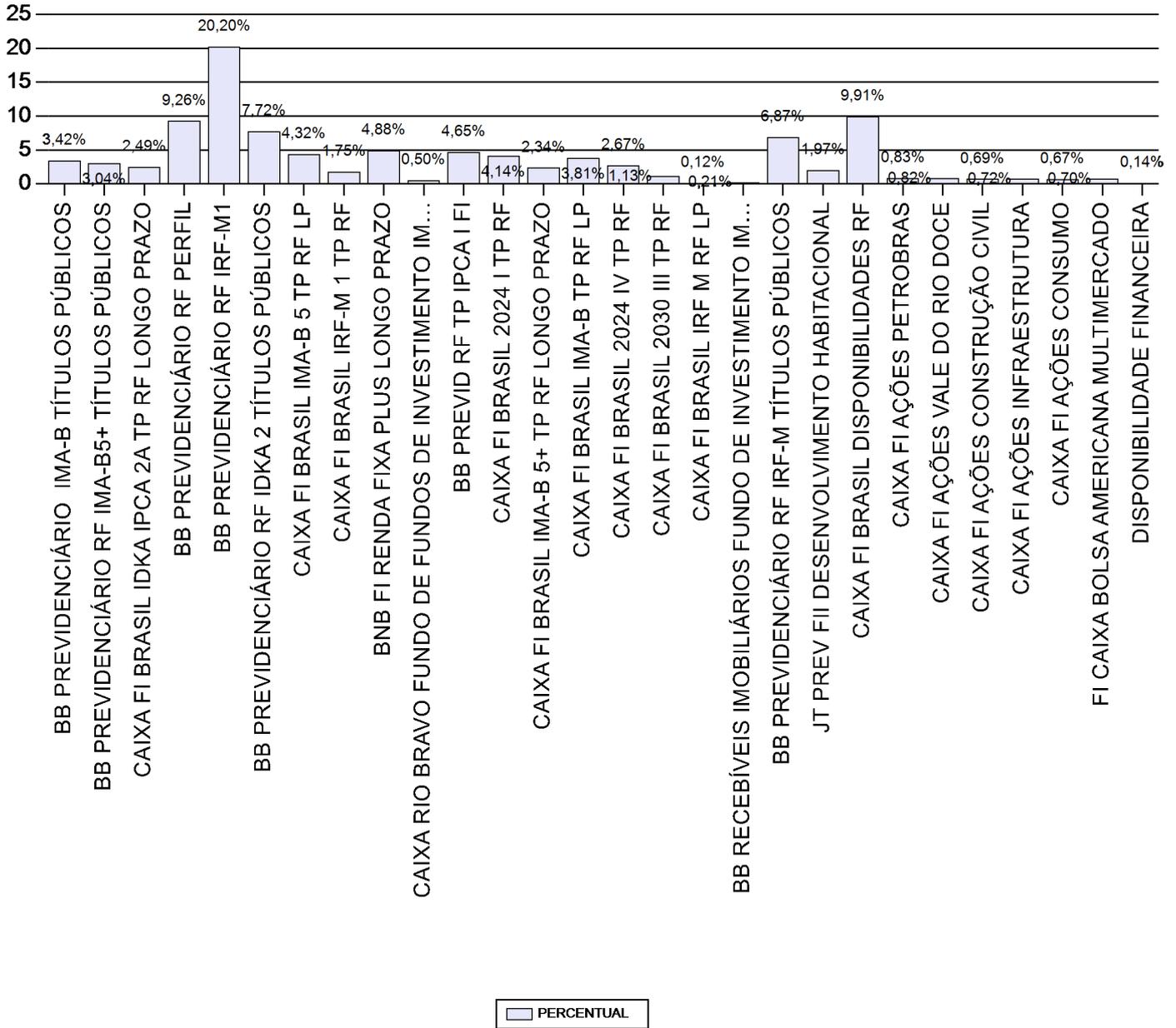




PORTFÓLIO DE INVESTIMENTO 11/2020

APLICAÇÃO	SEGMENTO	%	QTD. COTAS/TÍTULOS	VALOR UNIT.	SALDO ATUAL
BB PREVIDENCIÁRIO IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS	RENTA FIXA	2,16	1.109.670,021951000	6,239655600	6.265.249,51
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS	RENTA FIXA	1,98	13.299.904,852664000	3,322167830	5.761.668,83
CAIXA FI BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LONGO PRAZO	RENTA FIXA	2,49	3.861.181,091476000	2,358194000	7.229.160,57
BB PREVIDENCIÁRIO IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS	RENTA FIXA	1,27	117.894,753423000	6,239655600	3.676.706,78
BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL	RENTA FIXA	1,40	1.640.837,735168000	2,295989390	4.071.886,38
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M1	RENTA FIXA	16,50	26.231.786,093282000	2,716625010	47.918.972,52
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS	RENTA FIXA	6,37	6.920.396,253138000	2,847833200	18.493.527,36
BB PREVIDENCIÁRIO RF PERFIL	RENTA FIXA	7,86	11.714.422,880174000	2,295989390	22.817.531,69
CAIXA FI BRASIL IMA-B 5 TP RF LP	RENTA FIXA	4,32	6.780.757,220657000	3,171126000	12.533.819,81
CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	RENTA FIXA	0,21	372.484,409235000	2,605598000	622.095,07
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M1	RENTA FIXA	3,70	2.892.818,283193000	2,716625010	10.731.438,09
BNB FI RENDA FIXA PLUS LONGO PRAZO	RENTA FIXA	4,88	1.300.583,226024000	5,272717000	14.164.608,12
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FII	RENTA VARIÁVEL	0,50	1.500,000000000	96,994048400	1.454.910,72
BB PREVID RF TP IPCA I FI	RENTA FIXA	4,65	5.610.343,120014000	2,408732480	13.504.323,69
CAIXA FI BRASIL 2024 I TP RF	RENTA FIXA	4,14	6.688.211,384898000	1,717414000	12.021.898,00
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5+ TÍTULOS PÚBLICOS	RENTA FIXA	1,05	701.638,308280000	3,322167830	3.059.675,82
CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	RENTA FIXA	0,46	504.452,842534000	2,605598000	1.327.563,42
CAIXA FI BRASIL IRF-M 1 TP RF	RENTA FIXA	1,08	1.203.897,320635000	2,605598000	3.144.794,09
CAIXA FI BRASIL IMA-B 5+ TP RF LONGO PRAZO	RENTA FIXA	2,34	629.280,153293000	2,614102000	6.796.125,88
CAIXA FI BRASIL IMA-B TP RF LP	RENTA FIXA	3,78	2.836.989,363554000	3,523495000	10.961.814,00
CAIXA FI BRASIL 2024 IV TP RF	RENTA FIXA	2,67	4.668.022,278609000	1,550354000	7.751.770,00
CAIXA FI BRASIL 2030 III TP RF	RENTA FIXA	1,13	1.863.203,681425000	1,646020000	3.292.040,00
CAIXA FI BRASIL IRF M RF LP	RENTA FIXA	0,01	-1.990.163,803573000	2,309844000	42.819,22
CAIXA FI BRASIL IMA-B TP RF LP	RENTA FIXA	0,03	25.251,321483000	3,523495000	88.574,27
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FUNDO DE INVESTIMENTO IMOBILIÁRIO - FII	RENTA FIXA	0,21	10.000,000000000	62,206040200	622.060,42
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS	RENTA FIXA	1,35	1.374.479,838535000	2,847833200	3.914.289,32
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS	RENTA FIXA	5,78	2.783.343,577364000	6,029505220	16.780.950,19
CAIXA FI BRASIL IRF M RF LP	RENTA FIXA	0,10	128.615,988839000	2,309844000	296.792,26
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS	RENTA FIXA	1,09	524.880,049182000	6,029505220	3.164.767,00
JT PREV FII DESENVOLVIMENTO HABITACIONAL	RENTA FIXA	1,97	48.676,866159000	117,672218460	5.727.683,22
CAIXA FI BRASIL DISPONIBILIDADES RF	RENTA FIXA	9,91	15.281.083,915845000	1,879916000	28.782.781,44
CAIXA FI BRASIL IMA-B 5 TP RF LP	RENTA FIXA	0,01	5.011,903661000	3,171126000	16.055,81
CAIXA FI AÇÕES PETROBRAS	RENTA VARIÁVEL	0,83	0,000000000	7,827725000	2.418.494,77
CAIXA FI AÇÕES VALE DO RIO DOCE	RENTA VARIÁVEL	0,82	105.339,350182000	23,774947000	2.389.312,04
CAIXA FI AÇÕES CONSTRUÇÃO CIVIL	RENTA VARIÁVEL	0,69	0,000000000	1,652548000	2.002.525,60
CAIXA FI AÇÕES INFRAESTRUTURA	RENTA VARIÁVEL	0,72	0,000000000	1,821310000	2.098.877,71
CAIXA FI AÇÕES CONSUMO	RENTA VARIÁVEL	0,67	0,000000000	2,021613000	1.951.957,25
FI CAIXA BOLSA AMERICANA MULTIMERCADO	RENTA VARIÁVEL	0,70	0,000000000	1,291654000	2.039.308,62
TOTAL INVESTIMENTOS		99,86			289.938.829,49
DISPONIBILIDADE FINANCEIRA		0,14			397.681,86
TOTAL GERAL		100,00			290.336.511,35

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 %	64,03 %
Fundos de Índice Renda Fixa	RENDA FIXA	60,00 %	0,00 %	28,71 %
Fundos de Investimentos Imobiliário - FII	RENDA VARIÁVEL	5,00 %	5,00 %	0,50 %
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 %	1,97 %
Fundo de Investimentos em Ações - FIA	RENDA VARIÁVEL	20,00 %	0,00 %	3,74 %
Fundo Multimercado - FIM	RENDA VARIÁVEL	10,00 %	10,00 %	0,70 %
TOTAL				99,86 %

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 %	28,71 %	4.071.886,38
FIDICs Fundos de Investimentos em Direitos Creditórios - Abertos e Fechados	RENDA FIXA	5,00 %	0,00 %	0,21 %	622.060,42
Fundos de Renda Fixa	RENDA FIXA	60,00 %	0,00 %	1,97 %	5.727.683,22
Fundo de Investimentos em Ações - FIA	RENDA VARIÁVEL	20,00 %	0,00 %	3,74 %	2.418.494,77
TOTAL				99,86 %	

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				0,14 %	

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%
Outubro	289.139.740,44	24.835.654,49	26.335.847,47	-549.117,98	287.090.429,48	-0,19%	1,73%	7,07%	-5,34%
Novembro	287.090.429,48	3.588.397,35	2.790.726,11	4.238.390,68	292.126.491,40	1,47%	3,20%	8,44%	-5,24%

Rentabilidade da Carteira

—■— RENTABILIDADE ACUMULADA
—●— META ATUARIAL

