

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Posição de Ativos e Enquadramento

**RENDA FIXA** **99,26%**

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	8,93	3,95	29,45	10.335.697,17	4,41
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea a</b>		<b>8,93</b>	<b>3,95</b>	<b>29,45</b>	<b>10.335.697,17</b>	<b>4,41</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	2,49	1,42	9,80	29.359.978,79	12,52	5.223.400.089,37	0,56
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA INFLACAO 5 FIC	2,12	1,72	10,05	18.743.415,02	7,99	1.688.093.462,96	1,11
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	5,18	2,83	19,24	10.986.905,34	4,68	441.114.063,68	2,49
BB	BB	BB PREVID RF IRF-M1	0,30	0,62	5,12	946,53	0,00	7.803.027.907,11	0,00
BB	BB	BB PREV IMAB TPB	5,19	2,85	19,32	37.189.077,49	15,86	6.210.669.016,03	0,60
BRADERSCO	BRADERSCO	BRADERSCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB	5,19	2,83	19,23	40.589.267,69	17,31	778.660.441,80	5,21
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	5,20	2,85	19,37	46.834.733,90	19,97	11.475.861.578,54	0,41
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	2,14	1,72	10,08	26.729.511,15	11,40	10.040.403.127,50	0,27
BB	BB	BB PREV IMA-B5+	7,72	3,71	26,14	12.010.831,79	5,12	2.952.067.514,60	0,41
<b>Sub-total Artigo 7º I, Alínea b</b>			<b>3,64</b>	<b>2,46</b>	<b>15,27</b>	<b>222.444.667,70</b>	<b>94,85</b>		
<b>Renda Fixa</b>			<b>3,82</b>	<b>2,52</b>	<b>15,44</b>	<b>232.780.364,87</b>	<b>99,26</b>		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

0,74%

Artigo 8º I, Alinea 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 PREV ACOES GV	20,00	1,19	1,19	1.737.431,72	0,74	575.197.683,84	0,30
<b>Sub-total Artigo 8º I, Alinea a</b>			<b>20,00</b>	<b>1,19</b>	<b>1,19</b>	<b>1.737.431,72</b>	<b>0,74</b>		
Renda Variável e Investimentos Estruturados			8,42	1,19	1,19	1.737.431,72	0,74		
<b>Total</b>						<b>234.517.796,59</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	10.335.697,17	4,41	0,00	10,00	100,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	222.444.667,70	94,85	0,00	90,00	100,00	100,00
	<b>Total Renda Fixa</b>	<b>232.780.364,87</b>	<b>99,26</b>				
<b>Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	1.737.431,72	0,74				30,00
	<b>Total Renda Variável e Investimentos Estruturados</b>	<b>1.737.431,72</b>	<b>0,74</b>				

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Rentabilidades por Artigo**

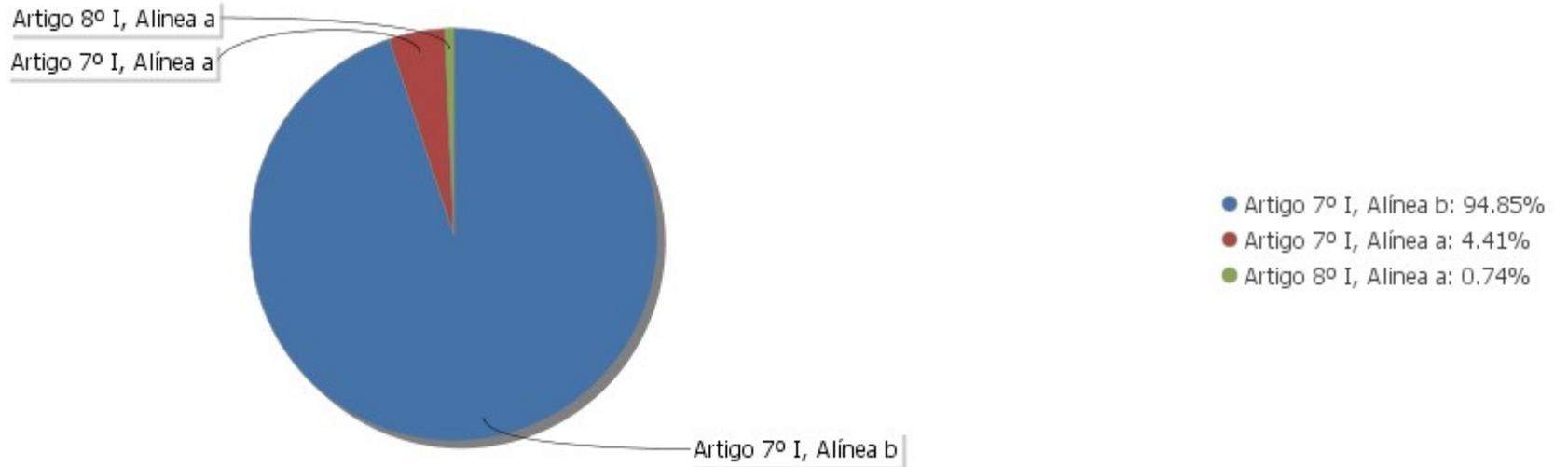
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	3,95 852,80	29,45 631,62	4,74 307,44	19,33 623,06		393.217,75	2.376.375,01
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	2,46 530,33	15,27 327,53	3,36 218,30	10,63 342,44		5.363.845,73	29.148.959,74
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	1,19 -0,07	1,19 -0,07				20.431,72	20.431,72
						5.777.495,20	31.545.766,47

**Análise de Liquidez**

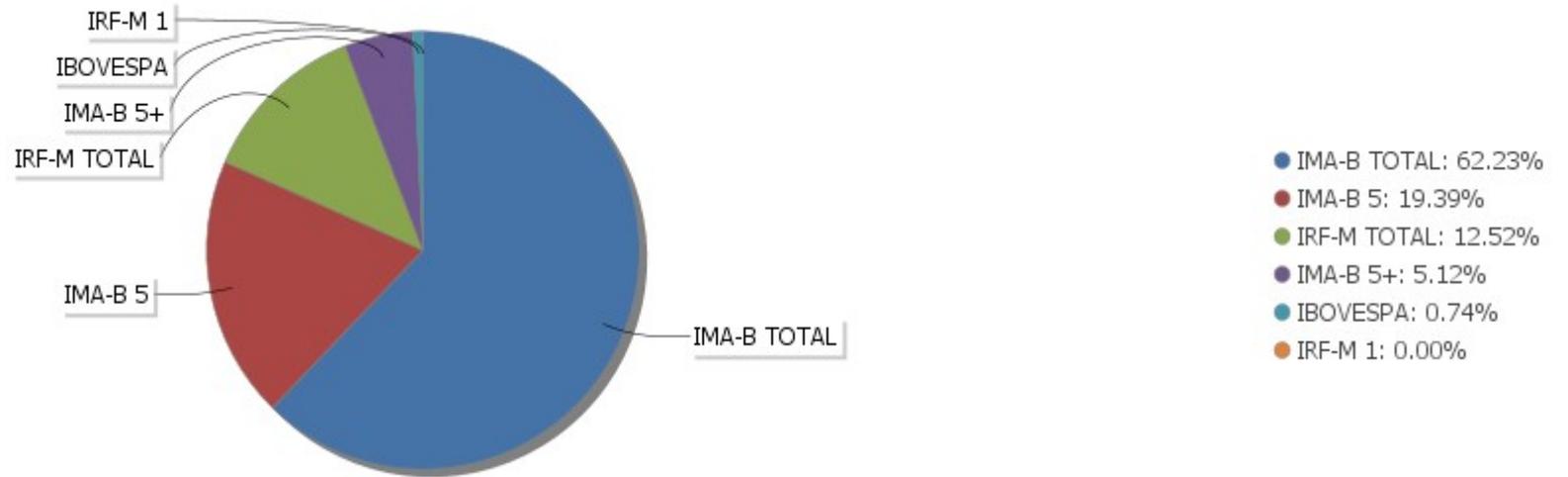
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	224.182.099,42	95,59	224.182.099,42	95,59
de 31 a 364 dias	0,00	0,00	224.182.099,42	95,59
acima de 365 dias	10.335.697,17	4,41	234.517.796,59	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

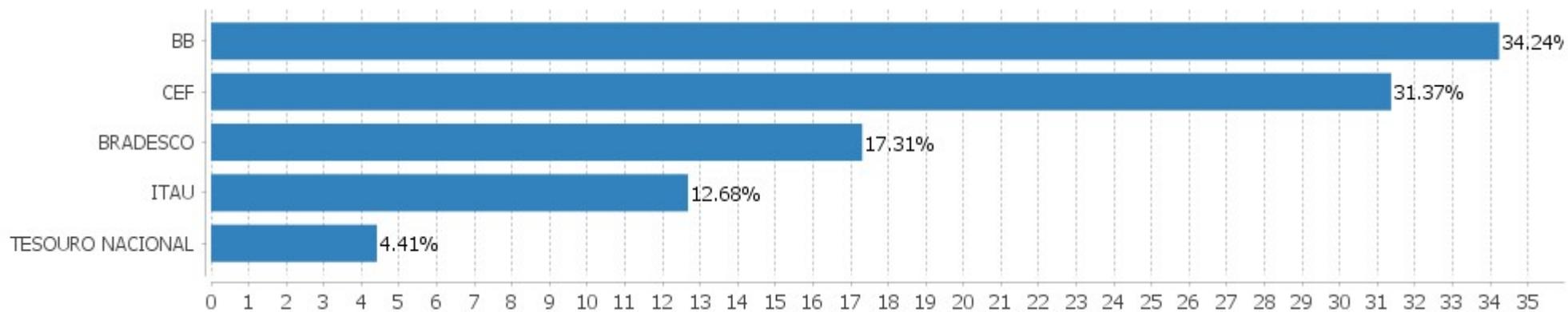


Alocação Por Estratégia



## 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
2019	3,29	0,47	0,58	1,25	2,87	3,03	1,18	-0,30	2,52				15,84
IPCA + 6%	0,83	0,90	1,19	1,06	0,64	0,45	0,72	0,62	0,45				7,07
p.p. indexador	2,46	-0,43	-0,62	0,19	2,23	2,58	0,46	-0,92	2,07				8,77
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**

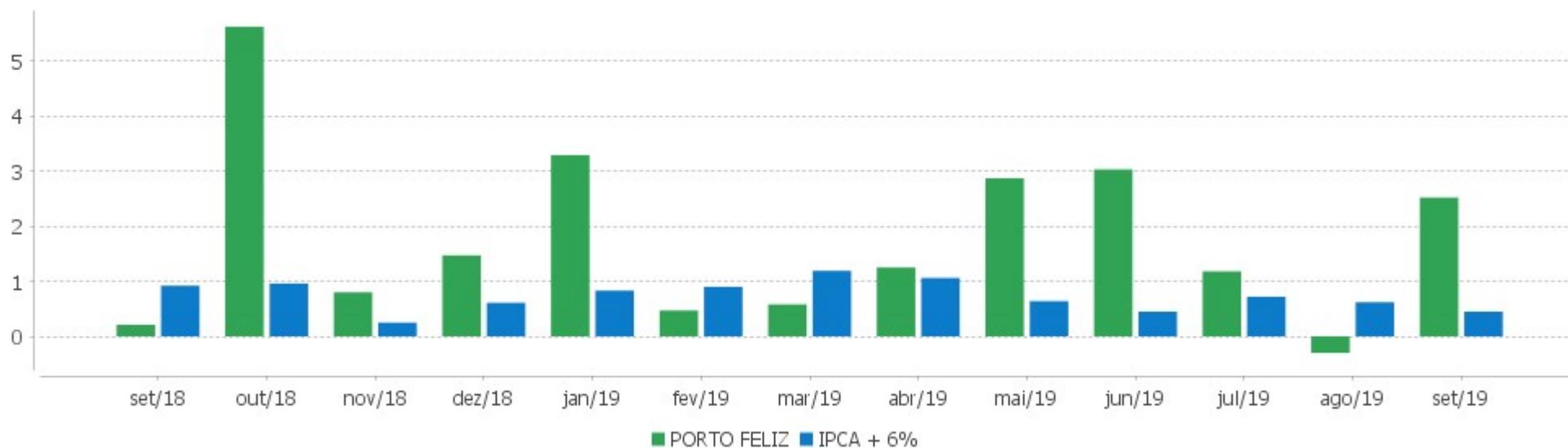
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	IPCA + 6%	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	12	57,14	03 meses	3,42	1,80	1,62	3,51
Meses abaixo da Meta Atuarial	9	42,86	06 meses	10,98	4,01	6,98	3,47
			12 meses	25,15	9,04	16,11	4,06
			24 meses				
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	5,62	2018-10					
Menor rentabilidade da Carteira	-2,62	2018-05	Desde 29/12/2017	29,22	17,69	11,52	4,19

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.	2,83 -0,03	19,24 -0,31	3,70 -0,07	13,12 -0,14	30,80 -0,57	33,53 -1,19	53,86 -2,10
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,85 -0,01	19,37 -0,18	3,72 -0,05	13,12 -0,15	31,16 -0,21	34,16 -0,56	55,13 -0,83
FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO Var. IMA-B 5 p.p.	1,72 -0,02	10,08 -0,19	2,72 -0,06	7,04 -0,13	15,21 -0,19	22,44 -0,49	38,69 -0,78
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA INFLACAO 5 FIC Var. IMA-B 5 p.p.	1,72 -0,02	10,05 -0,22	2,73 -0,05	7,05 -0,12	15,04 -0,35	22,06 -0,87	37,95 -1,53
BB PREVID RF IRF-M1 Var. IRF-M 1 p.p.	0,62 -0,02	5,12 -0,19	1,85 -0,07	3,60 -0,12	7,22 -0,22	14,20 -0,49	28,34 -0,87
BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	1,42 -0,02	9,80 -0,19	2,75 -0,06	7,41 -0,12	16,58 -0,25	23,02 -0,51	44,13 -0,96
BB PREV IMAB TPB Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,85 -0,01	19,32 -0,22	3,72 -0,04	13,15 -0,12	31,00 -0,37	34,05 -0,68	54,78 -1,19
BRÁDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TITULOS PUB Var. IMA-B TOTAL p.p.	2,83 -0,03	19,23 -0,32	3,68 -0,09	13,05 -0,21	30,90 -0,47	33,78 -0,94	54,22 -1,74
BB PREV IMA-B5+ Var. IMA-B 5+ p.p.	3,71 -0,02	26,14 -0,41	4,42 -0,06	17,32 -0,22	44,24 -0,60	42,79 -0,87	66,55 -1,96
NTN-B 150545 Var. IMA-B TOTAL p.p.	3,95 1,09	29,45 9,90	4,74 0,97	19,33 6,07	46,58 15,21	44,10 9,37	70,44 14,48
BB PREV ACOES GV Var. IBOVESPA p.p.	3,03 -0,54	19,92 0,74	4,24 0,49	10,82 1,04	36,11 4,09	38,02 -2,97	77,04 -2,42
CDI	0,46	4,66	1,54	3,10	6,27	13,34	26,41
IBOVESPA	3,57	19,18	3,74	9,78	32,02	40,99	79,46
INPC + 6%	0,44	7,21	1,71	3,96	9,07	20,13	29,35
IPCA + 6%	0,45	7,07	1,80	4,01	9,04	20,73	31,16

**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	0,64	5,31	1,92	3,72	7,44	14,70	29,21
IRF-M 1+	1,87	11,89	3,27	9,07	20,81	27,25	51,71
IRF-M TOTAL	1,44	9,99	2,81	7,53	16,83	23,54	45,09
IMA-B 5	1,74	10,27	2,78	7,17	15,40	22,93	39,47
IMA-B 5+	3,73	26,55	4,48	17,54	44,85	43,66	68,51
IMA-B TOTAL	2,86	19,55	3,77	13,27	31,37	34,72	55,96
IMA-C TOTAL	1,74	17,25	3,44	11,52	23,71	39,55	50,80
IMA-GERAL ex-C TOTAL	1,46	10,53	2,59	7,40	16,57	22,60	41,10
IMA-GERAL TOTAL	1,46	10,72	2,61	7,52	16,78	23,07	41,30
IDKA 2	1,60	9,13	2,72	6,49	12,85	22,46	39,19
IDKA 20	4,78	39,62	5,22	24,54	72,09	60,71	94,10
CDI	0,46	4,66	1,54	3,10	6,27	13,34	26,41
<b>Renda Variável</b>							
IBOVESPA	3,57	19,18	3,74	9,78	32,02	40,99	79,46
IBRX 100	3,21	20,50	4,25	10,92	34,84	42,73	81,88
IBRX 50	3,69	17,61	3,06	8,52	29,03	38,44	75,75
SMALL CAP	2,08	30,58	9,49	21,44	57,29	45,27	105,52
IFIX	1,04	14,15	2,21	8,11	25,74	20,86	47,81
Índice Consumo - ICON	2,64	42,35	17,30	33,49	54,64	29,25	55,37
Índice Dividendos - IDIV	1,89	27,02	7,04	17,36	52,83	44,68	105,47
<b>Indicadores Econômicos</b>							
IPCA	-0,04	2,49	0,26	0,97	2,89	7,55	10,28
INPC	-0,05	2,63	0,17	0,93	2,92	7,01	8,76
IGPM	-0,01	4,10	-0,28	1,90	3,38	13,77	12,11
SELIC	0,46	4,66	1,54	3,10	6,27	13,35	26,43
<b>Meta Atuarial</b>							
IPCA + 4%	0,29	5,55	1,30	3,00	6,99	16,25	23,93

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

IPCA + 5%	0,37	6,31	1,55	3,51	8,02	18,48	27,51
IPCA + 6%	0,45	7,07	1,80	4,01	9,04	20,73	31,16
INPC + 4%	0,28	5,69	1,20	2,96	7,02	15,67	22,22
INPC + 6%	0,44	7,21	1,71	3,96	9,07	20,13	29,35

## EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

## Movimentações

Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
06/09/2019	BB PREVID RF IRF-M1	50.000,00	0,00	19.323,51431000	2,5875210000
11/09/2019	BB PREV ACOES GV	1.717.000,00	0,00	630.694,54267800	2,7223955240
23/09/2019	BB PREVID RF IRF-M1	0,00	1.084.000,00	417.464,27327200	2,5966293870
24/09/2019	BB PREV RF IRF-M	0,00	90.000,00	15.904,59874600	5,6587406850