

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Posição de Ativos											
Gestor	CNPJ	Ativos	Vol*	VAR	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (31/01/2020)	% Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo
<b>Renda Fixa</b>											
<b>ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B" - FUNDOS 100% TÍTULOS PÚBLICOS</b>											
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	11.328.882/0001-35	BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,26%	0,05	0,42%	-0,02%	0,42%	3.450.917,71	6,33%	7.374.284.212,96	0,05%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	10.986.880/0001-70	BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	4,90%	0,57	0,24%	-0,03%	0,24%	5.476.103,07	10,04%	736.673.993,30	0,74%
CEF	10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4,91%	0,58	0,25%	-0,01%	0,25%	5.349.953,13	9,81%	6.604.088.892,56	0,08%
CEF	10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,25%	0,05	0,42%	-0,02%	0,42%	4.150.576,48	7,61%	10.529.932.746,92	0,04%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	11.484.558/0001-06	BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,25%	0,05	0,42%	-0,03%	0,42%	80.034,38	0,15%	752.613.419,69	0,01%
CEF	11.060.913/0001-10	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,97%	0,25	0,54%	-0,01%	0,54%	9.654.057,45	17,71%	9.706.276.068,00	0,10%
SANTANDER	14.504.578/0001-90	SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP	4,90%	0,57	0,24%	-0,02%	0,24%	2.250.628,04	4,13%	1.294.763.175,70	0,17%
CEF	14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,50%	0,19	0,46%	-0,08%	0,46%	9.215.312,79	16,90%	8.791.015.868,25	0,10%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	03.543.447/0001-03	BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,97%	0,25	0,56%	-0,00%	0,56%	3.247.987,46	5,96%	4.489.872.848,79	0,07%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	25.078.994/0001-90	BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,35%	0,29	0,49%	-0,07%	0,49%	5.545.761,91	10,17%	10.446.730.359,40	0,05%
<b>Sub-total ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B" - FUNDOS 100% TÍTULOS PÚBLICOS</b>								<b>48.421.332,43</b>	<b>88,81%</b>		
<b>ARTIGO 7º, INCISO IV, ALÍNEA "A" - FUNDOS RENDA FIXA (LIVRE)</b>											
CEF	03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,06%	0,03	0,37%	98,45%	0,37%	490.791,59	0,90%	5.345.385.558,02	0,01%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	08.702.798/0001-25	BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	5,01%	0,59	0,27%	0,01%	0,27%	5.609.717,86	10,29%	1.952.250.666,57	0,29%
<b>Sub-total ARTIGO 7º, INCISO IV, ALÍNEA "A" - FUNDOS RENDA FIXA (LIVRE)</b>								<b>6.100.509,46</b>	<b>11,19%</b>		
<b>Sub-total Renda Fixa</b>								<b>54.521.841,89</b>	<b>100,00%</b>		
<b>Total</b>								<b>54.521.841,89</b>	<b>100%</b>		

### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

#### Enquadramento da Carteira

Artigo	Classe	Valor(R\$)	% Carteira	Política Investimento	Limite Res. 4.604/17
<b>Renda Fixa</b>					
ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"	FUNDOS 100% TÍTULOS PÚBLICOS	48.421.332,42	88,81%	100,00%	100,00%
ARTIGO 7º, INCISO IV, ALÍNEA "A"	FUNDOS RENDA FIXA (LIVRE)	6.100.509,46	11,19%	40,00%	40,00%
<b>Total Renda Fixa</b>		<b>54.521.841,88</b>	<b>100,00%</b>		

#### Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)

Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
<b>ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"</b>	0,42	0,42	12,16	22,92
% do CDI	110,3	110,3	209,9	182,8
<b>ARTIGO 7º, INCISO IV, ALÍNEA "A"</b>	0,28	0,28	13,54	22,61
% do CDI	75,0	75,0	233,7	180,2

#### Ganhos Financeiros

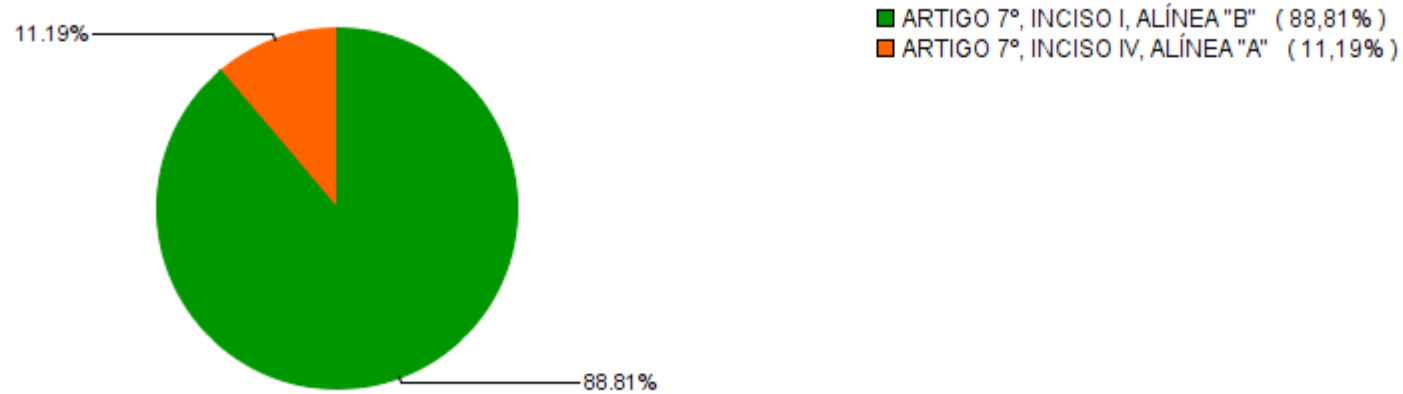
Estratégia	Ganho Bruto (R\$)
<b>ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"</b>	202.694,07
<b>ARTIGO 7º, INCISO IV, ALÍNEA "A"</b>	17.188,58
<b>Total</b>	<b>219.882,65</b>

#### Análise da Disponibilidade Financeira

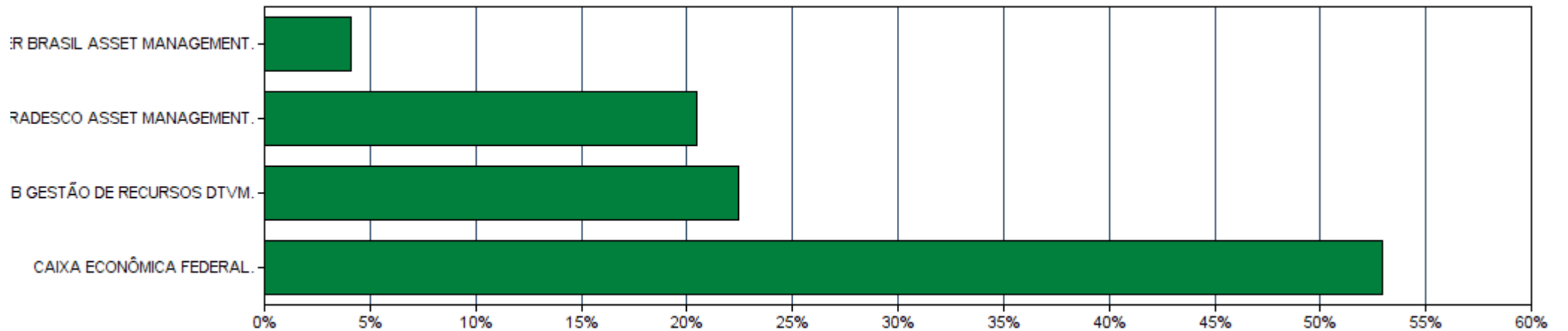
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acum. Bruto (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	54.521.841,89	100	54.521.841,89	100

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Alocação por Estratégia**



**Alocação por Gestor**

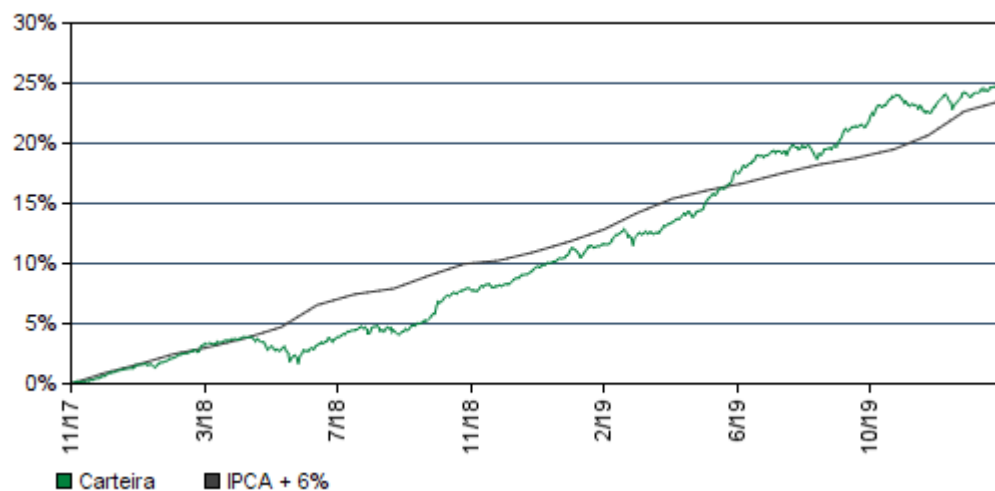


### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

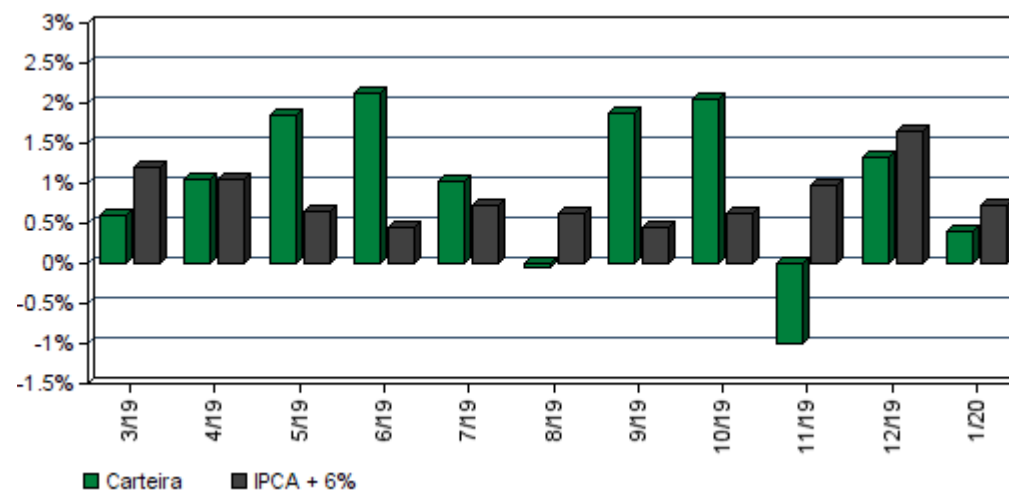
#### Rentabilidades da Carteira

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
<b>2017</b>													
<b>IPCA + 6%</b>	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	0,66	0,66
<b>p.p. Indx</b>	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	-0,24	-0,24
<b>2018</b>													
<b>IPCA + 6%</b>	0,94	0,54	1,22	0,46	-0,99	0,33	1,21	-0,01	0,72	2,49	0,31	1,09	8,59
<b>p.p. Indx</b>	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
	0,14	-0,20	0,64	-0,25	-1,88	-1,42	0,37	-0,45	-0,20	1,53	0,06	0,48	-1,33
<b>2019</b>													
<b>IPCA + 6%</b>	1,58	0,50	0,60	1,05	1,85	2,12	1,02	-0,04	1,88	2,04	-1,01	1,32	13,63
<b>p.p. Indx</b>	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
	0,75	-0,40	-0,59	-0,01	1,21	1,67	0,30	-0,66	1,43	1,41	-1,98	-0,32	3,04
<b>2020</b>													
<b>IPCA + 6%</b>	0,40	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	0,40
<b>p.p. Indx</b>	0,72	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	0,72
	-0,32	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	-0,32

#### Evolução da Rentabilidade



#### Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

#### Análise de Risco / Retorno da Carteira

	Qtd.	Perct.
Meses <b>acima</b> do Benchmark	12	46,2%
Meses <b>abaixo</b> do Benchmark	14	53,8%

	Rentab.	Mês
<b>Maior</b> rentabilidade da Carteira	2,49%	out/18
<b>Menor</b> rentabilidade da Carteira	-1,01%	nov/19

Período	Rentabilidade (%)			Volat. Anual
	Carteira	IPCA + 6%	p.p. Indx.	
<b>03 meses</b>	0,70	3,37	-2,7	2,390
<b>06 meses</b>	4,64	5,14	-0,5	2,509
<b>12 meses</b>	12,32	10,47	1,8	2,479
<b>24 meses</b>	22,74	21,46	1,3	2,337
<b>36 meses</b>	--	--	--	--
<b>Desde o início</b>	24,71	23,55	1,2	2,251

#### 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 IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO Var. do IRF-M 1 p.p.	0,42 -0,02	0,42 -0,02	1,13 -0,07	2,89 -0,15	6,33 -0,29	13,50 -0,54	14,80 -0,56
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA Var. do IMA-B TOTAL p.p.	0,24 -0,03	0,24 -0,03	-0,31 -0,07	5,48 -0,16	17,72 -0,39	19,05 -0,41	19,05 -0,41
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP Var. do IMA-B TOTAL p.p.	0,25 -0,01	0,25 -0,01	-0,36 -0,12	5,44 -0,20	17,72 -0,40	34,14 -0,64	39,79 -0,74
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA Var. do IRF-M 1 p.p.	0,42 -0,02	0,42 -0,02	1,14 -0,05	2,93 -0,11	6,40 -0,22	13,64 -0,40	14,93 -0,43
BRADERCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA Var. do IRF-M 1 p.p.	0,42 -0,03	0,42 -0,03	1,13 -0,07	2,90 -0,14	6,33 -0,28	13,23 -0,57	13,23 -0,57
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP Var. do IMA-B 5 p.p.	0,54 -0,01	0,54 -0,01	1,41 -0,10	4,89 -0,15	11,76 -0,30	22,83 -0,53	25,52 -0,59
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP Var. do IMA-B TOTAL p.p.	0,24 -0,02	0,24 -0,02	-0,30 -0,07	5,50 -0,14	17,78 -0,34	34,07 -0,72	39,72 -0,81
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP Var. do IDKA 2 p.p.	0,46 -0,08	0,46 -0,08	1,57 -0,19	4,44 -0,31	10,30 -0,72	20,93 -1,51	23,15 -1,67

**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 IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP Var. do IMA-B 5 p.p.	0,56 -0,00	0,56 -0,00	1,44 -0,07	4,92 -0,12	11,82 -0,24	22,77 -0,50	22,77 -0,50
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO Var. do IMA-GERAL TOTAL p.p.	0,49 -0,07	0,49 -0,07	0,50 -0,24	3,93 -0,21	11,38 0,06	12,11 0,12	12,11 0,12
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,37 98,45	0,37 98,45	1,03 90,91	2,44 93,45	5,55 95,80	12,08 96,32	13,31 96,37
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA Var. do IMA-B TOTAL p.p.	0,27 0,01	0,27 0,01	-0,33 -0,09	5,66 0,02	17,92 -0,19	34,49 -0,30	40,22 -0,31
CDI	0,38	0,38	1,14	2,61	5,79	12,54	23,13
IBOVESPA	-1,63	-1,63	6,10	11,74	16,80	33,97	75,91
DOLAR COMERCIAL	5,92	5,92	6,63	13,40	16,91	35,01	36,54
INPC + 6%	0,70	0,70	3,46	5,16	10,59	21,35	30,95
IPCA + 6%	0,72	0,72	3,37	5,14	10,47	21,46	32,33