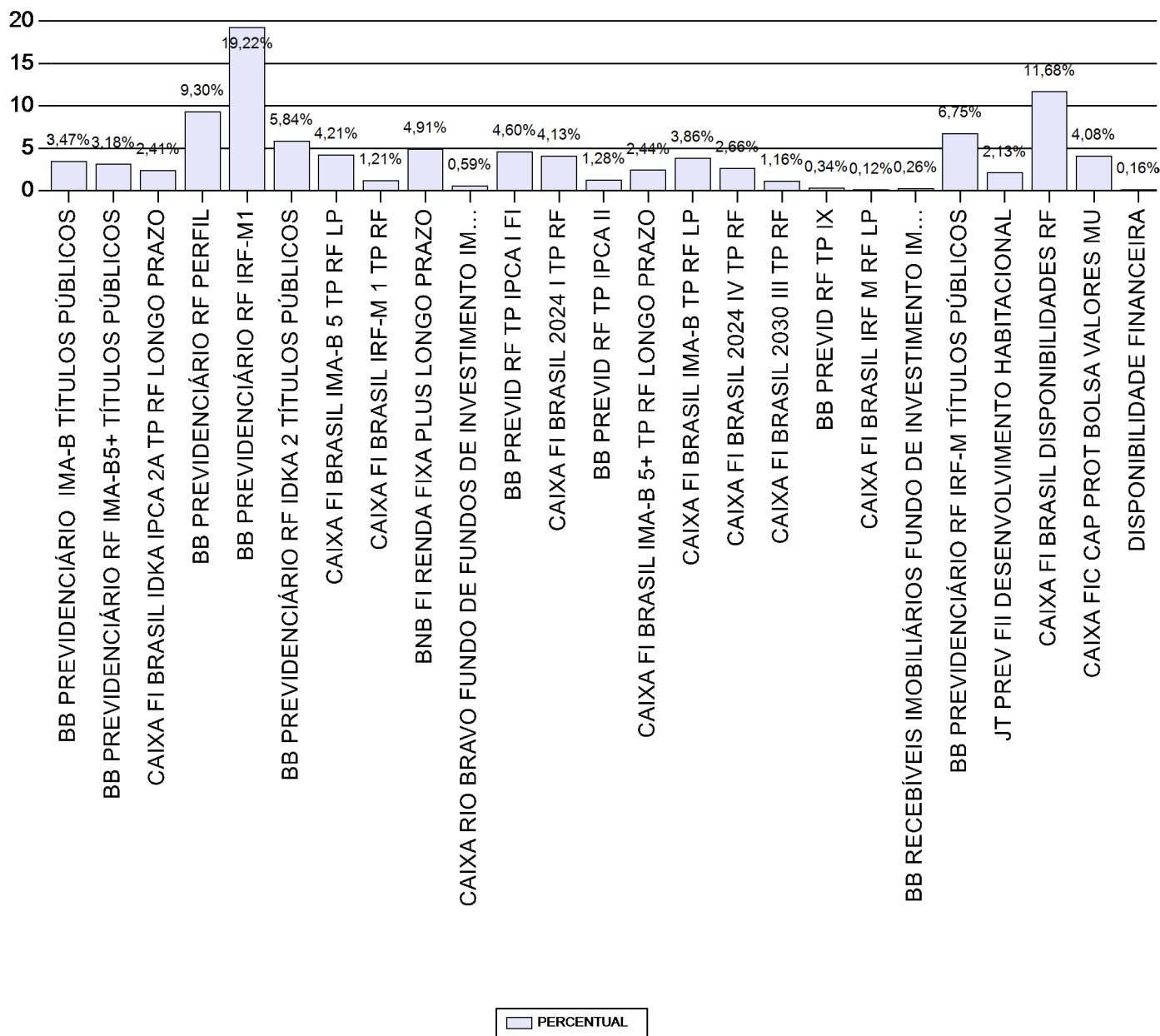


PORTFÓLIO DE INVESTIMENTO 2/2020

APLICAÇÃO	SEGMENTO	%	QTD. COTAS/TÍTULOS	VALOR UNIT.	SALDO ATUAL
BB PREVIDENCIÁRIO IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS	REND A FIXA	2,19	1.109.670,021951000	6,205982840	6.231.438,62
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS	REND A FIXA	2,08	13.299.904,852664000	3,410276690	5.914.476,91
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LONGO PRAZO	REND A FIXA	2,41	3.861.181,091476000	2,242498000	6.874.488,75
BB PREVIDENCIÁRIO IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS	REND A FIXA	1,28	117.894,753423000	6,205982840	3.656.865,16
BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL	REND A FIXA	1,41	1.640.837,735168000	2,261856420	4.011.352,31
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M1	REND A FIXA	16,25	26.031.141,116532000	2,654168320	46.284.743,75
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS	REND A FIXA	4,54	5.201.122,523873000	2,706409440	12.922.077,77
BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL	REND A FIXA	7,89	11.714.422,880174000	2,261856420	22.478.318,33
CAIXA FI BRASIL IMA-B 5 TP RF LP	REND A FIXA	4,21	6.780.757,220657000	3,031954000	11.983.744,93
CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	REND A FIXA	0,21	372.484,409235000	2,541313000	606.746,80
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M1	REND A FIXA	2,97	2.133.248,408771000	2,654168320	8.468.491,03
BNB FI RENDA FIXA PLUS LONGO PRAZO	REND A FIXA	4,91	1.300.583,226024000	5,203168000	13.977.771,93
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FII	REND A VARIÁVEL	0,59	1.500,000000000	1.678,651410000	1.678.651,41
BB PREVID RF TP IPCA I FI	REND A FIXA	4,60	5.753.355,490582000	2,280946360	13.114.106,81
CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF	REND A FIXA	4,13	6.688.211,384898000	1,681392000	11.769.744,00
BB PREVID RF TP IPCA II	REND A FIXA	1,28	4.080.495,188592000	1,993557010	3.651.866,89
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS	REND A FIXA	1,10	701.638,308280000	3,410276690	3.140.823,00
CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	REND A FIXA	0,27	303.055,670980000	2,541313000	781.283,60
CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	REND A FIXA	0,72	807.014,266322000	2,541313000	2.057.162,47
CAIXA FI BRASIL IMA-B 5+ TP RF LONGO PRAZO	REND A FIXA	2,44	629.280,153293000	2,678728000	6.964.140,15
CAIXA FI BRASIL IMA-B TP RF LP	REND A FIXA	3,83	2.836.989,363554000	3,506834000	10.909.980,58
CAIXA FI BRASIL 2024 IV TP RF	REND A FIXA	2,66	4.668.022,278609000	1,518179000	7.590.895,00
CAIXA FI BRASIL 2030 III TP RF	REND A FIXA	1,16	1.863.203,681425000	1,652214000	3.304.428,00
BB PREVID RF TP IX	REND A FIXA	0,34	606.254,045411000	1,579790710	957.482,88
CAIXA FI BRASIL IRF M RF LP	REND A FIXA	0,01	-1.990.163,803573000	2,245496000	41.626,35
CAIXA FI BRASIL IMA-B TP RF LP	REND A FIXA	0,03	25.251,321483000	3,506834000	88.155,44
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FII	REND A FIXA	0,26	10.000,000000000	72,808252700	728.082,53
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS	REND A FIXA	1,31	1.374.479,838535000	2,706409440	3.719.905,21
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS	REND A FIXA	5,67	2.755.553,591863000	5,864531990	16.158.831,53
CAIXA FI BRASIL IRF M RF LP	REND A FIXA	0,10	128.615,988839000	2,245496000	288.524,18
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS	REND A FIXA	1,08	524.880,049182000	5,864531990	3.078.175,84
JT PREV FII DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL	REND A FIXA	2,13	48.676,866159000	1,244516420	6.057.670,98
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	REND A FIXA	11,68	17.890.930,863706000	1,856357000	33.265.330,39
CAIXA FIC CAP PROT BOLSA VALORES MU	REND A FIXA	4,08	9.903,198777000	1,163435790	11.621.616,58
CAIXA FI BRASIL IMA-B 5 TP RF LP	REND A FIXA	0,01	5.011,903661000	3,031954000	15.351,17
TOTAL INVESTIMENTOS		99,84			284.394.351,28
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA		0,16			460.096,65
TOTAL GERAL		100,00			284.854.447,93

Composição da Carteira



Política Anual de Investimento - P.A.I. - 2020				
TIPO	SEGMENTO	RESOLUÇÃO	P.A.I	ALOCAÇÃO
Fundos 100% TPF	RENDA FIXA	100,00 %	100,00 %	66,38 %
Fundos de Índice Renda Fixa	RENDA FIXA	60,00 %	0,00 %	30,49 %
Fundos de Investimentos Imobiliário - FII	RENDA VARIÁVEL	5,00 %	5,00 %	0,59 %
FIDICs Fundos de Investimentos em Direitos Creditórios - Abertos e Fechados	RENDA FIXA	5,00 %	0,00 %	0,26 %
Fundos de Renda Fixa	RENDA FIXA	60,00 %	0,00 %	2,13 %
TOTAL				99,84 %

Esta carteira encontra-se desenquadrada na Política Anual de Investimento - PAI/2020 no(s) segmento(s):

TIPO	SEGMENTO	RESOLUÇÃO	P.A.I	ALOCÇÃO	DESENQUADRAMENTO R\$
Fundos de Índice Renda Fixa	RENDA FIXA	60,00 %	0,00 %	30,49 %	4.011.352,31
FIDICs Fundos de Investimentos em Direitos Creditórios - Abertos e Fechados	RENDA FIXA	5,00 %	0,00 %	0,26 %	728.082,53
Fundos de Renda Fixa	RENDA FIXA	60,00 %	0,00 %	2,13 %	6.057.670,98
TOTAL				99,84 %	

Esta carteira encontra-se desenquadrada na Política Anual de Investimento - PAI/2012 no(s) segmento(s):

TIPO	SEGMENTO	RESOLUÇÃO	P.A.I	ALOCÇÃO	DESENQUADRAMENTO R\$
TOTAL				0,16 %	

META ATUARIAL

	PATRIMÔNIO INICIAL	APLICAÇÕES	RESGATES / AMORTIZAÇÃO	RENTABILIDADE CARTEIRA	PATRIMÔNIO FINAL	RENTABILIDADE CARTEIRA	RENTABILIDADE ACUMULADA	META ATUARIAL	DIFERENÇA
Janeiro	282.711.701,90	2.414.571,14	823.152,27	1.127.005,39	285.430.126,16	0,40%	0,40%	0,70%	-0,30%
Fevereiro	285.430.126,16	2.925.662,41	2.873.533,06	1.099.757,68	286.582.013,19	0,39%	0,78%	1,43%	-0,65%

Rentabilidade da Carteira

