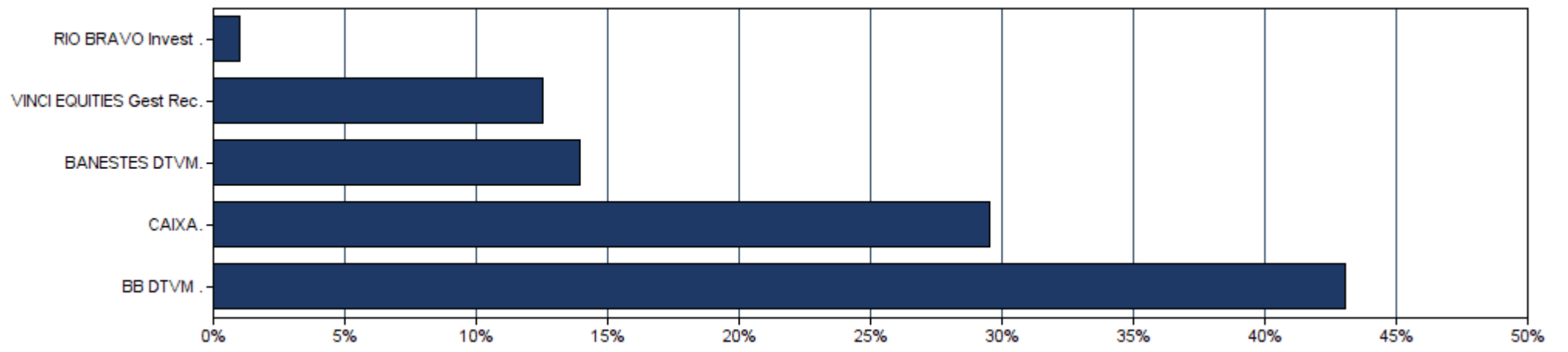
Alocação por Estratégia



Indexadores



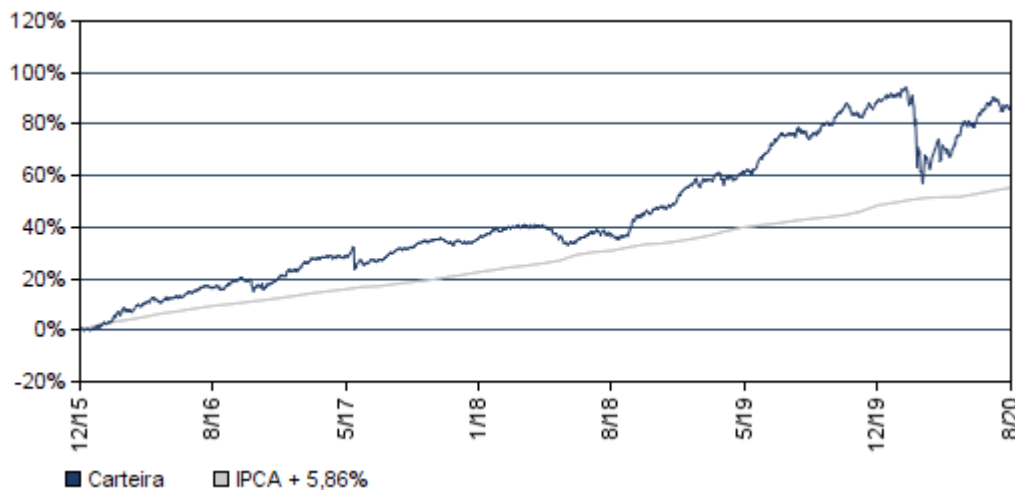
Alocação por Gestor



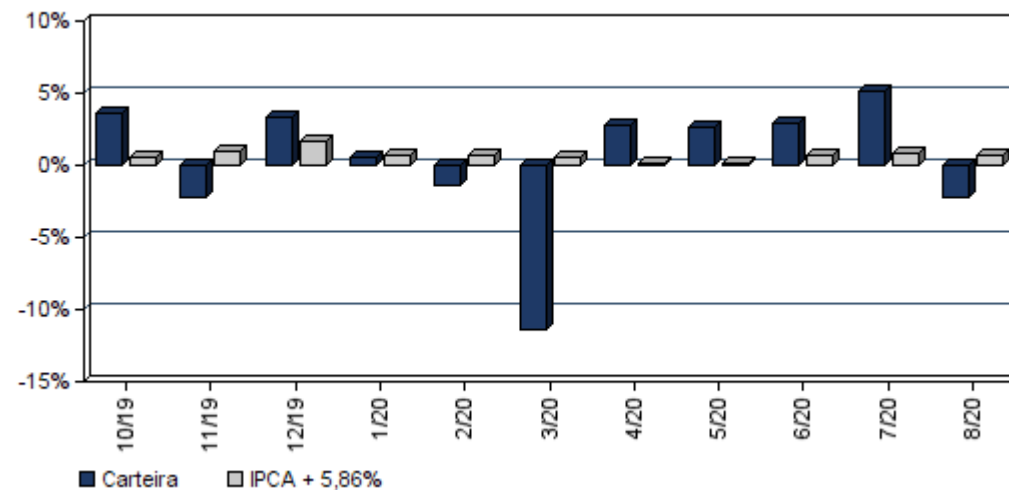
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira													
Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
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 + 5,86%	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
p.p. Indx	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
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 + 5,86%	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
p.p. Indx	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
2019	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
IPCA + 5,86%	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
p.p. Indx	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
2020	0,62	-1,33	-11,45	2,79	2,67	2,94	5,07	-2,25	--	--	--	--	-1,92
IPCA + 5,86%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,88	0,72	--	--	--	--	4,57
p.p. Indx	-0,09	-1,99	-12,02	2,65	2,60	2,20	4,19	-2,97	--	--	--	--	-6,49

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 acima do Benchmark	25	56,8%					
Meses abaixo do Benchmark	19	43,2%					
	Rentab.	Mês					
Maior rentabilidade da Carteira	6,39%	out/18	03 meses	5,72	2,35	3,4	7,401
Menor rentabilidade da Carteira	-11,45%	mar/20	06 meses	-1,20	3,16	-4,4	19,877
			12 meses	5,66	8,44	-2,8	14,753
			24 meses	35,61	18,65	17,0	11,284
			36 meses	40,17	30,81	9,4	9,522
			Desde o início	85,55	55,32	30,2	8,730

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.	-3,55 -1,75	-5,04 -5,85	6,06 1,45	-5,64 -5,73	2,57 -4,07	40,28 4,29	42,92 0,72
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI Var. do IMA-B TOTAL p.p.	-1,85 -0,06	0,64 -0,17	4,50 -0,11	-0,06 -0,15	6,38 -0,26	35,28 -0,71	41,12 -1,08
FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RF LP Var. do IMA-B TOTAL p.p.	-1,83 -0,03	0,54 -0,26	4,54 -0,07	-0,14 -0,23	6,20 -0,44	35,19 -0,80	41,02 -1,18
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA II FI Var. do IPCA + 6% p.p.	0,18 -0,55	1,00 -3,66	1,15 -1,24	0,78 -2,44	4,17 -4,42	14,18 -4,78	22,67 -8,66
FI CAIXA BRASIL 2024 I TP RF Var. do IPCA + 6% p.p.	-2,49 -3,21	0,66 -4,01	0,47 -1,92	1,55 -1,68	5,84 -2,75	21,37 2,40	20,52 -10,81
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. do IMA-GERAL TOTAL p.p.	-0,89 -0,29	2,63 -0,39	1,82 -0,31	1,67 -0,32	6,05 -0,46	12,05 -0,15	12,05 -0,15
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5+ TP FI Var. do IMA-B 5+ p.p.	-3,69 -0,07	-2,23 -0,22	6,21 -0,16	-2,57 -0,22	4,54 -0,18	18,39 -0,52	18,39 -0,52
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP RF LP Var. do IMA-B 5+ p.p.	-3,64 -0,02	-2,24 -0,23	6,31 -0,07	-2,48 -0,13	4,26 -0,45	44,64 -1,43	44,64 -1,43

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.	0,37 -0,06	4,46 -0,17	2,43 -0,13	3,21 -0,18	8,95 -0,29	16,78 -0,45	16,78 -0,45
FI CAIXA ALIANÇA TP RF % do CDI	0,14 88,68	2,20 103,67	0,55 95,92	1,51 104,85	3,93 101,48	10,40 100,00	17,62 98,14
BANESTES ESTRATÉGIA FIC FI RF % do CDI	-0,64 -398,90	-0,11 -5,31	1,82 318,62	-1,14 -79,19	5,57 143,58	24,91 239,53	25,58 228,65
FI BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA Var. do IMA-B TOTAL p.p.	-3,63 -1,83	-5,86 -6,66	4,97 0,37	-6,73 -6,82	0,44 -6,20	34,98 -1,02	37,17 -5,04
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA Var. do IBOVESPA p.p.	-3,43 0,01	-14,10 -0,03	13,42 -0,27	-4,74 -0,13	-1,87 -0,13	28,69 -0,90	38,62 -1,67
BANESTES FIC FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INST Var. do IBOVESPA p.p.	-0,43 3,01	-1,13 12,95	18,93 5,24	4,33 8,94	10,07 11,81	69,06 39,47	63,90 33,25
CAIXA FI AÇÕES DIVIDENDOS Var. do IBOVESPA p.p.	-6,01 -2,57	-22,50 -8,42	0,60 -13,09	-16,67 -12,06	-7,25 -5,50	31,54 1,94	34,97 -2,81
FIC FIA CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. do IBOVESPA p.p.	-3,82 -0,38	-13,31 0,76	8,95 -4,74	-8,81 -4,20	-1,14 0,61	48,70 19,10	44,23 3,95
CAIXA FIC FIA MULTIGESTOR Var. do IBOVESPA p.p.	-3,45 -0,01	-12,97 -0,38	15,87 2,17	-4,39 0,22	-12,97 -0,38	-12,97 -0,38	-12,97 -0,38
CAIXA RIO BRAVO FII Var. do Índice Fundos Imobiliários - IFIX p.p.	-10,03 -11,82	12,31 25,30	22,28 17,60	10,05 16,19	58,08 53,36	99,70 69,65	101,43 67,93
CDI	0,16	2,12	0,57	1,44	3,88	10,40	17,95
IMA - B	-1,80	0,80	4,61	0,09	6,64	36,00	42,20
IMA - B 5	0,43	4,63	2,55	3,39	9,24	25,01	33,33
IMA - B 5+	-3,62	-2,01	6,38	-2,35	4,71	44,71	48,51
IMA - GERAL	-0,60	3,02	2,13	1,99	6,51	23,37	30,91

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
IRF - M	-0,75	5,20	1,11	3,62	8,70	26,82	34,34
IRF - M 1	0,12	2,96	0,64	2,12	5,06	12,83	20,62
IRF - M 1+	-1,13	6,37	1,36	4,37	10,64	33,26	40,58
IBOVESPA	-3,44	-14,07	13,69	-4,61	-1,75	29,59	40,28
IFIX	1,79	-12,99	4,68	-6,13	4,72	30,04	33,50
SMALL CAP	-1,23	-14,27	23,76	-6,96	6,02	60,17	56,43
IPCA + 4,61%	0,62	3,75	2,04	2,54	7,16	15,88	26,26
IPCA + 4,81%	0,63	3,88	2,09	2,64	7,37	16,32	26,98
IPCA + 5,06%	0,65	4,05	2,15	2,76	7,62	16,88	27,89
IPCA + 5,27%	0,67	4,19	2,21	2,87	7,84	17,34	28,65
IPCA + 5,43%	0,68	4,29	2,25	2,94	8,00	17,70	29,23
IPCA + 5,5%	0,69	4,34	2,27	2,98	8,07	17,85	29,49
IPCA + 5,54%	0,69	4,36	2,28	3,00	8,11	17,94	29,64
IPCA + 5,61%	0,70	4,41	2,29	3,03	8,19	18,10	29,89
IPCA + 5,67%	0,70	4,45	2,31	3,06	8,25	18,23	30,11

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%	0,70	4,47	2,32	3,08	8,29	18,32	30,26
IPCA + 5,74%	0,71	4,49	2,32	3,10	8,32	18,38	30,37
IPCA + 5,77%	0,71	4,51	2,33	3,11	8,35	18,45	30,48
IPCA + 5,78%	0,71	4,52	2,33	3,12	8,36	18,47	30,52
IPCA + 5,80%	0,71	4,53	2,34	3,13	8,38	18,52	30,59
IPCA + 5,81%	0,71	4,54	2,34	3,13	8,39	18,54	30,63
IPCA + 5,82%	0,71	4,55	2,34	3,14	8,40	18,56	30,66
IPCA + 5,83%	0,71	4,55	2,35	3,14	8,41	18,58	30,70
IPCA + 5,84%	0,72	4,56	2,35	3,15	8,42	18,61	30,74
IPCA + 5,85%	0,72	4,57	2,35	3,15	8,43	18,63	30,77
IPCA + 5,86%	0,72	4,57	2,35	3,16	8,44	18,65	30,81
IPCA + 5,87%	0,72	4,58	2,36	3,16	8,45	18,67	30,85
IPCA + 5,88%	0,72	4,59	2,36	3,17	8,46	18,70	30,89
IPCA + 5,89%	0,72	4,59	2,36	3,17	8,47	18,72	30,92
IPCA + 6%	0,73	4,66	2,39	3,22	8,58	18,96	31,33

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	3,86	1,92	2,75	7,30	15,87	25,58
INPC + 4,81%	0,39	3,99	1,97	2,85	7,50	16,31	26,30
INPC + 5,06%	0,41	4,15	2,03	2,97	7,76	16,86	27,20
INPC + 5,27%	0,43	4,29	2,08	3,07	7,98	17,33	27,96
INPC + 5,43%	0,44	4,40	2,12	3,15	8,14	17,68	28,54
INPC + 5,54%	0,45	4,47	2,15	3,21	8,25	17,93	28,94
INPC + 5,61%	0,46	4,51	2,17	3,24	8,33	18,08	29,19
INPC + 5,67%	0,46	4,55	2,18	3,27	8,39	18,22	29,41
INPC + 5,71%	0,46	4,58	2,19	3,29	8,43	18,31	29,56
INPC + 5,74%	0,47	4,60	2,20	3,30	8,46	18,37	29,67
INPC + 5,77%	0,47	4,62	2,21	3,32	8,49	18,44	29,78
INPC + 5,78%	0,47	4,63	2,21	3,32	8,50	18,46	29,81
INPC + 5,80%	0,47	4,64	2,22	3,33	8,52	18,51	29,89
INPC + 5,81%	0,47	4,64	2,22	3,34	8,53	18,53	29,92
INPC + 5,82%	0,47	4,65	2,22	3,34	8,54	18,55	29,96

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	4,66	2,22	3,35	8,55	18,57	30,00
INPC + 5,84%	0,47	4,66	2,23	3,35	8,56	18,59	30,03
INPC + 5,85%	0,47	4,67	2,23	3,36	8,57	18,62	30,07
INPC + 5,86%	0,48	4,68	2,23	3,36	8,58	18,64	30,11
INPC + 5,87%	0,48	4,68	2,23	3,37	8,59	18,66	30,14
INPC + 5,88%	0,48	4,69	2,24	3,37	8,60	18,68	30,18
INPC + 5,89%	0,48	4,70	2,24	3,38	8,61	18,71	30,22
INPC + 6%	0,49	4,77	2,27	3,43	8,73	18,95	30,62