

Relatório Analítico dos Investimentos

em janeiro de 2020

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
TÍTULOS PÚBLICOS			2.144.531,45	0,46%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	13.184.098,06	2,86%	615	0,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	24.677.456,76	5,35%	717	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	15.868.015,20	3,44%	359	0,70%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	83.885.658,99	18,18%	922	0,86%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	54.592,11	0,01%	1.213	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	15.755.532,18	3,42%	583	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	24.730.535,42	5,36%	969	0,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	11.813.164,99	2,56%	888	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	85.788.310,45	18,60%	941	1,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	39.550,66	0,01%	1.361	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	7.212.099,37	1,56%	169	0,64%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	127.947,38	0,03%	684	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	13.364.510,36	2,90%	118	0,68%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	5.717.814,78	1,24%	288	0,11%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	15.785.147,54	3,42%	91	4,73%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	D+1009	Não há	766.709,75	0,17%	28	1,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL	D+1260	Não há	2.392.354,88	0,52%	19	4,20%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	3.982.436,77	0,86%	33	2,07%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	830.643,66	0,18%	70	1,09%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "

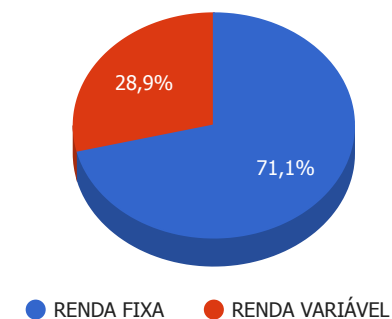
Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	D+4	Não há	21.383.897,90	4,64%	1.141	2,59%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	18.382.728,13	3,98%	165	0,74%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	23.167.825,73	5,02%	58.612	0,51%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	13.672.410,25	2,96%	51	1,54%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	D+4	Não há	4.633.615,79	1,00%	17.285	0,39%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	12.967.024,44	2,81%	4.330	1,10%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CONSTÂNCIA BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	18.742.969,50	4,06%	68	5,80%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	9.848.411,11	2,13%	26.307	0,15%	Artigo 8º, Inciso III
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	4.736.518,57	1,03%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
ÁTICO FLORESTAL BRASIL FICFIP	Não se ...	Não se aplica	643.668,42	0,14%	17	2,71%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
BRASIL FLORESTAL MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	646.867,22	0,14%	21	0,56%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	Não se ...	Não se aplica	2.450.427,15	0,53%		1,55%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
OSASCO PROPERTIES FII	Não se ...	Não se aplica	1.926.164,88	0,42%		0,46%	Desenquadrado - RV
Total para cálculo dos limites da Resolução			461.323.639,85				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			1.348,76	Artigo 6º			
PL Total			461.324.988,61				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENTA FIXA) - base (Janeiro / 2020)

Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "	100,00%	2.144.531,45	0,46%	0,00%	0,50%	50,00%	228.517.288,48
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	275.796.914,82	59,78%	15,00%	50,50%	90,00%	139.394.361,05
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	23.066.181,99
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	42.974.229,18	9,32%	2,00%	10,00%	40,00%	141.555.226,76
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	7.205.435,31	1,56%	0,00%	2,00%	5,00%	15.860.746,68
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	23.066.181,99
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	23.066.181,99
Total Renda Fixa	100,00%	328.121.110,76	71,13%	17,00%	63,00%	200,00%	

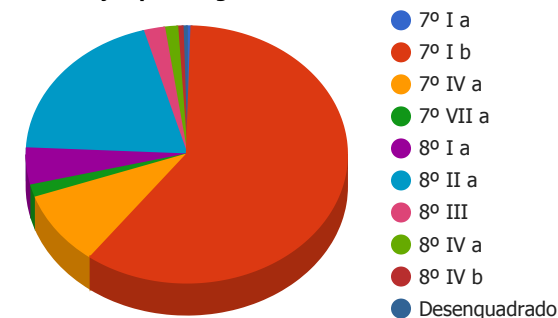
Distribuição por Segmento



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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	21.383.897,90	4,64%	0,00%	5,00%	10,00%	24.748.466,09
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	23.066.181,99
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	91.566.573,84	19,85%	7,00%	19,00%	20,00%	698.154,13
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	46.132.363,99
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	9.848.411,11	2,13%	0,00%	3,00%	10,00%	36.283.952,88
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	6.027.054,21	1,31%	0,00%	2,00%	5,00%	17.039.127,78
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	2.450.427,15	0,53%	0,00%	1,00%	5,00%	20.615.754,84
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " c "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	23.066.181,99
Desenquadrado - RV	0,00%	1.926.164,88	0,42%	0,00%	0,00%	0,00%	-1.926.164,88
Total Renda Variável	30,00%	133.202.529,09	28,87%	7,00%	30,00%	70,00%	

Distribuição por Artigos



Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2020			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	46.132.363,99
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	23.066.181,99
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	7,00%	15,00%	

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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	244.965.885,97	53,10	0,05
ITAÚ UNIBANCO	63.053.516,18	13,67	0,00
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	62.191.285,24	13,48	0,00
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	20.576.609,73	4,46	0,00
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	18.742.969,50	4,06	1,49
ITAÚ DTVM	13.672.410,25	2,96	0,00
NAVI CAPITAL	12.967.024,44	2,81	0,71
A5 CAPITAL PARTNERS	4.736.518,57	1,03	-
SULAMÉRICA INVESTIMENTOS	4.633.615,79	1,00	0,01
GRAPHEN INVESTIMENTOS LTDA	4.047.780,56	0,88	4,08
AURORA CAPITAL	3.982.436,77	0,86	5,39
RJI CORRETORA DE VALORES	2.392.354,88	0,52	1,24
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...)	2.144.531,45	0,46	-
CADENCE GESTORA	1.926.164,88	0,42	-
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	646.867,22	0,14	0,15
ÁTICO ASSET MANAGEMENT	643.668,42	0,14	2,71

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 "a"	2.144.531,45	0,46	0,00	50,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea "b"	275.796.914,82	59,78	15,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea "a"	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea "a"	42.974.229,18	9,32	2,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea "a"	7.205.435,31	1,56	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 I, Alínea "a"	21.383.897,90	4,64	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea "b"	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea "a"	91.566.573,84	19,85	7,00	20,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea "b"	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso III	9.848.411,11	2,13	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea "a"	6.027.054,21	1,31	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea "b"	2.450.427,15	0,53	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea "c"	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º - A, Inciso III	0,00	0,00	0,00	5,00
Desenquadrado - RV	1.926.164,88	0,42	0,00	0,00

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA Geral ex-C (Benchmark)	0,50%	0,50%	0,70%	4,08%	11,07%	22,22%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,49%	0,49%	0,50%	3,93%	11,38%	22,76%	0,01%	0,03%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,54%	0,54%	1,76%	4,74%	11,02%	22,45%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,46%	0,46%	1,57%	4,44%	10,30%	20,93%	0,01%	0,02%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,38%	0,38%	1,75%	4,52%	10,29%	20,76%	0,01%	0,02%
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	0,80%	0,80%	3,62%	5,65%	11,52%	23,76%	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	-5,11%	-5,11%	-4,98%	-9,06%	-13,16%	-27,14%	0,11%	0,09%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-0,11%	-0,11%	-0,71%	-1,83%	-0,15%	1.261,32%	0,01%	0,01%
IMA-B 5+ (Benchmark)	0,03%	0,03%	-1,54%	6,07%	22,33%	43,41%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,04%	-0,04%	-1,75%	5,77%	21,74%	42,13%	0,03%	0,09%
120% do CDI (Benchmark)	0,45%	0,45%	1,36%	3,13%	6,98%	15,22%	-	-
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL	-0,07%	-0,07%	-0,28%	0,31%	-	2,31%	-	-
IRF-M 1 (Benchmark)	0,44%	0,44%	1,20%	3,05%	6,61%	14,04%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,42%	0,42%	1,14%	2,93%	6,40%	13,64%	0,00%	0,00%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,42%	0,42%	1,13%	2,89%	6,33%	13,50%	0,00%	0,00%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA-B 5 (Benchmark)	0,56%	0,56%	1,51%	5,04%	12,06%	23,36%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,56%	0,56%	1,44%	4,92%	11,82%	22,86%	0,01%	0,02%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,54%	0,54%	1,41%	4,89%	11,76%	22,83%	0,01%	0,02%
IMA-B (Benchmark)	0,26%	0,26%	-0,24%	5,64%	18,11%	34,79%	-	-
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	0,24%	0,24%	-0,29%	2,54%	8,67%	-	0,01%	0,03%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	0,21%	0,21%	-0,59%	5,76%	19,42%	35,88%	0,02%	0,07%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,25%	0,25%	-0,36%	5,44%	17,72%	34,14%	0,02%	0,06%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	0,27%	0,27%	-0,33%	5,66%	17,92%	34,49%	0,02%	0,07%
CDI (Benchmark)	0,38%	0,38%	1,14%	2,60%	5,78%	12,53%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,37%	0,37%	1,03%	2,44%	5,55%	12,08%	0,00%	0,00%
IPCA (Benchmark)	0,21%	0,21%	1,88%	2,05%	4,19%	8,13%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,34%	0,34%	1,04%	2,66%	9,69%	19,74%	0,00%	0,02%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,43%	0,43%	0,33%	3,87%	10,74%	21,90%	0,01%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,82%	0,82%	0,91%	4,67%	14,10%	25,30%	0,01%	0,04%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	1,09%	1,09%	4,45%	7,40%	15,18%	31,97%	-	-
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	-	-

IPCA + 9,00% ao ano (Benchmark)	0,97%	0,97%	4,10%	6,66%	13,61%	28,42%	-	-
BRASIL FLORESTAL MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	0,00%	-

IGC (Benchmark)	0,07%	0,07%	9,76%	17,22%	26,02%	43,12%	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	-1,09%	-1,09%	7,44%	14,37%	19,95%	39,21%	0,10%	0,09%

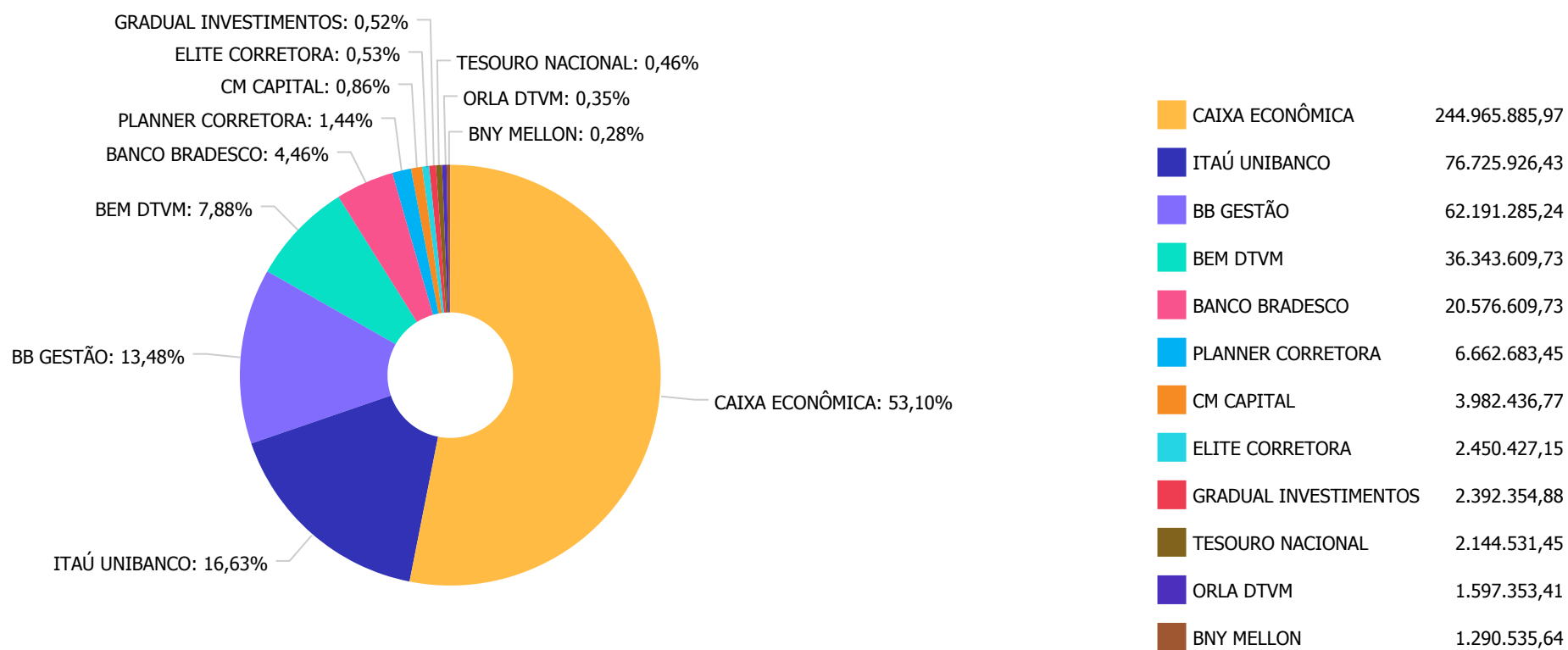
Ibovespa (Benchmark)	-1,63%	-1,63%	6,10%	11,74%	16,80%	33,97%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1,47%	1,47%	15,18%	17,48%	31,03%	65,96%	0,10%	0,11%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-0,19%	-0,19%	9,98%	18,27%	31,46%	59,14%	0,09%	0,10%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	1,92%	1,92%	13,33%	19,18%	34,04%	65,26%	0,10%	0,09%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	0,68%	0,68%	10,42%	16,16%	23,73%	43,87%	0,09%	0,09%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-2,30%	-2,30%	6,69%	15,24%	22,87%	63,81%	0,10%	0,11%
CONSTÂNCIA BRASIL FI AÇÕES	-0,68%	-0,68%	10,34%	15,34%	20,26%	44,74%	0,09%	0,10%

CDI (Benchmark)	0,38%	0,38%	1,14%	2,60%	5,78%	12,53%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,68%	0,68%	3,58%	6,70%	14,67%	28,07%	0,02%	0,02%

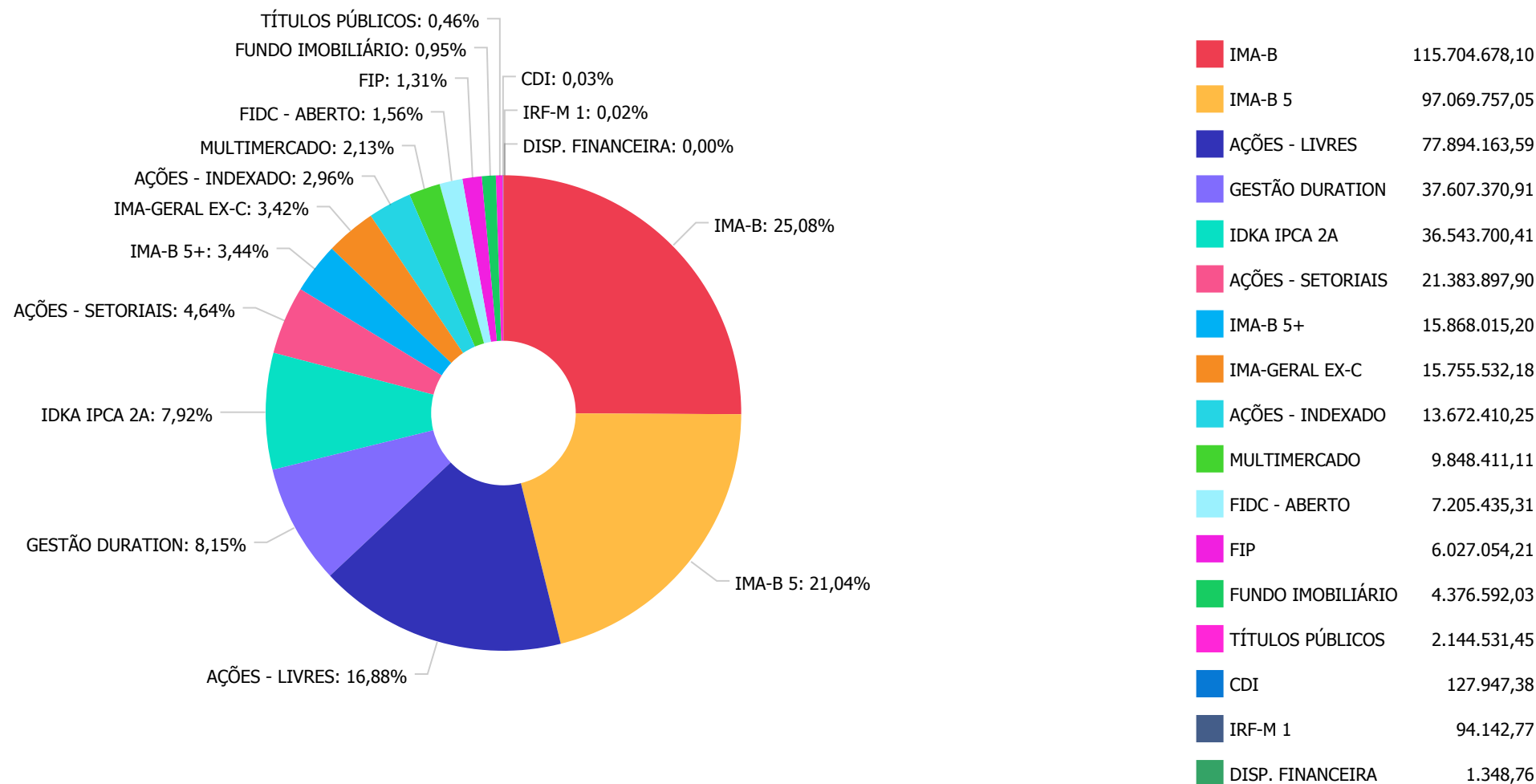
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	-0,20%	-0,20%	-0,31%	-	-	-	0,00%	0,00%
ÁTICO FLORESTAL BRASIL FICFIP	-	-	-	-	-	-	0,00%	0,12%
OSASCO PROPERTIES FII	-0,14%	-0,14%	-0,27%	443.674.239,07%	443.674.239,07%	-	-	-

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



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



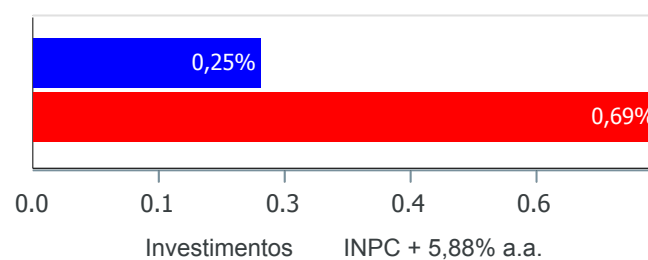
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Janeiro / 2020)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	31/07/2019	414	4.824,512202	4.916,333174	1.997.348,05	2.035.361,93	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	18/11/2019	7	4.995,267412	5.121,663370	34.966,87	35.851,64	Curva

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

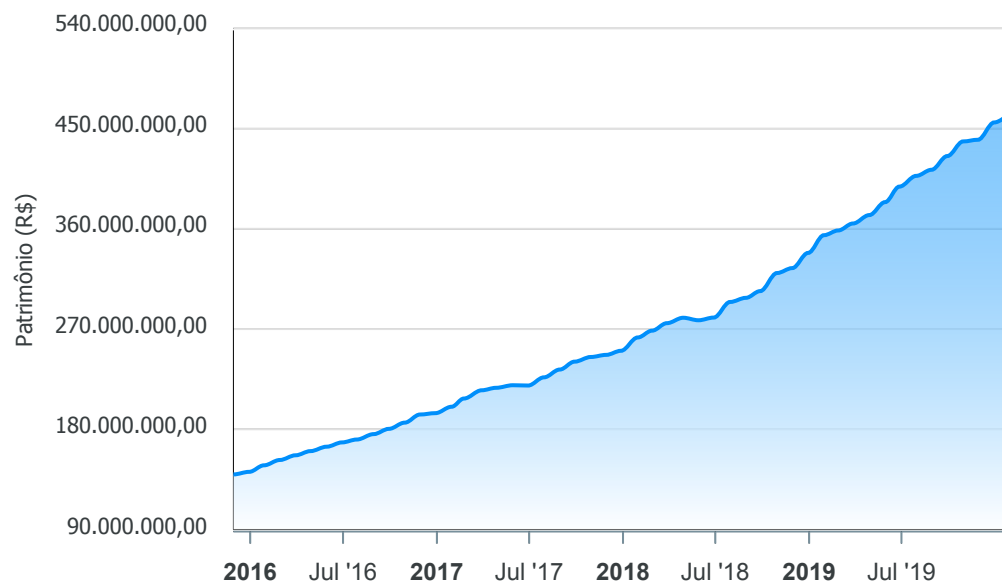
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	454.864.737,50	21.816.085,69	16.528.778,45	461.323.639,85	1.171.595,11	1.171.595,11	0,25%	0,25%	0,69%	0,69%	36,85%	3,25%

Investimentos x Meta Atuarial



Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

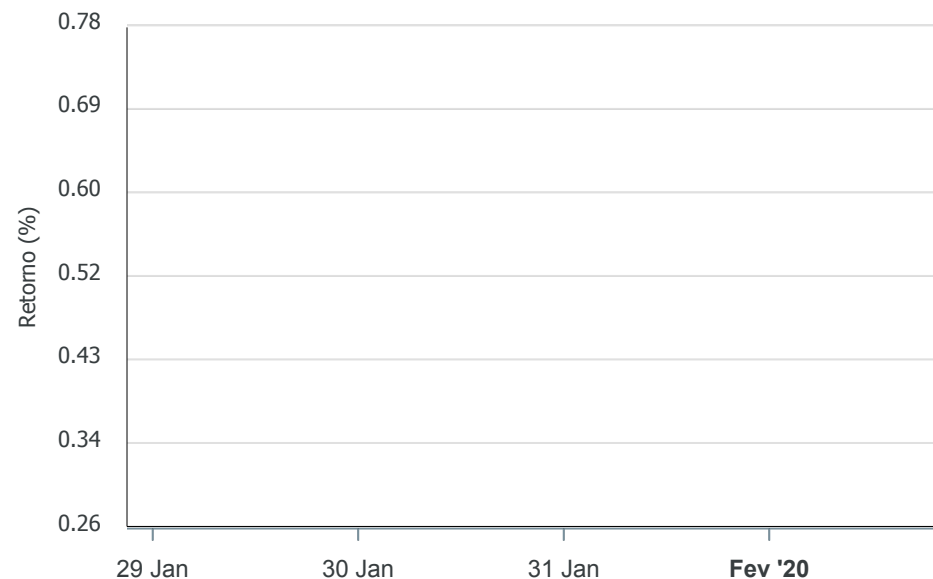
Evolução do Patrimônio



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 Janeiro/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
TÍTULOS PÚBLICOS	2.113.655,00	0,00	0,00	2.144.531,45	30.876,45	1,46%	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	4.196.748,74	0,00	248.501,91	3.982.436,77	34.189,94	0,81%	-5,11%	10,98%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	20.252.205,04	4.258.138,14	0,00	24.677.456,76	167.113,58	0,68%	0,82%	0,64%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	82.694.806,47	738.235,64	1.348,76	83.885.658,99	453.965,64	0,54%	0,54%	0,64%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	5.739.361,57	7.379.694,19	0,00	13.184.098,06	65.042,30	0,50%	0,56%	0,62%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.679.355,50	0,00	0,00	15.755.532,18	76.176,68	0,49%	0,49%	0,72%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	24.617.993,32	0,00	0,00	24.730.535,42	112.542,10	0,46%	0,46%	0,55%
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	7.181.304,77	0,00	0,00	7.212.099,37	30.794,60	0,43%	0,43%	0,65%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	39.384,23	0,00	0,00	39.550,66	166,43	0,42%	0,42%	0,09%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	54.364,14	0,00	0,00	54.592,11	227,97	0,42%	0,42%	0,09%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	11.767.860,14	0,00	0,00	11.813.164,99	45.304,85	0,38%	0,38%	0,55%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	5.698.396,84	0,00	0,00	5.717.814,78	19.417,94	0,34%	0,34%	0,00%
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	13.327.880,20	0,00	0,00	13.364.510,36	36.630,16	0,27%	0,27%	1,70%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	85.116.569,19	459.440,54	0,00	85.788.310,45	212.300,72	0,25%	0,25%	1,67%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	764.854,78	0,00	0,00	766.709,75	1.854,97	0,24%	0,24%	0,75%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	15.752.844,39	0,00	0,00	15.785.147,54	32.303,15	0,21%	0,21%	1,70%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	40.343,34	8.980.577,18	8.899.223,14	127.947,38	6.250,00	0,07%	0,37%	0,01%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	15.874.134,39	0,00	0,00	15.868.015,20	-6.119,19	-0,04%	-0,04%	2,62%
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL	2.393.920,60	0,00	0,00	2.392.354,88	-1.565,72	-0,07%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	831.536,57	0,00	0,00	830.643,66	-892,91	-0,11%	-0,11%	0,62%

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
Total Renda Fixa	314.137.519,22	21.816.085,69	9.149.073,81	328.121.110,76	1.316.579,66	0,40%		1,21%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	4.546.397,84	0,00	0,00	4.633.615,79	87.217,95	1,92%	1,92%	9,87%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	18.116.938,52	0,00	0,00	18.382.728,13	265.789,61	1,47%	1,47%	9,71%
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	7.315.765,53	0,00	7.379.704,64	0,00	63.939,11	0,87%	-0,42%	8,34%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	9.781.546,90	0,00	0,00	9.848.411,11	66.864,21	0,68%	0,68%	1,97%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	13.580.620,87	0,00	0,00	13.672.410,25	91.789,38	0,68%	0,68%	9,13%
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	2.453.590,16	0,00	0,00	2.450.427,15	-3.163,01	-0,13%	0,00%	0,00%
BRASIL FLORESTAL MULTISTRATÉGIA FIP	647.791,40	0,00	0,00	646.867,22	-924,18	-0,14%	-0,14%	0,01%
OSASCO PROPERTIES FII	1.928.918,98	0,00	0,00	1.926.164,88	-2.754,10	-0,14%	0,00%	-
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	4.744.714,82	0,00	0,00	4.736.518,57	-8.196,25	-0,17%	-	-
ÁTICO FLORESTAL BRASIL FICFIP	644.860,44	0,00	0,00	643.668,42	-1.192,02	-0,18%	-0,18%	0,02%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	23.211.674,06	0,00	0,00	23.167.825,73	-43.848,33	-0,19%	-0,19%	8,70%
CONSTÂNCIA BRASIL FI AÇÕES	18.863.505,21	0,00	0,00	18.742.969,50	-120.535,71	-0,64%	-0,68%	9,17%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	21.618.850,00	0,00	0,00	21.383.897,90	-234.952,10	-1,09%	-1,09%	9,59%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	13.272.043,55	0,00	0,00	12.967.024,44	-305.019,11	-2,30%	-2,30%	9,51%
Total Renda Variável	140.727.218,28	0,00	7.379.704,64	133.202.529,09	-144.984,55	-0,10%		8,46%