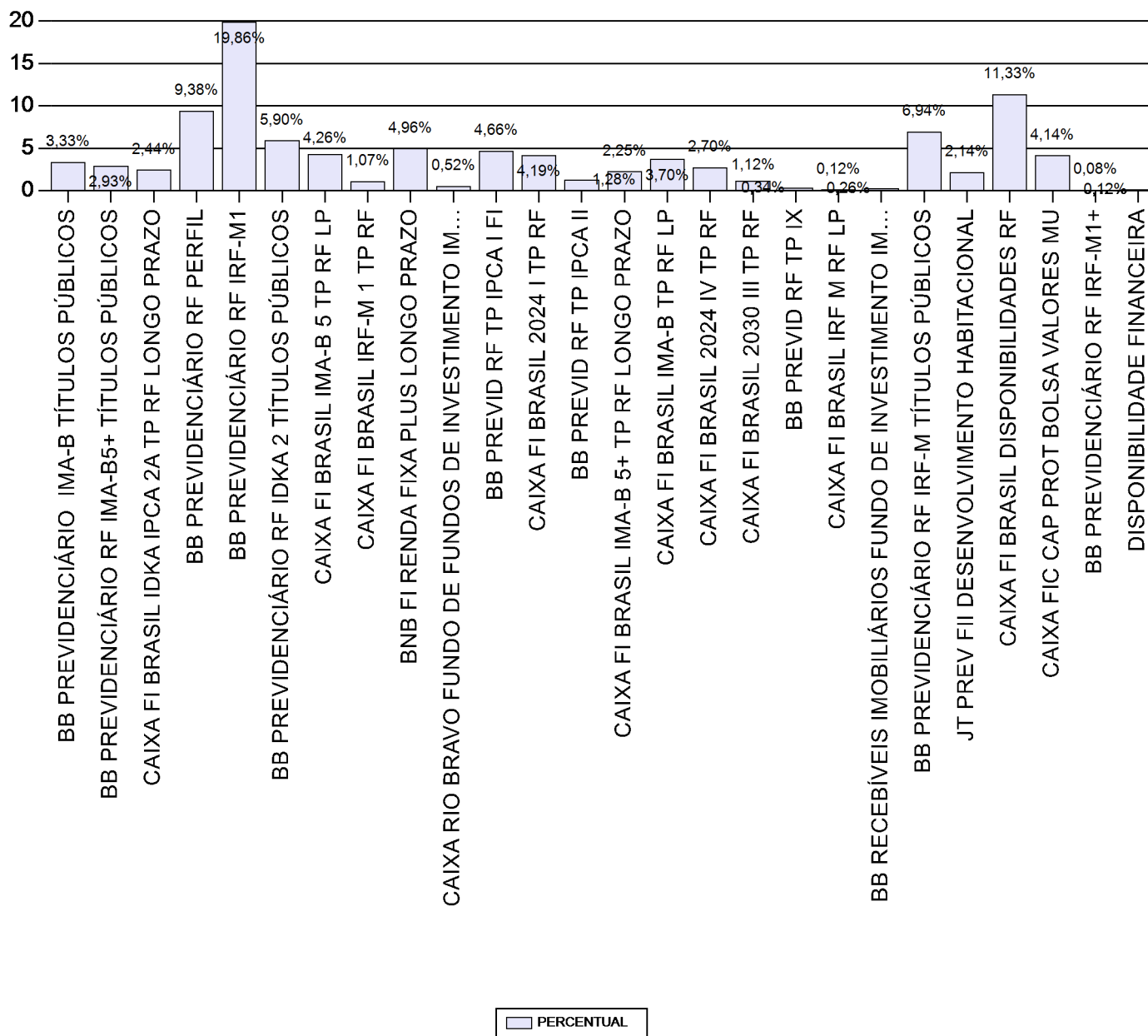


### PORTFÓLIO DE INVESTIMENTO 5/2020

APLICAÇÃO	SEGMENTO	%	QTD. COTAS/TÍTULOS	VALOR UNIT.	SALDO ATUAL
BB PREVIDENCIÁRIO IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS	RENTA FIXA	2,10	1.109.670,021951000	5,935353500	5.959.699,21
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS	RENTA FIXA	1,91	13.299.904,852664000	3,128232900	5.425.325,55
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LONGO PRAZO	RENTA FIXA	2,44	3.861.181,091476000	2,261596000	6.933.034,62
BB PREVIDENCIÁRIO IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS	RENTA FIXA	1,23	117.894,753423000	5,935353500	3.497.397,26
BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL	RENTA FIXA	1,42	1.640.837,735168000	2,272744930	4.030.662,85
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M1	RENTA FIXA	16,67	26.169.973,206900000	2,691460390	47.308.722,91
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS	RENTA FIXA	4,58	5.201.122,523873000	2,723443110	13.003.407,07
BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL	RENTA FIXA	7,96	11.714.422,880174000	2,272744930	22.586.528,35
CAIXA FI BRASIL IMA-B 5 TP RF LP	RENTA FIXA	4,25	6.780.757,220657000	3,054294000	12.072.043,39
CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	RENTA FIXA	0,22	372.484,409235000	2,577416000	615.366,52
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M1	RENTA FIXA	3,19	2.305.113,340929000	2,691460390	9.050.044,18
BNB FI RENDA FIXA PLUS LONGO PRAZO	RENTA FIXA	4,96	1.300.583,226024000	5,239551000	14.075.511,10
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FII	RENTA VARIÁVEL	0,52	1.500,000000000	988,284279530	1.482.426,41
BB PREVID RF TP IPCA I FI	RENTA FIXA	4,66	5.753.355,490582000	2,299145690	13.218.742,31
CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF	RENTA FIXA	4,19	6.688.211,384898000	1,699476000	11.896.332,00
BB PREVID RF TP IPCA II	RENTA FIXA	1,28	4.080.495,188592000	1,986401980	3.638.760,05
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS	RENTA FIXA	1,02	701.638,308280000	3,128232900	2.881.064,13
CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	RENTA FIXA	0,11	122.433,319050000	2,577416000	326.108,99
CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	RENTA FIXA	0,74	807.014,266322000	2,577416000	2.086.387,40
CAIXA FI BRASIL IMA-B 5+ TP RF LONGO PRAZO	RENTA FIXA	2,25	629.280,153293000	2,457271000	6.388.397,64
CAIXA FI BRASIL IMA-B TP RF LP	RENTA FIXA	3,67	2.836.989,363554000	3,349751000	10.421.285,51
CAIXA FI BRASIL 2024 IV TP RF	RENTA FIXA	2,70	4.668.022,278609000	1,534532000	7.672.660,00
CAIXA FI BRASIL 2030 III TP RF	RENTA FIXA	1,12	1.863.203,681425000	1,590188000	3.180.376,00
BB PREVID RF TP IX	RENTA FIXA	0,34	606.254,045411000	1,592279940	965.052,38
CAIXA FI BRASIL IRF M RF LP	RENTA FIXA	0,02	-1.990.163,803573000	2,299916000	42.635,18
CAIXA FI BRASIL IMA-B TP RF LP	RENTA FIXA	0,03	25.251,321483000	3,349751000	84.206,66
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FII	RENTA FIXA	0,26	10.000,000000000	73,106391100	731.063,91
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS	RENTA FIXA	1,32	1.374.479,838535000	2,723443110	3.743.317,65
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS	RENTA FIXA	5,83	2.755.553,591863000	6,002419990	16.538.761,08
CAIXA FI BRASIL IRF M RF LP	RENTA FIXA	0,10	128.615,988839000	2,299916000	295.516,61
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS	RENTA FIXA	1,11	524.880,049182000	6,002419990	3.150.550,50
JT PREV FII DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL	RENTA FIXA	2,14	48.676,866159000	124,513831460	6.060.698,03
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	RENTA FIXA	11,33	17.179.104,362763000	1,868535000	32.153.134,05
CAIXA FIC CAP PROT BOLSA VALORES MU	RENTA FIXA	4,14	9.903,198777000	1.176,103240000	11.748.152,40
CAIXA FI BRASIL IMA-B 5 TP RF LP	RENTA FIXA	0,01	5.011,903661000	3,054294000	15.464,28
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M1+	RENTA FIXA	0,08	202.727,659494000	1,159438980	235.050,35
<b>TOTAL INVESTIMENTOS</b>		<b>99,88</b>			<b>283.513.886,53</b>
<b>DISPONIBILIDADE FINANCEIRA</b>		<b>0,12</b>			<b>327.928,44</b>
<b>TOTAL GERAL</b>		<b>100,00</b>			<b>283.841.814,97</b>

## 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 %	66,65 %
Fundos de Índice Renda Fixa	RENDA FIXA	60,00 %	0,00 %	30,32 %
Fundos de Investimentos Imobiliário - FII	RENDA VARIÁVEL	5,00 %	5,00 %	0,52 %
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 %	2,14 %
<b>TOTAL</b>				<b>99,88 %</b>

**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 %	30,32 %	4.030.662,85
FIDICs Fundos de Investimentos em Direitos Creditórios - Abertos e Fechados	RENDA FIXA	5,00 %	0,00 %	0,26 %	731.063,91
Fundos de Renda Fixa	RENDA FIXA	60,00 %	0,00 %	2,14 %	6.060.698,03
<b>TOTAL</b>				<b>99,88 %</b>	

**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\$
<b>TOTAL</b>				<b>0,12 %</b>	

**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%
Março	286.582.013,19	3.870.031,12	3.499.992,20	-4.553.847,44	282.398.204,67	-1,59%	-0,81%	1,99%	-2,80%
Abril	282.398.204,67	5.989.430,90	5.815.146,25	1.617.267,49	284.189.756,81	0,57%	-0,23%	2,17%	-2,40%
Maior	284.189.756,81	2.350.536,20	3.631.648,33	2.792.903,76	285.701.548,44	0,99%	0,75%	2,27%	-1,52%

**Rentabilidade da Carteira**

