

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos											
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	VAR	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (31/10/2019)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
Renda Fixa											
Artigo 7º I, Alínea a - Títulos do Tesouro Nacional											
TESOURO NACIONAL	TESOURO NACIONAL	NTNB 15/05/2055 IPCA+4.46000%	0,00%	0,00	0,43%	0,33%	3,13%	42.075.132,23	6,38%	0,00	0,00%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a - Títulos do Tesouro Nacional				0,00				42.075.132,23	6,38%		
Artigo 7º I, Alínea b - 4604 - Fundos 100% Títulos Públicos - Referenciado											
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF IRF-M TP	2,15%	0,28	1,68%	-0,01%	11,65%	42.261.799,26	6,41%	5.394.586.843,41	0,78%
BANESTES	BANESTES	BANESTES PREVIDENCIARIO FI RF REF IMA-B	7,21%	0,88	4,85%	1,49%	33,56%	48.901.411,72	7,42%	324.178.386,61	15,08%
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,25%	0,05	0,60%	-0,03%	5,75%	12.736.645,62	1,93%	7.511.019.292,51	0,17%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IMAB TP FI RF LP	4,65%	0,57	3,33%	-0,04%	23,33%	51.816.716,34	7,86%	7.228.652.052,11	0,72%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IRFM 1 TP FI RF	0,24%	0,05	0,61%	-0,02%	5,79%	5.668.584,20	0,86%	11.285.978.738,46	0,05%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP FI RF LP	1,95%	0,25	1,64%	-0,01%	11,89%	120.730.923,61	18,31%	10.184.716.977,20	1,19%
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF	5,09%	0,58	-%	0,00%	-%	6.761.208,00	1,03%	451.112.145,70	1,50%
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2 FI	1,49%	0,20	1,24%	0,01%	9,71%	16.341.624,57	2,48%	7.906.000.337,57	0,21%
BB	BB	BB IMA-B 5 FIC RF PREVIDENCIÁRIO LP	1,95%	0,25	1,64%	-0,01%	11,90%	22.123.123,09	3,36%	4.676.887.165,88	0,47%
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RF TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI	2,42%	0,31	1,64%	1,01%	13,25%	9.757.419,31	1,48%	499.550.689,04	1,95%
BANESTES	BANESTES	FUNDO DE INVESTIMENTO BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS-RENDA FIXA	1,33%	0,18	0,91%	0,28%	9,60%	2.661.059,93	0,40%	160.754.469,66	1,66%
BB	BB	BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII	1,33%	0,18	1,05%	-2,32%	8,98%	2.452.972,61	0,37%	681.504.634,21	0,36%
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF ALOCACAO ATIVA FICFI	2,26%	0,29	1,80%	0,11%	13,06%	58.011.095,11	8,80%	8.931.824.899,36	0,65%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - 4604 - Fundos 100% Títulos Públicos - Referenciado				0,37				400.224.583,37	60,71%		
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Renda Fixa											
BANESTES	BANESTES	FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP	0,36%	0,06	0,31%	65,08%	5,18%	9.364.663,09	1,42%	511.769.798,12	1,83%
BANESTES	BANESTES	FI BANESTES INVESTIDOR CURTO PRAZO	0,02%	0,01	0,21%	43,62%	2,58%	724.869,10	0,11%	510.835.666,59	0,14%
CEF	CEF	CAIXA FI BRASIL RF REF DI LP	0,03%	0,03	0,45%	93,42%	5,02%	8.146.152,99	1,24%	4.756.296.768,69	0,17%
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF IMAB FI	4,63%	0,57	3,34%	-0,02%	23,21%	75.966.973,71	11,52%	1.659.796.243,53	4,58%
BANESTES	BANESTES	FI BANESTES INSTITUCIONAL RF	6,91%	0,84	4,22%	0,85%	31,63%	43.121.438,75	6,54%	347.920.517,62	12,39%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos											
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	VAR	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (31/10/2019)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
BB	BB	BB RPPS RF PERFIL FIC	0,03%	0,03	0,44%	90,99%	5,01%	1.644.153,58	0,25%	2.878.753.759,77	0,06%
BB	BB	BB PREVIDENCIARIO RF FLUXO FC FI	0,02%	0,02	0,38%	79,82%	1,68%	26.619,77	0,00%	1.271.131.291,73	0,00%
BANESTES	BANESTES	BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI	0,07%	0,03	0,37%	76,73%	5,38%	42.568.006,88	6,46%	2.907.811.417,58	1,46%
BANESTES	BANESTES	BANESTES ESTRATEGIA FIC DE FI RF	2,38%	0,31	2,39%	496,79%	16,73%	10.431.705,81	1,58%	148.242.078,71	7,04%
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Renda Fixa				0,44				191.994.583,68	29,12%		
Sub-total Renda Fixa				0,37				634.294.299,28	96,22%		
Renda Variável											
Artigo 8º II, Alínea a - 4604 - Fundos de Ações											
VINCI	CEF	FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	16,56%	1,86	3,46%	1,94%	30,23%	8.408.284,19	1,28%	749.627.403,36	1,12%
CEF	CEF	Caixa FI Ações Institucional BDR Nível I	15,92%	1,74	-1,37%	-3,73%	25,66%	3.894.061,01	0,59%	566.207.012,24	0,69%
BANESTES	BANESTES	BANESTES FIC DE FI ACOES BTG ABSOL. INST	17,36%	1,93	2,34%	0,82%	29,52%	8.891.375,22	1,35%	93.628.596,86	9,50%
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a - 4604 - Fundos de Ações				1,87				21.193.720,42	3,21%		
Artigo 8º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Participações											
RIO BRAVO	CEF	BRASIL ENERGIA RENOVÁVEL - FIP MULTIESTRATÉGIA	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	-2,69%	1.880.601,10	0,29%	257.548.320,79	0,73%
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a - 4604 - Fundos de Participações				0,00				1.880.601,10	0,29%		
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604 - Fundos de Investimentos Imobiliários											
RIO BRAVO	RIO BRAVO	BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO	0,00%	0,00	0,00%	-4,01%	5,65%	1.863.969,59	0,28%	1,05	177.052.119,79%
Sub-total Artigo 8º IV, Alínea b - 4604 - Fundos de Investimentos Imobiliários				0,00				1.863.969,59	0,28%		
Sub-total Renda Variável				1,59				24.938.291,11	3,78%		
Total								659.232.590,39	100%		

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Enquadramento da Carteira					
Artigo	Classe	Valor(R\$)	% Carteira	Politica Investimento	Limite Res. 3.922/10
Renda Fixa					
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	42.075.132,23	6,45%	10,00%	100,00%
Artigo 7º I, Alínea b - 4604	Fundos 100% Títulos Públicos - Referenciado	393.463.375,37	60,30%	55,00%	100,00%
Artigo 7º IV, Alínea a	RF e REFERENCIAL LIVRE	0,01	0,00%	0,00%	30,00%
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604	Fundos de Renda Fixa	191.994.583,68	29,43%	19,00%	40,00%
Total Renda Fixa		627.533.091,29	96,18%		
Renda Variável					
Artigo 8º II, Alínea a - 4604	Fundos de Ações	21.193.720,42	3,25%	3,00%	20,00%
Artigo 8º IV, Alínea a - 4604	Fundos de Participações	1.880.601,10	0,29%	0,50%	5,00%
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604	Fundos de Investimentos Imobiliários	1.863.969,59	0,29%	0,00%	5,00%
Total Renda Variável		24.938.291,11	3,83%		

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)				
Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,43 89,4	8,40 162,5	9,89 159,3	-- --
Artigo 7º I, Alínea b - 4604 % do CDI	0,48 99,9	12,49 241,5	14,45 232,7	25,31 192,2
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604 % do CDI	2,50 518,6	17,30 334,7	19,63 316,0	-- --
Artigo 8º II, Alínea a - 4604 Var. IBOVESPA p.p	2,07 -0,3	28,72 6,7	36,50 13,9	46,60 2,3
Artigo 8º IV, Alínea a - 4604 Var. IBOVESPA p.p	0,00 -2,4	0,00 -22,0	0,00 -22,6	-- --
Artigo 8º IV, Alínea b - 4604 Var. IBOVESPA p.p	0,00 -2,4	5,30 -16,7	9,54 -13,1	-- --

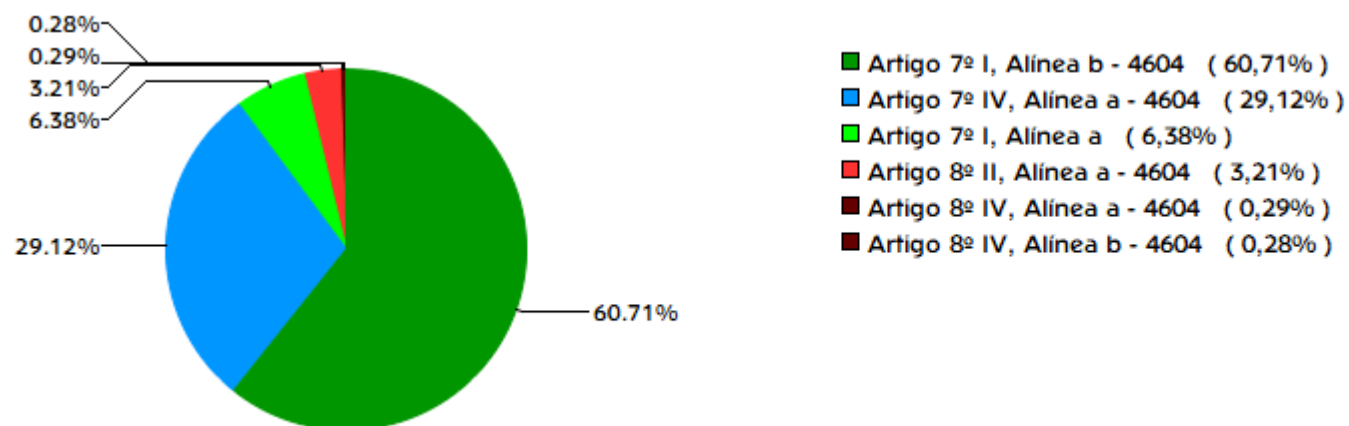
Ganhos Financeiros	
Estratégia	No Mês(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a	180.310,08
Artigo 7º I, Alínea b - 4604	8.644.019,52
Artigo 7º IV, Alínea a - 4604	4.674.211,15
Artigo 8º II, Alínea a - 4604	430.021,40
Total	13.928.562,14

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

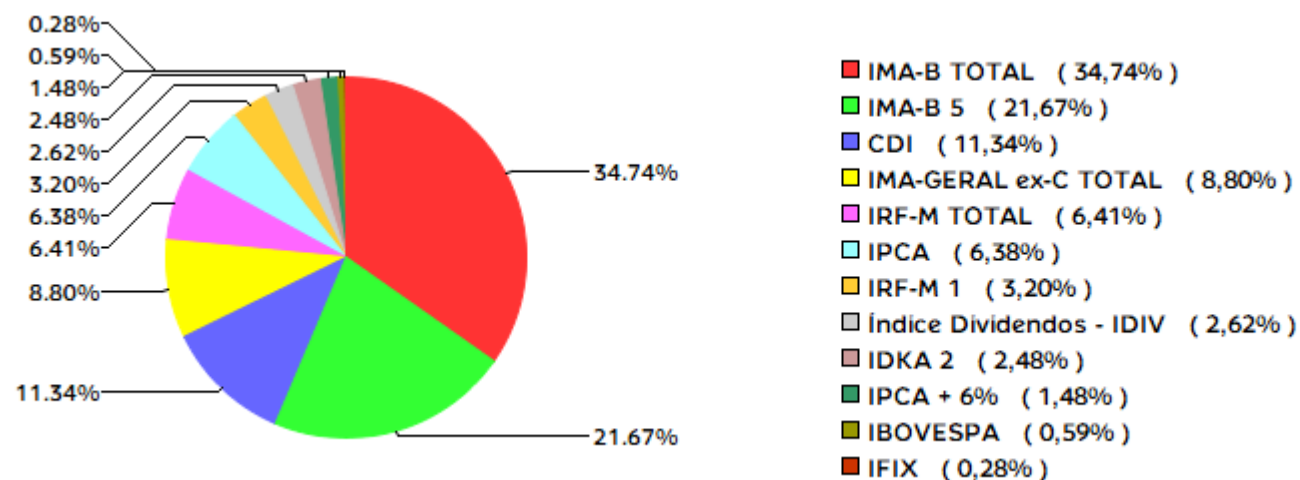
Análise da Disponibilidade Financeira				
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acum. Bruto (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	594.441.287,55	90	594.441.287,55	90
acima de 365 dias	64.791.302,84	10	659.232.590,39	100

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia

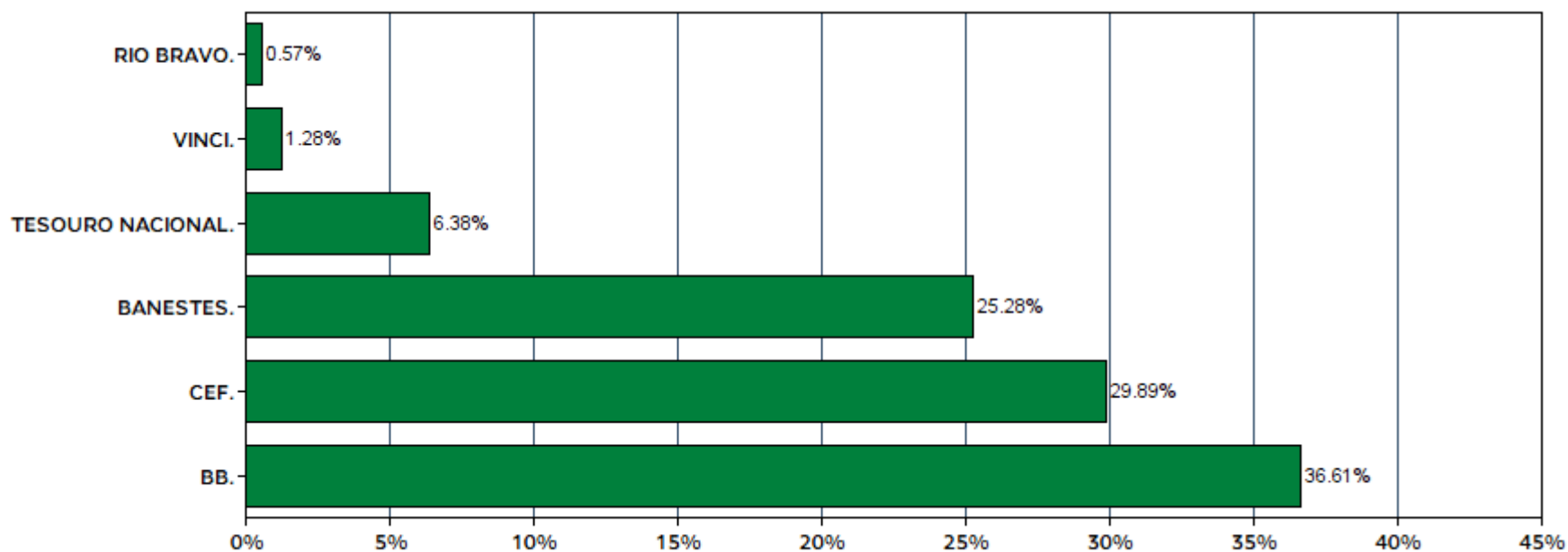


Indexadores



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

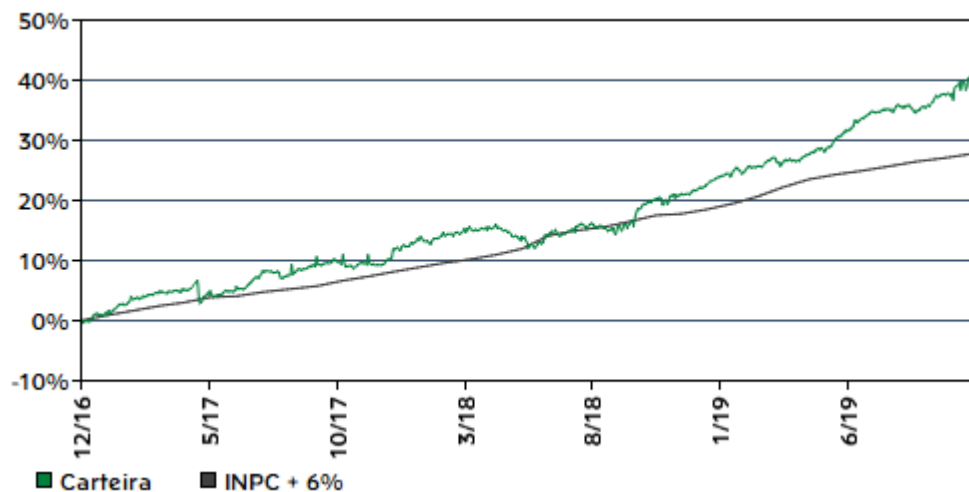
Alocação por Gestor



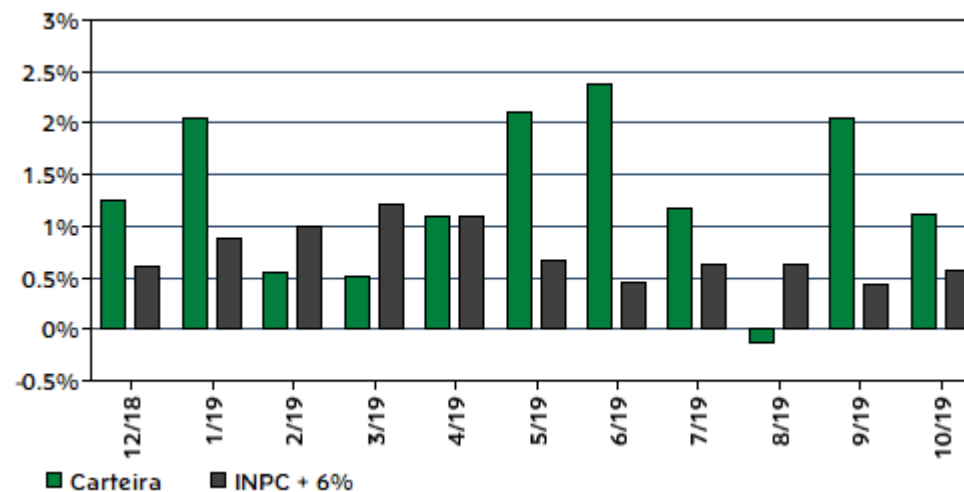
**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Rentabilidades da Carteira													
Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
2017	1,54	2,35	1,09	0,27	-0,39	0,55	2,69	0,89	1,33	0,09	0,10	0,83	11,90
INPC + 6%	0,93	0,66	0,85	0,50	0,87	0,19	0,66	0,50	0,44	0,86	0,64	0,72	8,12
p.p. Indx	0,61	1,69	0,24	-0,22	-1,26	0,36	2,04	0,39	0,89	-0,77	-0,55	0,10	3,78
2018	1,75	0,64	1,04	0,29	-1,93	0,01	1,56	-0,20	0,56	3,57	0,63	1,25	9,46
INPC + 6%	0,74	0,60	0,56	0,70	0,92	1,92	0,76	0,53	0,74	0,91	0,21	0,60	9,59
p.p. Indx	1,01	0,04	0,49	-0,41	-2,84	-1,92	0,80	-0,74	-0,19	2,65	0,42	0,65	-0,13
2019	2,04	0,56	0,52	1,09	2,10	2,37	1,17	-0,12	2,05	1,11	--	--	13,63
INPC + 6%	0,87	1,01	1,21	1,09	0,66	0,45	0,63	0,63	0,44	0,57	--	--	7,83
p.p. Indx	1,17	-0,45	-0,70	0,00	1,44	1,92	0,54	-0,75	1,61	0,54	--	--	5,80

**Evolução da Rentabilidade**



**Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses**





**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**
**Análise de Risco / Retorno da Carteira**

	Qtd.	Perct.
Meses acima do Benchmark	22	64,7%
Meses abaixo do Benchmark	12	35,3%

	Rentab.	Mês
Maior rentabilidade da Carteira	3,57%	out/18
Menor rentabilidade da Carteira	-1,93%	mai/18

Período	Rentabilidade (%)			Volat. Anual
	Carteira	INPC + 6%	p.p. Indx.	
03 meses	3,05	1,65	1,4	5,983
06 meses	8,98	3,43	5,5	4,501
12 meses	15,78	8,71	7,1	3,962
24 meses	25,53	19,79	5,7	4,677
36 meses	--	--	--	--
Desde o início	39,18	27,76	11,4	4,879

**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
NTNB 15/05/2055 IPCA+4.46000% % do Var. IPCA p.p.	0,43 0,33	3,13 2,57	1,37 1,20	3,03 2,53	-- --	-- --	-- --
BB IMA-B 5 FIC RF PREVIDENCIÁRIO LP % do Var. IMA-B 5 p.p.	1,64 -0,01	11,90 -0,19	3,43 -0,05	7,66 -0,09	13,56 -0,22	23,88 -0,49	40,35 -0,77
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA TÍTULOS PÚBLICOS VII % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	1,05 -2,32	8,98 -14,58	2,32 -3,58	5,19 -10,15	10,43 -16,31	20,61 -19,17	36,50 -23,68
BANESTES PREVIDENCIARIO FI RF REF IMA-B % do Var. 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	72,27 12,09
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,60 -0,03	5,75 -0,22	1,75 -0,08	3,71 -0,14	6,87 -0,27	14,19 -0,51	27,91 -0,90
BB PREVIDENCIARIO RF ALOCACAO ATIVA FICFI % do Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	1,80 0,11	13,06 0,66	3,41 0,06	8,88 0,58	15,25 0,63	25,21 0,71	41,83 -0,26
BB PREVIDENCIARIO RF IDKA 2 FI % do Var. IDKA 2 p.p.	1,24 0,01	9,71 -0,77	2,72 -0,21	5,87 -0,83	11,17 -0,89	21,20 -1,78	37,09 -3,23
BB PREVIDENCIARIO RF IRF-M TP % do Var. IRF-M TOTAL p.p.	1,68 -0,01	11,65 -0,21	3,37 -0,06	8,58 -0,12	14,44 -0,25	25,00 -0,51	44,78 -1,00

**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 TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI % do Var. IPCA + 6% p.p.	1,64 1,01	13,25 5,50	3,55 1,84	8,32 4,75	15,44 6,76	26,44 6,03	44,97 13,92
CAIXA FI BRASIL IMA B 5 TP FI RF LP % do Var. IMA-B 5 p.p.	1,64 -0,01	11,89 -0,20	3,42 -0,05	7,63 -0,11	13,58 -0,20	23,88 -0,48	40,32 -0,80
CAIXA FI BRASIL IMAB TP FI RF LP % do Var. 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
CAIXA FI BRASIL IRFM 1 TP FI RF % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,61 -0,02	5,79 -0,17	1,77 -0,06	3,74 -0,11	6,93 -0,20	14,31 -0,40	28,12 -0,68
FI CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS RF % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,53 -0,74	17,10 -6,35	-- --	-- --	-- --	-- --	-- --
FUNDO DE INVESTIMENTO BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS-RENDA FIXA % do Var. IRF-M 1 p.p.	0,91 0,28	9,60 3,64	2,38 0,56	7,15 3,30	11,27 4,14	20,14 5,43	35,55 6,74
FI BANESTES INVESTIDOR CURTO PRAZO % do % do CDI	0,21 43,62	2,58 49,92	0,67 46,20	1,51 49,06	3,11 50,07	6,69 50,79	15,11 58,70
BANESTES ESTRATEGIA FIC DE FI RF % do % do CDI	2,39 496,79	16,73 323,53	5,14 352,91	11,55 376,54	18,59 299,37	-- --	-- --
BANESTES LIQUIDEZ REFERENCIADO DI % do % do CDI	0,37 76,73	5,38 104,04	1,37 93,98	3,08 100,23	6,49 104,53	14,01 106,40	27,60 107,22
BB PREVIDENCIÁRIO RF FLUXO FC FI % do % do CDI	0,38 79,82	4,21 81,51	1,17 80,14	2,49 81,16	5,06 81,53	10,74 81,59	21,89 85,06
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMAB FI % do Var. IMA-B TOTAL p.p.	3,34 -0,02	23,21 -0,35	5,82 -0,07	15,13 -0,21	26,34 -0,40	39,12 -0,67	59,39 -0,79
BB RPPS RF PERFIL FIC % do % do CDI	0,44 90,99	5,01 96,90	1,39 95,21	2,95 96,23	6,02 96,88	12,94 98,30	25,61 99,53
CAIXA FI BRASIL RF REF DI LP % do % do CDI	0,45 93,42	5,02 97,11	1,39 95,51	2,96 96,52	6,04 97,22	12,77 96,98	25,31 98,36
FI BANESTES INSTITUCIONAL RF % do Var. 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
FI BANESTES VIP DI REFERENCIADO LP % do % do CDI	0,31 65,08	5,18 100,23	1,56 106,94	3,10 101,05	6,18 99,56	12,96 98,39	25,88 100,54

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Análise dos Fundos &amp; Ativos da Carteira

## Rentabilidades em Períodos Fechados (%)

Fundo / Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
BANESTES FIC DE FI ACOES BTG ABSOL. INST % do Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	2,34 0,82	29,52 --	5,61 -0,13	19,62 4,05	37,91 -1,32	60,76 14,29	78,00 -3,60
Caixa FI Ações Institucional BDR Nível I % do Var. IBOVESPA p.p.	-1,37 -3,73	25,66 3,66	7,35 2,04	5,38 -5,89	21,38 -1,26	46,93 2,64	82,18 17,04
FIC DE FI EM AÇÕES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS % do Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	3,46 1,94	30,23 --	6,48 0,73	13,96 -1,61	41,82 2,59	47,05 0,58	61,29 -20,31
BRASIL ENERGIA RENOVÁVEL - FIP MULTISTRATÉGIA % do % do CDI	0,00 0,00	-2,69 -52,09	0,00 0,00	-2,37 -77,16	-2,52 -40,60	-- --	15,96 62,01
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO % do Var. IFIX p.p.	0,00 -4,01	5,65 -13,07	0,00 -4,98	3,58 -7,72	9,05 -15,46	5,71 -19,71	-2,94 -51,05
CDI	0,48	5,17	1,46	3,07	6,21	13,17	25,74
IBOVESPA	2,36	22,00	5,31	11,28	22,64	44,29	65,15
DOLAR COMERCIAL	-3,85	3,34	6,35	1,49	7,70	22,19	25,87
INPC + 6%	0,57	7,83	1,65	3,43	8,71	19,79	29,27
IPCA + 6%	0,63	7,75	1,71	3,57	8,69	20,40	31,04