

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos												
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	Ano	Cotização Aplic/Resg	Valor(R\$) (30/09/2020)	% Carteira	Limite % Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo	Limite % PL Fundo
Renda Fixa												
BANESTES DTVM	Banco BANESTES	FI BANESTES PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B	23,29%	-5,05%	-9,84%	D0/D0	1.756.587,15	0,88%	100%	288.574.129,48	0,61%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI	12,72%	-1,56%	-0,93%	D0/D+1	15.628.363,17	7,86%	100%	5.533.318.681,28	0,28%	15%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RF LP	12,79%	-1,53%	-1,00%	D0/D0	33.453.525,92	16,82%	100%	5.834.527.804,73	0,57%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA II FI	0,00%	--%	--%	D0/D0	0,00	0,00%	100%	0,00	0,00%	15%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL 2024 I TP RF	9,26%	-0,77%	-0,12%	D0/D0	1.384.042,62	0,70%	100%	452.785.187,83	0,31%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,22%	-0,75%	1,86%	D0/D0	38.233.913,32	19,22%	100%	10.452.752.168,75	0,37%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5+ TP FI	19,64%	-2,65%	-4,82%	D0/D+2	17.544.007,92	8,82%	100%	1.936.096.946,75	0,91%	15%
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP RF LP	19,74%	-2,64%	-4,82%	D0/D0	14.306.624,48	7,19%	100%	1.755.979.575,38	0,81%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP FIC FI	4,98%	-0,15%	4,30%	D0/D+1	15.086.759,20	7,58%	100%	4.406.252.863,92	0,34%	15%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - FI 100% Títulos TN							137.393.823,78	69,06%				
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA ALIANÇA TP RF	0,27%	-0,07%	2,13%	D0/D0	263.158,60	0,13%	20%	425.183.614,13	0,06%	15%
BANESTES DTVM	Banco BANESTES	BANESTES ESTRATÉGIA FIC FI RF	2,82%	-1,52%	-1,63%	D0/D+1	4.600.312,26	2,31%	20%	183.820.888,05	2,50%	15%
BANESTES DTVM	Banco BANESTES	FI BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA	26,43%	-4,96%	-10,53%	D0/D0	11.446.317,56	5,75%	20%	291.923.457,14	3,92%	15%
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - FI Renda Fixa - Geral							16.309.788,42	8,20%				
Sub-total Renda Fixa							153.703.612,21	77,26%				
Renda Variável												
CAIXA	CAIXA	FIA CAIXA BRASIL IBOVSPA	43,83%	-4,71%	-18,15%	D+1/D+1	5.385.567,64	2,71%	30%	634.870.630,59	0,85%	15%
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a - FI de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações							5.385.567,64	2,71%				
BANESTES DTVM	Banco BANESTES	BANESTES FIC FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INST	45,24%	-2,96%	-4,05%	D+1/D+30	9.487.167,98	4,77%	20%	157.034.448,33	6,04%	15%
CAIXA	CAIXA	CAIXA FI AÇÕES DIVIDENDOS	38,86%	-4,03%	-25,62%	D+1/D+1	190.157,46	0,10%	20%	258.397.846,89	0,07%	15%
VINCI EQUITIES Gest Rec	CAIXA	FIC FIA CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	39,27%	-4,93%	-17,58%	D+1/D+30	24.163.663,22	12,15%	20%	783.577.685,83	3,08%	15%
CAIXA	CAIXA	CAIXA FIC FIA MULTIGESTOR	32,55%	-5,38%	-17,65%	D+1/D+23	3.642.356,46	1,83%	20%	829.848.817,55	0,44%	15%
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a - FI de Ações - Geral							37.483.345,11	18,84%				
RIO BRAVO Invest	CAIXA	CAIXA RIO BRAVO FII	0,00%	9,31%	22,77%	D0/D0	2.364.172,20	1,19%	5%	156.187.768,35	1,51%	5%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos												
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (30/09/2020)	% Carteira	Limite % Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo	Limite % PL Fundo
							Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b - FI Imobiliários	2.364.172,20	1,19%			
							Sub-total Renda Variável	45.233.084,96	22,74%			
Total							198.936.697,16	100%				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

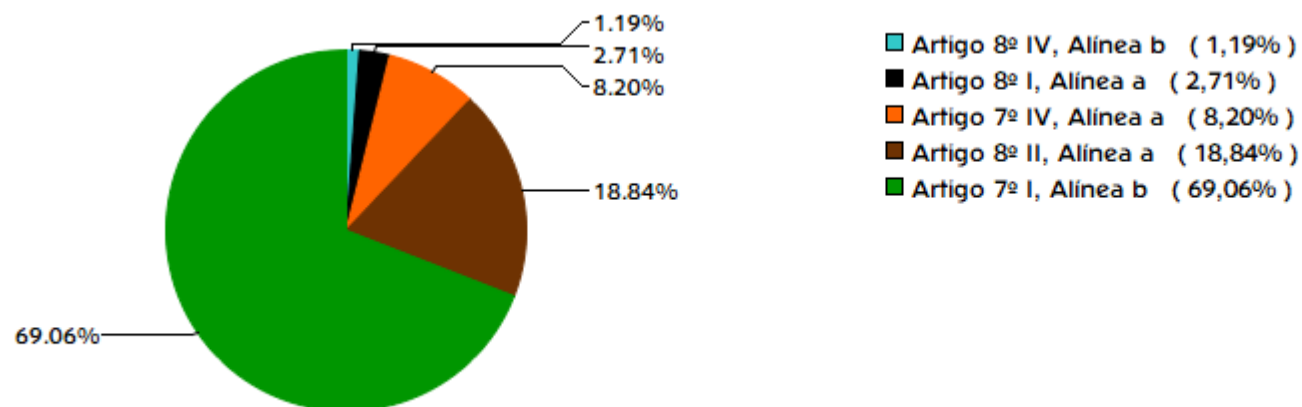
Enquadramento da Carteira					
Artigo	Classe	Valor(R\$)	% Carteira	Política Investimento	Limite Res. 3.922/2010
Renda Fixa					
Artigo 7º I, Alínea b	FI 100% Títulos TN	137.393.823,78	69,06%	63,50%	100,00%
Artigo 7º IV, Alínea a	FI Renda Fixa - Geral	16.309.788,43	8,20%	9,50%	40,00%
Total Renda Fixa		153.703.612,21	77,26%		
Renda Variável					
Artigo 8º I, Alínea a	FI de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações	5.385.567,64	2,71%	6,00%	30,00%
Artigo 8º II, Alínea a	FI de Ações - Geral	37.483.345,11	18,84%	20,00%	20,00%
Artigo 8º IV, Alínea b	FI Imobiliários	2.364.172,20	1,19%	1,00%	5,00%
Total Renda Variável		45.233.084,96	22,74%		

Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)				
Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
Artigo 7º I, Alínea b	-1,48	-0,60	2,18	32,35
% do CDI	-941,7	-26,3	61,2	321,7
Artigo 7º IV, Alínea a	-3,94	-7,61	-5,44	19,00
% do CDI	-2.510,1	-333,2	-153,1	188,9
Artigo 8º I, Alínea a	-4,71	-18,15	-9,67	18,59
% do CDI	-3.000,9	-794,1	-271,9	184,9
Artigo 8º II, Alínea a	-4,48	-14,16	-3,66	48,89
% do CDI	-2.852,1	-619,6	-102,8	486,1
Artigo 8º IV, Alínea b	-88,01	-86,53	-81,39	-76,28
% do CDI	-56.069,7	-3.786,6	-2.288,2	-758,6

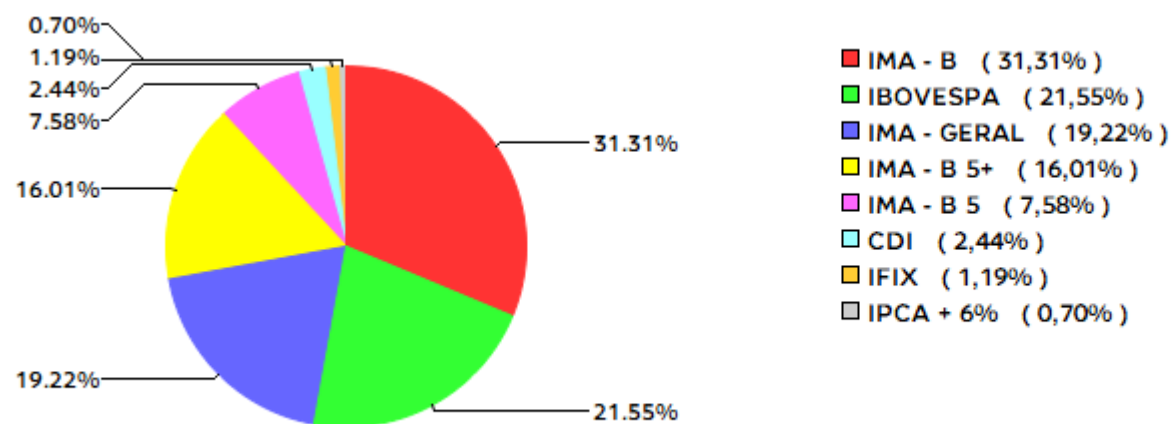
Ganhos Financeiros	
Estratégia	Ganho Bruto (R\$)
Artigo 7º I, Alínea b	-2.055.734,20
Artigo 7º IV, Alínea a	-668.960,36
Artigo 8º I, Alínea a	-266.220,74
Artigo 8º II, Alínea a	-1.755.863,15
Artigo 8º IV, Alínea b	392.218,20
Total	-4.354.560,24

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia

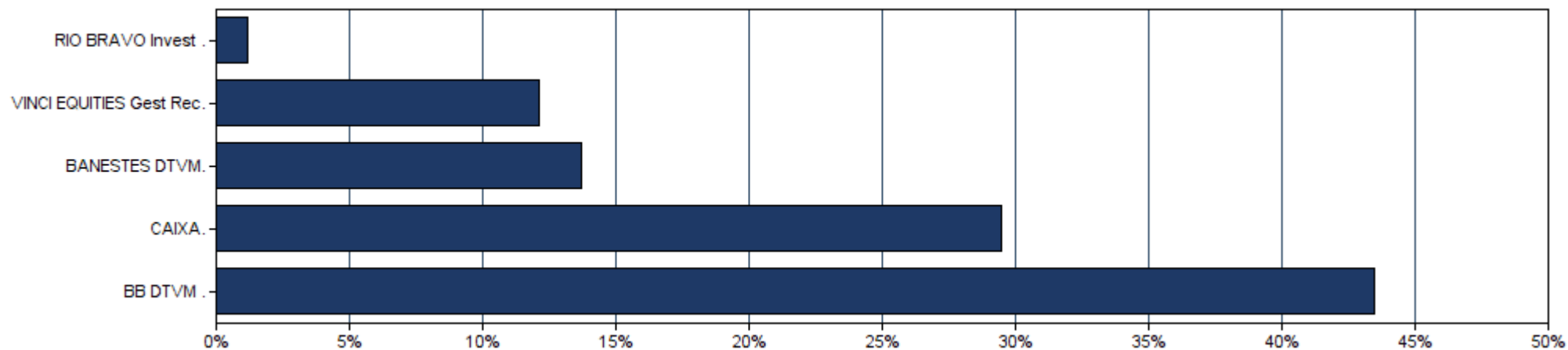


Indexadores



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor

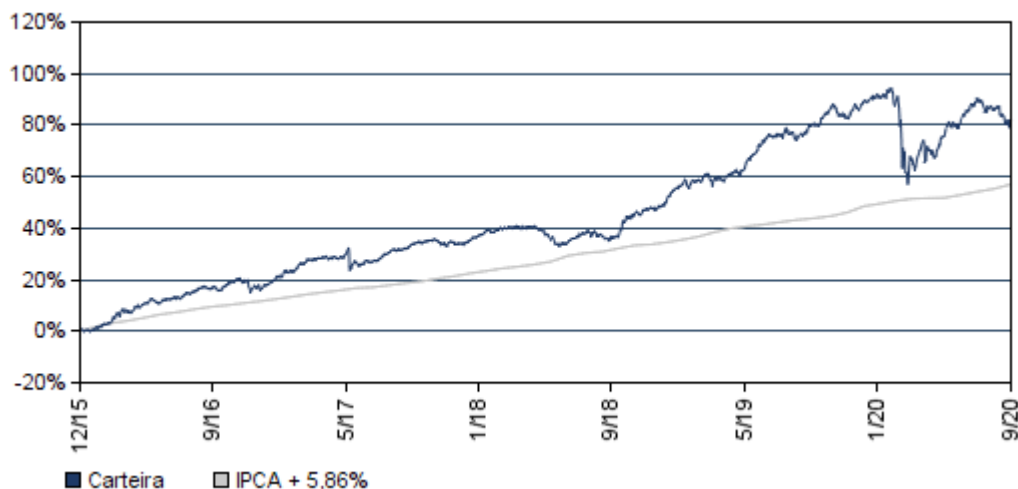


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

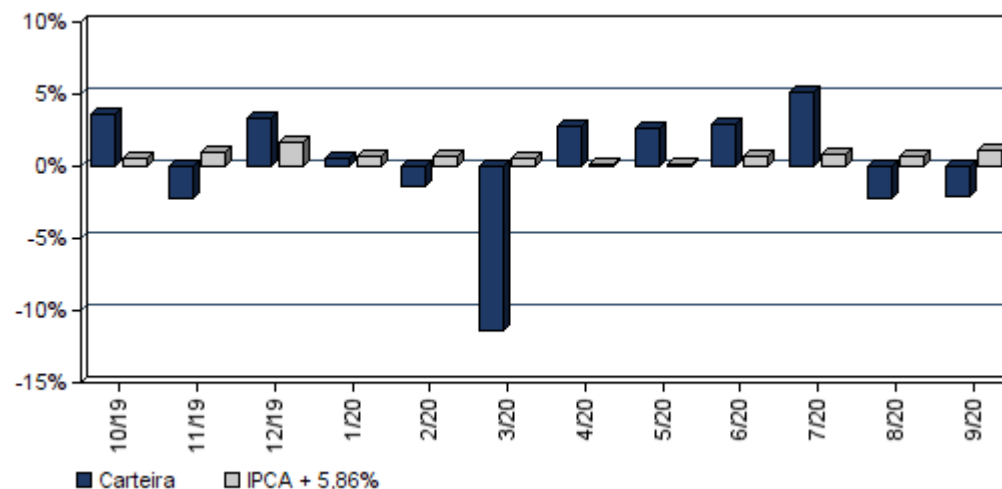
Rentabilidades da Carteira

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	-2,24	-2,15	--	--	--	-4,02
IPCA + 5,86%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,88	0,72	1,12	--	--	--	5,74
p.p. Indx	-0,09	-1,99	-12,02	2,65	2,60	2,20	4,19	-2,95	-3,27	--	--	--	-9,76

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	55,6%					
Meses abaixo do Benchmark	20	44,4%					
	Rentab.	Mês					
Maior rentabilidade da Carteira	6,39%	out/18	03 meses	0,51	2,74	-2,2	8,807
Menor rentabilidade da Carteira	-11,45%	mar/20	06 meses	9,19	3,72	5,5	11,314
			12 meses	0,57	9,18	-8,6	15,037
			24 meses	32,74	18,89	13,8	11,474
			36 meses	34,95	31,47	3,5	9,704
			Desde o início	81,59	57,06	24,5	8,789

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.	-5,05 -3,54	-9,84 -9,12	-1,55 -2,51	3,14 -2,83	-7,24 -9,35	33,89 -0,25	32,47 -5,09
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI Var. do IMA-B TOTAL p.p.	-1,56 -0,04	-0,93 -0,21	0,83 -0,13	5,77 -0,20	1,83 -0,28	33,39 -0,75	36,49 -1,07
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP RF LP Var. do IMA-B TOTAL p.p.	-1,53 -0,02	-1,00 -0,28	0,89 -0,07	5,84 -0,12	1,68 -0,43	33,36 -0,78	36,41 -1,16
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA II FI Var. do IPCA + 6% p.p.	-- 0,00	-- 0,00	-- 0,00	-- 0,00	-- 0,00	-- 0,00	-- 0,00
FI CAIXA BRASIL 2024 I TP RF Var. do IPCA + 6% p.p.	-0,77 -1,90	-0,12 -5,96	-1,53 -4,30	3,55 -0,24	2,77 -6,56	20,76 1,55	17,87 -14,12
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. do IMA-GERAL TOTAL p.p.	-0,75 -0,16	1,86 -0,55	0,10 -0,42	3,07 -0,36	3,70 -0,65	11,20 -0,32	11,20 -0,32
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5+ TP FI Var. do IMA-B 5+ p.p.	-2,65 -0,05	-4,82 -0,26	0,59 -0,16	6,44 -0,34	-1,87 -0,19	15,26 -0,56	15,26 -0,56
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TP RF LP Var. do IMA-B 5+ p.p.	-2,64 -0,04	-4,82 -0,27	0,65 -0,10	6,56 -0,22	-2,10 -0,43	40,97 -1,45	40,81 -1,45

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.	-0,15 -0,03	4,30 -0,20	1,18 -0,11	4,93 -0,17	6,95 -0,29	16,60 -0,49	16,60 -0,49
FI CAIXA ALIANÇA TP RF % do CDI	-0,07 -42,75	2,13 93,40	0,27 52,53	1,05 83,72	3,36 94,38	9,81 97,53	16,81 96,67
BANESTES ESTRATÉGIA FIC FI RF % do CDI	-1,52 -968,09	-1,63 -71,36	-0,33 -63,77	-0,92 -72,97	1,86 52,38	22,52 223,91	23,67 208,34
FI BANESTES INSTITUCIONAL RENDA FIXA Var. do IMA-B TOTAL p.p.	-4,96 -3,45	-10,53 -9,81	-2,38 -3,34	3,34 -2,63	-8,82 -10,92	28,45 -5,69	27,13 -10,43
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA Var. do IBOVESPA p.p.	-4,71 0,09	-18,15 0,05	-0,49 -0,01	29,15 -0,41	-9,67 0,01	18,59 -0,64	26,05 -1,29
BANESTES FIC FIA BTG PACTUAL ABSOLUTO INST Var. do IBOVESPA p.p.	-2,96 1,84	-4,05 14,15	4,70 5,18	48,11 18,55	5,50 15,18	60,57 41,33	59,06 34,67
CAIXA FI AÇÕES DIVIDENDOS Var. do IBOVESPA p.p.	-4,03 0,77	-25,62 -7,42	-5,76 -5,28	10,43 -19,12	-12,22 -2,53	26,84 7,60	29,54 -1,63
FIC FIA CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. do IBOVESPA p.p.	-4,93 -0,13	-17,58 0,61	-0,96 -0,48	19,42 -10,14	-6,98 2,70	43,54 24,31	31,29 3,95
CAIXA FIC FIA MULTIGESTOR Var. do IBOVESPA p.p.	-5,38 -0,58	-17,65 -0,87	-0,22 0,25	32,92 3,37	-17,65 -0,87	-17,65 -0,87	-17,65 -0,87
CAIXA RIO BRAVO FII Var. do Índice Fundos Imobiliários - IFIX p.p.	-88,01 -88,47	-86,53 -73,94	-87,88 -87,47	-83,47 -95,53	-81,39 -85,51	-76,45 -107,37	-77,79 -103,63
CDI	0,16	2,29	0,51	1,26	3,56	10,06	17,39
IMA - B	-1,51	-0,72	0,96	5,97	2,11	34,14	37,56
IMA - B 5	-0,12	4,51	1,30	5,11	7,24	23,75	31,84
IMA - B 5+	-2,60	-4,56	0,75	6,78	-1,67	42,42	41,26
IMA - GERAL	-0,60	2,41	0,53	3,43	4,35	21,85	28,42

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	-0,56	4,62	-0,24	3,15	6,56	24,50	31,64
IRF - M 1	0,15	3,12	0,51	1,66	4,54	12,32	19,91
IRF - M 1+	-0,91	5,40	-0,59	3,90	7,61	30,00	36,94
IBOVESPA	-4,80	-18,20	-0,48	29,56	-9,68	19,23	27,34
IFIX	0,46	-12,59	-0,41	12,06	4,12	30,92	25,84
SMALL CAP	-5,44	-18,93	2,27	35,50	-1,78	54,49	42,68
IPCA + 4,61%	1,02	4,81	2,43	3,11	7,89	16,11	26,89
IPCA + 4,81%	1,03	4,96	2,48	3,20	8,10	16,55	27,61
IPCA + 5,06%	1,05	5,15	2,54	3,33	8,35	17,11	28,53
IPCA + 5,27%	1,07	5,30	2,59	3,43	8,57	17,58	29,29
IPCA + 5,43%	1,08	5,42	2,64	3,51	8,74	17,93	29,88
IPCA + 5,5%	1,09	5,47	2,65	3,54	8,81	18,09	30,14
IPCA + 5,54%	1,09	5,50	2,66	3,56	8,85	18,18	30,29
IPCA + 5,61%	1,10	5,56	2,68	3,60	8,92	18,33	30,54
IPCA + 5,67%	1,10	5,60	2,70	3,63	8,98	18,47	30,77

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%	1,11	5,63	2,71	3,65	9,02	18,56	30,91
IPCA + 5,74%	1,11	5,65	2,71	3,66	9,06	18,63	31,02
IPCA + 5,77%	1,11	5,68	2,72	3,68	9,09	18,69	31,13
IPCA + 5,78%	1,11	5,68	2,72	3,68	9,10	18,71	31,17
IPCA + 5,80%	1,11	5,70	2,73	3,69	9,12	18,76	31,25
IPCA + 5,81%	1,11	5,70	2,73	3,70	9,13	18,78	31,28
IPCA + 5,82%	1,12	5,71	2,73	3,70	9,14	18,80	31,32
IPCA + 5,83%	1,12	5,72	2,74	3,71	9,15	18,83	31,36
IPCA + 5,84%	1,12	5,73	2,74	3,71	9,16	18,85	31,39
IPCA + 5,85%	1,12	5,73	2,74	3,72	9,17	18,87	31,43
IPCA + 5,86%	1,12	5,74	2,74	3,72	9,18	18,89	31,47
IPCA + 5,87%	1,12	5,75	2,75	3,73	9,19	18,92	31,51
IPCA + 5,88%	1,12	5,76	2,75	3,73	9,20	18,94	31,54
IPCA + 5,89%	1,12	5,76	2,75	3,74	9,21	18,96	31,58
IPCA + 6%	1,13	5,85	2,78	3,79	9,32	19,21	31,99

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%	1,25	5,53	2,87	3,81	8,68	16,99	27,18
INPC + 4,81%	1,27	5,68	2,92	3,91	8,88	17,44	27,90
INPC + 5,06%	1,29	5,87	2,98	4,03	9,14	18,00	28,82
INPC + 5,27%	1,30	6,03	3,03	4,13	9,36	18,47	29,59
INPC + 5,43%	1,32	6,15	3,07	4,21	9,53	18,83	30,18
INPC + 5,54%	1,32	6,23	3,10	4,27	9,64	19,08	30,58
INPC + 5,61%	1,33	6,28	3,12	4,30	9,72	19,23	30,84
INPC + 5,67%	1,33	6,33	3,14	4,33	9,78	19,37	31,06
INPC + 5,71%	1,34	6,36	3,15	4,35	9,82	19,46	31,21
INPC + 5,74%	1,34	6,38	3,15	4,37	9,85	19,53	31,32
INPC + 5,77%	1,34	6,40	3,16	4,38	9,88	19,59	31,43
INPC + 5,78%	1,34	6,41	3,16	4,39	9,89	19,62	31,47
INPC + 5,80%	1,35	6,43	3,17	4,40	9,91	19,66	31,54
INPC + 5,81%	1,35	6,43	3,17	4,40	9,92	19,68	31,58
INPC + 5,82%	1,35	6,44	3,17	4,41	9,93	19,71	31,62

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%	1,35	6,45	3,18	4,41	9,94	19,73	31,66
INPC + 5,84%	1,35	6,46	3,18	4,42	9,96	19,75	31,69
INPC + 5,85%	1,35	6,46	3,18	4,42	9,97	19,77	31,73
INPC + 5,86%	1,35	6,47	3,18	4,43	9,98	19,80	31,77
INPC + 5,87%	1,35	6,48	3,19	4,43	9,99	19,82	31,80
INPC + 5,88%	1,35	6,49	3,19	4,44	10,00	19,84	31,84
INPC + 5,89%	1,35	6,49	3,19	4,44	10,01	19,86	31,88
INPC + 6%	1,36	6,58	3,22	4,50	10,12	20,11	32,29