

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Posição de Ativos e Enquadramento

 RENDA FIXA 91,81%

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150545	21,14	2,79	-7,33	9.449.552,60	3,80
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea a</b>		<b>21,14</b>	<b>2,79</b>	<b>-7,33</b>	<b>9.449.552,60</b>	<b>3,80</b>

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF IRF-M	5,84	0,77	4,68	28.174.640,58	11,34	5.220.862.294,67	0,54
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA INFLACAO 5 FIC	4,92	1,07	3,10	19.821.609,48	7,98	1.349.967.643,25	1,47
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	12,35	2,00	-1,78	11.092.601,66	4,46	362.047.246,48	3,06
BB	BB	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,53	0,26	2,45	142.549,49	0,06	7.792.694.548,07	0,00
BB	BB	BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI	12,40	2,02	-1,75	37.675.810,62	15,16	5.526.503.185,82	0,68
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	12,40	2,02	-1,84	40.947.037,39	16,47	753.868.354,78	5,43
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	12,47	2,03	-1,88	47.197.582,94	18,99	5.979.262.081,07	0,79
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP	4,95	1,10	3,04	28.236.391,34	11,36	8.746.335.681,60	0,32
BB	BB	BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI	19,05	2,80	-5,38	5.446.519,61	2,19	1.945.603.761,59	0,28
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>9,96</b>	<b>1,67</b>	<b>-0,11</b>	<b>218.734.743,11</b>	<b>88,01</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>10,41</b>	<b>1,71</b>	<b>-0,44</b>	<b>228.184.295,71</b>	<b>91,81</b>		

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS**

**8,19%**

Artigo 8º I, Alínea a (Fundos de Ações Referenciados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	43,93	8,89	-17,46	15.677.421,17	6,31	828.382.101,16	1,89
<b>Sub-total Artigo 8º I, Alínea a</b>			<b>43,93</b>	<b>8,89</b>	<b>-17,46</b>	<b>15.677.421,17</b>	<b>6,31</b>		

Artigo 8º II, Alínea a (Fundos de Ações )

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BEM	BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS	42,99	8,50	-18,51	4.680.081,18	1,88	1.989.712.475,16	0,24
<b>Sub-total Artigo 8º II, Alínea a</b>			<b>42,99</b>	<b>8,50</b>	<b>-18,51</b>	<b>4.680.081,18</b>	<b>1,88</b>		

<b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>			<b>48,02</b>	<b>8,76</b>	<b>-17,82</b>	<b>20.357.502,35</b>	<b>8,19</b>		
<b>Total</b>						<b>248.541.798,06</b>	<b>100,00</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			
				Mínimo	Objetivo	Máximo	Limite Legal
<b>Renda Fixa</b>							
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	9.449.552,60	3,80	0,00	5,00	100,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	218.734.743,11	88,01	0,00	80,00	100,00	100,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>228.184.295,71</b>	<b>91,81</b>				
<b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	15.677.421,17	6,31	0,00	5,00	30,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	4.680.081,18	1,88	0,00	5,00	20,00	20,00
	<b>Total Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>	<b>20.357.502,35</b>	<b>8,19</b>				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

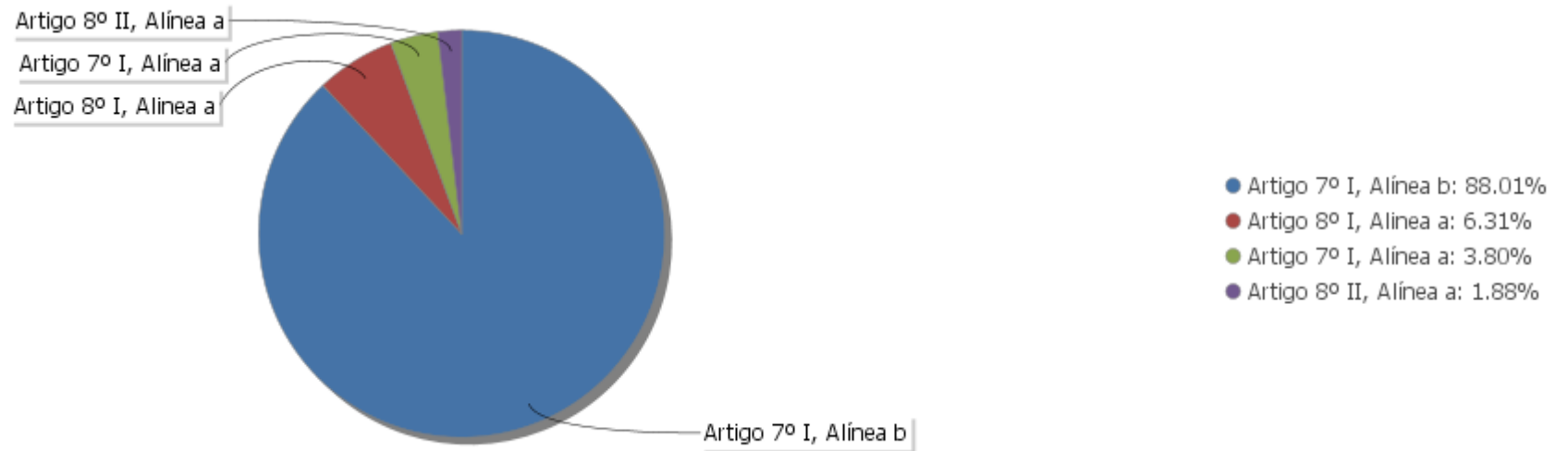
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	2,79 1.312,19	-7,33 -417,99	5,59 761,25	-7,33 -417,99	-1,91 -41,39	256.141,15	-778.035,91
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	1,67 784,70	-0,11 -6,49	4,42 602,08	-0,11 -6,49	5,94 128,98	3.596.396,97	-223.292,12
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	8,89 0,14	-17,46 0,34	30,78 0,60	-17,46 0,34		1.166.677,56	-1.560.052,09
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	8,50 -0,26	-18,51 -1,46	31,97 1,79			366.657,34	-569.940,08
						5.385.873,02	-3.131.320,20

Análise de Liquidez

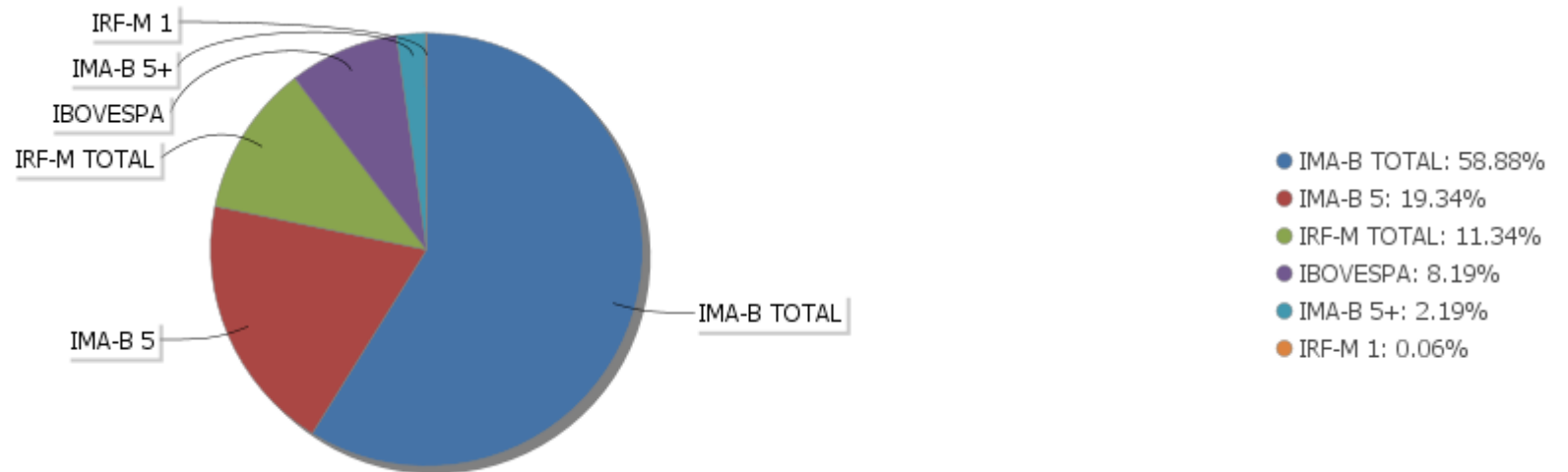
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	239.092.245,46	96,20	239.092.245,46	96,20
de 31 a 364 dias	0,00	0,00	239.092.245,46	96,20
acima de 365 dias	9.449.552,60	3,80	248.541.798,06	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

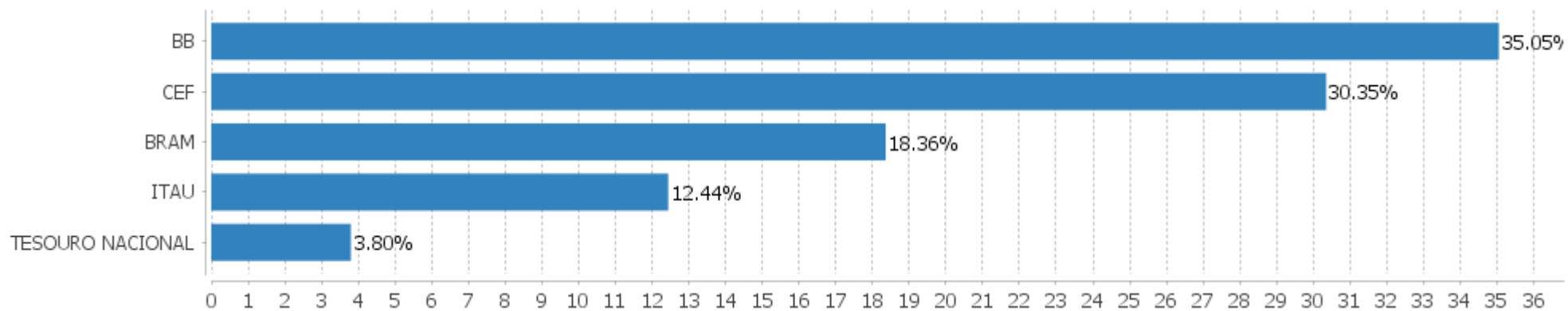


Alocação Por Estratégia



## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Alocação por Gestor



**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial**

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
2020	0,26	-0,04	-7,15	1,74	1,95	2,22							-1,34
IPCA + 5,87%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74							2,92
p.p. indexador	-0,45	-0,70	-7,72	1,60	1,88	1,48							-4,27
2019	3,29	0,47	0,58	1,25	2,87	3,03	1,18	-0,30	2,52	2,94	-2,03	1,93	19,09
IPCA + 6%	0,83	0,90	1,19	1,06	0,64	0,45	0,72	0,62	0,45	0,63	0,98	1,64	10,59
p.p. indexador	2,46	-0,43	-0,62	0,19	2,23	2,58	0,46	-0,92	2,07	2,30	-3,01	0,29	8,50
2018	2,70	0,63	1,00	0,02	-2,62	-0,18	1,98	-0,44	0,21	5,62	0,80	1,47	11,54
IPCA + 6%	0,80	0,74	0,58	0,71	0,89	1,75	0,84	0,44	0,92	0,96	0,25	0,61	9,92
p.p. indexador	1,90	-0,11	0,42	-0,69	-3,50	-1,93	1,14	-0,88	-0,71	4,66	0,55	0,86	1,62

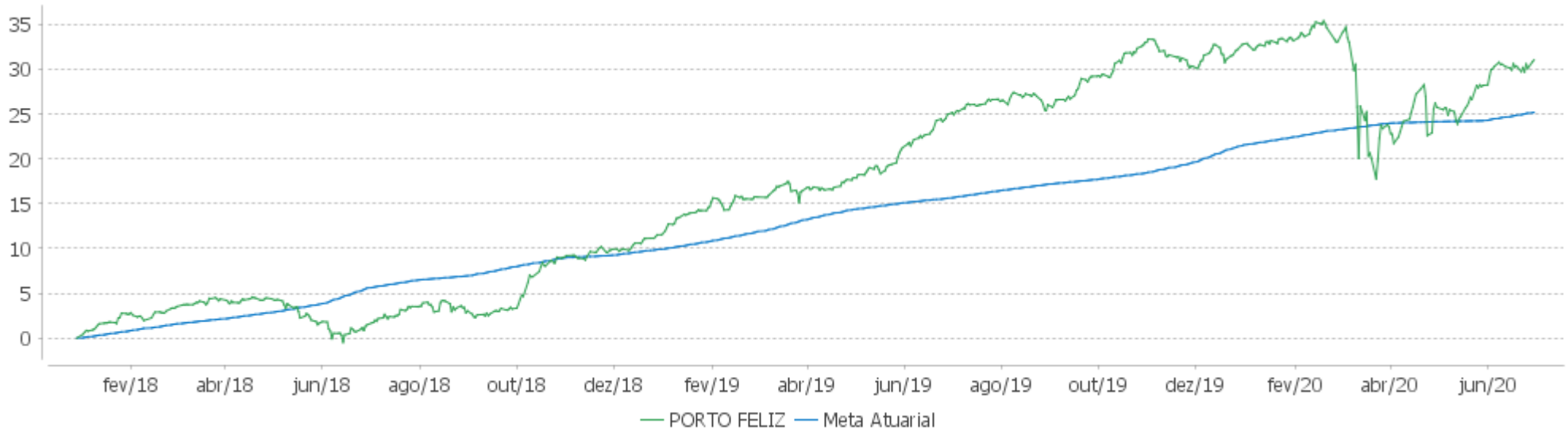
**PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL**

**RELATÓRIO TRIMESTRAL**

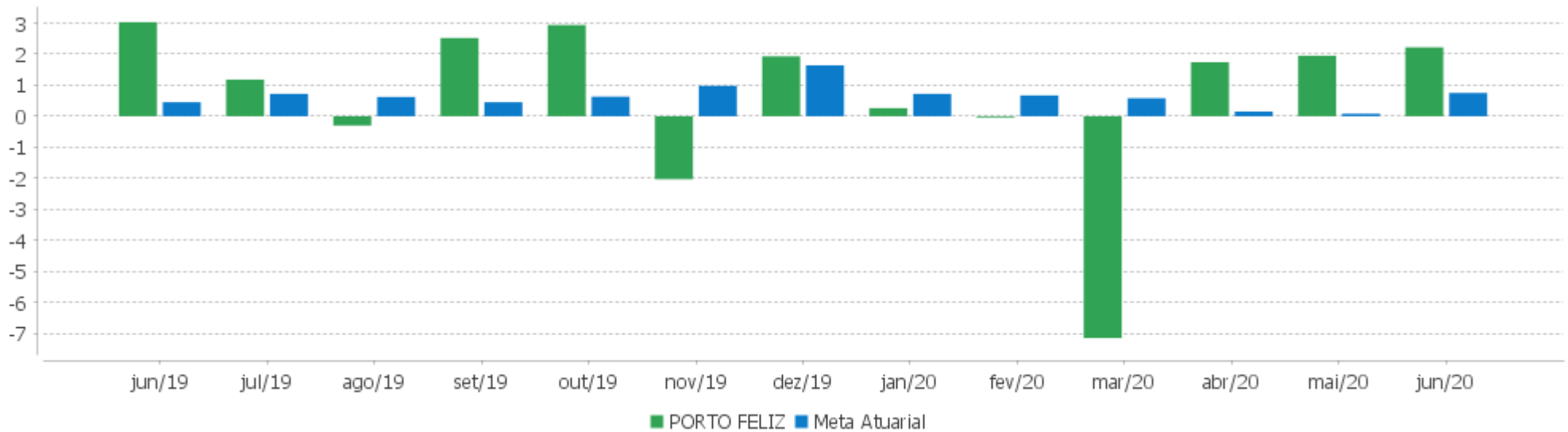
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	17	56,67	03 meses	6,03	0,95	5,08	11,03
Meses abaixo da Meta Atuarial	13	43,33	06 meses	-1,34	2,92	-4,27	16,36
			12 meses	4,89	8,22	-3,33	11,72
			24 meses	29,14	18,49	10,65	8,86
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	5,62	2018-10					
Menor rentabilidade da Carteira	-7,15	2020-03	Desde 29/12/2017	31,05	25,11	5,94	8,16

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses





## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,00 -0,05	-1,78 -0,12	4,84 -0,12	-1,78 -0,12	4,69 -0,25	34,14 -0,99	44,48 -1,73
FI CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. 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
FI CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS RF LP Var. IMA-B 5 p.p.	1,10 -0,02	3,04 -0,13	3,71 -0,06	3,04 -0,13	8,51 -0,30	24,21 -0,55	35,98 -0,92
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA INFLACAO 5 FIC Var. IMA-B 5 p.p.	1,07 -0,05	3,10 -0,07	3,68 -0,08	3,10 -0,07	8,64 -0,18	24,11 -0,65	35,63 -1,27
BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI Var. IRF-M 1 p.p.	0,26 -0,03	2,45 -0,14	1,06 -0,09	2,45 -0,14	5,71 -0,30	13,15 -0,52	21,70 -0,85
BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,77 -0,01	4,68 -0,18	3,26 -0,13	4,68 -0,18	9,51 -0,30	26,49 -0,59	37,50 -0,94
BB PREV RF IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. 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
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,02 -0,02	-1,84 -0,18	4,86 -0,10	-1,84 -0,18	4,59 -0,36	34,19 -0,94	44,70 -1,50
BB PREV RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI Var. 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	42,80 -0,75	51,23 -1,10
NTN-B 150545 Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,79 0,74	-7,33 -5,67	5,59 0,63	-7,33 -5,67	0,13 -4,82	42,49 7,36	51,24 5,04
BRADESCO FI EM ACOES MID SMALL CAPS Var. IBOVESPA p.p.	8,50 -0,26	-15,58 2,22	31,97 1,79	-15,58 2,22	6,25 12,11	52,81 22,17	84,44 33,32
BB AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. IBOVESPA p.p.	8,89 0,14	-17,46 0,34	30,78 0,60	-17,46 0,34	-3,93 1,92	35,59 4,96	49,22 -1,90
CDI	0,21	1,75	0,73	1,75	4,60	11,21	19,39
IBOVESPA	8,76	-17,80	30,18	-17,80	-5,85	30,64	51,12
INPC + 6%	0,79	3,25	1,24	3,25	8,51	18,75	30,23
IPCA + 6%	0,75	2,99	0,98	2,99	8,29	18,56	31,11

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Indexadores

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
<b>Renda Fixa</b>							
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
IRF-M TOTAL	0,79	4,86	3,39	4,86	9,81	27,08	38,44
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-B TOTAL	2,05	-1,66	4,96	-1,66	4,95	35,13	46,21
IMA-C TOTAL	3,74	7,46	7,95	7,46	13,21	41,24	63,14
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,90	1,71	2,74	1,71	6,32	22,95	33,11
IMA-GERAL TOTAL	0,99	1,87	2,89	1,87	6,52	23,45	33,90
IDKA 2	0,99	3,35	3,35	3,35	8,77	23,17	35,46
IDKA 20	4,18	-12,33	6,49	-12,33	-4,69	58,14	62,45
CDI	0,21	1,75	0,73	1,75	4,60	11,21	19,39
<b>Renda Variável</b>							
IBOVESPA	8,76	-17,80	30,18	-17,80	-5,85	30,64	51,12
IBRX 100	8,97	-17,39	30,39	-17,39	-4,66	34,21	53,90
IBRX 50	9,33	-17,76	31,79	-17,76	-6,93	27,59	47,47
SMALL CAP	14,43	-20,73	32,49	-20,73	5,15	49,01	69,83
IFIX	5,59	-12,24	12,52	-12,24	6,86	32,05	35,30
Índice Consumo - ICON	10,08	-10,90	39,45	-10,90	13,99	52,93	55,22
Índice Dividendos - IDIV	8,95	-18,38	18,70	-18,38	-0,15	47,52	60,57
<b>Indicadores Econômicos</b>							
IPCA	0,26	0,10	-0,43	0,10	2,13	5,57	10,21
INPC	0,30	0,36	-0,18	0,36	2,35	5,74	9,47
IGPM	1,56	4,39	2,66	4,39	7,31	14,30	22,21
SELIC	0,21	1,75	0,73	1,75	4,60	11,21	19,40
<b>Meta Atuarial</b>							

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Movimentações

APR	Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
27	02/06/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	270.000,00	0,00	100.284,32466800	2,6923449990
28	05/06/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	148.000,00	0,00	54.946,23081300	2,6935423560
26	12/06/2020	BB AÇÕES GOVERNANÇA FI	2.011.000,00	0,00	813.711,17393000	2,4713928780
29	19/06/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	125.000,00	0,00	46.349,51572000	2,6968998070
30	25/06/2020	BB PREV RF IRF-M1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC FI	0,00	1.310.000,00	485.632,41450800	2,6975135120