

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos												
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	Ano	Cotização Aplic/Resg	Valor(R\$) (28/02/2020)	% Carteira	Limite % Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo	Limite % PL Fundo
Renda Fixa												
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IRF-M 1 TP FIC FI	0,26%	0,35%	0,77%	D0/D0	1.620.855,74	3,91%	100%	7.492.585.716,79	0,02%	15%
SANTANDER Asset Management	Banco SANTANDER	SANTANDER FIC FI IMA-B TIT PUB RF LP	4,90%	0,41%	0,62%	D0/D0	882.277,24	2,13%	100%	15.077.500,84	5,85%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B TP FI	4,90%	0,44%	0,70%	D0/D+1	9.858.330,52	23,77%	100%	6.284.654.664,10	0,16%	15%
SANTANDER Asset Management	Banco SANTANDER	SANTANDER FIC FI IRF-M 1 TP RF	0,25%	0,33%	0,74%	D0/D0	100.937,52	0,24%	100%	171.482.770,26	0,06%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IDKA 2	1,50%	0,63%	1,02%	D0/D+1	3.011.489,07	7,26%	100%	6.830.764.502,36	0,04%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5+ TP FI	7,26%	0,30%	0,35%	D0/D+2	899.032,77	2,17%	100%	2.259.425.476,17	0,04%	15%
SANTANDER Asset Management	Banco SANTANDER	SANTANDER FIC FI IMA-B 5 TIT PUB RF	1,97%	0,62%	1,17%	D0/D0	663.513,96	1,60%	100%	1.191.923.039,46	0,06%	15%
SANTANDER Asset Management	Banco SANTANDER	SANTANDER FIC FI IMA-B INST TIT PUB RF LP	4,90%	0,43%	0,67%	D0/D0	794.010,34	1,91%	100%	1.413.979.781,38	0,06%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B 5 LP FIC FI	1,97%	0,65%	1,21%	D0/D+1	1.821.026,09	4,39%	100%	4.537.919.668,21	0,04%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF TP IPCA III FI	1,82%	0,55%	0,97%	D0/D0	1.991.237,67	4,80%	100%	880.076.235,05	0,23%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO RF ALOCAÇÃO ATIVA FIC FI	2,33%	0,46%	0,94%	D0/D0	5.814.009,63	14,02%	100%	10.908.803.618,87	0,05%	15%
CAIXA	CAIXA	CAIXA FIC BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RF	3,44%	0,62%	1,44%	D0/D0	2.536.456,19	6,12%	100%	10.626.779.468,55	0,02%	15%
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b - FI 100% Títulos TN							29.993.176,73	72,32%				
CAIXA	CAIXA	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,05%	0,23%	0,53%	D0/D0	2.502,64	0,01%	20%	455.022.894,33	0,00%	15%
SANTANDER Asset Management	Banco SANTANDER	SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL RF	0,21%	0,24%	0,61%	D0/D0	731.066,89	1,76%	20%	772.767.825,72	0,09%	15%
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a - FI Renda Fixa - Geral							733.569,53	1,77%				
Sub-total Renda Fixa							30.726.746,26	74,09%				
Renda Variável												
CAIXA	CAIXA	FI AÇÕES CAIXA BRASIL IBX-50	19,49%	-8,68%	-10,15%	D+1/D+1	1.055.688,84	2,55%	30%	1.204.220.398,60	0,09%	15%
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIÁRIO AÇÕES GOVERNANÇA FI	19,01%	-9,88%	-9,88%	D+1/D+1	720.966,33	1,74%	30%	843.490.895,18	0,09%	15%
SANTANDER Asset Management	Banco SANTANDER	SANTANDER FI IBOVESPA ATIVO INSTIT AÇÕES	19,25%	-8,98%	-9,87%	D+1/D+1	797.071,96	1,92%	30%	893.485.595,74	0,09%	15%
CAIXA	CAIXA	FIA CAIXA BRASIL IBOVESPA	19,17%	-8,30%	-9,83%	D+1/D+1	978.364,55	2,36%	30%	613.653.165,94	0,16%	15%
Sub-total Artigo 8º I, Alínea a - FI de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações							3.552.091,68	8,56%				
CAIXA	CAIXA	CAIXA FI AÇÕES DIVIDENDOS	17,10%	-8,37%	-6,99%	D+1/D+1	1.935.182,35	4,67%	20%	345.343.687,78	0,56%	15%

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos												
Gestor	Administrador	Ativos	Vol*	Mês	Ano	Cotização Aplic/Resg	Valor(R\$) (28/02/2020)	% Carteira	Limite % Carteira	PL do Fundo	% no PL do Fundo	Limite % PL Fundo
BB DTVM	BB DTVM	BB PREVIDENCIARIO AÇÕES VALOR FIC FIA	18,68%	-11,19%	-11,19%	D+1/D+30	444.060,01	1,07%	20%	798.991.874,74	0,06%	15%
CAIXA	CAIXA	CAIXA FIA CONSTRUÇÃO CIVIL	24,54%	-10,66%	-7,40%	D+1/D+1	541.077,51	1,30%	20%	974.243.337,57	0,06%	15%
CAIXA	CAIXA	CAIXA FI AÇÕES INFRAESTRUTURA	18,96%	-9,16%	-8,14%	D+1/D+1	1.397.233,93	3,37%	20%	615.683.381,90	0,23%	15%
CAIXA	CAIXA	CAIXA FI AÇÕES SMALL CAPS ATIVO	19,36%	-8,60%	-8,14%	D+1/D+1	1.483.322,60	3,58%	20%	1.542.999.030,98	0,10%	15%
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a - FI de Ações - Geral							5.800.876,39	13,99%				
Sub-total Renda Variável							9.352.968,07	22,55%				
Investimentos no Exterior												
CAIXA	CAIXA	CAIXA FIA INSTITUCIONAL BDR NIVEL I	16,34%	-5,69%	0,46%	D+1/D+1	1.392.604,56	3,36%	10%	866.229.995,42	0,16%	15%
Sub-total Artigo 9 A III - Fundo de Ações BDR Nível 1							1.392.604,56	3,36%				
Sub-total Investimentos no Exterior							1.392.604,56	3,36%				
Total							41.472.318,89	100%				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

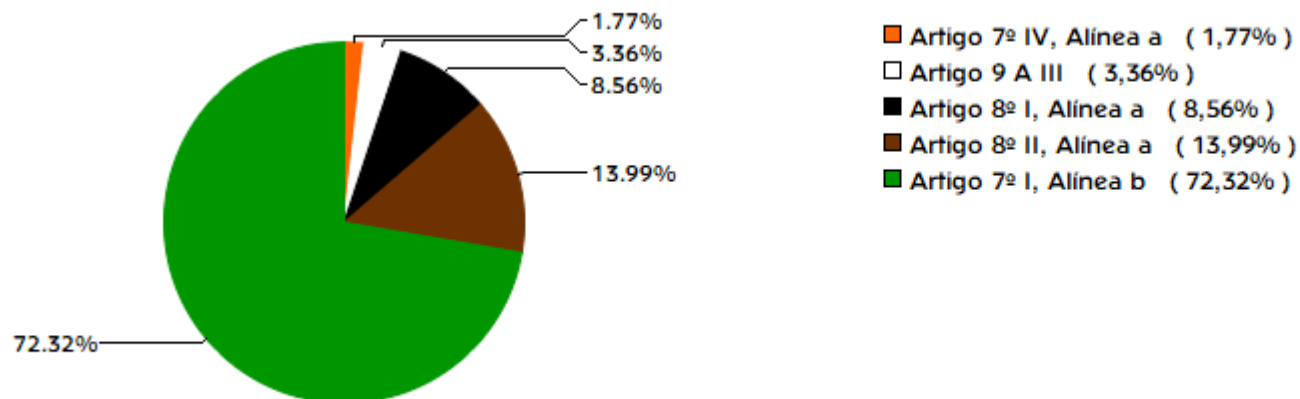
Enquadramento da Carteira					
Artigo	Classe	Valor(R\$)	% Carteira	Politica Investimento	Limite Res. 3.922/2010
Renda Fixa					
Artigo 7º I, Alínea b	FI 100% Títulos TN	29.993.176,73	72,32%	48,00%	100,00%
Artigo 7º IV, Alínea a	FI Renda Fixa - Geral	733.569,53	1,77%	2,00%	40,00%
Total Renda Fixa		30.726.746,26	74,09%		
Renda Variável					
Artigo 8º I, Alínea a	FI de Ações - Índices c/ no mínimo 50 ações	3.552.091,68	8,56%	6,00%	30,00%
Artigo 8º II, Alínea a	FI de Ações - Geral	5.800.876,39	13,99%	20,00%	20,00%
Total Renda Variável		9.352.968,07	22,55%		
Investimentos no Exterior					
Artigo 9 A III	Fundo de Ações BDR Nível 1	1.392.604,56	3,36%	10,00%	10,00%
Total Investimentos no Exterior		1.392.604,56	3,36%		

Rentabilidades por Artigo em Períodos Fechados (%)				
Estratégia	No Mês	No Ano	12 meses	24 meses
Artigo 7º I, Alínea b	0,46	0,86	--	--
% do CDI	154,9	128,1	--	--
Artigo 7º IV, Alínea a	0,24	0,61	--	--
% do CDI	82,4	90,5	--	--
Artigo 8º I, Alínea a	-8,51	-9,84	--	--
% do CDI	-2.887,1	-1.462,7	--	--
Artigo 8º II, Alínea a	-8,83	-7,61	--	--
% do CDI	-2.997,3	-1.131,9	--	--
Artigo 9 A III	-5,69	0,46	--	--
Var. Dolar Comercial p.p	-11,1	-11,1	--	--

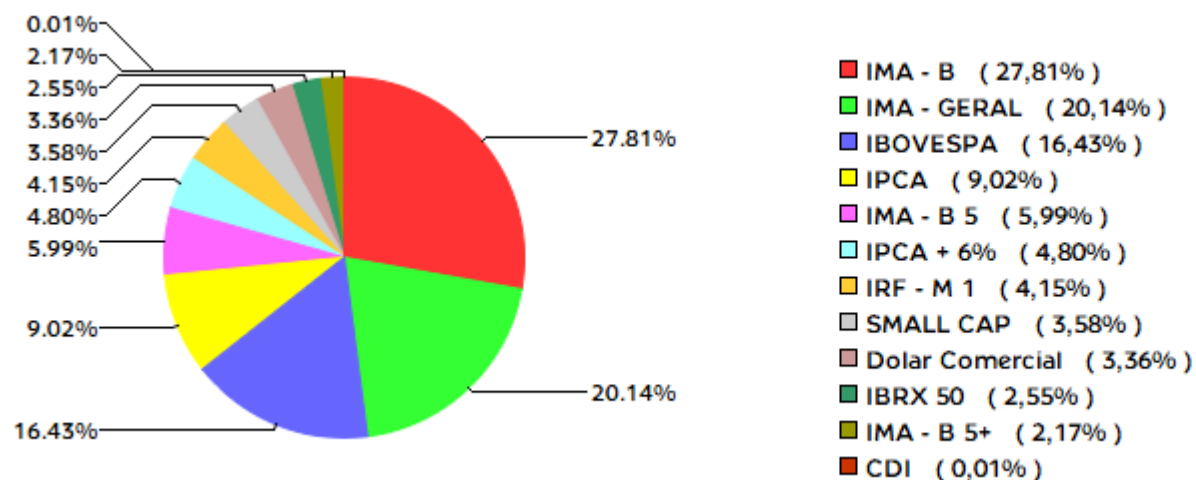
Ganhos Financeiros	
Estratégia	Ganho Bruto (R\$)
Artigo 7º I, Alínea b	134.328,40
Artigo 7º IV, Alínea a	4.034,55
Artigo 8º I, Alínea a	-346.600,84
Artigo 8º II, Alínea a	-577.558,04
Artigo 9 A III	-83.943,26
Total	-869.739,21

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Estratégia

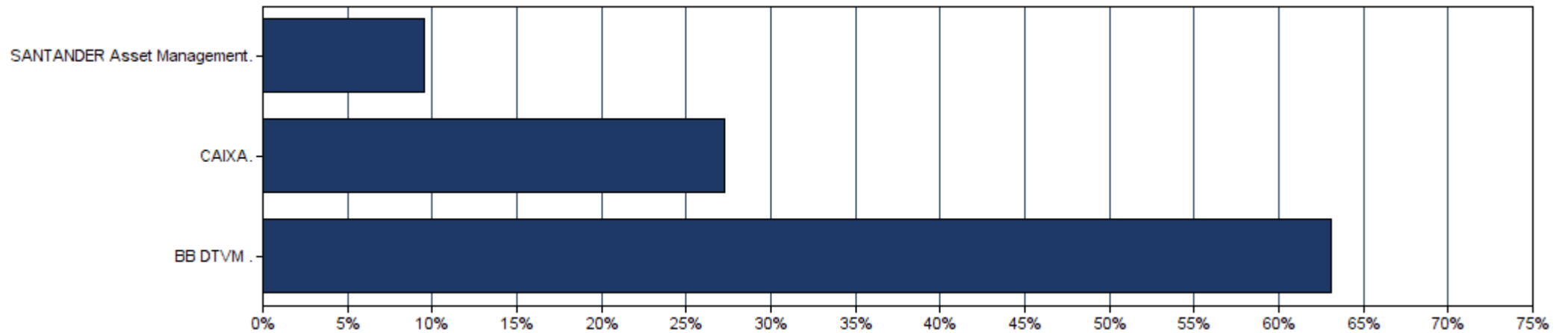


Indexadores



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor

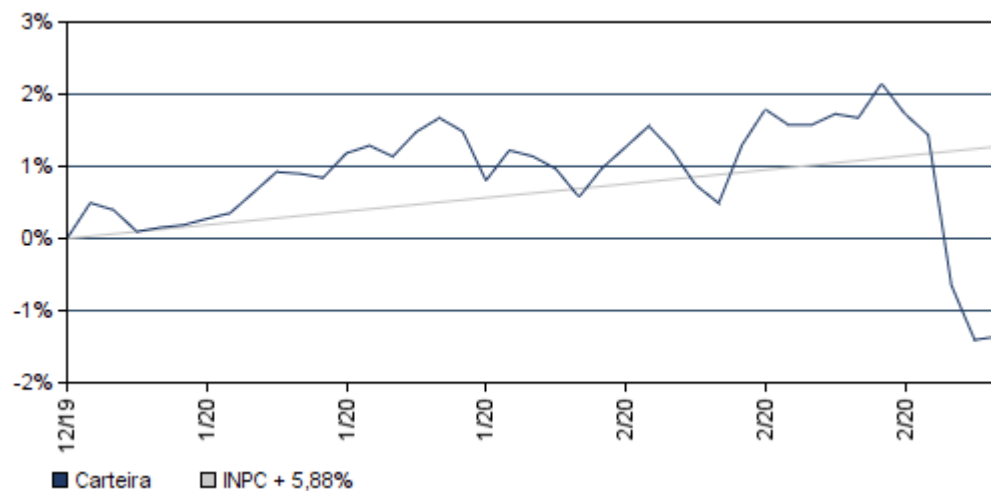


EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

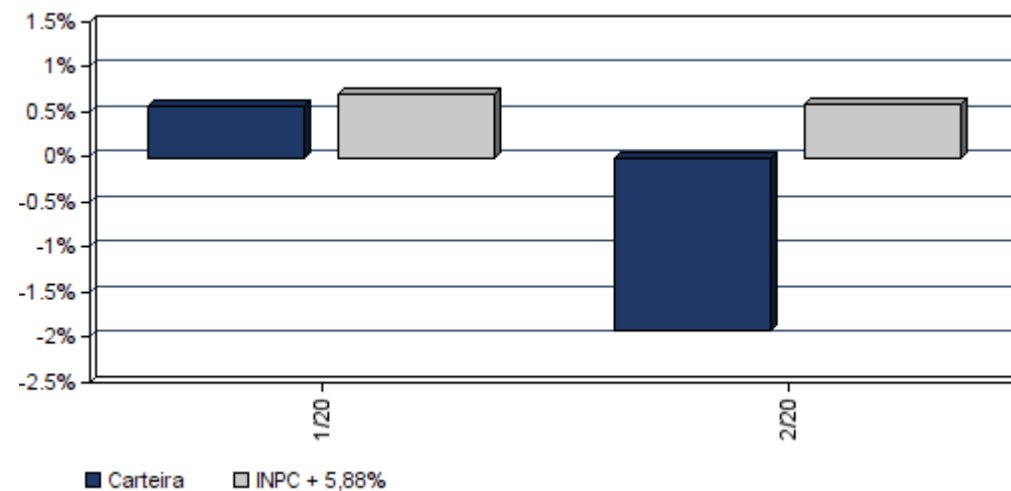
Rentabilidades da Carteira

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
2020	0,57	-1,92	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	-1,36
INPC + 5,88%	0,69	0,58	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	1,27
p.p. Indx	-0,12	-2,50	--	--	--	--	--	--	--	--	--	--	-2,63

Evolução da Rentabilidade



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



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.	-5,69 -11,05	0,46 -11,15	0,46 -11,15	0,46 -11,15	0,46 -11,15	0,46 -11,15	0,46 -11,15
IPCA + 5,45%	0,63	1,31	2,93	4,92	9,65	20,12	30,19
CDI	0,29	0,67	1,05	2,40	5,58	12,35	22,43
IMA - B	0,45	0,71	2,73	6,54	18,00	34,65	49,27
IMA - B 5	0,64	1,20	2,45	5,66	12,17	23,49	37,96
IMA - B 5+	0,32	0,35	2,96	7,23	22,04	43,07	58,49
IMA - GERAL	0,45	1,01	1,91	4,43	11,28	22,36	35,89
IRF - M	0,65	1,53	2,17	4,91	11,86	22,99	39,06
IRF - M 1	0,38	0,82	1,25	2,87	6,52	13,85	25,06
IRF - M 1+	0,80	1,92	2,66	6,01	14,22	27,05	45,12
IBOVESPA	-8,43	-9,92	-3,75	3,00	8,98	22,05	56,27
IFIX	-3,69	-7,31	2,54	11,56	21,74	28,25	46,14
SMALL CAP	-8,27	-7,86	3,80	13,95	35,70	51,63	99,83
IPCA + 6%	0,67	1,39	3,06	5,19	10,22	21,38	32,23
INPC + 6%	0,59	1,29	3,03	5,12	10,13	21,34	30,86

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
<i>Dolar Comercial</i>	5,37	11,61	6,50	8,70	20,33	38,64	45,15
<i>IBRX 100</i>	-8,22	-9,37	-2,78	3,55	11,15	25,47	60,69
<i>IBRX 50</i>	-8,66	-10,38	-4,50	2,05	6,61	18,16	52,61
<i>IGPM</i>	-0,04	0,44	2,54	3,53	6,83	14,96	14,48
<i>INPC</i>	0,17	0,36	1,58	2,12	3,92	8,02	9,97
<i>IPCA</i>	0,25	0,46	1,62	2,20	4,00	8,05	11,12