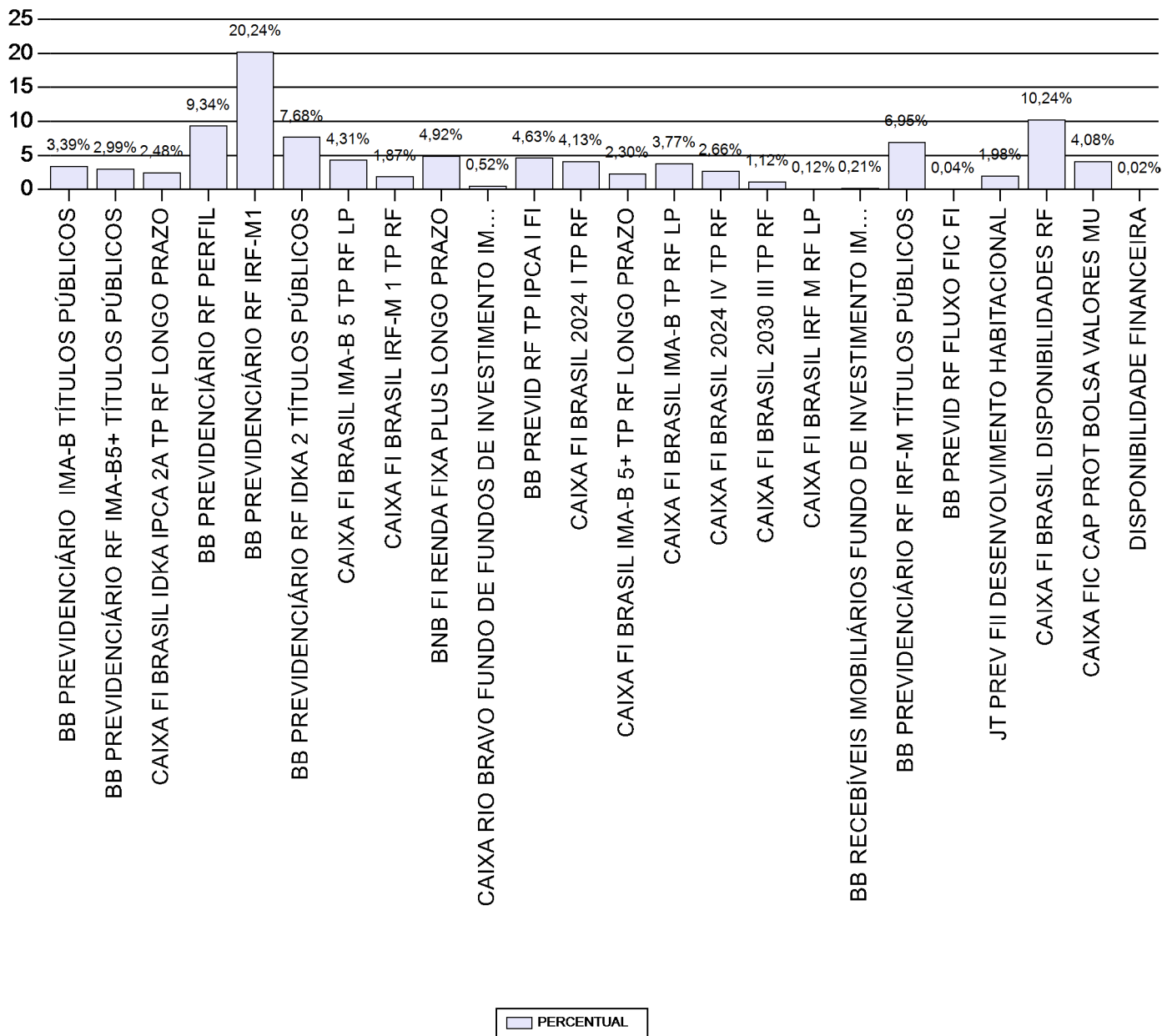




PORTFÓLIO DE INVESTIMENTO 9/2020

APLICAÇÃO	SEGMENTO	%	QTD. COTAS/TÍTULOS	VALOR UNIT.	SALDO ATUAL
BB PREVIDENCIÁRIO IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS	RENTA FIXA	2,14	1.109.670,021951000	6,105765190	6.130.809,90
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS	RENTA FIXA	1,95	13.299.904,852664000	3,234700030	5.609.972,56
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LONGO PRAZO	RENTA FIXA	2,48	3.861.181,091476000	2,326265000	7.131.280,65
BB PREVIDENCIÁRIO IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS	RENTA FIXA	1,25	117.894,753423000	6,105765190	3.597.812,07
BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL	RENTA FIXA	1,41	1.640.837,735168000	2,288721900	4.058.997,65
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M1	RENTA FIXA	16,60	26.180.315,866043000	2,708199450	47.630.961,19
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS	RENTA FIXA	6,34	6.920.396,253138000	2,800971920	18.189.215,15
BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL	RENTA FIXA	7,93	11.714.422,880174000	2,288721900	22.745.307,41
CAIXA FI BRASIL IMA-B 5 TP RF LP	RENTA FIXA	4,30	6.780.757,220657000	3,125142000	12.352.068,85
CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	RENTA FIXA	0,22	372.484,409235000	2,596282000	619.870,84
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M1	RENTA FIXA	3,65	2.807.159,402236000	2,708199450	10.465.970,20
BNB FI RENDA FIXA PLUS LONGO PRAZO	RENTA FIXA	4,92	1.300.583,226024000	5,259040000	14.127.866,28
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FII	RENTA VARIÁVEL	0,52	1.500,000000000	99,119008190	1.486.785,12
BB PREVID RF TP IPCA I FI	RENTA FIXA	4,63	5.610.343,120014000	2,368878690	13.280.887,31
CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF	RENTA FIXA	4,13	6.688.211,384898000	1,694241000	11.859.687,00
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS	RENTA FIXA	1,04	701.638,308280000	3,234700030	2.979.119,05
CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	RENTA FIXA	0,56	617.942,012530000	2,596282000	1.617.688,46
CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	RENTA FIXA	1,09	1.203.897,320635000	2,596282000	3.133.550,25
CAIXA FI BRASIL IMA-B 5+ TP RF LONGO PRAZO	RENTA FIXA	2,30	629.280,153293000	2,543178000	6.611.738,11
CAIXA FI BRASIL IMA-B TP RF LP	RENTA FIXA	3,74	2.836.989,363554000	3,448124000	10.727.330,10
CAIXA FI BRASIL 2024 IV TP RF	RENTA FIXA	2,66	4.668.022,278609000	1,529417000	7.647.085,00
CAIXA FI BRASIL 2030 III TP RF	RENTA FIXA	1,12	1.863.203,681425000	1,604726000	3.209.452,00
CAIXA FI BRASIL IRF M RF LP	RENTA FIXA	0,01	-1.990.163,803573000	2,310524000	42.831,83
CAIXA FI BRASIL IMA-B TP RF LP	RENTA FIXA	0,03	25.251,321483000	3,448124000	86.679,57
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FII	RENTA FIXA	0,21	10.000,000000000	60,429370900	604.293,71
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS	RENTA FIXA	1,34	1.374.479,838535000	2,800971920	3.849.879,43
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS	RENTA FIXA	5,85	2.783.343,577364000	6,027865600	16.776.386,92
CAIXA FI BRASIL IRF M RF LP	RENTA FIXA	0,10	128.615,988839000	2,310524000	296.879,63
BB PREVID RF FLUXO FIC FI	RENTA FIXA	0,04	55.996,066443000	2,109652250	125.068,72
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS	RENTA FIXA	1,10	524.880,049182000	6,027865600	3.163.906,39
JT PREV FII DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL	RENTA FIXA	1,98	48.676,866159000	116,587572410	5.674.888,18
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	RENTA FIXA	10,24	15.629.607,466126000	1,876739000	29.384.413,96
CAIXA FIC CAP PROT BOLSA VALORES MU	RENTA FIXA	4,08	9.903,198777000	1.173,041853000	11.717.572,05
CAIXA FI BRASIL IMA-B 5 TP RF LP	RENTA FIXA	0,01	5.011,903661000	3,125142000	15.822,99
TOTAL INVESTIMENTOS		99,98			286.952.078,53
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA		0,02			52.622,98
TOTAL GERAL		100,00			287.004.701,51

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 %	68,10 %
Fundos de Índice Renda Fixa	RENDA FIXA	60,00 %	0,00 %	29,17 %
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 %	0,21 %
Fundos de Renda Fixa	RENDA FIXA	60,00 %	0,00 %	1,98 %
TOTAL				99,98 %

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

TIPO	SEGMENTO	RESOLUÇÃO	P.A.I	ALOCAÇÃO	DESENQUADRAMENTO R\$
Fundos de Índice Renda Fixa	RENDA FIXA	60,00 %	0,00 %	29,17 %	4.058.997,65
FIDICs Fundos de Investimentos em Direitos Creditórios - Abertos e Fechados	RENDA FIXA	5,00 %	0,00 %	0,21 %	604.293,71
Fundos de Renda Fixa	RENDA FIXA	60,00 %	0,00 %	1,98 %	5.674.888,18
TOTAL				99,98 %	

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

TIPO	SEGMENTO	RESOLUÇÃO	P.A.I	ALOCAÇÃO	DESENQUADRAMENTO R\$
TOTAL				0,02 %	

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%
Mai	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%
Junho	285.701.548,44	6.826.799,07	8.983.096,78	2.259.568,97	285.804.819,70	0,80%	1,55%	3,02%	-1,47%
Julho	285.804.819,70	3.218.190,04	1.648.219,59	3.244.033,10	290.618.823,25	1,13%	2,68%	3,87%	-1,19%
Agosto	290.618.823,25	5.034.574,21	4.369.698,78	-894.408,04	290.389.290,64	-0,31%	2,37%	4,59%	-2,22%
Setembro	290.389.290,64	7.626.487,25	7.551.083,57	-1.324.953,88	289.139.740,44	-0,46%	1,92%	5,72%	-3,80%

Rentabilidade da Carteira

