



LDB
EMPRESAS

PARANA PREV
FEVEREIRO 2020



Prezados Senhores,

Este documento tem por objetivo apresentar as principais características e informações referente a sua carteira de investimentos, na intenção de ajudá-lo na tomada de decisão e acompanhamento da mesma.

As informações contidas neste documento se destinam somente à orientação de caráter geral e fornecimento de informações sobre o tema de interesse. Nossos estudos são baseados em informações disponíveis ao público, consideradas confiáveis na data de publicação. Dado que as opiniões nascem de julgamentos e estimativas, estão sujeitas a mudanças. Nossos relatórios não representam oferta de negociação de valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros.

Informações adicionais sobre quaisquer empresas, valores mobiliários ou outros instrumentos financeiros podem ser obtidas mediante solicitação.

O presente relatório apresenta todas as informações e índices disponíveis até o dia 17.03.2020.

Não é permitido a divulgação e a utilização deste e de seu respectivo conteúdo por pessoas não autorizadas pela LDB CONSULTORIA FINANCEIRA.

Permanecemos à disposição para quaisquer esclarecimentos que se fizerem necessários e muito obrigado,

Equipe LDB Empresas.

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Posição de Ativos e Enquadramento

RENTA FIXA 86,97%

Artigo 7º I, Alínea a (Títulos do Tesouro Nacional)

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150521 (6,053767%)	2,93	0,52	1,84	117.587.539,10	2,07
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150521 (6,233645%)	2,94	0,53	1,87	117.356.606,42	2,07
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (5,821837%)	2,91	0,51	1,80	67.601.628,35	1,19
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (5,909982%)	2,92	0,51	1,82	53.950.606,06	0,95
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (5,918082%)	2,92	0,51	1,82	72.985.692,67	1,28
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (5,926210%)	2,92	0,51	1,82	57.297.004,58	1,01
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (5,981799%)	2,93	0,52	1,83	42.065.975,23	0,74
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (6,144256%)	2,94	0,53	1,85	68.681.908,67	1,21
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (6,230209%)	2,95	0,53	1,87	70.191.865,21	1,24
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (6,338349%)	2,96	0,54	1,88	69.984.782,55	1,23
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (6,440487%)	2,97	0,55	1,90	73.113.315,58	1,29
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (6,491301%)	2,98	0,55	1,91	71.352.719,77	1,26
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150523 (6,747233%)	3,00	0,57	1,94	145.010.432,39	2,55
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150820 (6,056927%)	2,95	0,52	1,84	49.649.227,79	0,87
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150820 (6,057706%)	2,95	0,52	1,84	50.311.045,93	0,89

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150820 (6,100603%)	2,95	0,53	1,85	51.294.395,62	0,90
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150820 (6,149065%)	2,95	0,53	1,85	52.276.105,80	0,92
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150820 (6,411379%)	2,96	0,55	1,89	86.586.416,39	1,52
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150820 (6,417192%)	2,96	0,55	1,89	32.882.175,31	0,58
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150820 (6,450601%)	2,96	0,55	1,90	27.094.929,13	0,48
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150820 (6,502574%)	2,96	0,55	1,91	44.267.046,13	0,78
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150820 (6,524832%)	2,96	0,55	1,91	49.547.856,16	0,87
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150820 (6,547252%)	2,96	0,56	1,91	52.845.882,92	0,93
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150820 (6,591253%)	2,97	0,56	1,92	18.162.290,26	0,32
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150820 (6,617127%)	2,97	0,56	1,92	32.688.438,69	0,58
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150820 (6,654070%)	2,97	0,56	1,93	37.305.045,26	0,66
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150820 (7,044014%)	2,98	0,59	1,99	19.774.454,28	0,35
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150820 (7,050743%)	2,98	0,59	1,99	19.773.877,17	0,35
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150820 (7,128576%)	2,98	0,59	2,00	9.883.602,86	0,17
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150822 (5,299940%)	2,90	0,47	1,72	136.246.043,86	2,40
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150822 (5,448403%)	2,91	0,48	1,75	70.416.056,98	1,24
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150822 (5,569740%)	2,92	0,49	1,76	26.753.852,72	0,47
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150822 (6,230051%)	2,97	0,53	1,87	280.187.728,77	4,93

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Emissor	Título Público	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150822 (6,288608%)	2,97	0,54	1,87	279.830.763,42	4,92
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,349962%)	2,80	0,47	1,73	414.460.125,30	7,29
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,389448%)	2,81	0,48	1,74	307.969.657,37	5,42
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (5,659837%)	2,87	0,50	1,78	284.099.579,73	5,00
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (6,054890%)	2,96	0,52	1,84	33.363.262,10	0,59
TESOURO NACIONAL	NTN-B 150830 (6,348109%)	3,02	0,54	1,88	277.967.288,51	4,89
TESOURO NACIONAL	NTN-F 2021 (12,670000%)	4,94	0,86	1,91	11.449.034,97	0,20
TESOURO NACIONAL	NTN-F 2021 (12,710000%)	4,95	0,86	1,92	11.445.713,88	0,20
TESOURO NACIONAL	NTN-F 2021 (12,750000%)	4,95	0,86	1,92	11.442.394,94	0,20
TESOURO NACIONAL	NTN-F 2021 (12,830000%)	4,95	0,87	1,93	11.435.763,53	0,20
TESOURO NACIONAL	NTN-F 2021 (13,010000%)	4,97	0,88	1,96	11.420.874,30	0,20
TESOURO NACIONAL	NTN-F 2021 (13,160000%)	4,97	0,89	1,98	11.805.317,13	0,21
TESOURO NACIONAL	NTN-F 2021 (13,260000%)	4,98	0,89	2,00	5.947.965,24	0,10
Sub-total Artigo 7º I, Alínea a		0,40	0,53	1,83	3.847.764.289,03	67,71

Artigo 7º I, Alínea b (Fundos 100% Títulos Públicos)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF IRF-M	2,05	0,63	1,49	94.395.130,17	1,66	5.100.791.923,15	1,85
BB	BB	BB PREVID RF IRF-M1	0,26	0,35	0,77	50.168.004,07	0,88	7.492.585.716,79	0,67
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	0,25	0,36	0,79	46.201.822,23	0,81	10.513.960.188,40	0,44
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	1,98	0,63	1,18	117.900.065,15	2,07	9.698.235.388,71	1,22

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BB	BB	BB PREV RF IDKA2	1,50	0,63	1,02	57.866.269,06	1,02	6.830.764.502,36	0,85
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP	2,93	0,78	1,86	27.902.938,99	0,49	2.655.596.398,85	1,05
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	1,51	0,62	1,08	0,00	0,00	8.419.154.798,69	0,00
BB	BB	BB PREV IPCA III	1,82	0,55	0,97	66.391.379,44	1,17	880.076.235,05	7,54
BB	BB	BB PREV IPCA I	2,29	0,73	1,37	49.178.785,68	0,87	497.651.331,34	9,88
BRB	BRB	67-BRB FIRF 2023	0,36	0,52	1,83	18.404.184,98	0,32	73.820.471,71	24,93
BB	BB	BB PREV RF VII	1,19	0,41	0,61	19.545.706,34	0,34	676.748.275,25	2,89
BB	BB	BB PREV ALOC FIC	2,33	0,46	0,94	219.928.446,04	3,87	10.908.803.618,87	2,02
CEF	CEF	FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	3,44	0,62	1,44	202.717.211,90	3,57	10.626.779.468,55	1,91
Sub-total Artigo 7º I, Alínea b			1,72	0,57	1,13	970.599.944,05	17,08		

Artigo 7º IV, Alínea a (Fundos de Renda Fixa)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
VERITAS	RJI	FIC TMJ FI RF LP IMAB 1000	8,68	0,12	-0,71	70.521,79	0,00	35.627.062,91	0,20
BB	BB	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,06	0,06	0,06	0,00	0,00	2.774.667.818,45	0,00
BB	BB	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,05	0,06	0,49	0,00	0,00	1.376.949.540,95	0,00
CEF	CEF	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,05	0,23	0,53	3.244.152,01	0,06	455.022.894,33	0,71
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	1,69	0,26	0,60	121.104.787,33	2,13	5.092.614.949,01	2,38
Sub-total Artigo 7º IV, Alínea a			0,14	0,26	0,60	124.419.461,13	2,19		

Artigo 7º VII, Alínea b (Fundos Renda Fixa "Crédito Privado")

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BNP PARIBAS	BNP PARIBAS	BNP PARIBAS TARGUS FIC DE FI RENDA FIXA CREDITO PR	0,09	0,29	0,69	430,54	0,00	981.505.406,40	0,00
Sub-total Artigo 7º VII, Alínea b			0,09	0,29	0,69	430,54	0,00		
Renda Fixa			0,51	0,52	1,65	4.942.784.124,75	86,97		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

RENDA VARIÁVEL E INVESTIMENTOS ESTRUTURADOS

12,00%

Artigo 8º II, Alínea a (Fundos de Ações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRAM	BEM	BRDESCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES MID SMALL	18,32	-7,91	-6,42	79.505.647,85	1,40	2.341.977.575,47	3,39
ICATU	BEM	ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	15,61	-7,00	-6,42	52.337.930,53	0,92	1.963.717.198,95	2,67
BTG PACTUAL	BTG PACTUAL	BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	18,63	-7,13	-5,24	46.250.681,24	0,81	1.938.091.271,83	2,39
BAHIA	BEM	BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	19,71	-7,29	-7,83	15.583.174,09	0,27	1.139.056.064,38	1,37
SUL AMERICA	BEM	SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	18,67	-8,70	-6,95	78.772.916,80	1,39	1.147.102.331,65	6,87
VINCI	CEF	FIC ACOES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	17,49	-6,37	-4,94	86.765.272,85	1,53	909.648.393,83	9,54
ITAU	ITAU	ITAU ACOES DUNAMIS FIC	18,26	-9,79	-9,96	47.862.588,89	0,84	4.106.559.997,95	1,17
ITAU	ITAU	ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	19,26	-9,27	-7,93	66.819.006,16	1,18	2.262.526.519,52	2,95
VINCI	BEM	VINCI MOSAICO FUNDO DE INVESTIMENTO DE ACOES	17,97	-5,42	-7,61	36.872.085,93	0,65	1.674.749.361,15	2,20
Sub-total Artigo 8º II, Alínea a			18,64	-7,83	-6,65	510.769.304,34	8,99		

Artigo 8º III (Fundos Multimercados)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	4,03	-1,51	-0,84	53.439.292,13	0,94	6.152.155.591,60	0,87
WESTERN	BNP PARIBAS	WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	15,04	-7,50	-7,16	26.652.763,99	0,47	814.886.135,28	3,27
Sub-total Artigo 8º III			7,83	-3,59	-3,04	80.092.056,12	1,41		

Artigo 8º IV, Alínea a (Fundos de Participações)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
BRZ	BB	BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGISTICOS FIP	3,97	-0,14	-0,30	14.745.913,88	0,26	167.215.009,22	8,82
KINEA	BRB	INDUSTRIAL PARKS BRASIL FIP MULTIESTRATÉGIA	78,22	7,76	7,62	33.196.367,16	0,58	175.433.411,16	18,92
GRAPHEN	ORLA	BRB BLUEJAY FIP IMOBILIÁRIO MULTIESTRATÉGIA PARANÁ I	4,86	-0,45	-0,89	1.908.361,50	0,03	7.636.500,62	24,99
BTG PACTUAL	SANTANDER	BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP	20,25	27,65	27,42	41.431.664,85	0,73	313.996.871,15	13,19

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
		Sub-total Artigo 8º IV, Alínea a	52,29	14,52	14,31	91.282.307,39	1,61		
		Renda Variável e Investimentos Estruturados	17,08	-4,82	-3,87	682.143.667,85	12,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

INVESTIMENTOS NO EXTERIOR

1,02%

Artigo 9º A, III (Ações - BDR Nível I)

Gestor	Admin.	Ativo	Volatilid. a.a. (%)	Rentab. Mês (%)	Rentab. Ano (%)	Valor (R\$)	% Carteira	PL do Fundo	% Fundo
CEF	CEF	FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	16,34	-5,69	0,46	23.315.991,63	0,41	866.229.995,42	2,69
SAFRA	SAFRA	SAFRA CONS AMERICANO PB FI ACOES	14,55	-5,24	1,37	34.858.772,96	0,61	849.143.050,83	4,11
Sub-total Artigo 9º A, III			16,85	-5,42	1,00	58.174.764,59	1,02		
Investimentos no Exterior			16,77	-5,42	1,00	58.174.764,59	1,02		
Total						5.683.102.557,19	100,00		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Enquadramento da Carteira

Artigo	Tipo de Ativo	Valor(R\$)	% Carteira	Política de Investimentos			
				Mínimo	Objetivo	Máximo	Limite Legal
Renda Fixa							
Artigo 7º I, Alínea a	Títulos do Tesouro Nacional	3.847.764.289,03	67,71	50,00	65,00	80,00	100,00
Artigo 7º I, Alínea b	Fundos 100% Títulos Públicos	970.599.944,05	17,08	3,00	14,00	80,00	100,00
Artigo 7º IV, Alínea a	Fundos de Renda Fixa	124.419.461,13	2,19	1,00	3,00	40,00	40,00
Artigo 7º VII, Alínea b	Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	430,54	0,00	0,00	0,00	5,00	5,00
	Total Renda Fixa	4.942.784.124,75	86,97				
Renda Variável e Investimentos Estruturados							
Artigo 8º II, Alínea a	Fundos de Ações	510.769.304,34	8,99	0,00	12,00	20,00	20,00
Artigo 8º III	Fundos Multimercados	80.092.056,12	1,41	0,00	2,00	10,00	10,00
Artigo 8º IV, Alínea a	Fundos de Participações	91.282.307,39	1,61	0,00	1,50	5,00	5,00
	Total Renda Variável e Investimentos Estruturados	682.143.667,85	12,00				
Investimentos no Exterior							
Artigo 9º A, III	Ações - BDR Nível I	58.174.764,59	1,02	0,00	2,50	8,00	10,00
	Total Investimentos no Exterior	58.174.764,59	1,02				

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades por Artigo

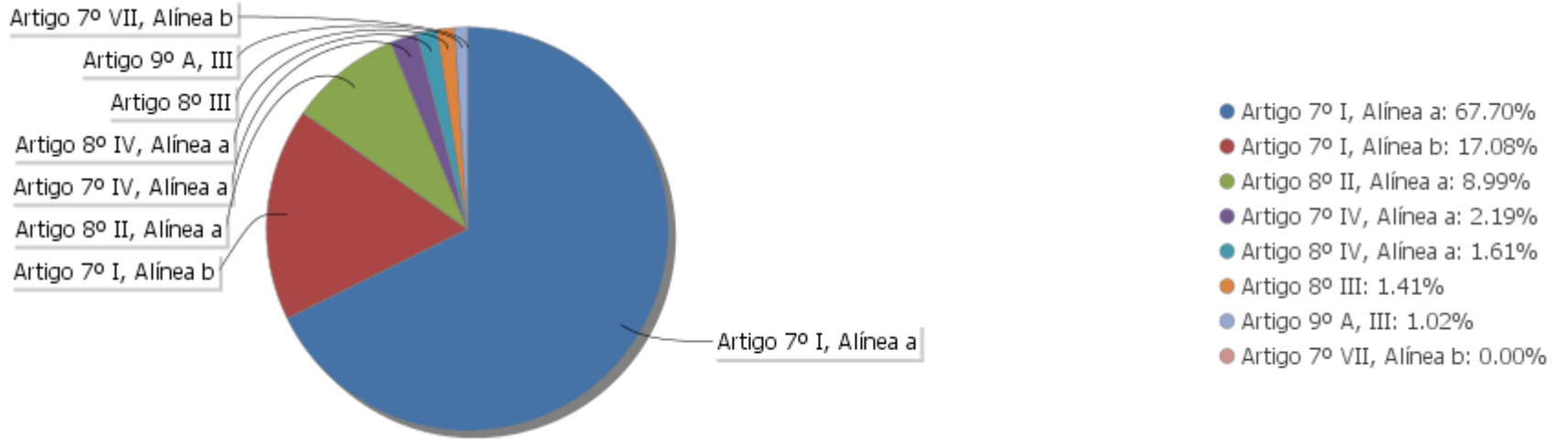
Estratégia Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	No Mês(R\$)	No Ano(R\$)
Artigo 7º I, Alínea a % do CDI	0,53 179,14	1,83 273,16	3,19 304,15			20.381.385,84	70.568.989,22
Artigo 7º I, Alínea b % do CDI	0,57 192,87	1,13 168,16	2,15 204,57			5.625.646,44	11.576.566,77
Artigo 7º IV, Alínea a % do CDI	0,26 87,64	0,60 89,06	0,94 89,79			379.217,33	796.126,72
Artigo 7º VII, Alínea b % do CDI	0,29 98,34	0,69 102,05	1,00 95,65			1,24	2,93
Artigo 8º II, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	-7,83 0,60	-6,65 3,27	1,68 5,43			-43.610.571,93	-37.547.092,63
Artigo 8º III Var. IBOVESPA p.p.	-3,59 4,84	-3,04 6,89	-0,83 2,92			-2.981.001,37	-2.507.221,73
Artigo 8º IV, Alínea a Var. IBOVESPA p.p.	14,52 22,95	14,31 24,23	14,27 18,02			11.785.424,42	11.610.352,64
Artigo 9º A, III % do CDI	-5,42 -1.843,93	1,00 149,32	-0,45 -42,93			-3.331.253,50	577.497,68
						-11.751.151,53	55.075.221,60

Análise de Liquidez

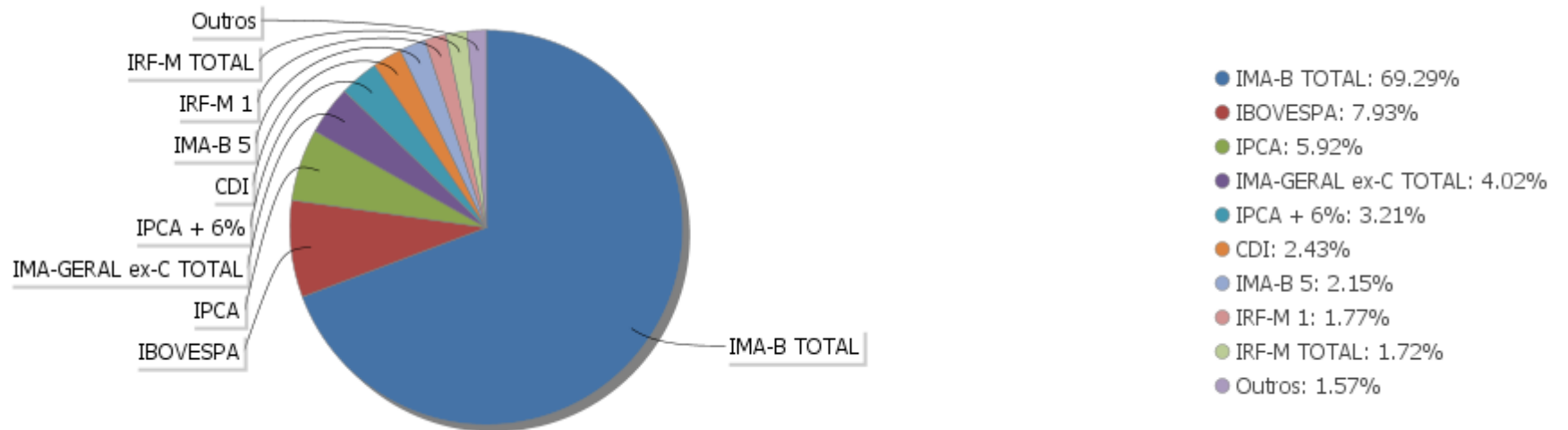
Período	Valor (R\$)	(%)	Valor Acumulado (R\$)	(%) Acum.
de 0 a 30 dias	1.433.667.973,05	25,23	1.433.667.973,05	25,23
de 31 a 364 dias	957.369.570,57	16,85	2.391.037.543,62	42,07
acima de 365 dias	3.292.065.013,57	57,93	5.683.102.557,19	100,00

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Artigo

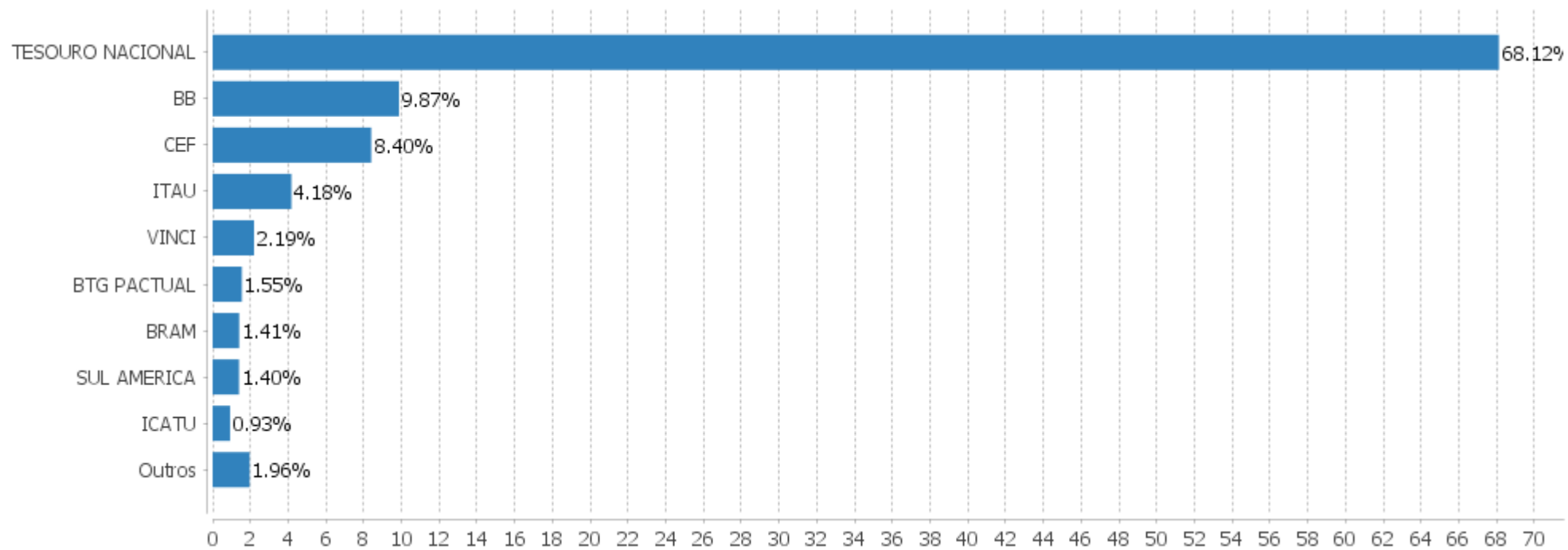


Alocação Por Estratégia



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Alocação por Gestor



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Rentabilidades da Carteira versus Meta Atuarial

Ano	Jan	Fev	Mar	Abr	Mai	Jun	Jul	Ago	Set	Out	Nov	Dez	Rent.Ano
2020	1,16	-0,19											0,97
IPCA + 5,5%	0,68	0,63											1,32
p.p. indexador	0,48	-0,83											-0,35
2019	1,34	0,65	0,85	1,22	0,97	1,00	0,89	0,56	0,88	0,89	0,56	1,79	12,22
IPCA + 5,5%	0,79	0,86	1,16	1,02	0,60	0,41	0,68	0,58	0,41	0,59	0,94	1,60	10,07
p.p. indexador	0,55	-0,21	-0,31	0,20	0,37	0,59	0,21	-0,02	0,47	0,30	-0,38	0,19	2,16

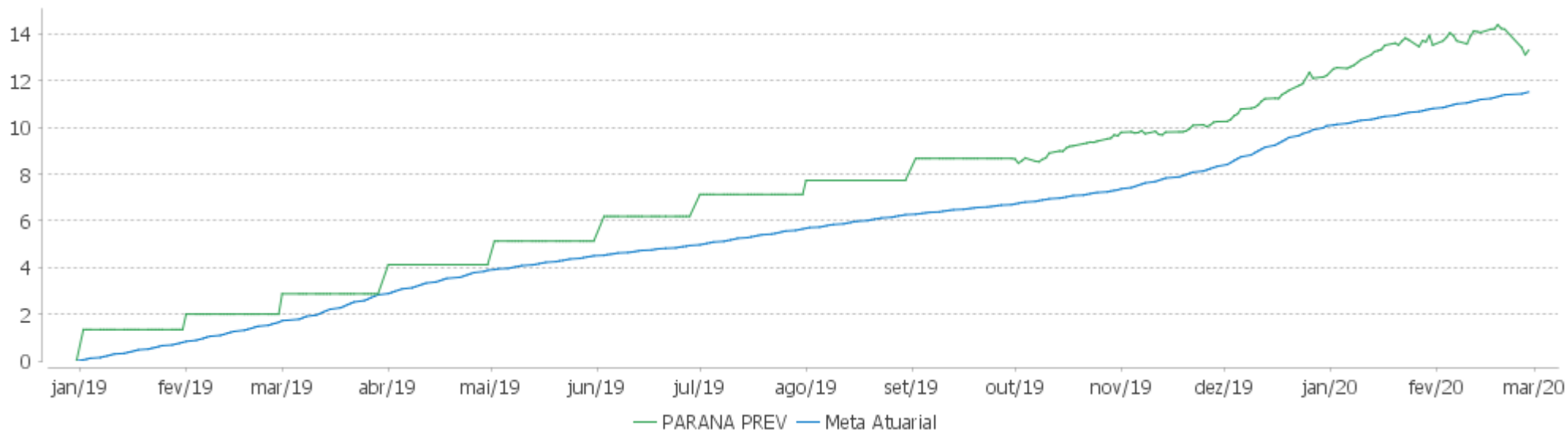
PERFORMANCE SOBRE A META ATUARIAL

RELATÓRIO TRIMESTRAL

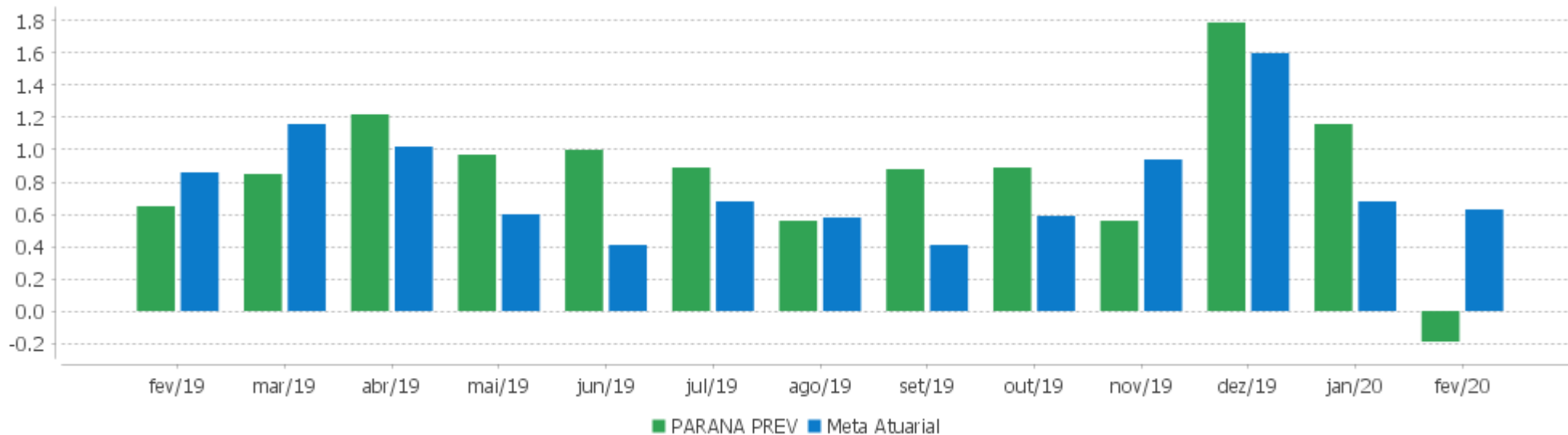
	Quantidade	Perc. (%)	Período	Carteira	Meta Atuarial	p.p. Indx.	Volatilidade Anual
Meses acima da Meta Atuarial	9	64,29	03 meses	2,78	2,94	-0,16	2,71
Meses abaixo da Meta Atuarial	5	35,71	06 meses	5,18	4,95	0,23	2,36
			12 meses	11,08	9,70	1,38	2,79
			24 meses				
			36 meses				
Maior rentabilidade da Carteira	1,79	2019-12					
Menor rentabilidade da Carteira	-0,19	2020-02	Desde 31/12/2018	13,31	11,52	1,79	2,91

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Evolução



Rentabilidades Mensais - 12 últimos meses



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Performance dos Fundos

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
FIC TMJ FI RF LP IMAB 1000 % do CDI	0,12 41,55	-0,71 -105,08	0,05 4,90	-0,32 -13,26	2,23 39,96	4,05 32,79	9,32 41,62
BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI % do CDI	0,27 92,98	0,62 92,92	0,98 93,45	2,23 93,12	5,33 95,61	11,98 97,04	22,11 98,72
BB PREVID RF FLUXO FIC % do CDI	0,22 73,69	0,50 74,86	0,79 75,23	1,85 77,44	4,45 79,85	9,95 80,64	18,58 82,98
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI Var. IPCA p.p.	0,26 0,01	0,60 0,14	0,95 -0,67	2,60 0,40	9,60 5,60	19,17 11,12	31,31 20,19
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF % do CDI	0,23 78,51	0,53 79,49	0,84 80,23	1,97 82,21	4,70 84,24	10,48 84,92	19,40 86,63
FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO Var. IMA-B 5 p.p.	0,63 -0,01	1,18 -0,03	2,40 -0,05	5,51 -0,15	11,87 -0,29	22,95 -0,54	37,12 -0,84
BB PREV IPCA I Var. IPCA + 6% p.p.	0,73 0,06	1,37 -0,02	2,57 -0,49	5,75 0,56	12,96 2,74	25,03 3,65	40,63 8,40
BB PREVID RF IRF-M1 Var. IRF-M 1 p.p.	0,35 -0,03	0,77 -0,05	1,17 -0,07	2,72 -0,15	6,24 -0,28	13,31 -0,55	24,21 -0,86
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP Var. IRF-M 1+ p.p.	0,78 -0,02	1,86 -0,06	2,58 -0,08	5,89 -0,11	13,88 -0,34	26,38 -0,68	43,90 -1,22
BB PREV RF VII Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,41 -0,04	0,61 -0,10	1,53 -1,20	4,15 -2,39	9,09 -8,91	20,06 -14,60	33,19 -16,08
BB PREV RF IDKA2 Var. IDKA 2 p.p.	0,63 -0,06	1,02 -0,21	2,18 -0,26	5,12 -0,25	10,31 -0,88	20,84 -1,68	34,64 -3,12
BB PREV ALOC FIC Var. IMA-GERAL ex-C TOTAL p.p.	0,46 0,01	0,94 -0,00	1,91 0,05	4,31 -0,05	11,46 0,39	22,39 0,50	35,25 -0,19
FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF Var. IPCA p.p.	0,62 0,37	1,44 0,98	2,04 0,43	5,45 3,26	14,23 10,23	25,27 17,21	37,87 26,74
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP Var. IDKA 2 p.p.	0,60 -0,08	1,06 -0,16	2,17 -0,27	4,96 -0,41	10,35 -0,84	20,98 -1,54	34,79 -2,98
BB PREV RF IRF-M Var. IRF-M TOTAL p.p.	0,63 -0,02	1,49 -0,04	2,11 -0,06	4,80 -0,11	11,62 -0,24	22,46 -0,52	38,10 -0,96
67-BRB FIRF 2023 Var. IPCA + 6% p.p.	0,52 -0,15	1,83 0,43	3,18 0,13	5,02 -0,17	10,26 0,05	21,28 -0,10	32,08 -0,15
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	0,36	0,79	1,19	2,77	6,31	13,44	24,42

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IRF-M 1 p.p.	-0,02	-0,04	-0,05	-0,11	-0,21	-0,41	-0,64
BB PREV IPCA III	0,55	0,97	2,08	5,04	11,35	31,95	44,28
Var. IPCA + 6% p.p.	-0,12	-0,42	-0,98	-0,15	1,13	10,57	12,05
BNP PARIBAS TARGUS FIC DE FI RENDA FIXA CREDITO PR	0,29	0,69	1,00	2,12	5,28	12,00	22,07
% do CDI	97,68	102,09	95,54	88,74	94,65	97,26	98,55
NTN-B 150521 (6,233645%)	0,53	1,87	3,25	5,15	7,35		
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,09	1,15	0,52	-1,39	-10,65		
NTN-B 150523 (5,909982%)	0,51	1,82	3,17	4,99	7,05		
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,06	1,11	0,44	-1,55	-10,95		
NTN-B 150820 (7,050743%)	0,59	1,99	3,44	5,55	8,15		
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,14	1,28	0,71	-0,99	-9,85		
NTN-B 150820 (6,100603%)	0,53	1,85	3,22	5,09	7,23		
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,08	1,13	0,48	-1,46	-10,78		
NTN-B 150830 (5,349962%)	0,47	1,73	3,04	4,72	6,63		
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,03	1,02	0,31	-1,83	-11,37		
NTN-B 150830 (5,389448%)	0,48	1,74	3,05	4,74	6,66		
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,03	1,03	0,32	-1,81	-11,34		
NTN-B 150523 (6,440487%)	0,55	1,90	3,30	5,25	7,53		
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,10	1,19	0,56	-1,29	-10,47		
NTN-B 150523 (6,747233%)	0,57	1,94	3,37	5,41	7,80		
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,12	1,23	0,64	-1,14	-10,20		
NTN-B 150523 (5,918082%)	0,51	1,82	3,17	5,00	7,06		
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,06	1,11	0,44	-1,55	-10,95		
NTN-F 2021 (12,670000%)	0,86	1,91	2,93	6,10	7,19		
NTN-B 150820 (6,411379%)	0,55	1,89	3,29	5,24	7,53		
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,10	1,18	0,56	-1,30	-10,47		
NTN-B 150820 (6,547252%)	0,56	1,91	3,32	5,31	7,66		
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,11	1,20	0,59	-1,24	-10,34		
NTN-B 150822 (6,288608%)	0,54	1,87	3,26	5,18	7,40		
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,09	1,16	0,53	-1,36	-10,60		
NTN-B 150820 (6,524832%)	0,55	1,91	3,32	5,30	7,64		
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,10	1,20	0,58	-1,25	-10,36		
NTN-B 150523 (5,981799%)	0,52	1,83	3,19	5,03	7,11		
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,07	1,12	0,46	-1,51	-10,89		
NTN-F 2021 (13,010000%)	0,88	1,96	3,00	6,25	7,49		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
NTN-B 150523 (6,491301%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,55 0,10	1,91 1,19	3,31 0,58	5,28 -1,26	7,57 -10,43		
NTN-B 150523 (5,926210%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,51 0,06	1,82 1,11	3,17 0,44	5,00 -1,54	7,06 -10,94		
NTN-F 2021 (12,710000%)	0,86	1,92	2,94	6,11	7,23		
NTN-B 150820 (6,450601%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,55 0,10	1,90 1,19	3,30 0,57	5,26 -1,28	7,57 -10,43		
NTN-B 150820 (6,056927%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,52 0,07	1,84 1,13	3,21 0,47	5,07 -1,48	7,18 -10,82		
NTN-B 150523 (6,230209%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,53 0,09	1,87 1,15	3,25 0,51	5,15 -1,39	7,34 -10,66		
NTN-B 150521 (6,053767%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,52 0,07	1,84 1,13	3,20 0,47	5,06 -1,48	7,18 -10,82		
NTN-B 150523 (6,144256%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,53 0,08	1,85 1,14	3,23 0,49	5,11 -1,43	7,26 -10,74		
NTN-B 150822 (6,230051%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,53 0,09	1,87 1,15	3,25 0,51	5,15 -1,39	7,34 -10,66		
NTN-B 150822 (5,569740%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,49 0,04	1,76 1,05	3,09 0,36	4,83 -1,72	6,73 -11,27		
NTN-B 150820 (6,417192%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,55 0,10	1,89 1,18	3,29 0,56	5,24 -1,30	7,53 -10,47		
NTN-F 2021 (12,830000%)	0,87	1,93	2,97	6,17	7,34		
NTN-B 150830 (5,659837%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,50 0,05	1,78 1,07	3,11 0,38	4,87 -1,67	6,87 -11,13		
NTN-F 2021 (13,260000%)	0,89	2,00	3,06	6,37	7,71		
NTN-F 2021 (13,160000%)	0,89	1,98	3,04	6,32	7,63		
NTN-B 150820 (6,502574%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,55 0,10	1,91 1,20	3,31 0,58	5,29 -1,26	7,62 -10,38		
NTN-B 150830 (6,054890%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,52 0,07	1,84 1,13	3,20 0,47	5,07 -1,48	7,17 -10,83		
NTN-B 150820 (6,591253%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,56 0,11	1,92 1,21	3,33 0,60	5,33 -1,21	7,71 -10,30		
NTN-B 150820 (6,617127%) Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,56 0,11	1,92 1,21	3,34 0,61	5,34 -1,20	7,73 -10,27		
NTN-B 150523 (6,338349%)	0,54	1,88	3,27	5,20	7,43		

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,09	1,17	0,54	-1,34	-10,57		
NTN-B 150822 (5,299940%)	0,47	1,72	3,03	4,69	6,48		
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,02	1,01	0,29	-1,85	-11,52		
NTN-F 2021 (12,750000%)	0,86	1,92	2,95	6,13	7,26		
NTN-B 150822 (5,448403%)	0,48	1,75	3,06	4,77	6,62		
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,03	1,03	0,33	-1,78	-11,38		
NTN-B 150820 (7,128576%)	0,59	2,00	3,46	5,59	8,23		
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,15	1,29	0,73	-0,95	-9,77		
NTN-B 150820 (7,044014%)	0,59	1,99	3,44	5,55	8,15		
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,14	1,28	0,71	-0,99	-9,85		
NTN-B 150820 (6,057706%)	0,52	1,84	3,21	5,07	7,18		
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,07	1,13	0,47	-1,48	-10,82		
NTN-B 150820 (6,654070%)	0,56	1,93	3,35	5,36	7,77		
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,11	1,22	0,61	-1,18	-10,23		
NTN-B 150523 (5,821837%)	0,51	1,80	3,15	4,95	6,97		
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,06	1,09	0,42	-1,59	-11,03		
NTN-B 150820 (6,149065%)	0,53	1,85	3,23	5,11	7,27		
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,08	1,14	0,50	-1,43	-10,73		
NTN-B 150830 (6,348109%)	0,54	1,88	3,27	5,21	7,40		
Var. IMA-B TOTAL p.p.	0,09	1,17	0,54	-1,33	-10,60		
BRB BLUEJAY FIP IMOBILIÁRIO MULTISTRATÉGIA PARANÁ I	-0,45	-0,89	-1,33	-6,66	-6,66	-18,84	-65,06
% do CDI	-151,61	-132,23	-126,45	-278,48	-119,50	-152,63	-290,56
BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGISTICOS FIP	-0,14	-0,30	-0,46	-4,62	-4,62	-22,22	-28,14
% do CDI	-46,75	-45,12	-43,91	-193,21	-82,90	-180,05	-125,67
BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP	27,65	27,42	27,19	14,80	18,08	159,97	161,23
Var. IPCA + 6% p.p.	26,98	26,03	24,13	9,60	7,86	138,59	129,00
INDUSTRIAL PARKS BRASIL FIP MULTISTRATÉGIA	7,76	7,62	7,96	2,17	2,17	2,03	-24,92
% do CDI	2.641,09	1.134,53	759,01	90,55	38,85	16,42	-111,29
FIC CAIXA ALOCAÇÃO MACRO MULTIMERCADO LP	-1,51	-0,84	1,24	4,45	12,95	25,31	39,50
% do CDI	-513,87	-124,52	117,82	186,20	232,28	205,07	176,38
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	-7,50	-7,16	-4,73	3,26	10,30	17,58	45,11
% do CDI	-2.554,49	-1.066,88	-451,48	136,25	184,80	142,47	201,46
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	-8,70	-6,95	1,96	7,60	23,75	47,88	98,81
Var. IBOVESPA p.p.	-0,27	2,97	5,71	4,59	14,77	25,84	42,54
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	-7,13	-5,24	1,57	5,51	24,91	47,72	92,53
Var. IBOVESPA p.p.	1,30	4,68	5,32	2,51	15,92	25,67	36,26

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Fundo Variação da Estratégia	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA Var. IBOVESPA p.p.	-7,29 1,14	-7,83 2,09	-0,14 3,62	6,88 3,88	13,79 4,81	30,65 8,60	68,06 11,80
VINCI MOSAICO FUNDO DE INVESTIMENTO DE ACOES Var. IBOVESPA p.p.	-5,42 3,01	-3,77 6,15	8,11 11,86	16,15 13,14	30,01 21,02	53,28 31,23	104,24 47,98
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI Var. IBOVESPA p.p.	-9,27 -0,84	-7,93 1,99	1,46 5,21	4,94 1,94	20,69 11,71	47,79 25,75	88,59 32,32
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	-9,79	-9,96	-2,64	5,05	20,11	42,38	
FIC ACOES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS Var. Índice Dividendos - IDIV p.p.	-6,37 -0,19	-4,94 2,72	3,17 1,61	8,42 0,89	19,87 -1,76	41,01 -1,30	75,29 7,68
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA Var. IBOVESPA p.p.	-7,00 1,43	-6,42 3,50	0,61 4,36	5,66 2,66	21,20 12,22	49,95 27,91	85,08 28,81
BRDESCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES MID SMALL Var. IBOVESPA p.p.	-7,91 0,52	-6,42 3,50	3,34 7,09	10,51 7,51	27,29 18,31	57,75 35,71	106,37 50,11
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I Var. IBOVESPA p.p.	-5,69 2,74	0,46 10,38	-1,30 2,45	8,85 5,84	26,84 17,86	48,66 26,61	81,60 25,33
SAFRA CONS AMERICANO PB FI ACOES Var. IBOVESPA p.p.	-5,24 3,19	1,37 11,29	0,13 3,88	6,50 3,50	29,59 20,60		
CDI	0,29	0,67	1,05	2,39	5,57	12,34	22,39
IBOVESPA	-8,43	-9,92	-3,75	3,00	8,98	22,05	56,27
INPC + 6%	0,59	1,29	3,03	5,12	10,13	21,34	30,86
IPCA + 6%	0,67	1,39	3,06	5,19	10,22	21,38	32,23

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexadores

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
Renda Fixa							
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
IRF-M TOTAL	0,65	1,53	2,17	4,91	11,86	22,99	39,06
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-B TOTAL	0,45	0,71	2,73	6,54	18,00	34,65	49,27
IMA-C TOTAL	0,63	3,18	3,59	6,91	18,59	39,02	52,96
IMA-GERAL ex-C TOTAL	0,44	0,95	1,87	4,36	11,07	21,89	35,44
IMA-GERAL TOTAL	0,45	1,01	1,91	4,43	11,28	22,36	35,89
IDKA 2	0,69	1,22	2,44	5,37	11,19	22,52	37,76
IDKA 20	-0,09	-1,46	2,43	6,69	27,19	57,08	70,16
CDI	0,29	0,67	1,05	2,39	5,57	12,34	22,39
Renda Variável							
IBOVESPA	-8,43	-9,92	-3,75	3,00	8,98	22,05	56,27
IBRX 100	-8,22	-9,37	-2,78	3,55	11,15	25,47	60,69
IBRX 50	-8,66	-10,38	-4,50	2,05	6,61	18,16	52,61
SMALL CAP	-8,27	-7,86	3,80	13,95	35,70	51,63	99,83
IFIX	-3,69	-7,31	2,54	11,56	21,74	28,23	46,08
Índice Consumo - ICON	-10,00		0,78	4,44	34,77	34,01	67,27
Índice Dividendos - IDIV	-6,18	-7,66	1,56	7,52	21,63	42,31	67,61
Indicadores Econômicos							
IPCA	0,25	0,46	1,62	2,20	4,00	8,05	11,13
INPC	0,17	0,36	1,58	2,12	3,92	8,02	9,97
IGPM	-0,04	0,44	2,54	3,54	6,84	14,98	14,49
SELIC	0,29	0,67	1,05	2,39	5,57	12,34	22,41
Meta Atuarial							
IPCA + 4%	0,53	1,09	2,59	4,20	8,15	16,85	24,92

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Indexador	No Mês	No Ano	3 meses	6 meses	12 meses	24 meses	36 meses
IPCA + 5%	0,60	1,24	2,82	4,70	9,18	19,10	28,54
IPCA + 5,5%	0,63	1,32	2,94	4,95	9,70	20,24	30,38
IPCA + 5,89%	0,66	1,38	3,03	5,14	10,11	21,13	31,82
IPCA + 6%	0,67	1,39	3,06	5,19	10,22	21,38	32,23
INPC + 4%	0,45	0,99	2,55	4,13	8,06	16,81	23,63
INPC + 6%	0,59	1,29	3,03	5,12	10,13	21,34	30,86

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Movimentações

Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
03/02/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	10.605.647,62	0,00	5.725.534,28038667	1,8523420000
03/02/2020	BB PREVID RF IRF-M1	671.578,03	0,00	253.836,29481700	2,6457131770
03/02/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	671.578,03	321.895,14822759	2,0863254190
04/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	64.010,70	0,00	25.264,42298205	2,5336300000
04/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	10.610.000,00	0,00	4.187.667,49683261	2,5336300000
04/02/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	10.610.000,00	5.727.098,62268946	1,8525960000
05/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	85.190,18	0,00	33.617,31665007	2,5341160000
05/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	261.864,46	0,00	103.335,62473068	2,5341160000
06/02/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	4.276.499,26	0,00	2.048.972,17893643	2,0871436440
06/02/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	4.276.498,28	2.048.971,70939520	2,0871436440
07/02/2020	BB PREVID RF IRF-M1	479,02	0,00	180,91069500	2,6478250000
07/02/2020	BRADESCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES MID SMALL	4.276.499,26	0,00	359.979,40612723	11,8798442000
07/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	4.049.591,23	0,00	1.597.454,87128934	2,5350270000
07/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	29.880,29	0,00	11.786,97110524	2,5350270000
10/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	943.485,15	0,00	372.114,93977244	2,5354670000
14/02/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	1.914,04	0,00	916,41284947	2,0886219580
17/02/2020	BB PREVID RF IRF-M1	32.611,21	0,00	12.304,10463300	2,6504330000
17/02/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	74.922.064,92	0,00	33.156.344,28188312	2,2596600000
17/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	80.948,77	0,00	31.899,37142112	2,5376290000
17/02/2020	FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	50.000.000,00	0,00	34.704.002,62084628	1,4407560000
17/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	50.000.000,00	0,00	19.703.431,82553478	2,5376290000
17/02/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	1.914,27	916,41464055	2,0888688540
17/02/2020	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	0,00	100.000.000,00	44.657.151,41855674	2,2392830000
18/02/2020	BB PREV IPCA I	0,00	1.262.182,98	554.468,68724000	2,2763827950
18/02/2020	BB PREV RF IDKA2	0,00	50.000.000,00	18.504.629,66311800	2,7020265150
18/02/2020	VINCI MOSAICO FUNDO DE INVESTIMENTO DE ACOES	5.000.000,00	0,00	650.584,91878059	7,6853918000
18/02/2020	BB PREVID RF IRF-M1	45.000.000,00	0,00	16.975.688,37578200	2,6508497920
18/02/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	3.513.228,39	0,00	1.681.682,00739386	2,0891157630

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
18/02/2020	FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	30.000.000,00	0,00	20.823.933,64106480	1,4406500000
18/02/2020	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	0,00	30.000.000,00	13.397.642,01500536	2,2392000000
18/02/2020	BB PREV RF VII	0,00	525.232,62	300.055,71143503	1,7504503330
18/02/2020	BB PREV IPCA III	0,00	1.725.812,79	791.812,36243002	2,1795729290
19/02/2020	VINCI MOSAICO FUNDO DE INVESTIMENTO DE ACOES	5.000.000,00	0,00	642.395,13686325	7,7833715000
19/02/2020	BB PREVID RF IRF-M1	3.513.656,51	0,00	1.325.216,99881300	2,6513820100
19/02/2020	FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	24.500.000,00	0,00	16.989.878,88643480	1,4420350000
19/02/2020	FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	0,00	24.987.144,52	11.140.830,35645814	2,2428440000
19/02/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	3.513.656,51	1.681.682,00775661	2,0893703410
19/02/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	5.000.000,00	2.212.092,81914570	2,2603029840
20/02/2020	VINCI MOSAICO FUNDO DE INVESTIMENTO DE ACOES	5.000.000,00	0,00	650.031,73909973	7,6919321000
20/02/2020	FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	487.144,52	0,00	337.939,96858854	1,4415120000
20/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	55.043,72	0,00	21.680,18764069	2,5388950000
20/02/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	5.000.000,00	2.211.807,19666581	2,2605948690
20/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	0,00	3.565.556,24	1.404.373,25686962	2,5388950000
21/02/2020	VINCI MOSAICO FUNDO DE INVESTIMENTO DE ACOES	5.000.000,00	0,00	649.082,89844022	7,7031763000
21/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	1.993.403,22	0,00	785.006,85019168	2,5393450000
21/02/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	1.961.848,03	0,00	938.767,44708481	2,0898125900
21/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	79.696.208,41	0,00	31.384.553,26471984	2,5393450000
21/02/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	63.000.000,00	0,00	33.950.312,90871731	1,8556530000
21/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	2.195.889,99	0,00	864.746,61379214	2,5393450000
21/02/2020	BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	0,00	64.961.848,03	28.732.446,00988181	2,2609230000
26/02/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	7.018.276,80	0,00	3.781.631,41486061	1,8558860000
27/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	29.651.389,81	0,00	11.671.822,55331293	2,5404250000
27/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	1.962.313,51	0,00	772.435,12798055	2,5404250000
27/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	6.646.694,27	0,00	2.616.370,98910615	2,5404250000
27/02/2020	BB PREVID RF FLUXO FIC	0,00	1.962.313,51	938.767,44917318	2,0903084270
28/02/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	3.217.927,64	0,00	1.733.463,78956203	1,8563570000
28/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	212.176,79	0,00	83.491,01035567	2,5413130000
28/02/2020	FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	0,00	70.027.000,00	37.722.808,70543759	1,8563570000

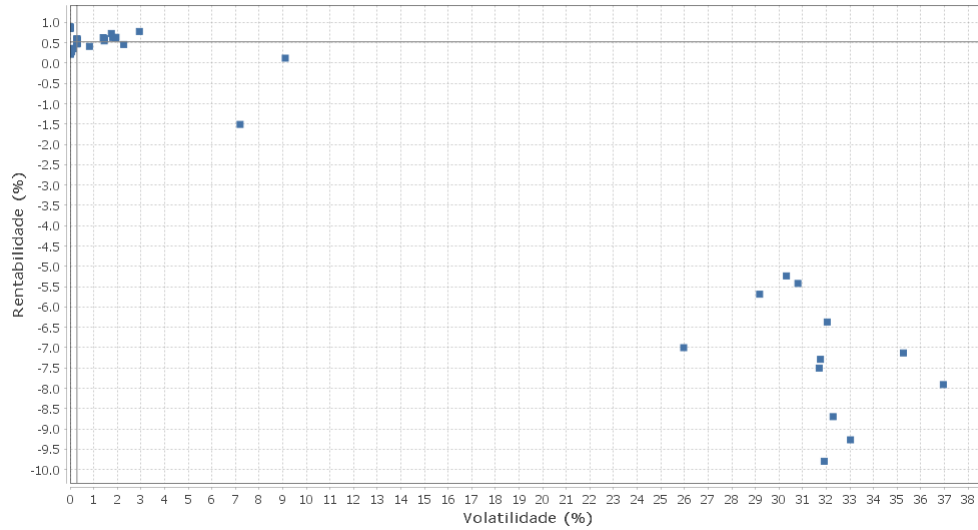
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Data	Ativo	Aplicação	Resgate	Quantidade	Valor Cota
28/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	0,00	141.962.612,09	55.861.915,50981717	2,5413130000
28/02/2020	FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	0,00	7.316.981,30	2.879.212,95015608	2,5413130000

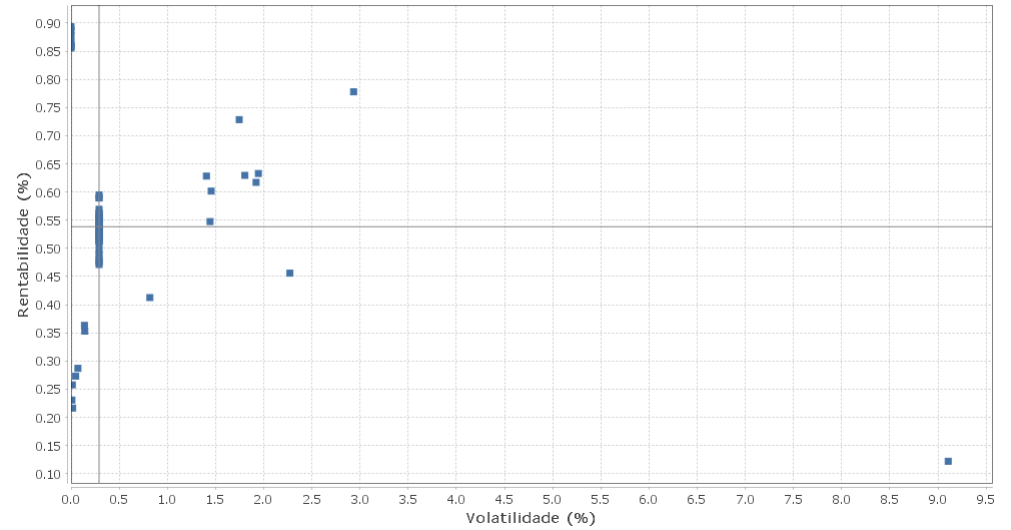
EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Risco - Dispersão

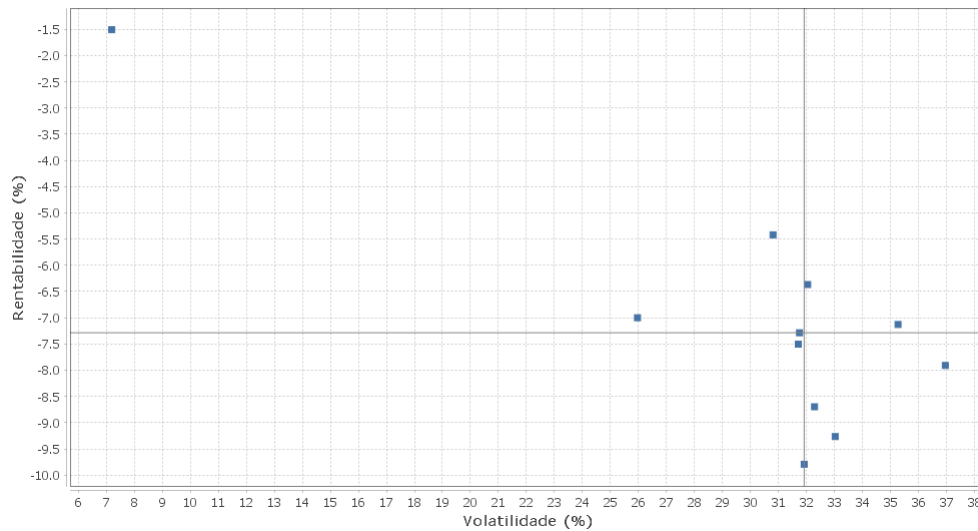
PARANA PREV - No Mês



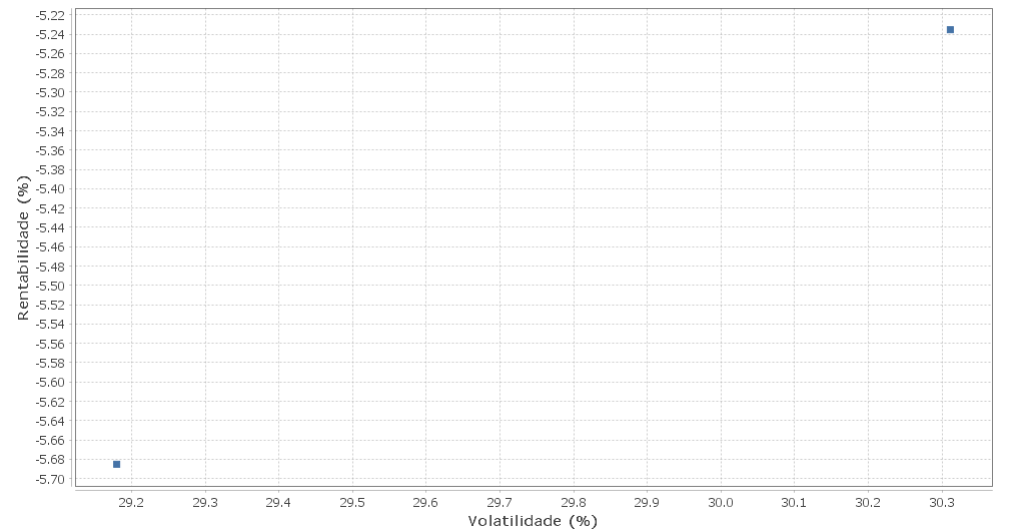
Renda Fixa - No Mês



Renda Variável e Investimentos Estruturados - No Mês



Investimentos no Exterior - No Mês



EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-F 2021 (12,710000%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,00	0,05	0,86	11.445.713,88	0,20
NTN-F 2021 (12,750000%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,00	0,05	0,86	11.442.394,94	0,20
NTN-F 2021 (13,160000%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,00	0,05	0,89	11.805.317,13	0,21
NTN-F 2021 (13,010000%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,00	0,05	0,88	11.420.874,30	0,20
NTN-F 2021 (12,830000%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,00	0,05	0,87	11.435.763,53	0,20
NTN-F 2021 (12,670000%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,00	0,05	0,86	11.449.034,97	0,20
NTN-F 2021 (13,260000%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,00	0,05	0,89	5.947.965,24	0,10
FI CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RF	Artigo 7º IV, Alínea a	0,01	0,01	0,23	3.244.152,01	0,06
ITAU INSTITUCIONAL ALOCACAO DINAMICA RF FICFI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,01	0,02	0,26	121.104.787,33	2,13
BB PREVID RF FLUXO FIC	Artigo 7º IV, Alínea a	0,02	0,01	0,22	0,00	0,00
BB PREVID RF REF DI LP PERFIL FIC FI	Artigo 7º IV, Alínea a	0,05	0,02	0,27	0,00	0,00
BNP PARIBAS TARGUS FIC DE FI RENDA FIXA CREDITO PR	Artigo 7º VII, Alínea b	0,07	0,02	0,29	430,54	0,00
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1 TP RF	Artigo 7º I, Alínea b	0,14	0,03	0,36	46.201.822,23	0,81
BB PREVID RF IRF-M1	Artigo 7º I, Alínea b	0,14	0,03	0,35	50.168.004,07	0,88
67-BRB FIRF 2023	Artigo 7º I, Alínea b	0,29	0,06	0,52	18.404.184,98	0,32
NTN-B 150820 (6,547252%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,29	0,06	0,56	52.845.882,92	0,93
NTN-B 150822 (6,230051%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,29	0,06	0,53	280.187.728,77	4,93
NTN-B 150523 (6,230209%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,29	0,06	0,53	70.191.865,21	1,24
NTN-B 150820 (6,417192%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,29	0,06	0,55	32.882.175,31	0,58
NTN-B 150820 (6,591253%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,29	0,06	0,56	18.162.290,26	0,32
NTN-B 150523 (6,338349%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,29	0,06	0,54	69.984.782,55	1,23
NTN-B 150822 (6,288608%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,29	0,06	0,54	279.830.763,42	4,92
NTN-B 150822 (5,448403%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,29	0,06	0,48	70.416.056,98	1,24
NTN-B 150820 (6,411379%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,29	0,06	0,55	86.586.416,39	1,52
NTN-B 150521 (6,053767%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,29	0,06	0,52	117.587.539,10	2,07
NTN-B 150820 (6,450601%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,29	0,06	0,55	27.094.929,13	0,48
NTN-B 150523 (6,440487%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,29	0,06	0,55	73.113.315,58	1,29
NTN-B 150523 (6,747233%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,29	0,06	0,57	145.010.432,39	2,55
NTN-B 150820 (6,149065%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,29	0,06	0,53	52.276.105,80	0,92
NTN-B 150820 (6,524832%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,29	0,06	0,55	49.547.856,16	0,87

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
NTN-B 150822 (5,299940%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,29	0,06	0,47	136.246.043,86	2,40
NTN-B 150523 (6,144256%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,29	0,06	0,53	68.681.908,67	1,21
NTN-B 150820 (6,654070%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,29	0,06	0,56	37.305.045,26	0,66
NTN-B 150830 (5,389448%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,29	0,06	0,48	307.969.657,37	5,42
NTN-B 150822 (5,569740%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,29	0,06	0,49	26.753.852,72	0,47
NTN-B 150820 (6,100603%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,29	0,06	0,53	51.294.395,62	0,90
NTN-B 150820 (6,056927%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,29	0,06	0,52	49.649.227,79	0,87
NTN-B 150820 (6,617127%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,29	0,06	0,56	32.688.438,69	0,58
NTN-B 150523 (5,926210%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,29	0,06	0,51	57.297.004,58	1,01
NTN-B 150830 (6,054890%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,29	0,06	0,52	33.363.262,10	0,59
NTN-B 150820 (6,502574%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,29	0,06	0,55	44.267.046,13	0,78
NTN-B 150820 (7,128576%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,29	0,06	0,59	9.883.602,86	0,17
NTN-B 150820 (6,057706%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,29	0,06	0,52	50.311.045,93	0,89
NTN-B 150820 (7,044014%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,29	0,06	0,59	19.774.454,28	0,35
NTN-B 150830 (6,348109%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,29	0,06	0,54	277.967.288,51	4,89
NTN-B 150820 (7,050743%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,29	0,06	0,59	19.773.877,17	0,35
NTN-B 150523 (5,918082%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,29	0,06	0,51	72.985.692,67	1,28
NTN-B 150523 (5,821837%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,29	0,06	0,51	67.601.628,35	1,19
NTN-B 150830 (5,659837%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,29	0,06	0,50	284.099.579,73	5,00
NTN-B 150523 (6,491301%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,29	0,06	0,55	71.352.719,77	1,26
NTN-B 150523 (5,981799%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,29	0,06	0,52	42.065.975,23	0,74
NTN-B 150521 (6,233645%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,29	0,06	0,53	117.356.606,42	2,07
NTN-B 150830 (5,349962%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,29	0,06	0,47	414.460.125,30	7,29
NTN-B 150523 (5,909982%)	Artigo 7º I, Alínea a	0,29	0,06	0,51	53.950.606,06	0,95
BB PREV RF VII	Artigo 7º I, Alínea b	0,82	0,11	0,41	19.545.706,34	0,34
BB PREV RF IDKA2	Artigo 7º I, Alínea b	1,41	0,18	0,63	57.866.269,06	1,02
BB PREV IPCA III	Artigo 7º I, Alínea b	1,44	0,18	0,55	66.391.379,44	1,17
FI CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	1,46	0,18	0,60	0,00	0,00
BB PREV IPCA I	Artigo 7º I, Alínea b	1,75	0,22	0,73	49.178.785,68	0,87
FI CAIXA BRASIL IMAB 5 TP RF LONGO PRAZO	Artigo 7º I, Alínea b	1,80	0,22	0,63	117.900.065,15	2,07

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Ativo	Estratégia	Volatilidade	VaR	Rent.	Valor(R\$)	% Carteira
FIC BRASIL GESTAO ESTRATEGICA RF	Artigo 7º I, Alínea b	1,92	0,23	0,62	202.717.211,90	3,57
BB PREV RF IRF-M	Artigo 7º I, Alínea b	1,94	0,24	0,63	94.395.130,17	1,66
BB PREV ALOC FIC	Artigo 7º I, Alínea b	2,27	0,26	0,46	219.928.446,04	3,87
FI CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TP RF LP	Artigo 7º I, Alínea b	2,93	0,35	0,78	27.902.938,99	0,49
FIC CAIXA ALOCACAO MACRO MULTIMERCADO LP	Artigo 8º III	7,20	0,66	-1,51	53.439.292,13	0,94
FIC TMJ FI RF LP IMAB 1000	Artigo 7º IV, Alínea a	9,11	0,95	0,12	70.521,79	0,00
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	Artigo 8º II, Alínea a	25,96	2,29	-7,00	52.337.930,53	0,92
FIA CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I	Artigo 9º A, III	29,18	2,70	-5,69	23.315.991,63	0,41
SAFRA CONS AMERICANO PB FI ACOES	Artigo 9º A, III	30,31	2,84	-5,24	34.858.772,96	0,61
VINCI MOSAICO FUNDO DE INVESTIMENTO DE ACOES	Artigo 8º II, Alínea a	30,80	2,88	-5,42	36.872.085,93	0,65
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	Artigo 8º III	31,70	2,85	-7,50	26.652.763,99	0,47
BAHIA AM VALUATION FIC DE FIA	Artigo 8º II, Alínea a	31,75	2,87	-7,29	15.583.174,09	0,27
ITAU ACOES DUNAMIS FIC	Artigo 8º II, Alínea a	31,91	2,73	-9,79	47.862.588,89	0,84
FIC ACOES CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS	Artigo 8º II, Alínea a	32,04	2,95	-6,37	86.765.272,85	1,53
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	Artigo 8º II, Alínea a	32,28	2,84	-8,70	78.772.916,80	1,39
ITAU INSTITUCIONAL ACOES PHOENIX FICFI	Artigo 8º II, Alínea a	33,02	2,88	-9,27	66.819.006,16	1,18
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIQ FIA	Artigo 8º II, Alínea a	35,27	3,24	-7,13	46.250.681,24	0,81
BRANCO FUNDO DE INVESTIMENTO EM ACOES MID SMALL	Artigo 8º II, Alínea a	36,95	3,37	-7,91	79.505.647,85	1,40

EXTRATO CONSOLIDADO DE ATIVOS

Observações

-Referente ao mês de fevereiro de 2020, vale observar que:

- O Instituto está com 24,93% do patrimônio líquido do fundo 67 - BRB FI RF 2023 (Art. 7, Inciso I, Alínea B), percentual este superior ao permitido na Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010;
- O Instituto está com 8,82% do patrimônio líquido do fundo BRASIL PORTOS E ATIVOS LOGÍSTICOS FIP (Art. 8, Inciso IV, Alínea A), percentual este superior ao permitido na Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010;
- O Instituto está com 18,92% do patrimônio líquido do fundo 59 - IND PARK FIP (Art. 8, Inciso IV, Alínea A), percentual este superior ao permitido na Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010;
- O Instituto está com 24,99% do patrimônio líquido do fundo BRB BLUEJAY FIP IMOBILIÁRIO MULTIESTRATÉGIA PARANÁ I (Art. 8, Inciso IV, Alínea A), percentual este superior ao permitido na Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010;
- O Instituto está com 13,19% do patrimônio líquido do fundo BTG PACTUAL INFRAESTRUTURA II FIC DE FIP (Art. 8, Inciso IV, Alínea A), percentual este superior ao permitido na Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010.