



# CHORÓPREV

 Abril a Junho de 2020

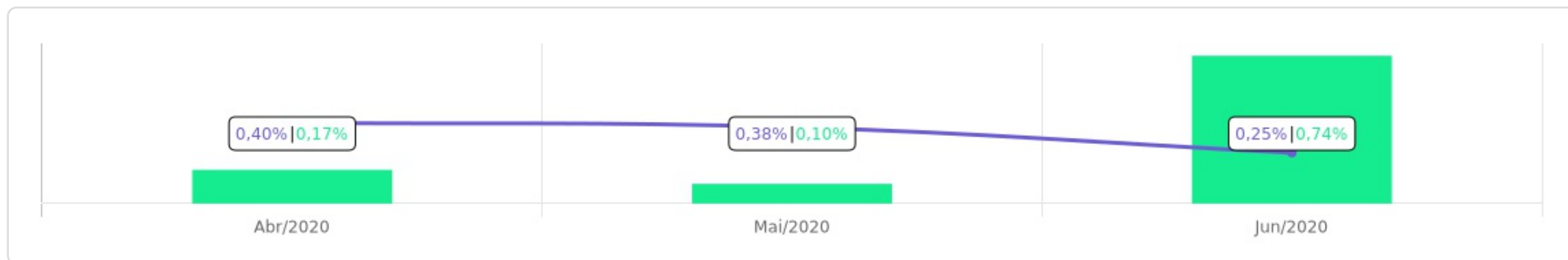


|  |  |     |       |       |       |   |     |       |       |       |   |     |       |           |          |   |
|--|--|-----|-------|-------|-------|---|-----|-------|-------|-------|---|-----|-------|-----------|----------|---|
| <p>Patrimônio</p> <p><b>R\$ 1.863.130,98</b></p> | <p>Rentabilidade</p> <table border="0"> <tr> <td>Mês</td> <td>Acum.</td> </tr> <tr> <td>0,25%</td> <td>1,04%</td> </tr> </table> | Mês | Acum. | 0,25% | 1,04% | <p>Meta</p> <table border="0"> <tr> <td>Mês</td> <td>Acum.</td> </tr> <tr> <td>0,74%</td> <td>1,00%</td> </tr> </table> | Mês | Acum. | 0,74% | 1,00% | <p>Gap</p> <table border="0"> <tr> <td>Mês</td> <td>Acum.</td> </tr> <tr> <td>-0,48p.p.</td> <td>0,04p.p.</td> </tr> </table> | Mês | Acum. | -0,48p.p. | 0,04p.p. | <p>VaR<sub>1,252</sub></p> <p>0,08%</p> |
| Mês  | Acum.  |     |       |       |       |   |     |       |       |       |   |     |       |           |          |   |
| 0,25%  | 1,04%  |     |       |       |       |   |     |       |       |       |   |     |       |           |          |   |
| Mês  | Acum.  |     |       |       |       |   |     |       |       |       |   |     |       |           |          |   |
| 0,74%  | 1,00%  |     |       |       |       |   |     |       |       |       |   |     |       |           |          |   |
| Mês  | Acum.  |     |       |       |       |   |     |       |       |       |   |     |       |           |          |   |
| -0,48p.p.  | 0,04p.p.   |     |       |       |       |   |     |       |       |       |   |     |       |           |          |   |

Evolução do Patrimônio

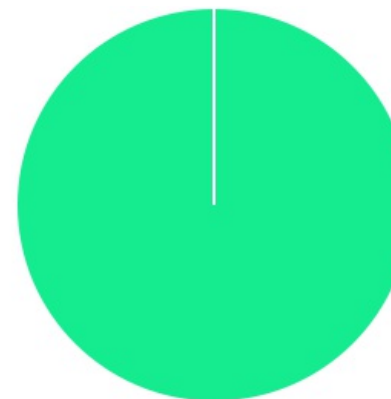




Comparativo (Rentabilidades | Metas)

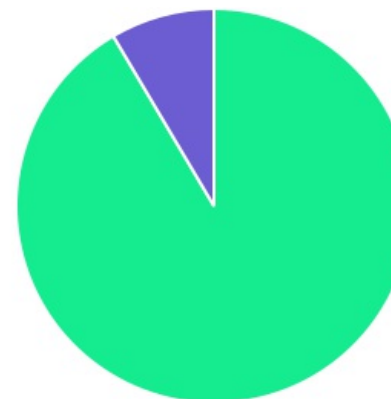


| ATIVO                       | SALDO                   | CARTEIRA(%)    | RESG. | 3.922     | RETORNO (R\$)        | (%)          | TX ADM |
|-----------------------------|-------------------------|----------------|-------|-----------|----------------------|--------------|--------|
| BB IRF-M 1 TP FIC RF PREVID | R\$ 1.689.986,88        | 90,71%         | D+0   | 7, I "b"  | R\$ 22.302,30        | 1,06%        | 0,10%  |
| BB IDKA 2 TP FI RF PREVID   | R\$ 14.811,17           | 0,79%          | D+1   | 7, I "b"  | R\$ 510,82           | 3,57%        | 0,20%  |
| BB FLUXO FIC RF PREVID      | R\$ 158.332,93          | 8,50%          | D+0   | 7, IV "a" | R\$ 915,09           | 0,32%        | 1,00%  |
| <b>Total investimentos</b>  | <b>R\$ 1.863.130,98</b> | <b>100.00%</b> |       |           | <b>R\$ 23.728,21</b> | <b>1,04%</b> |        |
| Disponibilidade             | R\$ 0,00                | -              |       |           | -                    | -            |        |
| <b>Total patrimônio</b>     | <b>R\$ 1.863.130,98</b> | <b>100.00%</b> |       |           | <b>-</b>             | <b>-</b>     |        |

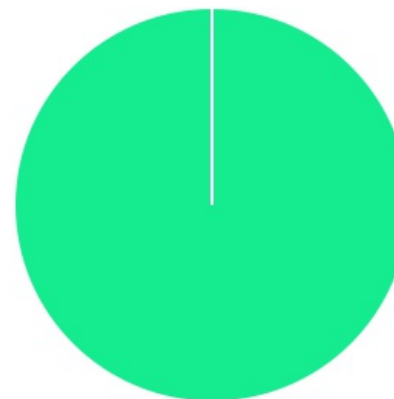
| CLASSE       | PERCENTUAL     | VALOR                   | LEG.  |
|--------------|----------------|-------------------------|---|
| Renda Fixa   | 100,00%        | R\$ 1.863.130,98        |  |
| <b>Total</b> | <b>100,00%</b> | <b>R\$ 1.863.130,98</b> |   |



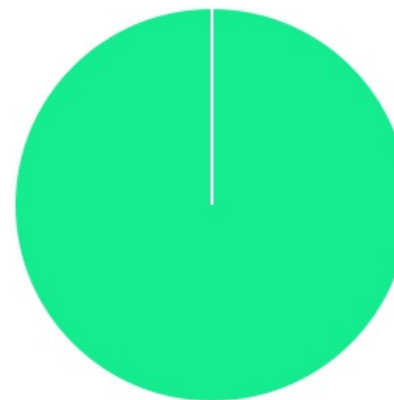
| ENQUADRAMENTO                     | PERCENTUAL     | VALOR                   | LEG.  |
|-----------------------------------|----------------|-------------------------|---|
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b " | 91,50%         | R\$ 1.704.798,05        |  |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea "a"  | 8,50%          | R\$ 158.332,93          |  |
| <b>Total</b>                      | <b>100,00%</b> | <b>R\$ 1.863.130,98</b> |   |






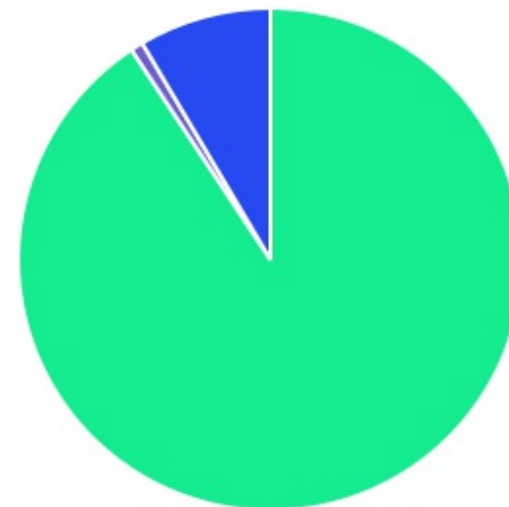
| GESTOR       | PERCENTUAL     | VALOR                   | LEG.  |
|--------------|----------------|-------------------------|---|
| BB GESTAO    | 100,00%        | R\$ 1.863.130,98        |  |
| <b>Total</b> | <b>100,00%</b> | <b>R\$ 1.863.130,98</b> |   |



| ADMINISTRADOR | PERCENTUAL     | VALOR                   | LEG.  |
|---------------|----------------|-------------------------|---|
| BB GESTAO     | 100,00%        | R\$ 1.863.130,98        |  |
| <b>Total</b>  | <b>100,00%</b> | <b>R\$ 1.863.130,98</b> |   |



| BENCHMARK    | PERCENTUAL     | VALOR                   | LEG.  |
|--------------|----------------|-------------------------|---|
| IRF-M 1      | 90,71%         | R\$ 1.689.986,88        |  |
| CDI          | 8,50%          | R\$ 158.332,93          |  |
| IDKA IPCA 2A | 0,79%          | R\$ 14.811,17           |  |
| <b>Total</b> | <b>100,00%</b> | <b>R\$ 1.863.130,98</b> |   |



| LIQUIDEZ     | PERCENTUAL     | VALOR                   | LEG.                                 |
|--------------|----------------|-------------------------|--------------------------------------|
| 0 a 30 dias  | 100,00%        | R\$ 1.863.130,98        | <span style="color: green;">■</span> |
| <b>Total</b> | <b>100,00%</b> | <b>R\$ 1.863.130,98</b> |                                      |



| RENDA FIXA   | RESOLUÇÃO(%) | CARTEIRA (R\$)          | (%)            | POLÍTICA DE INVESTIMENTO |         |             |
|--|--------------|-------------------------|----------------|--------------------------|---------|-------------|
|  |              |                         |                | Inferior(%)              | Alvo(%) | Superior(%) |
| Títulos Tesouro Nacional - SELIC - 7, I "a"            | 100%         | R\$ 0,00                | 0.00%          | 0,00%                    | 0,00%   | 100,00%     |
| FI Renda Fixa Referenciado 100% títulos TN - 7, I "b"  | 100%         | R\$ 1.704.798,05        | 91.50%         | 0,00%                    | 62,00%  | 100,00%     |
| FI em Índices de Renda Fixa 100% títulos TN - 7, I "c" | 100%         | R\$ 0,00                | 0.00%          | 0,00%                    | 0,00%   | 100,00%     |
| Operações Compromissadas - 7, II                       | 5%           | R\$ 0,00                | 0.00%          | 0,00%                    | 0,00%   | 5,00%       |
| FI Renda Fixa Referenciados - 7, III "a"               | 60%          | R\$ 0,00                | 0.00%          | 0,00%                    | 0,00%   | 60,00%      |
| FI de Índices Renda Fixa - 7, III "b"                  | 60%          | R\$ 0,00                | 0.00%          | 0,00%                    | 0,00%   | 60,00%      |
| FI de Renda Fixa - 7, IV "a"                           | 40%          | R\$ 158.332,93          | 8.50%          | 0,00%                    | 38,00%  | 40,00%      |
| FI de Índices Renda Fixa - 7, IV "b"                   | 40%          | R\$ 0,00                | 0.00%          | 0,00%                    | 0,00%   | 40,00%      |
| Letras Imobiliárias Garantidas - 7, V "b"              | 20%          | R\$ 0,00                | 0.00%          | 0,00%                    | 0,00%   | 20,00%      |
| Certificados de Depósitos Bancários (CDB) - 7, VI "a"  | 15%          | R\$ 0,00                | 0.00%          | 0,00%                    | 0,00%   | 15,00%      |
| Poupança - 7, VI "b"                                   | 15%          | R\$ 0,00                | 0.00%          | 0,00%                    | 0,00%   | 15,00%      |
| FI Direitos Creditórios (FIDC) - sênior - 7, VII "a"   | 5%           | R\$ 0,00                | 0.00%          | 0,00%                    | 0,00%   | 5,00%       |
| FI Renda Fixa "Crédito Privado" - 7, VII "b"           | 5%           | R\$ 0,00                | 0.00%          | 0,00%                    | 0,00%   | 5,00%       |
| FI Debêntures - 7, VII "c"                             | 5%           | R\$ 0,00                | 0.00%          | 0,00%                    | 0,00%   | 5,00%       |
| <b>Total Renda Fixa</b>                                |              | <b>R\$ 1.863.130,98</b> | <b>100,00%</b> |                          |         |             |



| RENDA VARIÁVEL                               | RESOLUÇÃO(%) | CARTEIRA (R\$)          | (%)            | POLÍTICA DE INVESTIMENTO |         |             |
|--|--------------|-------------------------|----------------|--------------------------|---------|-------------|
|  |              |                         |                | Inferior(%)              | Alvo(%) | Superior(%) |
| FI Ações Referenciados - 8, I "a"            | 30%          | R\$ 0,00                | 0,00%          | 0,00%                    | 0,00%   | 30,00%      |
| FI de Índices Ações Referenciados - 8, I "b" | 30%          | R\$ 0,00                | 0,00%          | 0,00%                    | 0,00%   | 30,00%      |
| FI em Ações Livre - 8, II "a"                | 20%          | R\$ 0,00                | 0,00%          | 0,00%                    | 0,00%   | 20,00%      |
| FI de Índices em Ações Livre - 8, II "b"     | 20%          | R\$ 0,00                | 0,00%          | 0,00%                    | 0,00%   | 20,00%      |
| FI Multimercado - 8, III                     | 10%          | R\$ 0,00                | 0,00%          | 0,00%                    | 0,00%   | 10,00%      |
| FI em Participações - 8, IV "a"              | 5%           | R\$ 0,00                | 0,00%          | 0,00%                    | 0,00%   | 5,00%       |
| FI Imobiliário - 8, IV "b"                   | 5%           | R\$ 0,00                | 0,00%          | 0,00%                    | 0,00%   | 5,00%       |
| <b>Total Renda Variável</b>                  |              | <b>R\$ 0,00</b>         | <b>0,00%</b>   |                          |         |             |
| INVESTIMENTOS NO EXTERIOR                    | RESOLUÇÃO(%) | CARTEIRA (R\$)          | (%)            | Inferior(%)              | Alvo(%) | Superior(%) |
| Renda Fixa - Dívida Externa - 9 - A, I       | 10%          | R\$ 0,00                | 0,00%          | 0,00%                    | 0,00%   | 10,00%      |
| Investimento no Exterior - 9 - A, II         | 10%          | R\$ 0,00                | 0,00%          | 0,00%                    | 0,00%   | 10,00%      |
| Ações - BDR Nível I - 9 - A, III             | 10%          | R\$ 0,00                | 0,00%          | 0,00%                    | 0,00%   | 10,00%      |
| <b>Total Investimentos no exterior</b>       |              | <b>R\$ 0,00</b>         | <b>0,00%</b>   |                          |         |             |
| <b>Total Global</b>                          |              | <b>R\$ 1.863.130,98</b> | <b>100,00%</b> |                          |         |             |

| PERÍODO | SALDO ANTERIOR   | SALDO FINAL      | META              | RENT.(R\$)    | RENT.(%) | GAP       |
|---------|------------------|------------------|-------------------|---------------|----------|-----------|
| 2020    |                  |                  | IPCA + 5.89% a.a. |               |          |           |
| Abril   | R\$ 2.461.456,18 | R\$ 2.296.797,01 | 0,17%             | R\$ 9.860,20  | 0,40%    | 0,24p.p.  |
| Maiο    | R\$ 2.296.797,01 | R\$ 2.081.557,07 | 0,10%             | R\$ 8.633,38  | 0,38%    | 0,28p.p.  |
| Junho   | R\$ 2.081.557,07 | R\$ 1.863.130,98 | 0,74%             | R\$ 5.234,63  | 0,25%    | -0,48p.p. |
| Total   | R\$ 2.081.557,07 | R\$ 1.863.130,98 | 1,00%             | R\$ 23.728,21 | 1,04%    | 0,04p.p.  |

| ATIVO                      | CNPJ               | RENTABILIDADE |         |         |               |
|----------------------------|--------------------|---------------|---------|---------|---------------|
|                            |                    | Abr (%)       | Mai (%) | Jun (%) | Trimestre (%) |
| BB IRF-M 1 TP FIC RF...    | 11.328.882/0001-35 | 0,41%         | 0,39%   | 0,26%   | 1,06%         |
| BB FLUXO FIC RF PREVID     | 13.077.415/0001-05 | 0,11%         | 0,09%   | 0,13%   | 0,32%         |
| BB PERFIL FIC RF REF DI... | 13.077.418/0001-49 | -             | -       | -       | -             |
| BB IDKA 2 TP FI RF...      | 13.322.205/0001-35 | 0,32%         | 2,00%   | 1,21%   | 3,57%         |
| BB IRF-M TP FI RF PREVID   | 07.111.384/0001-69 | -             | -       | -       | -             |
| BB FI MULTIMERCADO...      | 10.418.362/0001-50 | -             | -       | -       | -             |

| TÍTULO         | VENC. | COMPRA | QTD. | P.U.<br>COMPRA | ATUAL | MARCAÇÃO | VALOR COMPRA | VALOR ATUAL | RETORNO            |
|----------------|-------|--------|------|----------------|-------|----------|--------------|-------------|--------------------|
| Total Públicos |       |        |      |                |       |          | R\$ 0,00     | R\$ 0,00    | R\$ 0,00 ( 0,00% ) |
| Total Privados |       |        |      |                |       |          | R\$ 0,00     | R\$ 0,00    | R\$ 0,00 ( 0,00% ) |
| Total Global   |       |        |      |                |       |          | R\$ 0,00     | R\$ 0,00    | R\$ 0,00 ( 0,00% ) |