

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENTA FIXA **93,91%**

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	8,09	0,09	-0,06	10.439.486,81	4,22
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		8,09	0,09	-0,06	10.439.486,81	4,22

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	2,05	0,63	1,49	27.316.533,99	11,03	5.100.791.923,15	0,54
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA INFLACAO 5 FIC	1,97	0,63	1,17	19.449.931,92	7,86	1.660.772.359,14	1,17
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	4,89	0,43	0,68	11.369.993,25	4,59	385.487.147,46	2,95
BB	BB	BB PREVID RF IRF-M1	0,26	0,35	0,77	112.759,66	0,05	7.492.585.716,79	0,00
BB	BB	BB PREV IMAB TPB	4,90	0,44	0,70	38.613.857,58	15,59	6.284.654.664,10	0,61
BRAM	BRABESCO	BRABESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TP	4,90	0,43	0,66	41.991.132,50	16,96	748.077.616,53	5,61
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	4,91	0,44	0,69	48.430.059,92	19,56	6.609.422.706,56	0,73
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	1,98	0,63	1,18	27.725.267,53	11,20	9.698.235.388,71	0,29
BB	BB	BB PREV IMA-B5+	7,26	0,30	0,35	7.083.004,34	2,86	2.259.425.476,17	0,31
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			3,77	0,50	0,88	222.092.540,69	89,69		
Renda Fixa			3,96	0,49	0,83	232.532.027,50	93,91		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENTA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

6,09%

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 PREV ACOES GV	19,01	-7,77	-8,77	11.520.454,57	4,65	843.490.895,06	1,37
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			19,01	-7,77	-8,77	11.520.454,57	4,65		

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	BRABESCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES MID SMALL	18,32	-9,66	-9,66	3.556.662,04	1,44	2.341.977.575,47	0,15
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			18,32	-9,66	-9,66	3.556.662,04	1,44		

Renda Variável e Investimentos Estruturados			19,21	-8,00	-9,00	15.077.116,61	6,09		
Total						247.609.144,11	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

				Política de Investimentos			
Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Mínimo	Objetivo	Máximo	Limite Legal
Renda Fixa							
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	10.439.486,81	4,22	0,00	5,00	100,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	222.092.540,69	89,69	0,00	80,00	100,00	100,00
	Total Renda Fixa	232.532.027,50	93,91				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	11.520.454,57	4,65	0,00	5,00	30,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	3.556.662,04	1,44	0,00	5,00	20,00	20,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	15.077.116,61	6,09				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

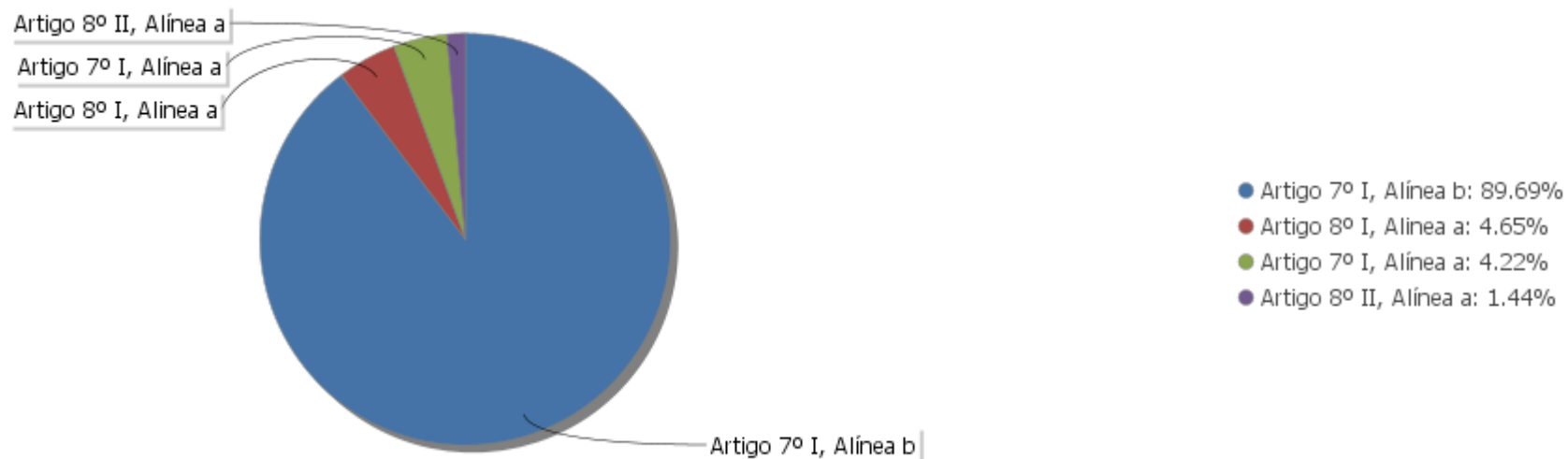
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,09 30,87	-0,06 -9,53	3,01 287,29	5,00 209,00	20,97 376,13	9.457,31	-6.684,12
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,50 171,78	0,88 130,69	2,58 246,35	6,05 253,03	15,18 272,27	1.171.358,92	2.005.105,46
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-7,77 0,66	-8,77 1,15	-1,87 1,88			-972.237,44	-1.141.018,69
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-9,66 -0,57	-9,66 -0,57				-293.359,22	-293.359,22
						-84.780,43	564.043,43

Análise de Liquidez

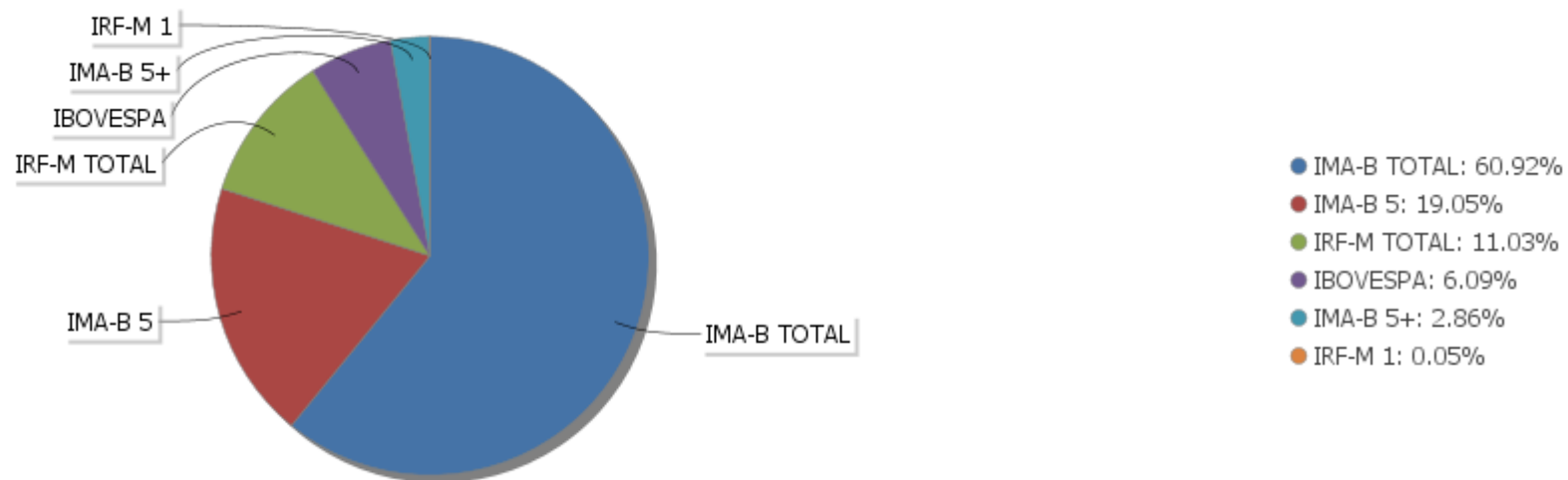
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	237.169.657,30	95,78	237.169.657,30	95,78
de 31 a 364 dias	0,00	0,00	237.169.657,30	95,78
acima de 365 dias	10.439.486,81	4,22	247.609.144,11	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

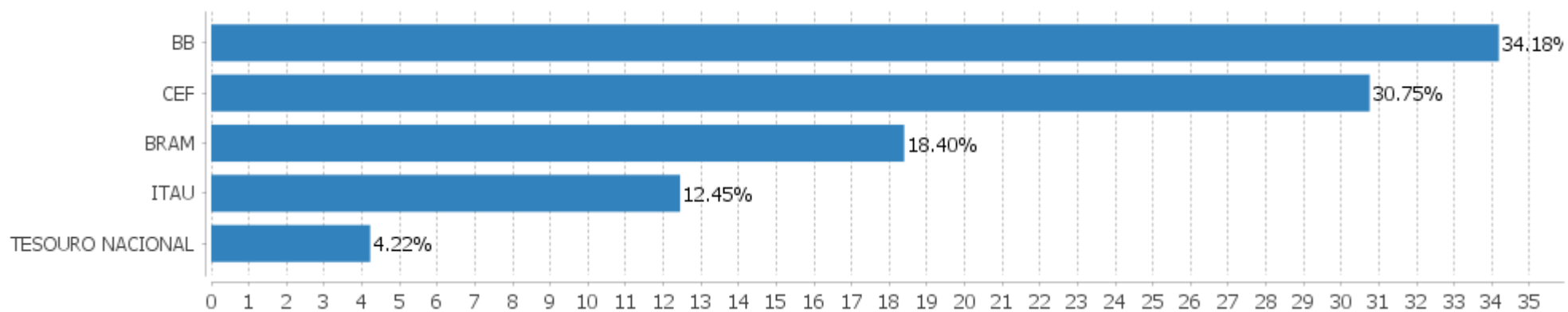


Alocação Por Estratégia



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											0,22
IPCA + 5,87%	0,71	0,66											1,37
p.p. indexador	-0,45	-0,70											-1,16
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

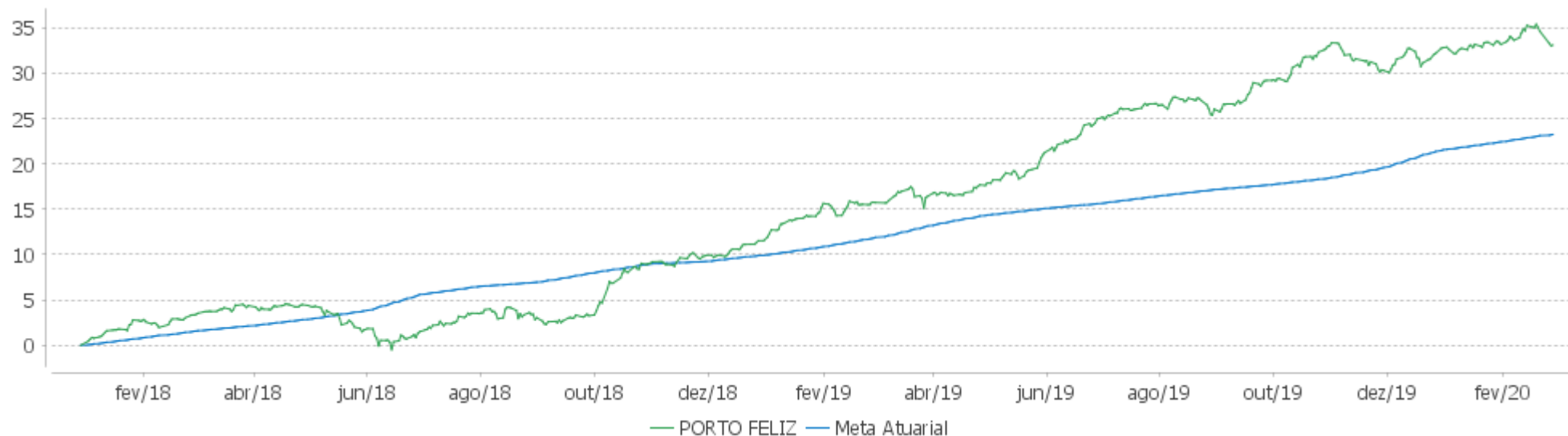
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

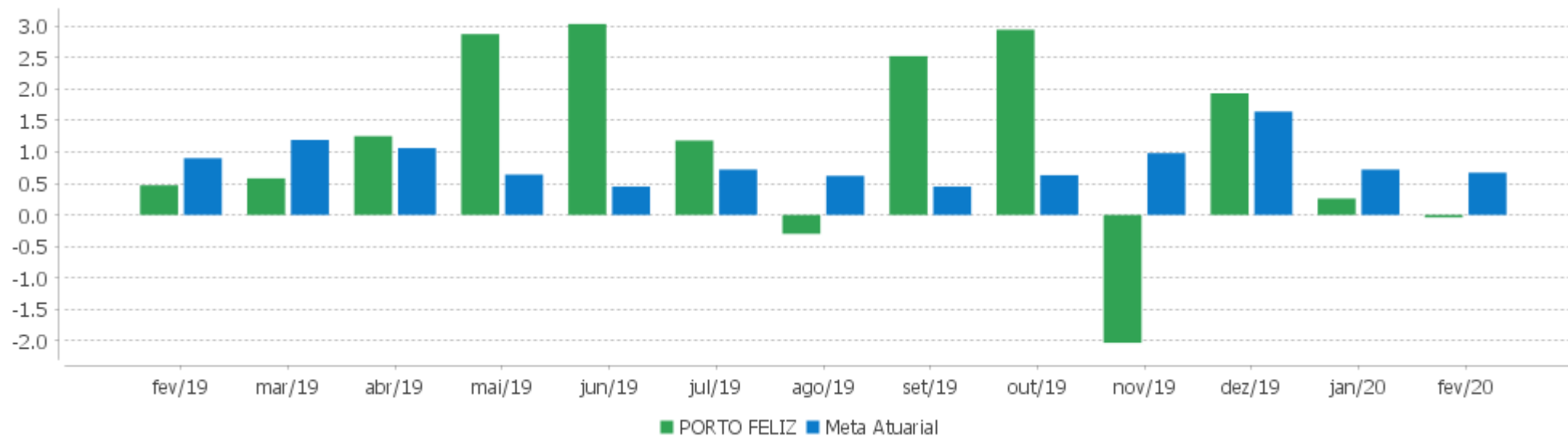
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	14	53,85	03 meses	2,15	3,04	-0,88	4,42
Meses abaixo da Meta Atuarial	12	46,15	06 meses	5,62	5,17	0,44	4,12
			12 meses	15,00	10,20	4,80	4,06
			24 meses	28,81	21,35	7,46	4,27
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	5,62	2018-10	Desde 29/12/2017	33,12	23,23	9,89	4,20
Menor rentabilidade da Carteira	-2,62	2018-05					

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
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,44 -0,01	0,69 -0,03	2,69 -0,04	6,35 -0,19	17,63 -0,37	34,00 -0,65	48,25 -1,02
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,43 -0,01	0,68 -0,04	2,68 -0,05	6,42 -0,12	17,71 -0,29	33,57 -1,08	47,41 -1,85
FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO Var. IMA-B 5 p.p.	0,63 -0,01	1,18 -0,03	2,40 -0,05	5,51 -0,15	11,87 -0,29	22,95 -0,54	37,12 -0,84
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA INFLACAO 5 FIC Var. IMA-B 5 p.p.	0,63 -0,01	1,17 -0,03	2,40 -0,05	5,56 -0,10	11,93 -0,24	22,72 -0,77	36,55 -1,41
BB PREVID RF IRF-M1 Var. IRF-M 1 p.p.	0,35 -0,03	0,77 -0,05	1,17 -0,07	2,72 -0,15	6,24 -0,28	13,31 -0,55	24,21 -0,86
BB PREV IMAB TPB Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,44 -0,01	0,70 -0,01	2,69 -0,05	6,44 -0,10	17,76 -0,24	33,99 -0,66	48,16 -1,11
BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,63 -0,02	1,49 -0,04	2,11 -0,06	4,80 -0,11	11,62 -0,24	22,46 -0,52	38,10 -0,96
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TP Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,43 -0,02	0,66 -0,05	2,66 -0,07	6,38 -0,16	17,61 -0,39	33,72 -0,93	47,55 -1,72
BB PREV IMA-B5+ Var. IMA-B 5+ p.p.	0,30 -0,02	0,35 -0,01	3,08 0,11	7,29 0,06	21,88 -0,16	42,45 -0,62	57,12 -1,37
NTN-B 150545 Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,09 -0,36	-0,06 -0,78	3,01 0,28	7,18 0,63	23,48 5,48	42,47 7,82	56,44 7,18
BB PREV ACOES GV Var. IBOVESPA p.p.	-7,77 0,66	-8,77 1,15	-1,87 1,88	4,96 1,96	12,66 3,68	28,85 6,81	61,57 5,30
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES MID SMALL Var. IBOVESPA p.p.	-7,91 0,52	-6,42 3,50	3,34 7,09	10,51 7,51	27,29 18,31	57,75 35,71	106,37 50,11
CDI	0,29	0,67	1,05	2,39	5,57	12,34	22,39
IBOVESPA	-8,43	-9,92	-3,75	3,00	8,98	22,05	56,27
INPC + 6%	0,59	1,29	3,03	5,12	10,13	21,34	30,86
IPCA + 6%	0,67	1,39	3,06	5,19	10,22	21,38	32,23

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Renda Fixa							
IRF-M 1	0,38	0,82	1,25	2,87	6,52	13,85	25,06
IRF-M 1+	0,80	1,92	2,66	6,01	14,22	27,05	45,12
IRF-M TOTAL	0,65	1,53	2,17	4,91	11,86	22,99	39,06
IMA-B 5	0,64	1,20	2,45	5,66	12,17	23,49	37,96
IMA-B 5+	0,32	0,35	2,96	7,23	22,04	43,07	58,49
IMA-B TOTAL	0,45	0,71	2,73	6,54	18,00	34,65	49,27
IMA-C TOTAL	0,63	3,18	3,59	6,91	18,59	39,02	52,96
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,44	0,95	1,87	4,36	11,07	21,89	35,44
IMA-GERAL TOTAL	0,45	1,01	1,91	4,43	11,28	22,36	35,89
IDKA 2	0,69	1,22	2,44	5,37	11,19	22,52	37,76
IDKA 20	-0,09	-1,46	2,43	6,69	27,19	57,08	70,16
CDI	0,29	0,67	1,05	2,39	5,57	12,34	22,39
Renda Variável							
IBOVESPA	-8,43	-9,92	-3,75	3,00	8,98	22,05	56,27
IBRX 100	-8,22	-9,37	-2,78	3,55	11,15	25,47	60,69
IBRX 50	-8,66	-10,38	-4,50	2,05	6,61	18,16	52,61
SMALL CAP	-8,27	-7,86	3,80	13,95	35,70	51,63	99,83
IFIX	-3,69	-7,31	2,54	11,56	21,74	28,23	46,08
Índice Consumo - ICON	-10,00		0,78	4,44	34,77	34,01	67,27
Índice Dividendos - IDIV	-6,18	-7,66	1,56	7,52	21,63	42,31	67,61
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,25	0,46	1,62	2,20	4,00	8,05	11,13
INPC	0,17	0,36	1,58	2,12	3,92	8,02	9,97
IGPM	-0,04	0,44	2,54	3,54	6,84	14,98	14,49
SELIC	0,29	0,67	1,05	2,39	5,57	12,34	22,41
Meta Atuarial							
IPCA + 4%	0,53	1,09	2,59	4,20	8,15	16,85	24,92

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IPCA + 5%	0,60	1,24	2,82	4,70	9,18	19,10	28,54
IPCA + 5,5%	0,63	1,32	2,94	4,95	9,70	20,24	30,38
IPCA + 5,89%	0,66	1,38	3,03	5,14	10,11	21,13	31,82
IPCA + 6%	0,67	1,39	3,06	5,19	10,22	21,38	32,23
INPC + 4%	0,45	0,99	2,55	4,13	8,06	16,81	23,63
INPC + 6%	0,59	1,29	3,03	5,12	10,13	21,34	30,86

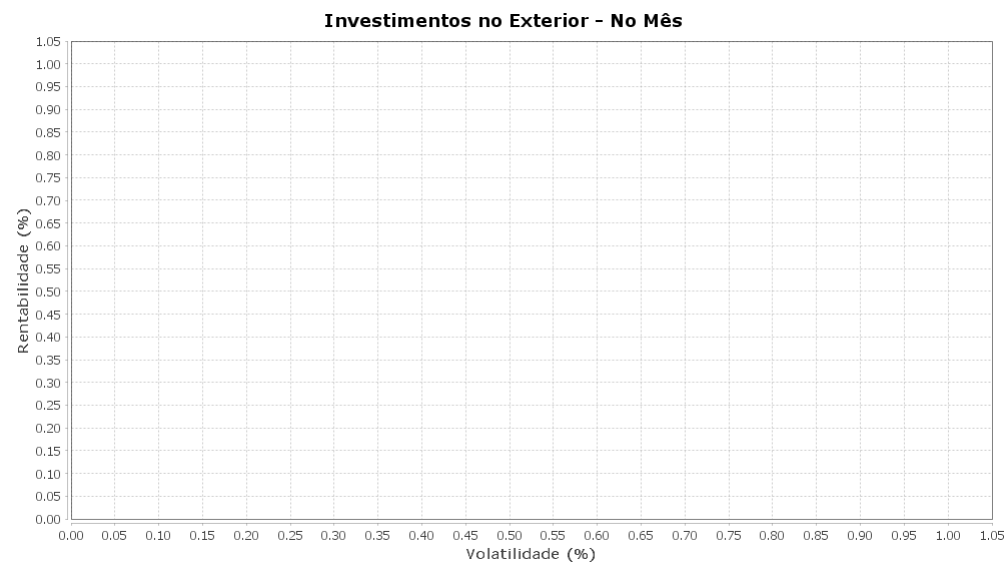
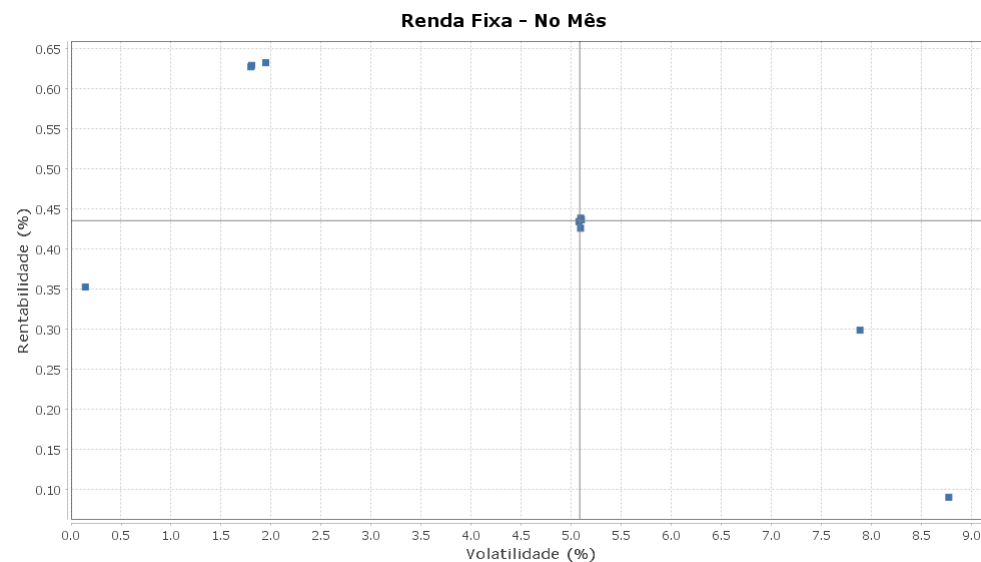
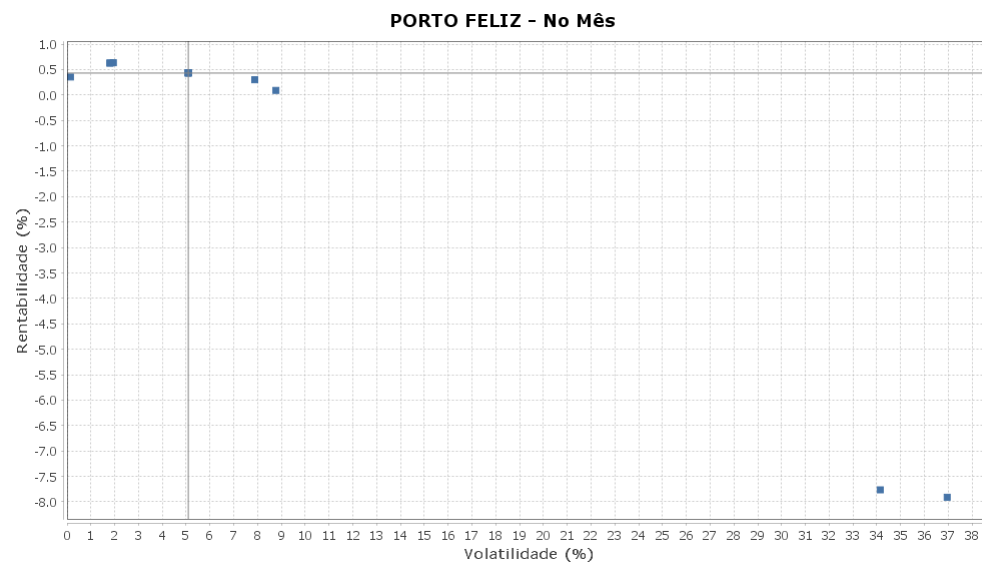
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
03/02/2020	BB PREV ACOES GV	245.000,00	0,00	79.758,19391200	3,0717847030
10/02/2020	BB PREVID RF IRF-M1	1.910.000,00	0,00	721.226,62862700	2,6482660570
18/02/2020	BB PREVID RF IRF-M1	0,00	1.900.000,00	716.751,28697700	2,6508497920
19/02/2020	BB PREV IMA-B5+	0,00	2.000.000,00	572.301,91608900	3,4946589270
20/02/2020	BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES MID SMALL	2.635.000,00	0,00	216.445,33768690	12,1739744000
21/02/2020	BB PREV IMA-B5+	0,00	1.215.000,00	351.367,30082400	3,4579199520
26/02/2020	BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES MID SMALL	1.215.021,26	0,00	106.959,01184060	11,3596904000

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
BB PREVID RF IRF-M1	Artigo 7º I, Alínea b	0,14	0,03	0,35	112.759,66	0,05
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA INFLACAO 5 FIC	Artigo 7º I, Alínea b	1,80	0,22	0,63	19.449.931,92	7,86
FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	1,80	0,22	0,63	27.725.267,53	11,20
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	1,94	0,24	0,63	27.316.533,99	11,03
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	Artigo 7º I, Alínea b	5,07	0,55	0,43	11.369.993,25	4,59
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TP	Artigo 7º I, Alínea b	5,09	0,55	0,43	41.991.132,50	16,96
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	5,09	0,55	0,44	48.430.059,92	19,56
BB PREV IMAB TPB	Artigo 7º I, Alínea b	5,10	0,55	0,44	38.613.857,58	15,59
BB PREV IMA-B5+	Artigo 7º I, Alínea b	7,88	0,83	0,30	7.083.004,34	2,86
NTN-B 150545	Artigo 7º I, Alínea a	8,77	0,91	0,09	10.439.486,81	4,22
BB PREV ACOES GV	Artigo 8º I, Alínea a	34,14	3,09	-7,77	11.520.454,57	4,65
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES MID SMALL	Artigo 8º II, Alínea a	36,95	3,37	-7,91	3.556.662,04	1,44