

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

Posição de Ativos											
Gestor	CNPJ	Ativos	Vol*	VAR	Mês	% Índice	Ano	Valor(R\$) (28/02/2020)	% 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	0,35%	-0,03%	0,77%	3.472.789,41	6,33%	7.492.585.716,79	0,05%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	10.986.880/0001-70	BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	4,90%	0,57	0,43%	-0,02%	0,66%	5.499.446,84	10,02%	748.077.616,53	0,74%
CEF	10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4,91%	0,57	0,44%	-0,01%	0,69%	5.373.435,25	9,79%	6.609.422.706,56	0,08%
CEF	10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,25%	0,05	0,36%	-0,02%	0,79%	107.869,42	0,20%	10.513.960.188,40	0,00%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	11.484.558/0001-06	BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,25%	0,05	0,35%	-0,03%	0,77%	4.222.970,61	7,69%	788.508.955,47	0,54%
CEF	11.060.913/0001-10	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,98%	0,25	0,63%	-0,01%	1,18%	9.714.833,76	17,70%	9.698.235.388,71	0,10%
SANTANDER	14.504.578/0001-90	SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP	4,90%	0,57	0,43%	-0,02%	0,67%	2.260.243,57	4,12%	1.413.979.781,38	0,16%
CEF	14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,51%	0,20	0,60%	-0,08%	1,06%	9.270.738,83	16,89%	8.419.154.798,69	0,11%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	03.543.447/0001-03	BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,97%	0,25	0,65%	0,01%	1,21%	3.269.120,69	5,96%	4.537.919.668,21	0,07%
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	25.078.994/0001-90	BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,33%	0,28	0,46%	0,01%	0,94%	5.571.050,13	10,15%	10.908.803.618,87	0,05%
<b>Sub-total ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B" - FUNDOS 100% TÍTULOS PÚBLICOS</b>								<b>48.762.498,52</b>	<b>88,84%</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	0,27%	92,94%	0,65%	492.135,77	0,90%	5.421.482.050,58	0,01%
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	08.702.798/0001-25	BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	5,01%	0,58	0,46%	0,01%	0,73%	5.635.346,87	10,27%	1.974.476.515,72	0,29%
<b>Sub-total ARTIGO 7º, INCISO IV, ALÍNEA "A" - FUNDOS RENDA FIXA (LIVRE)</b>								<b>6.127.482,64</b>	<b>11,16%</b>		
<b>Sub-total Renda Fixa</b>								<b>54.889.981,16</b>	<b>100,00%</b>		
<b>Total</b>								<b>54.889.981,16</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	48.762.498,51	88,84%	100,00%	100,00%
ARTIGO 7º, INCISO IV, ALÍNEA "A"	FUNDOS RENDA FIXA (LIVRE)	6.127.482,65	11,16%	40,00%	40,00%
<b>Total Renda Fixa</b>		<b>54.889.981,16</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>	0,46	0,88	12,11	22,84
% do CDI	157,7	131,2	217,0	184,9
<b>ARTIGO 7º, INCISO IV, ALÍNEA "A"</b>	0,44	0,73	13,57	22,51
% do CDI	150,0	108,0	243,1	182,3

#### Ganhos Financeiros

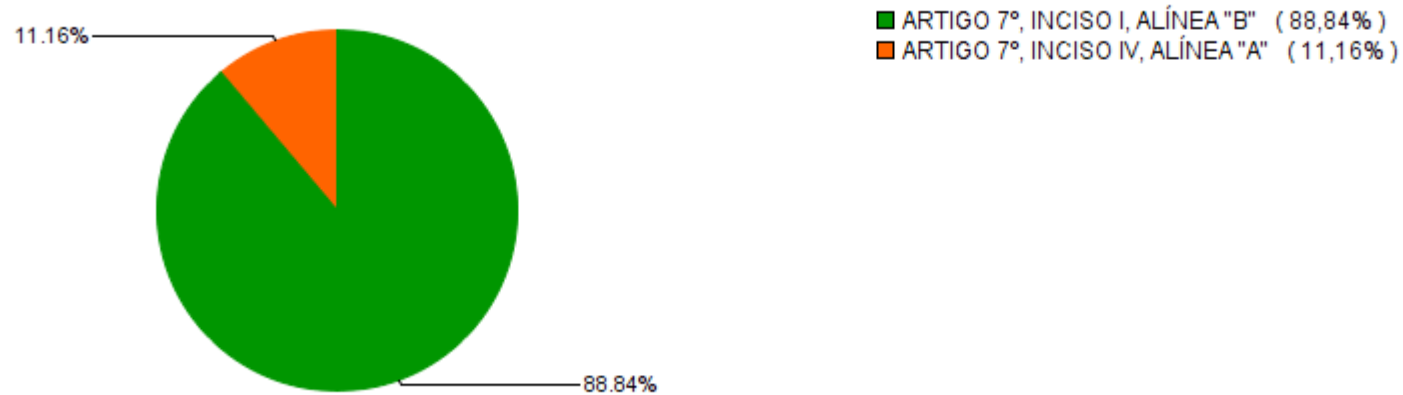
Estratégia	Ganho Bruto (R\$)
<b>ARTIGO 7º, INCISO I, ALÍNEA "B"</b>	245.879,76
<b>ARTIGO 7º, INCISO IV, ALÍNEA "A"</b>	26.973,18
<b>Total</b>	<b>272.852,94</b>

#### Análise da Disponibilidade Financeira

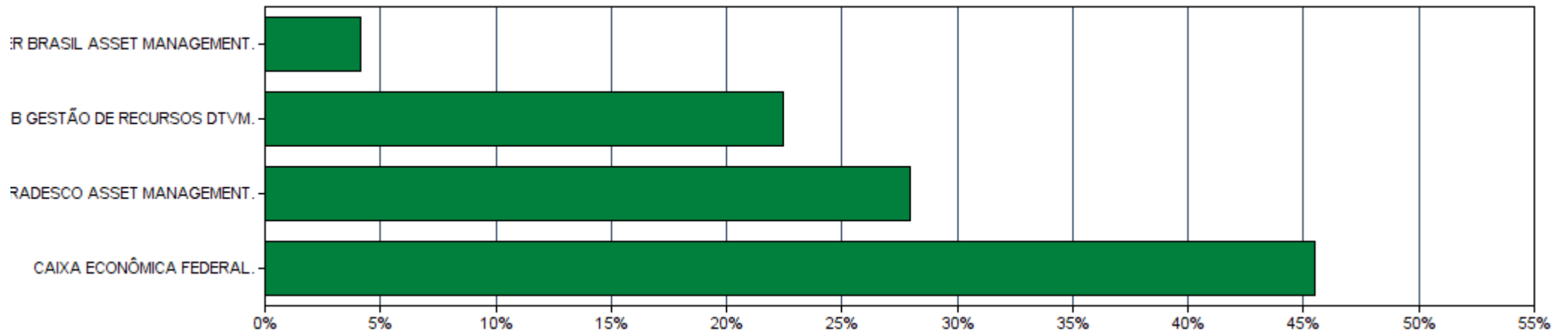
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acum. Bruto (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	54.889.981,16	100	54.889.981,16	100

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Alocação por Estratégia**



**Alocação por Gestor**

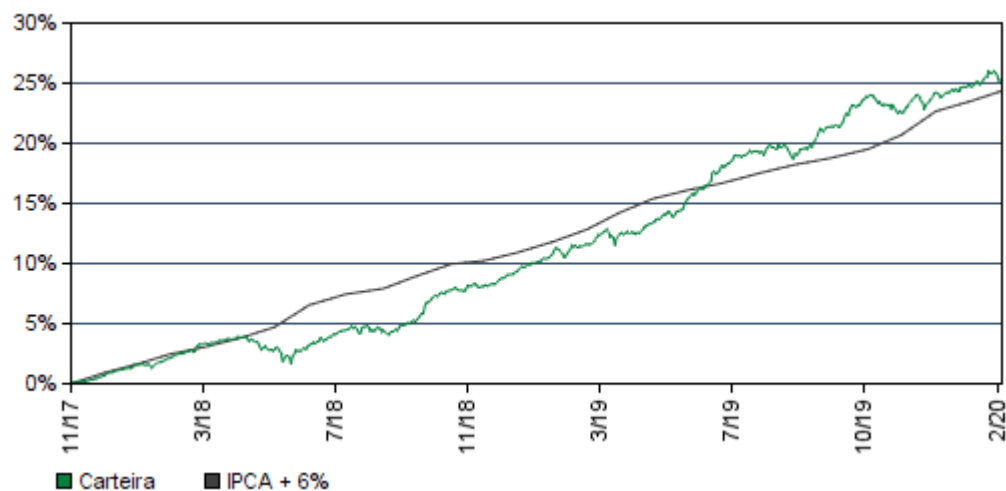


### EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

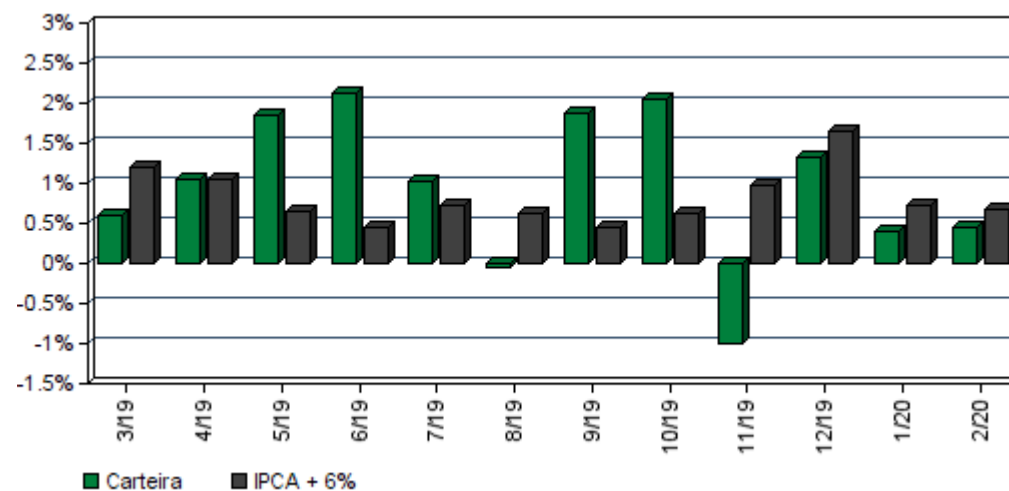
#### Rentabilidades da Carteira

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	0,46	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	0,86
<b>p.p. Indx</b>	0,72	0,67	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	1,39
	-0,32	-0,21	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	-0,54

#### 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	44,4%
Meses <b>abaixo</b> do Benchmark	15	55,6%

	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>	2,19	3,06	-0,9	2,463
<b>06 meses</b>	5,16	5,19	-0,0	2,476
<b>12 meses</b>	12,27	10,22	2,1	2,490
<b>24 meses</b>	22,64	21,38	1,3	2,377
<b>36 meses</b>	--	--	--	--
<b>Desde o início</b>	25,28	24,37	0,9	2,262

#### 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.	0,35 -0,03	0,77 -0,05	1,17 -0,07	2,72 -0,15	6,24 -0,28	13,31 -0,55	15,21 -0,59
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA Var. do 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	19,55 -0,44	19,55 -0,44
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP Var. do 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	40,40 -0,76
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA Var. do IRF-M 1 p.p.	0,36 -0,02	0,79 -0,04	1,19 -0,05	2,77 -0,11	6,31 -0,21	13,44 -0,41	15,35 -0,45
BRADERCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA Var. do IRF-M 1 p.p.	0,35 -0,03	0,77 -0,05	1,17 -0,07	2,73 -0,15	6,23 -0,29	13,27 -0,58	13,63 -0,60
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP Var. do 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	26,31 -0,61
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP Var. do IMA-B TOTAL p.p.	0,43 -0,02	0,67 -0,04	2,66 -0,07	6,41 -0,13	17,66 -0,34	33,92 -0,73	40,31 -0,84
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP Var. do IDKA 2 p.p.	0,60 -0,08	1,06 -0,16	2,17 -0,27	4,96 -0,41	10,35 -0,84	20,98 -1,54	23,89 -1,78

**EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS**

**Análise dos Fundos & Ativos da Carteira**

**Rentabilidades em Períodos Fechados (%)**

<b>Fundo / Indexador</b>	<b>No Mês</b>	<b>No Ano</b>	<b>3 meses</b>	<b>6 meses</b>	<b>12 meses</b>	<b>24 meses</b>	<b>36 meses</b>
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP Var. do IMA-B 5 p.p.	0,65 0,01	1,21 0,01	2,42 -0,03	5,56 -0,09	11,96 -0,21	23,02 -0,47	23,57 -0,49
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO Var. do IMA-GERAL TOTAL p.p.	0,46 0,01	0,94 -0,07	1,91 -0,00	4,31 -0,12	11,46 0,17	12,62 0,13	12,62 0,13
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP % do CDI	0,27 92,94	0,65 96,03	1,00 95,08	2,22 92,57	5,33 95,45	11,90 96,31	13,62 96,28
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA Var. do IMA-B TOTAL p.p.	0,46 0,01	0,73 0,02	2,76 0,03	6,61 0,07	17,85 -0,15	34,37 -0,29	40,86 -0,30
<i>CDI</i>	<i>0,29</i>	<i>0,67</i>	<i>1,05</i>	<i>2,40</i>	<i>5,58</i>	<i>12,35</i>	<i>22,43</i>
<i>IBOVESPA</i>	<i>-8,43</i>	<i>-9,92</i>	<i>-3,75</i>	<i>3,00</i>	<i>8,98</i>	<i>22,05</i>	<i>56,27</i>
<i>DOLAR COMERCIAL</i>	<i>5,37</i>	<i>11,61</i>	<i>6,50</i>	<i>8,70</i>	<i>20,33</i>	<i>38,64</i>	<i>45,15</i>
<i>INPC + 6%</i>	<i>0,59</i>	<i>1,29</i>	<i>3,03</i>	<i>5,12</i>	<i>10,13</i>	<i>21,34</i>	<i>30,86</i>
<i>IPCA + 6%</i>	<i>0,67</i>	<i>1,39</i>	<i>3,06</i>	<i>5,19</i>	<i>10,22</i>	<i>21,38</i>	<i>32,23</i>