



# Relatório Analítico dos Investimentos em fevereiro de 2020

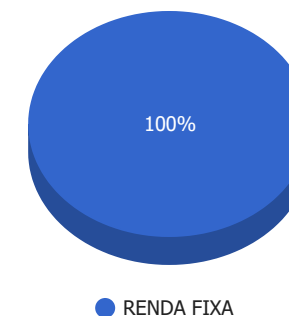
Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	58.035,71	2,16%	622	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVI...	D+2	Não há	9.232,57	0,34%	316	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	49.643,23	1,85%	644	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	6.207,10	0,23%	118	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.866.291,49	<b>69,53%</b>	191	0,49%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se ...	Não se aplica	694.711,74	<b>25,88%</b>	98	0,82%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>2.684.121,84</b>				

**Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Fevereiro / 2020)**

Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	67.268,28	2,51%	20,00%	30,00%	90,00%	2.348.441,38
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	1.610.473,10
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	1.922.141,82	71,61%	5,00%	25,00%	40,00%	-848.493,08
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	402.618,28
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	694.711,74	25,88%	0,00%	5,00%	5,00%	-560.505,65
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	134.206,09
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	134.206,09
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>2.684.121,84</b>	<b>100,00%</b>	<b>25,00%</b>	<b>70,00%</b>	<b>220,00%</b>	

**Distribuição por Segmento**



**⚠ ATENÇÃO!** Valores em desacordo com Artigo 7º, Inciso VII, § 5º

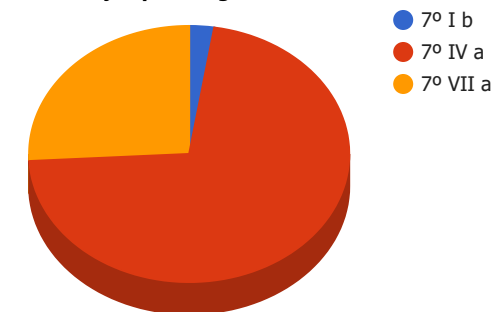
A totalidade das aplicações previstas nos incisos VI e VII não deverá exceder o limite de 15% (quinze por cento).

**⚠ ATENÇÃO!** O Somatório dos incisos "a" e "b" do Artigo 7º IV não podem ultrapassar 40% (quarenta por cento).

**Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Fevereiro / 2020)**

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	0,00	0,00%	7,00%	15,00%	20,00%	536.824,37
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	7,00%	10,00%	10,00%	268.412,18
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	134.206,09
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>14,00%</b>	<b>30,00%</b>	<b>35,00%</b>	

**Distribuição por Artigos**



**Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (Fevereiro / 2020)**

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	1.872.498,59	69,76	0,00
PETRA CAPITAL	694.711,74	25,88	0,09
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	116.911,51	4,36	0,00

**Artigo 14º** - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR)

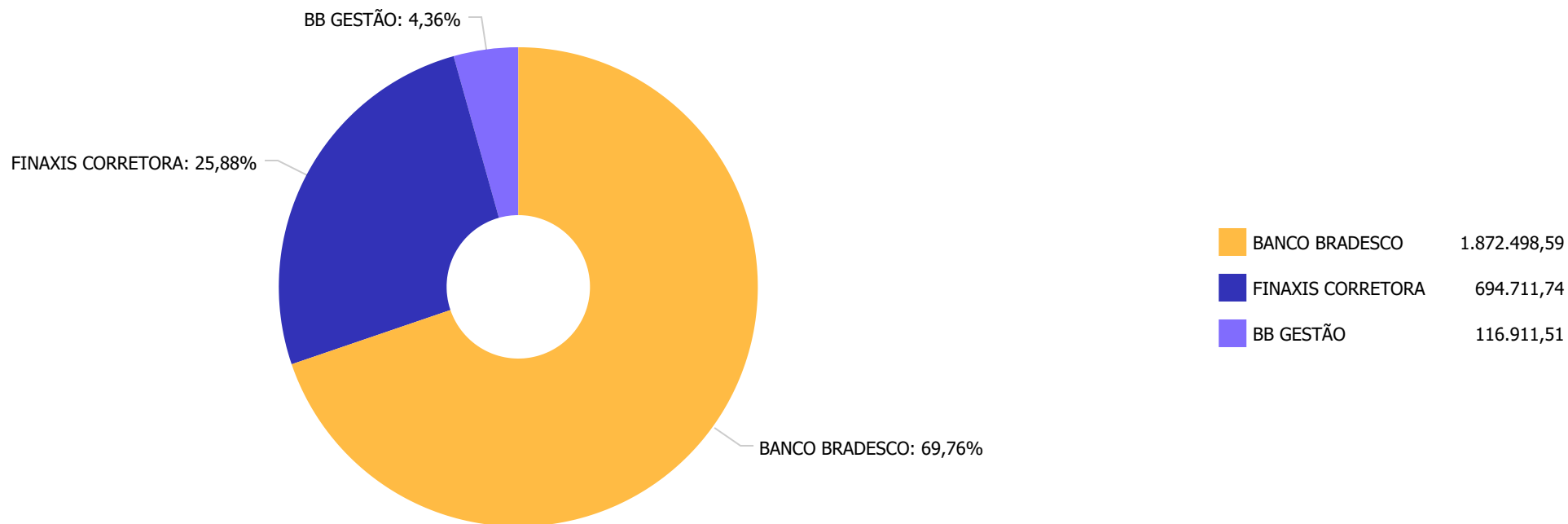
**Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos**

Artigos	Estratégia de Alocação - 2020		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	67.268,28	2,51	20,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	1.922.141,82	71,61	5,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	694.711,74	25,88	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	0,00	0,00	7,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00	7,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00

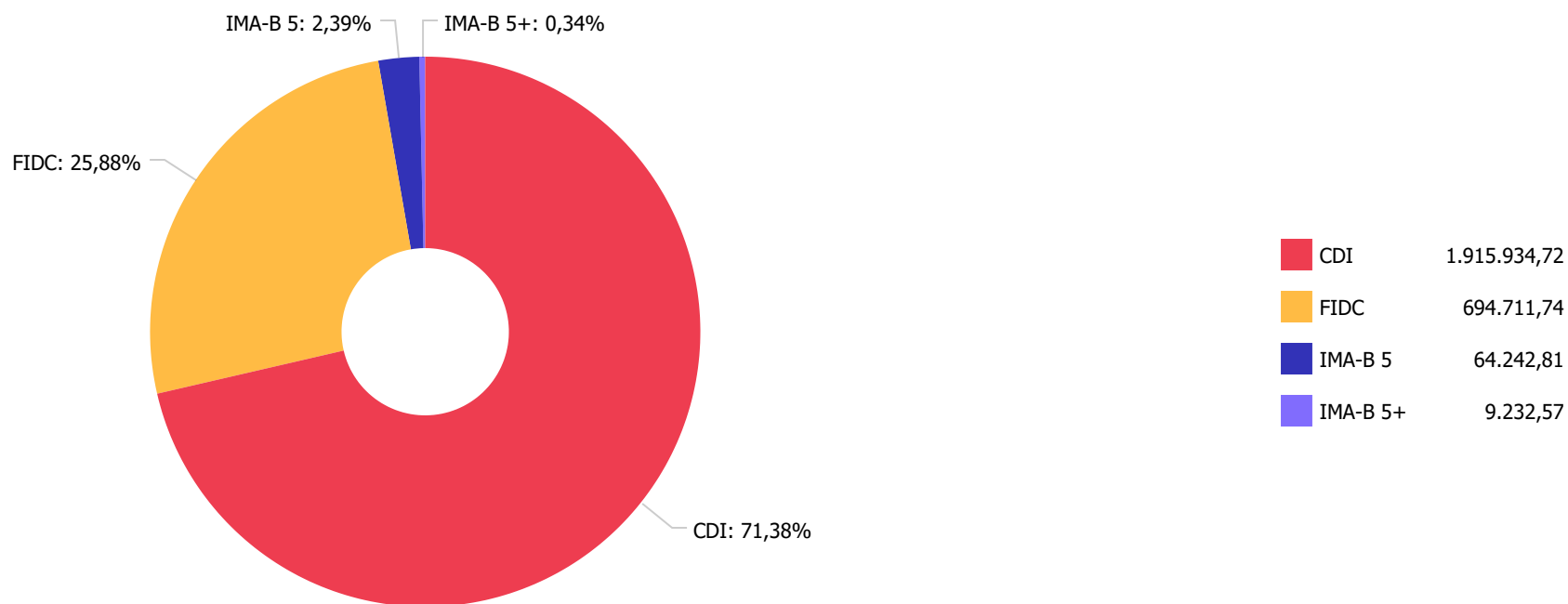
**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2020 - RENDA FIXA**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IMA-B 5+ (Benchmark)</b>	0,32%	0,35%	2,96%	7,23%	22,04%	43,07%	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,30%	0,35%	3,08%	7,29%	21,88%	42,45%	0,04%	0,10%
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	0,64%	1,20%	2,45%	5,66%	12,17%	23,49%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,65%	1,21%	2,42%	5,56%	11,96%	23,02%	0,01%	0,02%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	0,61%	1,17%	2,42%	5,56%	11,93%	22,91%	0,01%	0,02%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,29%	0,67%	1,05%	2,39%	5,57%	12,34%	-	-
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	0,26%	0,62%	0,97%	2,25%	5,28%	11,73%	0,00%	0,00%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,27%	0,62%	0,98%	2,23%	5,33%	11,98%	0,00%	0,00%
<b>IPCA (Benchmark)</b>	0,25%	0,46%	1,62%	2,20%	4,00%	8,05%	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,18%	-0,72%	-0,88%	-1,40%	-9,51%	-13,94%	0,00%	0,06%

Distribuição dos ativos por Administradores - base (Fevereiro / 2020)



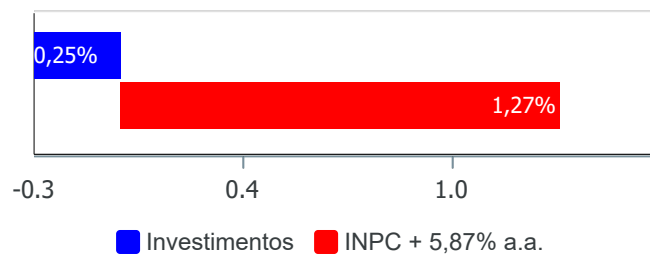
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Fevereiro / 2020)



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	1.128.083,55	47.145,98	403.210,41	769.023,75	-2.995,37	-2.995,37	-0,27%	-0,27%	0,69%	0,69%	-38,47%	0,59%
Fevereiro	769.023,75	1.914.597,25	0,00	2.684.121,84	500,84	-2.494,53	0,02%	-0,25%	0,58%	1,27%	-19,39%	0,05%

Investimentos x Meta Atuarial



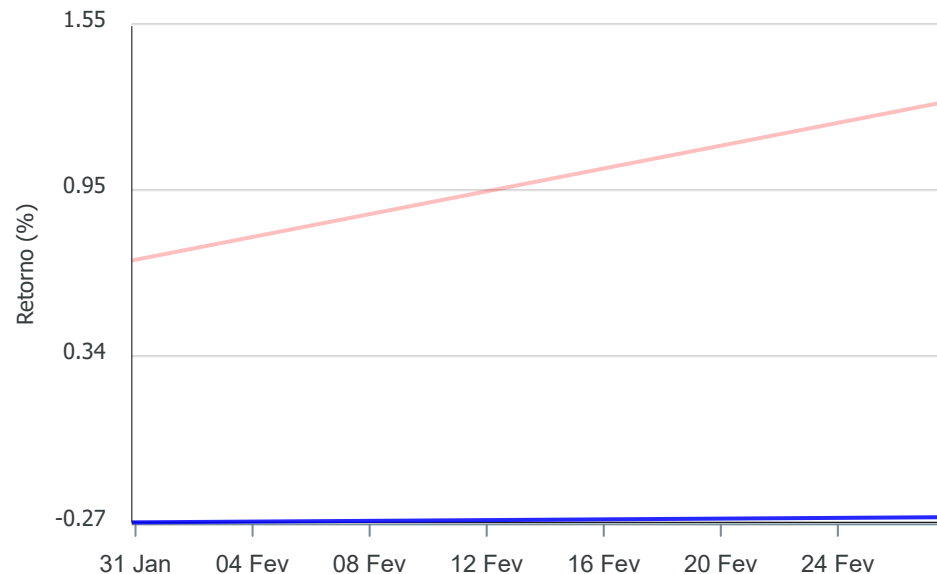
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



- Investimentos  Meta Atuarial  CDI  IMA-B  IMA-B 5
- IMA-B 5+  IMA Geral  IRF-M  IRF-M 1  IRF-M 1+
- Ibovespa  IBX  SMLL  IDIV

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Fevereiro/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	6.166,74	0,00	0,00	6.207,10	40,36	0,65%	0,65%	0,92%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	57.660,54	0,00	0,00	58.035,71	375,17	0,65%	0,65%	0,85%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	9.205,04	0,00	0,00	9.232,57	27,53	0,30%	0,30%	3,74%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	0,00	49.565,25	0,00	49.643,23	77,98	0,16%	0,27%	0,02%
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	0,00	1.865.032,00	0,00	1.866.291,49	1.259,49	0,07%	0,26%	0,01%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	695.991,43	0,00	0,00	694.711,74	-1.279,69	-0,18%	-0,18%	0,04%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>769.023,75</b>	<b>1.914.597,25</b>	<b>0,00</b>	<b>2.684.121,84</b>	<b>500,84</b>	<b>0,02%</b>		<b>0,05%</b>