

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos												
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	Ano	Cotização Aplic/Resg	Valor(R\$) (31/08/2020)	% Carteira	Limite % Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo	Limite % PL Fundo
Renda Fixa												
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP FIC FI	4,92%	0,37%	4,46%	D0/D+1	860.489,02	2,84%	100%	4.251.005.212,54	0,02%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA III FI	4,08%	0,42%	3,69%	D0/D0	1.291.217,41	4,26%	100%	570.737.914,69	0,23%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	6,12%	-0,89%	2,63%	D0/D0	4.001.152,10	13,21%	100%	10.897.747.304,90	0,04%	15%
CAIXA	CAIXA	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	5,93%	-0,56%	5,06%	D0/D0	2.626.918,61	8,67%	100%	13.462.808.031,45	0,02%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5+ TP FI	19,35%	-3,69%	-2,23%	D0/D+2	875.928,57	2,89%	100%	1.987.566.192,50	0,04%	15%
SANTANDER Gest Rec	Banco SANTANDER	SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TIT PUB RF	4,97%	0,40%	4,52%	D0/D0	171.943,97	0,57%	100%	1.118.420.367,89	0,02%	15%
SANTANDER Gest Rec	Banco SANTANDER	SANTANDER FIC FI IMA-B INST TIT PUB RF LP	12,59%	-1,82%	0,38%	D0/D0	865.788,62	2,86%	100%	1.145.871.824,82	0,08%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M 1 TP FIC FI	0,54%	0,09%	2,78%	D0/D0	104.564,74	0,35%	100%	7.749.783.927,00	0,00%	15%
SANTANDER Gest Rec	Banco SANTANDER	SANTANDER FIC FI IMA-B TIT PUB RF LP	12,59%	-1,85%	0,18%	D0/D0	878.396,02	2,90%	100%	15.190.423,72	5,78%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI	12,54%	-1,85%	0,64%	D0/D+1	6.732.728,75	22,22%	100%	5.638.549.883,16	0,12%	15%
SANTANDER Gest Rec	Banco SANTANDER	SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TP RF	0,53%	0,07%	2,63%	D0/D0	522.977,37	1,73%	100%	116.121.113,59	0,45%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	4,12%	0,69%	4,43%	D0/D+1	418.855,09	1,38%	100%	6.452.433.505,43	0,01%	15%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - FI 100% Títulos TN							19.350.960,25	63,88%				
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,07%	0,09%	1,55%	D0/D0	2.527,92	0,01%	20%	496.713.163,83	0,00%	15%
SANTANDER Gest Rec	Banco SANTANDER	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL RF	0,98%	0,22%	2,00%	D0/D0	2.527.748,62	8,34%	20%	448.079.296,05	0,56%	15%
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - FI Renda Fixa - Geral							2.530.276,54	8,35%				
Sub-total Renda Fixa							21.881.236,78	72,23%				
Renda Variável												
CAIXA	CAIXA	FI AÇÕES CAIXA BRASIL IBX-50	44,80%	-3,25%	-14,62%	D+1/D+1	0,00	0,00%	30%	1.002.237.416,93	0,00%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES GOVERNANÇA FI	44,14%	-3,27%	-14,47%	D+1/D+1	684.231,86	2,26%	30%	942.280.344,59	0,07%	15%
SANTANDER Gest Rec	Banco SANTANDER	SANTANDER FI IBOVESPA ATIVO INSTIT AÇÕES	44,48%	-2,91%	-17,75%	D+1/D+1	727.384,39	2,40%	30%	806.876.353,28	0,09%	15%
CAIXA	CAIXA	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	43,48%	-3,43%	-14,10%	D+1/D+1	931.996,15	3,08%	30%	683.983.509,09	0,14%	15%
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a - FI de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações							2.343.612,39	7,74%				
CAIXA	CAIXA	CAIXA FI AÇÕES DIVIDENDOS	38,54%	-6,01%	-22,50%	D+1/D+1	1.612.507,31	5,32%	20%	270.846.204,75	0,60%	15%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos												
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	Ano	Cotização Aplic/Resg	Valor(R\$) (31/08/2020)	% Carteira	Limite % Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo	Limite % PL Fundo
CAIXA	CAIXA	CAIXA FIA CONSTRUÇÃO CIVIL	59,91%	-7,99%	-31,42%	D+1/D+1	400.737,98	1,32%	20%	529.350.277,83	0,08%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIARIO AÇÕES VALOR FIC FIA	40,49%	-3,55%	-16,80%	D+1/D+30	416.008,66	1,37%	20%	901.803.096,40	0,05%	15%
CAIXA	CAIXA	CAIXA FI AÇÕES SMALL CAPS ATIVO	47,51%	-1,38%	-15,36%	D+1/D+1	1.366.797,64	4,51%	20%	1.226.260.606,95	0,11%	15%
CAIXA	CAIXA	CAIXA FI AÇÕES INFRAESTRUTURA	46,68%	-3,66%	-12,31%	D+1/D+1	1.333.812,90	4,40%	20%	523.396.542,73	0,25%	15%
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a - FI de Ações - Geral							5.129.864,49	16,93%				
Sub-total Renda Variável							7.473.476,88	24,67%				
Investimentos no Exterior												
CAIXA	CAIXA	CAIXA FIA INSTITUCIONAL BDR NIVEL I	27,07%	15,16%	55,87%	D+1/D+1	939.435,59	3,10%	10%	1.583.297.843,04	0,06%	15%
Sub-total Artigo 9 A III - Fundo de Ações BDR Nível 1							939.435,59	3,10%				
Sub-total Investimentos no Exterior							939.435,59	3,10%				
Total							30.294.149,26	100%				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

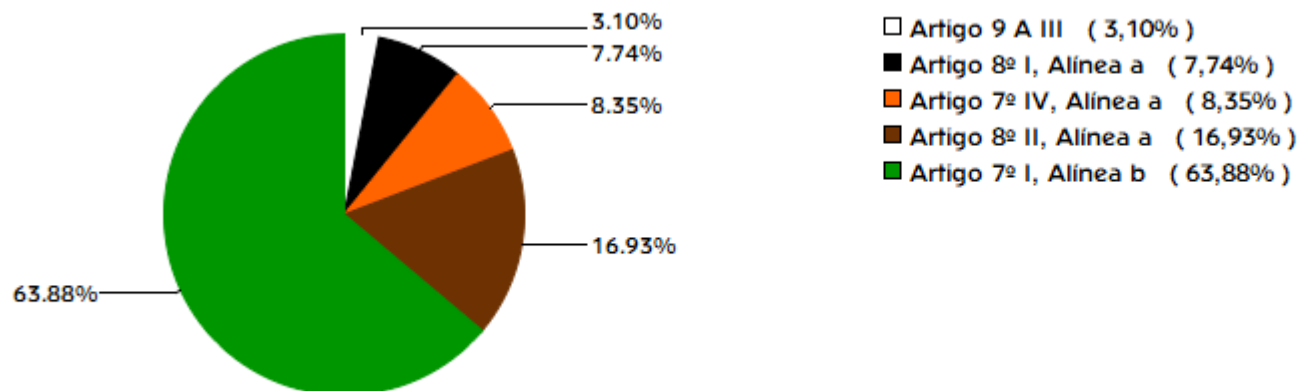
Enquadramento da Carteira					
Artigo	Classe	Valor(R\$)	% Carteira	Politica Investimento	Limite Res. 3.922/2010
Renda Fixa					
Artigo 7º I, Alínea b	FI 100% Títulos TN	19.350.960,25	63,88%	48,00%	100,00%
Artigo 7º IV, Alínea a	FI Renda Fixa - Geral	2.530.276,54	8,35%	2,00%	40,00%
Total Renda Fixa		21.881.236,78	72,23%		
Renda Variável					
Artigo 8º I, Alínea a	FI de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações	2.343.612,39	7,74%	6,00%	30,00%
Artigo 8º II, Alínea a	FI de Ações - Geral	5.129.864,49	16,93%	20,00%	20,00%
Total Renda Variável		7.473.476,88	24,67%		
Investimentos no Exterior					
Artigo 9 A III	Fundo de Ações BDR Nível 1	939.435,59	3,10%	10,00%	10,00%
Total Investimentos no Exterior		939.435,59	3,10%		

Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)				
Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	-1,15 -711,9	2,49 117,0	-- --	-- --
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,22 136,5	2,00 94,0	-- --	-- --
Artigo 8º I, Alínea a % do CDI	-3,16 -1.965,7	-14,99 -705,3	-- --	-- --
Artigo 8º II, Alínea a % do CDI	-4,17 -2.590,5	-18,30 -861,1	-- --	-- --
Artigo 9 A III Var. Dolar Comercial p.p	15,16 10,0	55,87 20,1	-- --	-- --

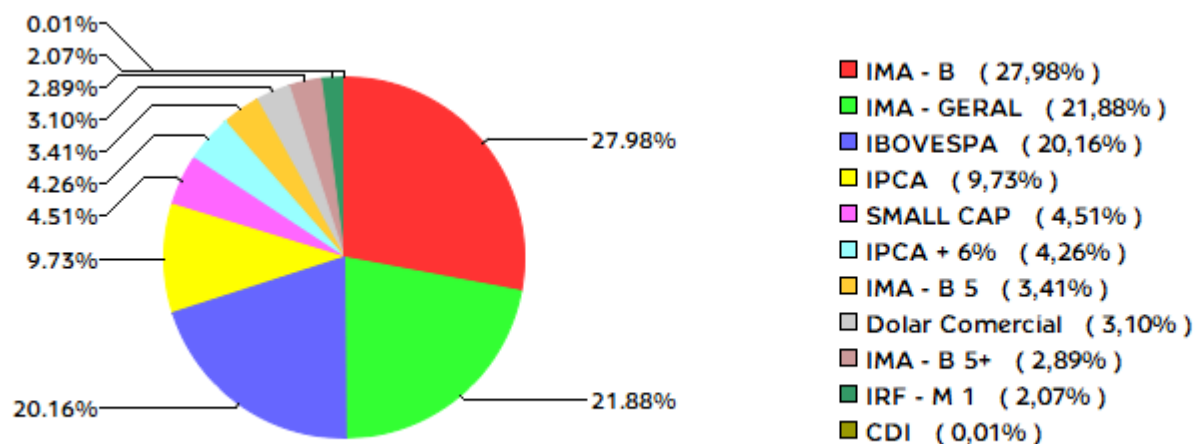
Ganhos Financeiros	
Estratégia	Ganho Bruto (R\$)
Artigo 7º I, Alínea b	-247.349,60
Artigo 7º IV, Alínea a	4.089,96
Artigo 8º I, Alínea a	-82.965,35
Artigo 8º II, Alínea a	-223.068,40
Artigo 9 A III	123.689,71
Total	-425.603,68

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia

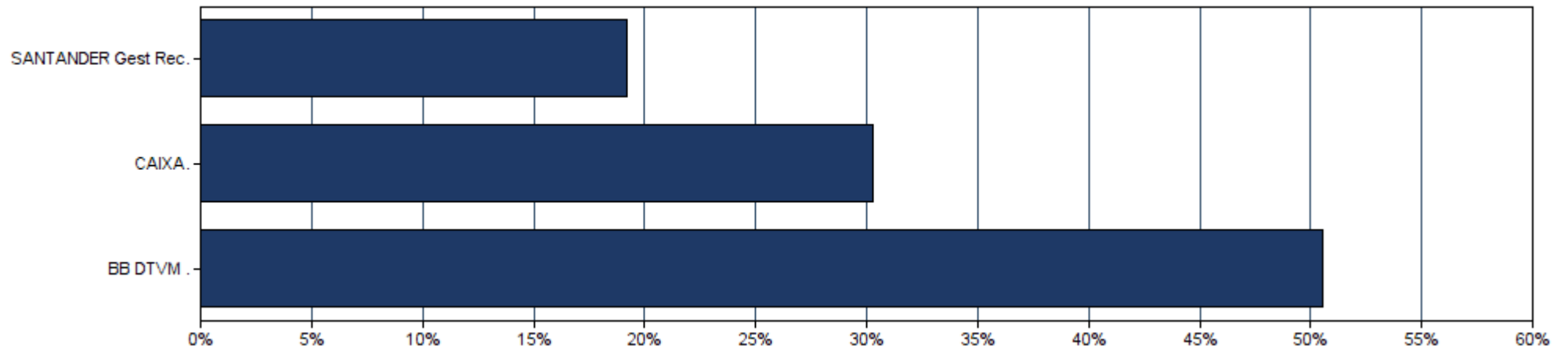


Indexadores



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

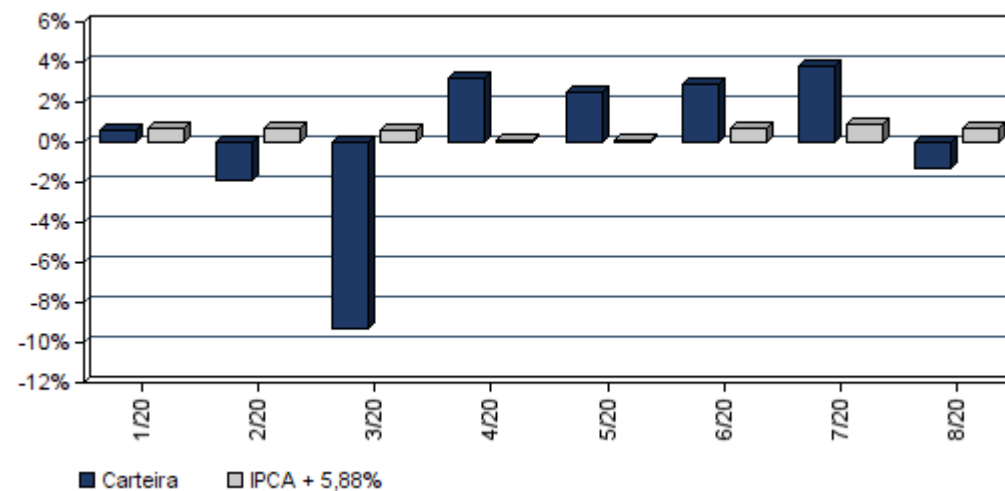
Rentabilidades da Carteira

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
2020	0,57	-1,92	-9,27	3,24	2,48	2,90	3,81	-1,31	--	--	--	--	-0,18
IPCA + 5,88%	0,71	0,66	0,57	0,14	0,07	0,74	0,88	0,72	--	--	--	--	4,59
p.p. Indx	-0,14	-2,58	-9,84	3,09	2,41	2,16	2,92	-2,02	--	--	--	--	-4,76

Evolução da Rentabilidade



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Análise de Risco / Retorno da Carteira

	Qtd.	Perct.	Período	Rentabilidade (%)			Volat. Anual
				Carteira	IPCA + 5,88%	p.p. Indx.	
Meses acima do Benchmark	4	50,0%					
Meses abaixo do Benchmark	4	50,0%					
	Rentab.	Mês					
Maior rentabilidade da Carteira	3,81%	jul/20	03 meses	5,43	2,36	3,1	7,537
Menor rentabilidade da Carteira	-9,27%	mar/20	06 meses	1,20	3,17	-2,0	18,666
			12 meses	--	--	--	--
			24 meses	--	--	--	--
			36 meses	--	--	--	--
			Desde o início	-0,18	4,59	-4,8	16,675

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 PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP FIC FI Var. do IMA-B 5 p.p.	0,37 -0,06	4,46 -0,17	2,43 -0,13	3,21 -0,18	4,46 -0,17	4,46 -0,17	4,46 -0,17
BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA III FI Var. do IPCA + 6% p.p.	0,42 -0,30	3,69 -0,97	2,25 -0,14	2,69 -0,53	3,69 -0,97	3,69 -0,97	3,69 -0,97
BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI Var. do IMA-GERAL TOTAL p.p.	-0,89 -0,29	2,63 -0,39	1,82 -0,31	1,67 -0,32	2,63 -0,39	2,63 -0,39	2,63 -0,39
CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF Var. do IMA-GERAL TOTAL p.p.	-0,56 0,04	5,06 2,04	1,17 -0,96	3,57 1,58	5,06 2,04	5,06 2,04	5,06 2,04
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5+ TP FI Var. do IMA-B 5+ p.p.	-3,69 -0,07	-2,23 -0,22	6,21 -0,16	-2,57 -0,22	-2,23 -0,22	-2,23 -0,22	-2,23 -0,22
SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TIT PUB RF Var. do IMA-B 5 p.p.	0,40 -0,02	4,52 -0,11	2,47 -0,09	3,32 -0,08	4,52 -0,11	4,52 -0,11	4,52 -0,11
SANTANDER FIC FI IMA-B INST TIT PUB RF LP Var. do IMA-B TOTAL p.p.	-1,82 -0,03	0,38 -0,43	4,51 -0,10	-0,29 -0,38	0,38 -0,43	0,38 -0,43	0,38 -0,43
BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M 1 TP FIC FI Var. do IRF-M 1 p.p.	0,09 -0,03	2,78 -0,18	0,58 -0,06	1,99 -0,13	2,78 -0,18	2,78 -0,18	2,78 -0,18

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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
SANTANDER FIC FI IMA-B TIT PUB RF LP Var. do IMA-B TOTAL p.p.	-1,85 -0,05	0,18 -0,63	4,43 -0,18	-0,44 -0,53	0,18 -0,63	0,18 -0,63	0,18 -0,63
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI Var. do IMA-B TOTAL p.p.	-1,85 -0,06	0,64 -0,17	4,50 -0,11	-0,06 -0,15	0,64 -0,17	0,64 -0,17	0,64 -0,17
SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TP RF Var. do IRF-M 1 p.p.	0,07 -0,05	2,63 -0,33	0,53 -0,11	1,88 -0,25	2,63 -0,33	2,63 -0,33	2,63 -0,33
BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2 Var. do IPCA p.p.	0,69 0,45	4,43 3,73	2,73 1,87	3,38 3,14	4,43 3,73	4,43 3,73	4,43 3,73
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI	0,09 56,28	1,55 72,91	0,35 61,57	1,01 70,01	1,55 72,91	1,55 72,91	1,55 72,91
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL RF Var. do IPCA p.p.	0,22 -0,02	2,00 1,30	0,95 0,09	1,38 1,14	2,00 1,30	2,00 1,30	2,00 1,30
FI AÇÕES CAIXA BRASIL IBX-50 Var. do IBRX 50 p.p.	-3,25 0,16	-14,62 -0,52	14,57 0,37	-4,97 -0,82	-14,62 -0,52	-14,62 -0,52	-14,62 -0,52
BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES GOVERNANÇA FI Var. do IBOVESPA p.p.	-3,27 0,18	-14,47 -0,11	14,23 0,54	-5,10 -0,49	-14,47 -0,11	-14,47 -0,11	-14,47 -0,11
SANTANDER FI IBOVESPA ATIVO INSTIT AÇÕES Var. do IBOVESPA p.p.	-2,91 0,54	-17,75 -3,67	13,62 -0,07	-8,74 -4,13	-17,75 -3,67	-17,75 -3,67	-17,75 -3,67
FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA Var. do IBOVESPA p.p.	-3,43 0,01	-14,10 -0,03	13,42 -0,27	-4,74 -0,13	-14,10 -0,03	-14,10 -0,03	-14,10 -0,03
CAIXA FI AÇÕES DIVIDENDOS Var. do IBOVESPA p.p.	-6,01 -2,57	-22,50 -8,42	0,60 -13,09	-16,67 -12,06	-22,50 -8,42	-22,50 -8,42	-22,50 -8,42
CAIXA FIA CONSTRUÇÃO CIVIL Var. do IBOVESPA p.p.	-7,99 -4,55	-31,42 -17,35	16,26 2,57	-25,94 -21,33	-31,42 -17,35	-31,42 -17,35	-31,42 -17,35
BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES VALOR FIC FIA Var. do IBOVESPA p.p.	-3,55 -0,11	-16,80 -2,44	10,23 -3,46	-6,32 -1,71	-16,80 -2,44	-16,80 -2,44	-16,80 -2,44
CAIXA FI AÇÕES SMALL CAPS ATIVO Var. do Índice Small Cap - SMLL p.p.	-1,38 -0,15	-15,36 -1,09	21,66 -2,10	-7,86 -0,90	-15,36 -1,09	-15,36 -1,09	-15,36 -1,09
CAIXA FI AÇÕES INFRAESTRUTURA Var. do IBOVESPA p.p.	-3,66 -0,21	-12,31 1,76	12,41 -1,28	-4,54 0,07	-12,31 1,76	-12,31 1,76	-12,31 1,76

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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
CAIXA FIA INSTITUCIONAL BDR NIVEL I Var. do Dolar Comercial p.p.	15,16 10,01	55,87 20,12	22,45 21,62	55,15 33,53	55,87 20,12	55,87 20,12	55,87 20,12
CDI	0,16	2,12	0,57	1,44	3,88	10,40	17,95
IMA - B	-1,80	0,80	4,61	0,09	6,64	36,00	42,20
IMA - B 5	0,43	4,63	2,55	3,39	9,24	25,01	33,33
IMA - B 5+	-3,62	-2,01	6,38	-2,35	4,71	44,71	48,51
IMA - GERAL	-0,60	3,02	2,13	1,99	6,51	23,37	30,91
IRF - M	-0,75	5,20	1,11	3,62	8,70	26,82	34,34
IRF - M 1	0,12	2,96	0,64	2,12	5,06	12,83	20,62
IRF - M 1+	-1,13	6,37	1,36	4,37	10,64	33,26	40,58
IBOVESPA	-3,44	-14,07	13,69	-4,61	-1,75	29,59	40,28
IFIX	1,79	-12,99	4,68	-6,13	4,72	30,04	33,50
SMALL CAP	-1,23	-14,27	23,76	-6,96	6,02	60,17	56,43
IPCA + 4,61%	0,62	3,75	2,04	2,54	7,16	15,88	26,26
IPCA + 4,81%	0,63	3,88	2,09	2,64	7,37	16,32	26,98
IPCA + 5,06%	0,65	4,05	2,15	2,76	7,62	16,88	27,89

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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
IPCA + 5,27%	0,67	4,19	2,21	2,87	7,84	17,34	28,65
IPCA + 5,43%	0,68	4,29	2,25	2,94	8,00	17,70	29,23
IPCA + 5,5%	0,69	4,34	2,27	2,98	8,07	17,85	29,49
IPCA + 5,54%	0,69	4,36	2,28	3,00	8,11	17,94	29,64
IPCA + 5,61%	0,70	4,41	2,29	3,03	8,19	18,10	29,89
IPCA + 5,67%	0,70	4,45	2,31	3,06	8,25	18,23	30,11
IPCA + 5,71%	0,70	4,47	2,32	3,08	8,29	18,32	30,26
IPCA + 5,74%	0,71	4,49	2,32	3,10	8,32	18,38	30,37
IPCA + 5,77%	0,71	4,51	2,33	3,11	8,35	18,45	30,48
IPCA + 5,78%	0,71	4,52	2,33	3,12	8,36	18,47	30,52
IPCA + 5,80%	0,71	4,53	2,34	3,13	8,38	18,52	30,59
IPCA + 5,81%	0,71	4,54	2,34	3,13	8,39	18,54	30,63
IPCA + 5,82%	0,71	4,55	2,34	3,14	8,40	18,56	30,66
IPCA + 5,83%	0,71	4,55	2,35	3,14	8,41	18,58	30,70
IPCA + 5,84%	0,72	4,56	2,35	3,15	8,42	18,61	30,74

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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
IPCA + 5,85%	0,72	4,57	2,35	3,15	8,43	18,63	30,77
IPCA + 5,86%	0,72	4,57	2,35	3,16	8,44	18,65	30,81
IPCA + 5,87%	0,72	4,58	2,36	3,16	8,45	18,67	30,85
IPCA + 5,88%	0,72	4,59	2,36	3,17	8,46	18,70	30,89
IPCA + 5,89%	0,72	4,59	2,36	3,17	8,47	18,72	30,92
IPCA + 6%	0,73	4,66	2,39	3,22	8,58	18,96	31,33
INPC + 4,61%	0,74	4,23	2,29	3,12	7,69	16,29	26,03
INPC + 4,81%	0,75	4,36	2,34	3,22	7,89	16,73	26,75
INPC + 5,06%	0,77	4,53	2,40	3,34	8,15	17,28	27,66
INPC + 5,27%	0,79	4,67	2,45	3,44	8,37	17,75	28,42
INPC + 5,43%	0,80	4,77	2,49	3,52	8,53	18,11	29,00
INPC + 5,54%	0,81	4,84	2,52	3,58	8,64	18,35	29,40
INPC + 5,61%	0,82	4,89	2,54	3,61	8,72	18,51	29,66
INPC + 5,67%	0,82	4,93	2,55	3,64	8,78	18,64	29,88
INPC + 5,71%	0,83	4,96	2,56	3,66	8,82	18,73	30,02

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

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
INPC + 5,74%	0,83	4,98	2,57	3,68	8,85	18,80	30,13
INPC + 5,77%	0,83	5,00	2,58	3,69	8,88	18,87	30,24
INPC + 5,78%	0,83	5,00	2,58	3,70	8,89	18,89	30,28
INPC + 5,80%	0,83	5,01	2,59	3,71	8,91	18,93	30,35
INPC + 5,81%	0,83	5,02	2,59	3,71	8,92	18,95	30,39
INPC + 5,82%	0,83	5,03	2,59	3,72	8,93	18,98	30,43
INPC + 5,83%	0,84	5,03	2,59	3,72	8,94	19,00	30,46
INPC + 5,84%	0,84	5,04	2,60	3,73	8,95	19,02	30,50
INPC + 5,85%	0,84	5,05	2,60	3,73	8,96	19,04	30,54
INPC + 5,86%	0,84	5,05	2,60	3,74	8,97	19,07	30,57
INPC + 5,87%	0,84	5,06	2,60	3,74	8,98	19,09	30,61
INPC + 5,88%	0,84	5,07	2,61	3,75	8,99	19,11	30,65
INPC + 5,89%	0,84	5,07	2,61	3,75	9,00	19,13	30,68
INPC + 6%	0,85	5,15	2,64	3,80	9,12	19,38	31,09