

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENDA FIXA 94,62%

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	18,79	-12,19	-12,24	9.167.324,87	3,97
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		18,79	-12,19	-12,24	9.167.324,87	3,97

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	5,03	-0,11	1,38	27.286.272,32	11,81	4.885.428.546,31	0,56
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA INFLACAO 5 FIC	4,55	-1,71	-0,56	19.117.222,90	8,28	1.560.138.713,72	1,23
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	11,04	-6,95	-6,32	10.580.107,65	4,58	346.254.084,73	3,06
BB	BB	BB PREVID RF IRF-M1	0,45	0,60	1,38	113.433,52	0,05	6.969.533.398,64	0,00
BB	BB	BB PREV IMAB TPB	11,10	-6,98	-6,33	35.917.458,47	15,55	5.743.378.118,49	0,63
BRAM	BRADERSCO	BRADERSCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TP	11,10	-7,01	-6,39	39.048.328,53	16,90	708.758.244,80	5,51
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	11,16	-7,10	-6,46	44.990.492,91	19,47	5.890.819.394,91	0,76
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	4,58	-1,80	-0,64	27.227.009,85	11,79	9.363.308.744,85	0,29
BB	BB	BB PREV IMA-B5+	16,80	-10,89	-10,58	5.147.064,61	2,23	1.940.264.057,52	0,27
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			8,92	-5,18	-4,35	209.427.390,76	90,65		
Renda Fixa			9,32	-5,49	-4,70	218.594.715,63	94,62		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

5,38%

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	40,98	-30,82	-36,89	8.876.633,21	3,84	598.696.495,88	1,48
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a			40,98	-30,82	-36,89	8.876.633,21	3,84		

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	BRANCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES MID SMALL	40,05	-31,64	-38,25	3.546.352,67	1,54	1.534.763.661,47	0,23
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			40,05	-31,64	-38,25	3.546.352,67	1,54		

Renda Variável e Investimentos Estruturados			52,54	-31,08	-37,28	12.422.985,88	5,38		
Total						231.017.701,51	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			
				Mínimo	Objetivo	Máximo	Limite Legal
Renda Fixa							
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	9.167.324,87	3,97	0,00	5,00	100,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	209.427.390,76	90,65	0,00	80,00	100,00	100,00
	Total Renda Fixa	218.594.715,63	94,62				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º I, Alínea a	Fundos de Ações Referenciados	8.876.633,21	3,84	0,00	5,00	30,00	30,00
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	3.546.352,67	1,54	0,00	5,00	20,00	20,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	12.422.985,88	5,38				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

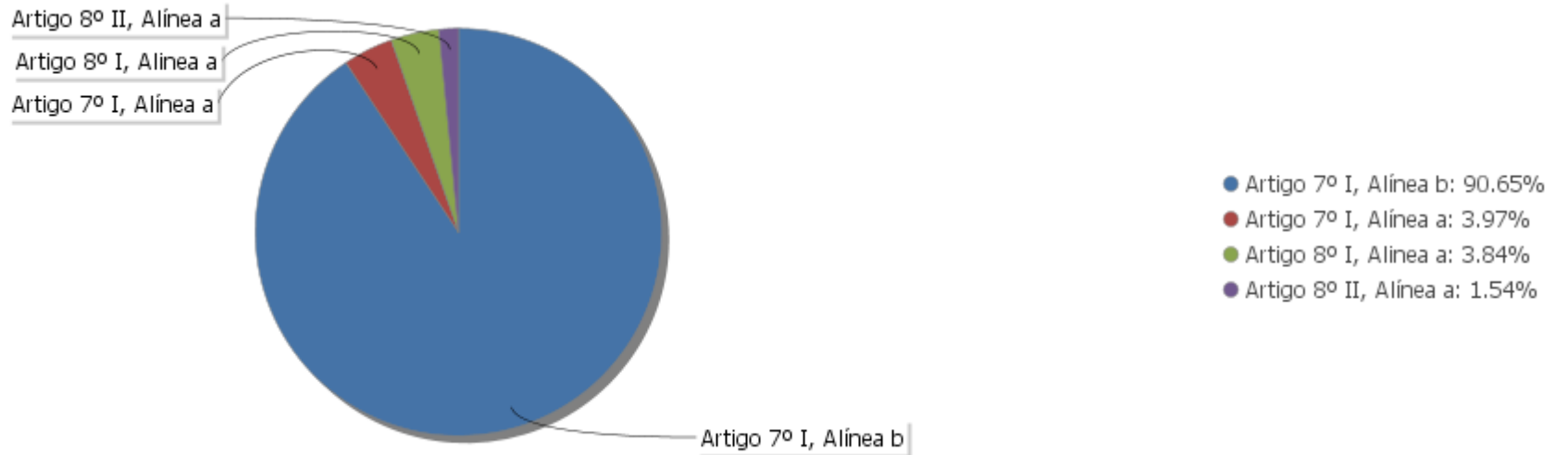
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	-12,19 -3.601,40	-12,24 -1.209,59	-12,24 -1.209,59	-11,30 -499,29	5,84 107,46	-1.272.161,94	-1.278.846,06
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-5,18 -1.530,26	-4,35 -429,39	-4,35 -429,39	-1,85 -81,85	8,58 157,71	-11.515.149,93	-9.510.044,47
Artigo 8º I, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-30,82 -0,92	-36,89 -0,03	-36,89 -0,03	-29,53 0,76		-3.553.821,36	-4.694.840,05
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-31,64 -1,74	-38,25 -1,97				-1.410.309,37	-1.703.668,59
						-17.751.442,60	-17.187.399,17

Análise de Liquidez

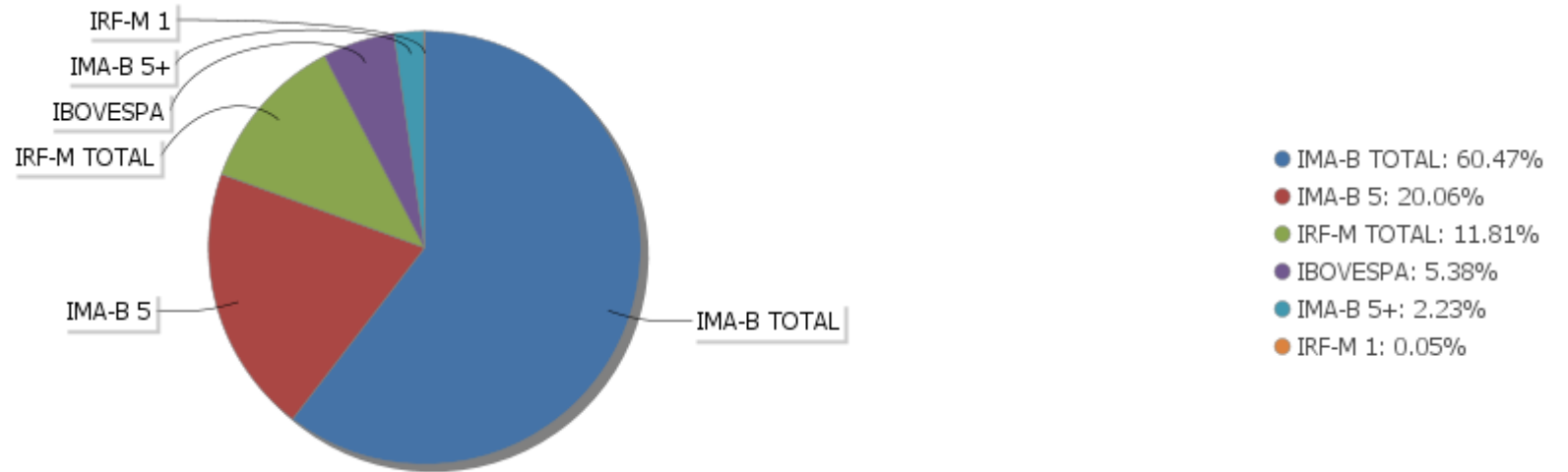
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	221.850.376,64	96,03	221.850.376,64	96,03
de 31 a 364 dias	0,00	0,00	221.850.376,64	96,03
acima de 365 dias	9.167.324,87	3,97	231.017.701,51	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

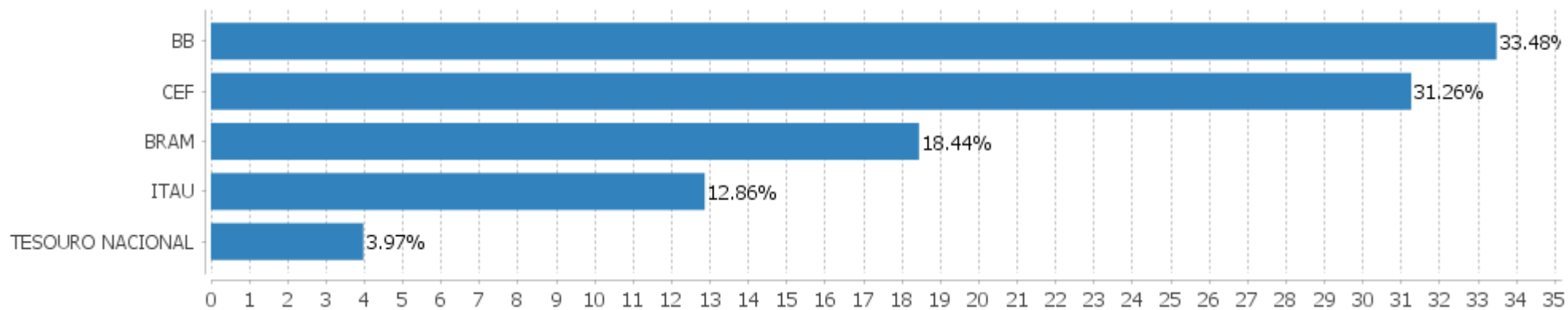


Alocação Por Estratégia



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										-6,95
IPCA + 5,87%	0,71	0,66	0,57										1,95
p.p. indexador	-0,45	-0,70	-7,72										-8,90
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

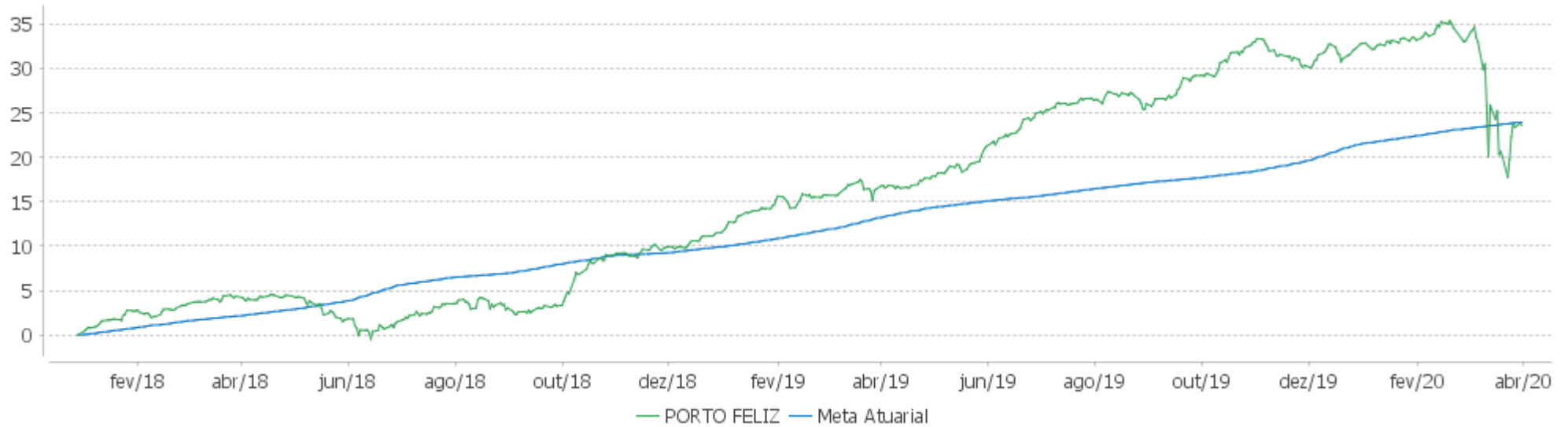
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

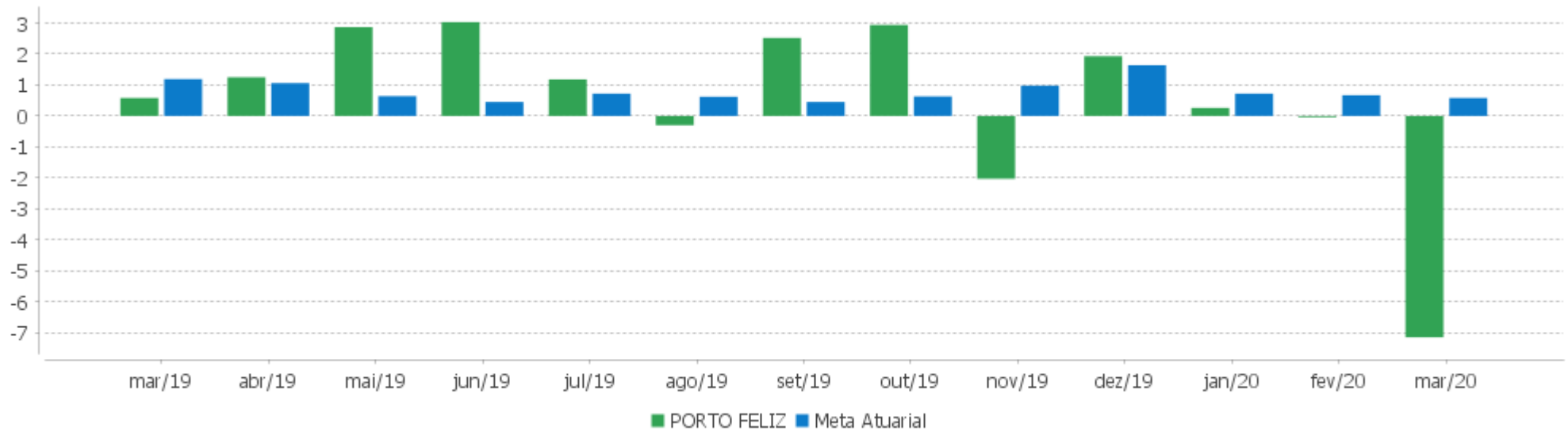
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	14	51,85	03 meses	-6,95	1,95	-8,90	20,24
Meses abaixo da Meta Atuarial	13	48,15	06 meses	-4,35	5,30	-9,65	14,51
			12 meses	6,16	9,52	-3,36	10,53
			24 meses	18,42	21,35	-2,93	8,19
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	5,62	2018-10					
Menor rentabilidade da Carteira	-7,15	2020-03	Desde 29/12/2017	23,60	23,93	-0,34	7,79

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
NTN-B 150545 Var. IMA-B TOTAL p.p.	-12,19 -5,21	-12,24 -5,93	-12,24 -5,93	-9,46 -5,82	8,04 -1,10	25,44 1,33	36,84 -0,58
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO Var. IMA-B TOTAL p.p.	-7,10 -0,13	-6,46 -0,15	-6,46 -0,15	-3,94 -0,30	8,66 -0,48	23,36 -0,75	36,31 -1,12
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI Var. IMA-B TOTAL p.p.	-6,95 0,03	-6,32 -0,01	-6,32 -0,01	-3,70 -0,06	8,94 -0,21	23,20 -0,91	35,81 -1,62
FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO Var. IMA-B 5 p.p.	-1,80 -0,04	-0,64 -0,07	-0,64 -0,07	1,86 -0,17	9,03 -0,31	18,84 -0,55	32,82 -0,85
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA INFLACAO 5 FIC Var. IMA-B 5 p.p.	-1,71 0,04	-0,56 0,01	-0,56 0,01	1,99 -0,03	9,18 -0,15	18,74 -0,65	32,42 -1,25
BB PREVID RF IRF-M1 Var. IRF-M 1 p.p.	0,60 -0,01	1,38 -0,06	1,38 -0,06	2,70 -0,13	6,40 -0,26	13,27 -0,53	23,59 -0,83
BB PREV IMAB TPB Var. IMA-B TOTAL p.p.	-6,98 -0,01	-6,33 -0,02	-6,33 -0,02	-3,73 -0,09	8,93 -0,22	23,52 -0,58	36,42 -1,00
BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	-0,11 -0,00	1,38 -0,04	1,38 -0,04	3,22 -0,09	10,87 -0,23	20,76 -0,49	35,94 -0,91
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TP Var. IMA-B TOTAL p.p.	-7,01 -0,04	-6,39 -0,08	-6,39 -0,08	-3,80 -0,15	8,76 -0,38	23,20 -0,90	35,83 -1,60
BB PREV IMA-B5+ Var. IMA-B 5+ p.p.	-10,89 0,04	-10,58 0,04	-10,58 0,04	-7,80 0,11	8,16 -0,07	26,53 -0,41	38,86 -1,08
BRADERCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES MID SMALL Var. IBOVESPA p.p.	-31,64 -1,74	-36,03 0,83	-36,03 0,83	-26,34 3,95	-12,50 10,97	5,75 20,21	42,39 30,02
BB PREV ACOES GV Var. IBOVESPA p.p.	-30,82 -0,92	-36,89 -0,03	-36,89 -0,03	-29,53 0,76	-21,90 1,57	-9,95 4,51	13,11 0,75
CDI	0,34	1,01	1,01	2,26	5,44	12,12	21,53
IBOVESPA	-29,90	-36,86	-36,86	-30,29	-23,47	-14,46	12,37
INPC + 6%	0,69	1,99	1,99	5,38	9,56	21,50	30,65
IPCA + 6%	0,58	1,98	1,98	5,33	9,55	21,38	31,96

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	0,60	1,43	1,43	2,83	6,66	13,79	24,42
IRF-M 1+	-0,47	1,44	1,44	3,57	12,96	24,50	42,11
IRF-M TOTAL	-0,11	1,42	1,42	3,31	11,09	21,25	36,85
IMA-B 5	-1,75	-0,57	-0,57	2,03	9,34	19,39	33,68
IMA-B 5+	-10,93	-10,62	-10,62	-7,92	8,24	26,94	39,94
IMA-B TOTAL	-6,97	-6,31	-6,31	-3,64	9,14	24,10	37,42
IMA-C TOTAL	-3,52	-0,45	-0,45	1,38	13,06	32,40	46,04
IMA-GERAL ex-C TOTAL	-1,93	-1,00	-1,00	0,87	8,34	18,40	31,22
IMA-GERAL TOTAL	-1,98	-0,99	-0,99	0,89	8,47	18,79	31,60
IDKA 2	-1,21	-0,00	-0,00	2,46	9,11	19,14	33,92
IDKA 20	-16,46	-17,67	-17,67	-14,94	5,94	33,16	42,21
CDI	0,34	1,01	1,01	2,26	5,44	12,12	21,53
Renda Variável							
IBOVESPA	-29,90	-36,86	-36,86	-30,29	-23,47	-14,46	12,37
IBRX 100	-30,09	-36,64	-36,64	-29,86	-22,20	-12,35	15,05
IBRX 50	-30,37	-37,60	-37,60	-31,47	-25,64	-17,77	8,61
SMALL CAP	-35,07	-40,17	-40,17	-27,52	-11,98	-1,62	31,66
IFIX	-15,85	-22,00	-22,00	-7,08	0,45	5,79	22,69
Índice Consumo - ICON	-31,51			-30,32	-6,98	-7,63	14,29
Índice Dividendos - IDIV	-25,53	-31,24	-31,24	-21,42	-7,78	4,87	27,17
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,07	0,53	0,53	2,31	3,30	8,03	10,93
INPC	0,18	0,54	0,54	2,36	3,31	8,13	9,82
IGPM	1,24	1,69	1,69	4,83	6,82	15,66	15,90
SELIC	0,34	1,01	1,01	2,26	5,44	12,13	21,55
Meta Atuarial							
IPCA + 4%	0,41	1,51	1,51	4,33	7,47	16,84	24,68

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IPCA + 5%	0,50	1,74	1,74	4,83	8,51	19,10	28,29
IPCA + 5,5%	0,54	1,86	1,86	5,08	9,03	20,24	30,12
IPCA + 5,89%	0,57	1,96	1,96	5,28	9,44	21,13	31,55
IPCA + 6%	0,58	1,98	1,98	5,33	9,55	21,38	31,96
INPC + 4%	0,52	1,52	1,52	4,39	7,48	16,96	23,44
INPC + 6%	0,69	1,99	1,99	5,38	9,56	21,50	30,65

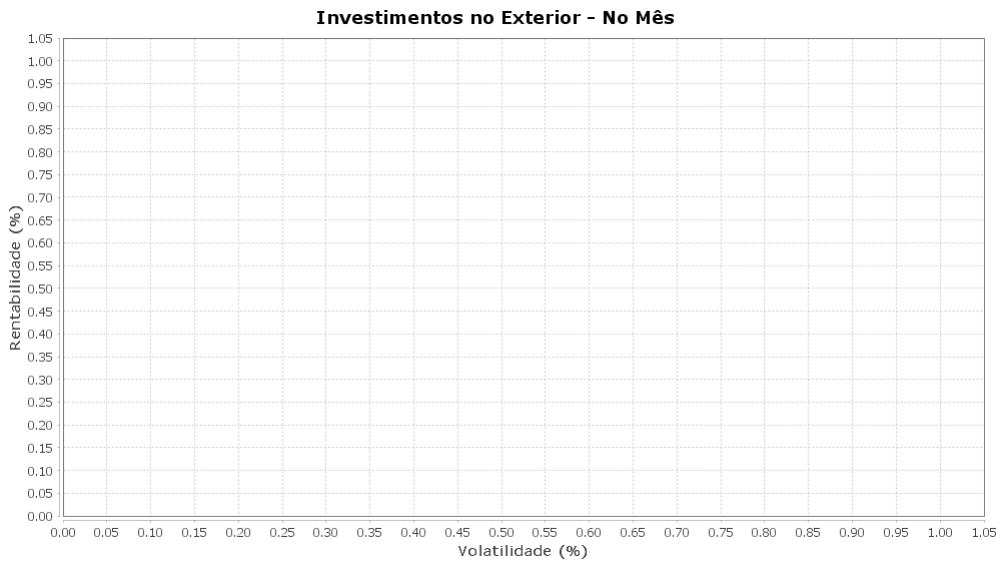
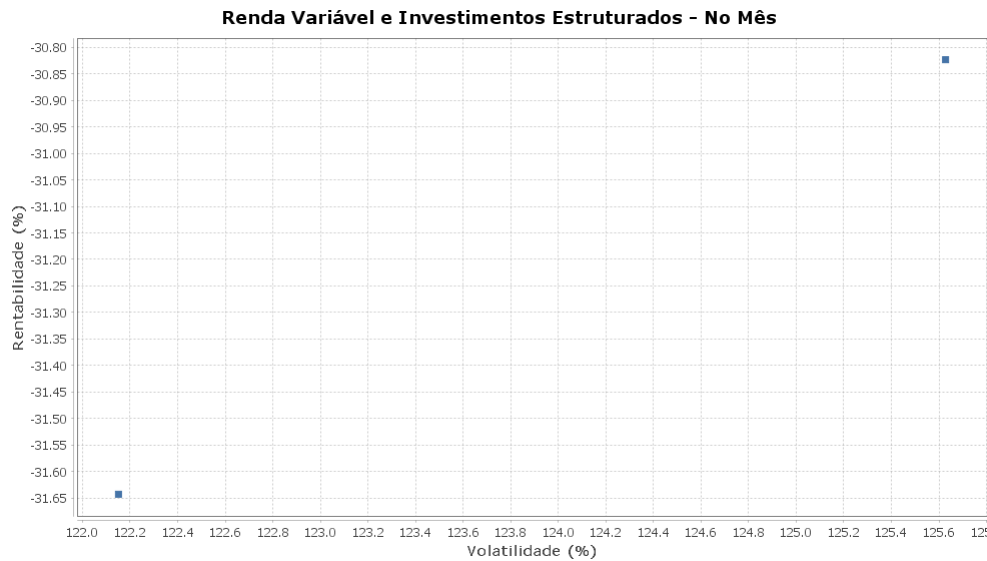
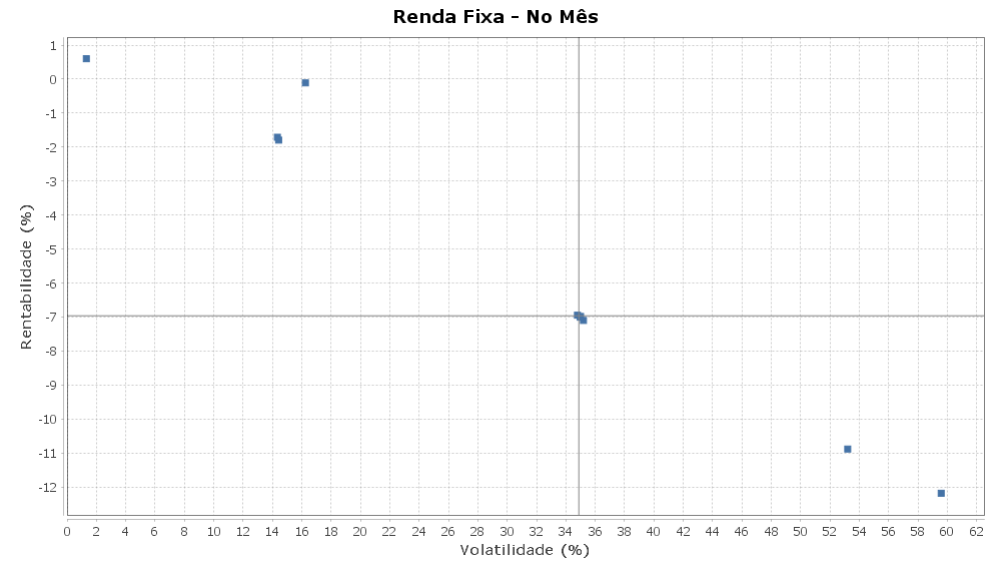
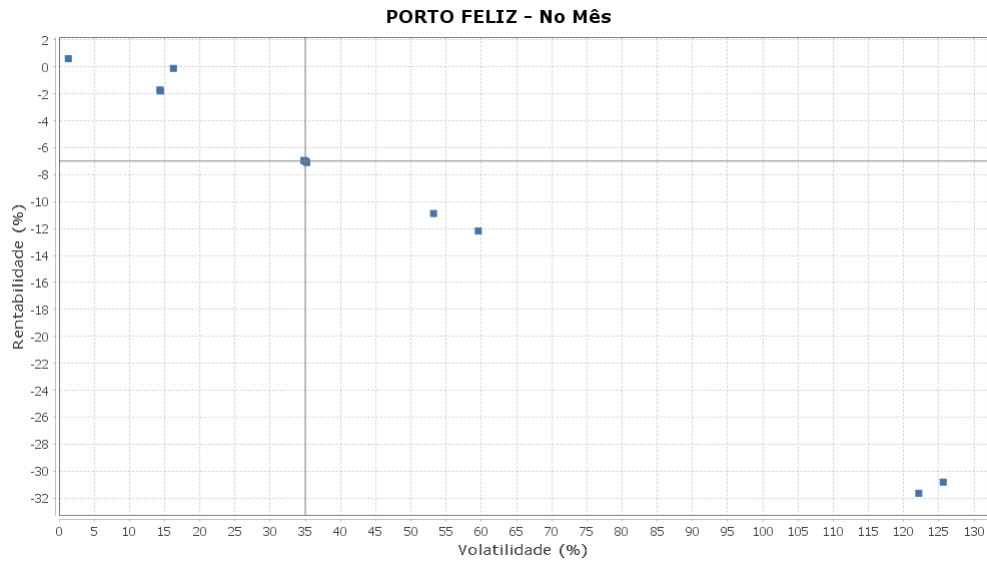
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
04/03/2020	BRDESCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES MID SMALL	400.000,00	0,00	34.668,47855690	11,5378585000
12/03/2020	BB PREV ACOES GV	910.000,00	0,00	467.307,36879400	1,9473264510
13/03/2020	BRDESCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES MID SMALL	1.000.000,00	0,00	113.664,44779640	8,7978257000
25/03/2020	BB PREV IMA-B5+	0,00	1.150.000,00	383.297,11737700	3,0002834560

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	1,31	0,16	0,60	113.433,52	0,05
ITAU INSTITUCIONAL RENDA FIXA INFLACAO 5 FIC	Artigo 7º I, Alínea b	14,33	1,41	-1,71	19.117.222,90	8,28
FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	14,42	1,41	-1,80	27.227.009,85	11,79
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	16,25	1,68	-0,11	27.286.272,32	11,81
ITAU INSTITUCIONAL RF INFLACAO FICFI	Artigo 7º I, Alínea b	34,78	3,28	-6,95	10.580.107,65	4,58
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RF IMA-B TP	Artigo 7º I, Alínea b	34,98	3,29	-7,01	39.048.328,53	16,90
BB PREV IMAB TPB	Artigo 7º I, Alínea b	34,99	3,30	-6,98	35.917.458,47	15,55
FI CAIXA BRASIL IMA B TP RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	35,19	3,31	-7,10	44.990.492,91	19,47
BB PREV IMA-B5+	Artigo 7º I, Alínea b	53,21	4,99	-10,89	5.147.064,61	2,23
NTN-B 150545	Artigo 7º I, Alínea a	59,58	5,58	-12,19	9.167.324,87	3,97
BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES MID SMALL	Artigo 8º II, Alínea a	122,15	10,93	-31,64	3.546.352,67	1,54
BB PREV ACOES GV	Artigo 8º I, Alínea a	125,63	11,34	-30,82	8.876.633,21	3,84