

Relatório Analítico dos Investimentos

em fevereiro de 2020

Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	27.323.900,66	10,09%	731	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVID...	D+0	15/08/2024	27.825.476,00	10,27%	31	9,83%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENC...	D+0	16/05/2023	7.885.978,46	2,91%	51	2,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	D+2	Não há	2.948.766,49	1,09%	32.246	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	15/08/2022	6.010.652,61	2,22%	165	0,89%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVI...	D+2	Não há	13.544.973,18	5,00%	316	0,60%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	22.090.424,63	8,16%	1.359	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	16/08/2020	2.524.034,00	0,93%	107	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	48.219.130,44	17,80%	593	0,44%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	2.353.096,85	0,87%	32	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	115.298,21	0,04%	888	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	2.414.982,85	0,89%	1.214	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRADESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZ...	D+0	Não há	9.767.169,38	3,61%	1.532	1,20%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	2.013.512,88	0,74%	50	0,62%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	D+0	Não há	20.445.111,46	7,55%	91	2,15%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	82.253,38	0,03%	321	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	508.790,15	0,19%	644	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	2.020.288,72	0,75%	100	0,23%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	8.197.896,80	3,03%	284	0,50%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	2.928.569,10	1,08%	172	0,24%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "

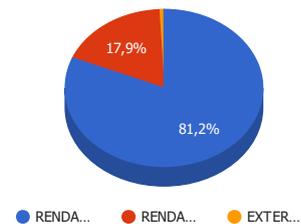
Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BRDESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	524,03	0,00%	397	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.999.045,18	1,48%	740	0,29%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	4.318.332,46	1,59%	119	0,22%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO...	D+30 ou...	Não há	2.481.228,21	0,92%	74	0,42%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BRDESCO VALUATION IBOVESPA FIC AÇÕES	D+4	Não há	3.458.880,47	1,28%	741	4,15%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
XP INVESTOR FI AÇÕES	D+4	Não há	2.078.278,42	0,77%	3.547	0,46%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
MOAT CAPITAL FIC AÇÕES	D+17	Não há	4.121.689,27	1,52%	18.816	0,11%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	9.224.674,42	3,41%	4.226	0,84%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ALASKA BLACK INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+32	Não há	2.967.447,86	1,10%	123.439	0,14%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAU DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	6.811.083,03	2,51%	57.633	0,17%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BRDESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	D+4	Não há	7.137.745,25	2,64%	2.186	0,30%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	1.129.396,44	0,42%	25.577	0,02%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MUL...	D+2	01/10/2020	6.976.801,87	2,58%	955	1,39%	Artigo 8º, Inciso III
ITAU PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	3.166.371,61	1,17%	862	0,37%	Artigo 8º, Inciso III
FP2 MULTISTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não há	1.535.944,08	0,57%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO...	D+5	Não há	2.252.356,74	0,83%	125	3,24%	Artigo 9º - A, Inciso II
Total para cálculo dos limites da Resolução			270.880.105,59				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			911.449,62				Artigo 6º
PL Total			271.791.555,21				

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 " a "	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	100,00%	270.880.105,59
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	163.256.714,38	60,27%	40,00%	50,00%	100,00%	107.623.391,21
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " c "	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	270.880.105,59
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	13.544.005,28
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	162.528.063,35
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	162.528.063,35
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	54.281.493,54	20,04%	0,00%	8,00%	40,00%	54.070.548,70
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	108.352.042,24
Artigo 7º, Inciso V, Alínea " b "	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	54.176.021,12
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	15,00%	40.632.015,84
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " b "	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	40.632.015,84
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	13.544.005,28
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	2.481.228,21	0,92%	0,00%	2,00%	5,00%	11.062.777,07
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	13.544.005,28
Total Renda Fixa	100,00%	220.019.436,13	81,22%	40,00%	65,00%	570,00%	

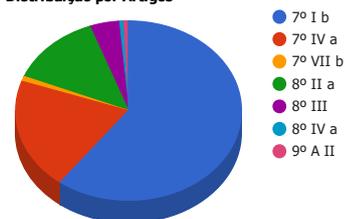
Distribuição por Segmento



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 I, Alínea " a "	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	30,00%	81.264.031,68
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	81.264.031,68
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	35.799.798,72	13,22%	0,00%	15,00%	20,00%	18.376.222,40
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	54.176.021,12
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	11.272.569,92	4,16%	0,00%	5,00%	10,00%	15.815.440,64
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	1.535.944,08	0,57%	0,00%	1,00%	5,00%	12.008.061,20
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	13.544.005,28
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " c "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	13.544.005,28
Total Renda Variável	30,00%	48.608.312,72	17,94%	0,00%	30,00%	125,00%	

Distribuição por Artigos



Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2020			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	13.544.005,28
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	2.252.356,74	0,83%	0,00%	1,00%	5,00%	11.291.648,54
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	5,00%	13.544.005,28
Total Exterior	10,00%	2.252.356,74	0,83%	0,00%	5,00%	15,00%	

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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	141.648.563,55	52,29	0,01
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	60.126.810,98	22,20	0,01
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	29.624.733,57	10,94	0,00
ITAÚ UNIBANCO	9.977.454,64	3,68	0,00
NAVI CAPITAL	9.224.674,42	3,41	0,52
MOAT CAPITAL	4.121.689,27	1,52	0,04
ALASKA ASSET MANAGEMENT	2.967.447,86	1,10	0,02
SUL AMERICA INVESTIMENTOS GEST...	2.948.766,49	1,09	0,01
SAFRA ASSET MANAGEMENT	2.353.096,85	0,87	0,00
XP VISTA ASSET MANAGEMENT	2.252.356,74	0,83	0,00
XP GESTÃO DE RECURSOS	2.078.278,42	0,77	0,00
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	2.020.288,72	0,75	0,00
LAD CAPITAL	1.535.944,08	0,57	-

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 "	0,00	0,00	0,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	163.256.714,38	60,27	40,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " c "	0,00	0,00	0,00	100,00
Artigo 7º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	54.281.493,54	20,04	0,00	40,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00	0,00	40,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea " b "	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " b "	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	2.481.228,21	0,92	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	0,00	0,00	0,00	30,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	0,00	0,00	0,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	35.799.798,72	13,22	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	11.272.569,92	4,16	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	1.535.944,08	0,57	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " c "	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso I	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso II	2.252.356,74	0,83	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso III	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
IMA Geral ex-C (Benchmark)	0,44%	0,95%	1,87%	4,36%	11,07%	21,89%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,46%	0,94%	1,91%	4,31%	11,46%	22,39%	0,01%	0,03%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,69%	1,22%	2,44%	5,37%	11,19%	22,52%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,63%	1,02%	2,18%	5,12%	10,31%	20,84%	0,01%	0,01%
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	0,67%	1,39%	3,06%	5,19%	10,22%	21,38%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,77%	1,44%	2,92%	6,35%	14,56%	27,12%	0,01%	0,03%
IMA-B 5+ (Benchmark)	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%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	0,29%	0,26%	2,86%	7,08%	21,56%	42,12%	0,04%	0,10%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA	0,65%	1,00%	3,27%	7,33%	18,54%	-	0,03%	0,06%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,38%	0,82%	1,25%	2,87%	6,52%	13,85%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,35%	0,77%	1,17%	2,72%	6,24%	13,31%	0,00%	0,00%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,36%	0,79%	1,19%	2,77%	6,31%	13,44%	0,00%	0,00%
IMA-B (Benchmark)	0,45%	0,71%	2,73%	6,54%	18,00%	34,65%	-	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,40%	0,67%	2,69%	6,42%	17,63%	33,97%	0,02%	0,06%

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
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	0,46%	0,73%	2,76%	6,61%	17,85%	34,37%	0,03%	0,07%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	-0,14%	-0,48%	1,82%	5,42%	16,62%	33,64%	0,02%	0,06%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,41%	0,61%	1,53%	4,15%	9,09%	20,06%	0,00%	0,01%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-2,44%	-2,47%	-1,71%	0,58%	1,55%	4,76%	0,05%	0,04%

Selic (Benchmark)	0,29%	0,67%	1,05%	2,39%	5,57%	12,34%	-	-
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	0,27%	0,63%	0,99%	2,29%	5,38%	11,93%	0,00%	0,00%

CDI (Benchmark)	0,29%	0,67%	1,05%	2,39%	5,57%	12,34%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,22%	0,50%	0,79%	1,85%	4,45%	9,95%	0,00%	0,00%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	0,28%	0,64%	1,01%	2,25%	5,41%	12,41%	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%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,23%	0,53%	0,84%	1,97%	4,70%	10,48%	0,00%	0,00%
BRADESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,11%	0,26%	0,42%	1,10%	2,91%	6,68%	0,00%	0,00%

IPCA (Benchmark)	0,25%	0,46%	1,62%	2,20%	4,00%	8,05%	-	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,32%	1,15%	2,27%	5,33%	11,18%	23,55%	0,01%	0,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,72%	1,41%	2,71%	6,06%	13,94%	26,48%	0,01%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,62%	1,44%	2,04%	5,45%	14,23%	25,27%	0,01%	0,04%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,27%	0,61%	1,01%	4,81%	11,66%	17,39%	0,00%	0,03%

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
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,39%	0,82%	1,67%	4,16%	10,71%	21,41%	0,01%	0,03%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
S&P 500 (Benchmark)	-8,41%	-8,56%	-5,95%	0,95%	6,10%	8,86%	-	-
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	-7,54%	-7,21%	-4,75%	3,27%	10,32%	17,19%	0,15%	0,15%
Ibovespa (Benchmark)	-8,43%	-9,92%	-3,75%	3,00%	8,98%	22,05%	-	-
XP INVESTOR FI AÇÕES	-5,88%	-2,88%	6,86%	15,53%	34,88%	58,89%	0,15%	0,13%
BRADESCO VALUATION IBOVESPA FIC AÇÕES	-9,50%	-8,40%	-1,19%	1,99%	14,36%	25,84%	0,17%	0,14%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-6,28%	-8,43%	-0,15%	5,34%	17,00%	49,89%	0,15%	0,13%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	0,27%	0,58%	0,91%	2,99%	7,33%	-	0,00%	0,01%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-9,79%	-9,96%	-2,64%	5,05%	20,11%	42,38%	0,15%	0,16%
MOAT CAPITAL FIC AÇÕES	-8,75%	-9,36%	-1,36%	5,90%	19,71%	51,51%	0,17%	0,16%
CDI (Benchmark)	0,29%	0,67%	1,05%	2,39%	5,57%	12,34%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	-1,51%	-0,84%	1,24%	4,45%	12,95%	25,31%	0,03%	0,03%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
FP2 MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	-	-
ALASKA BLACK INSTITUCIONAL FI AÇÕES	-10,39%	-8,97%	-1,91%	9,85%	9,82%	44,94%	0,17%	0,19%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	-7,91%	-6,42%	3,34%	10,51%	27,29%	57,75%	0,17%	0,15%

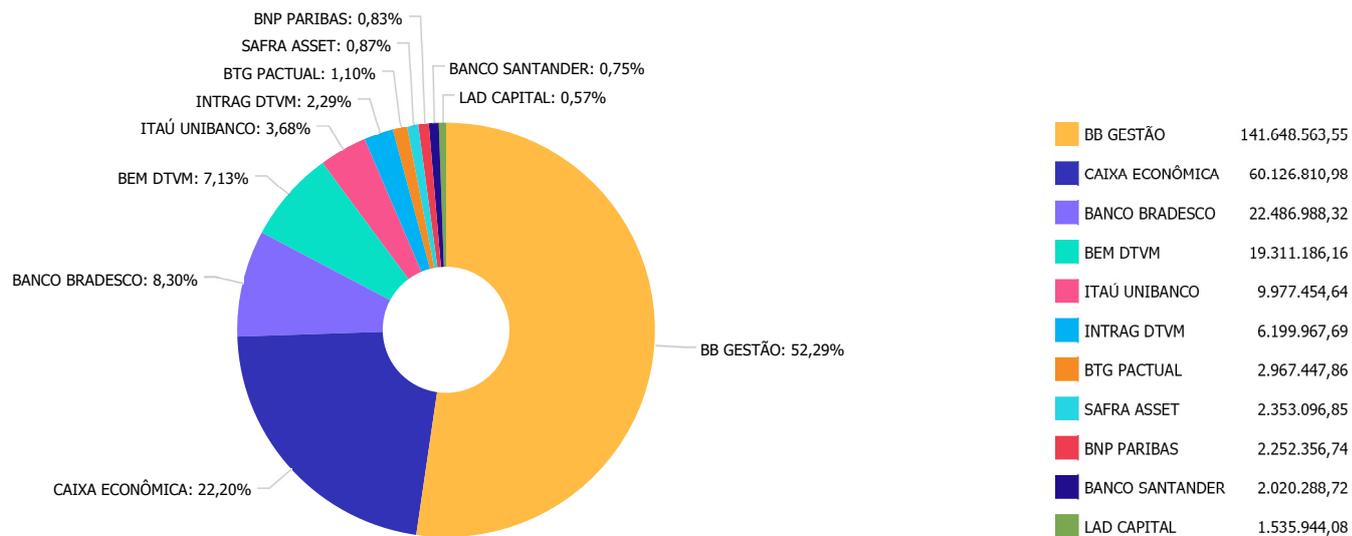
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2020 - RENDA VARIÁVEL

Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
-----	-----	----	----	-----	-----	---------	------------------

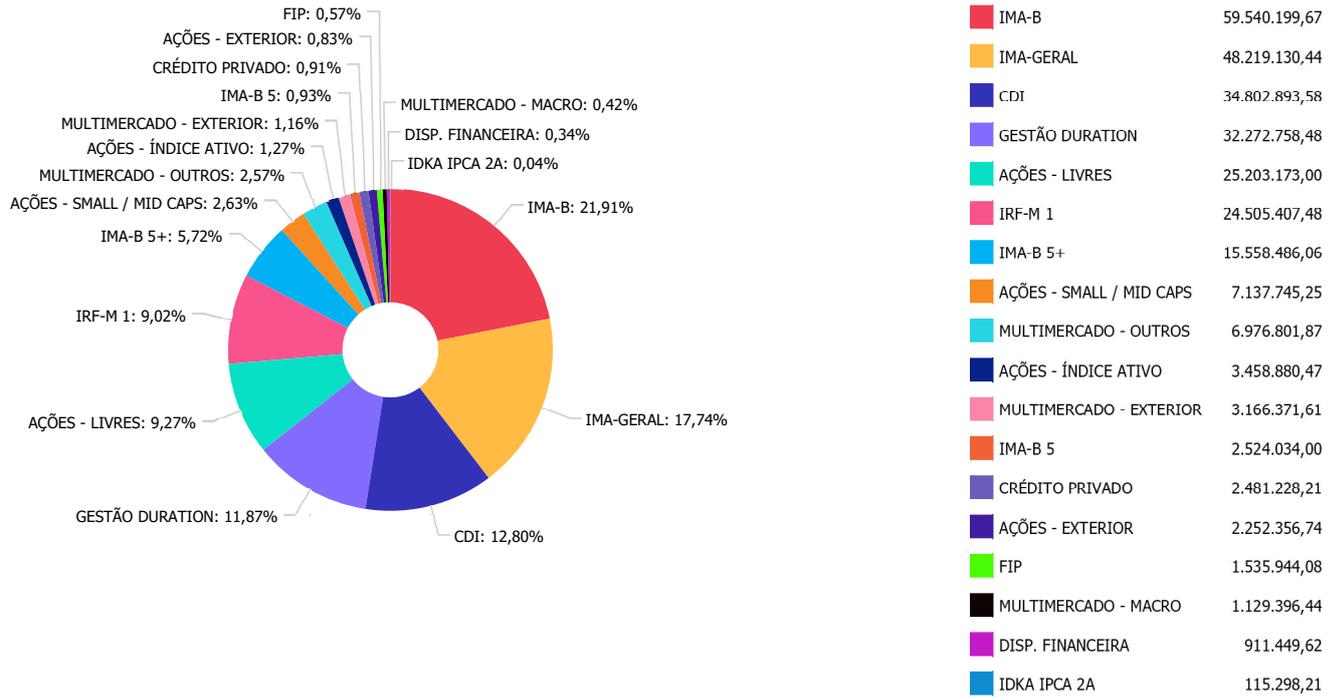
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2020 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕ...	-2,97%	5,58%	3,19%	-	-	-	0,11%	-

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



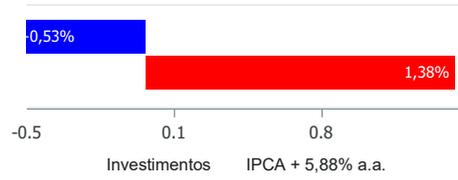
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Fevereiro / 2020)



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	269.178.843,08	19.157.889,20	19.870.125,55	269.545.785,69	1.079.178,96	1.079.178,96	0,40%	0,40%	0,71%	0,71%	56,38%	2,13%
Fevereiro	269.545.785,69	21.259.186,81	17.391.810,86	270.880.105,59	-2.533.056,05	-1.453.877,09	-0,93%	-0,53%	0,66%	1,38%	-38,47%	3,31%

Investimentos x Meta Atuarial



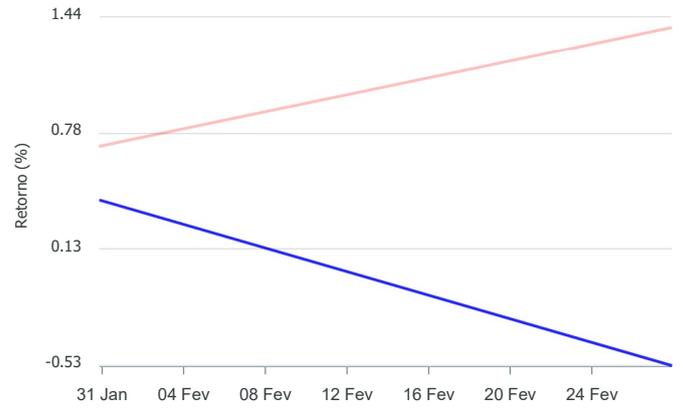
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	7.825.678,24	0,00	0,00	7.885.978,46	60.300,22	0,77%	0,77%	1,23%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDEN...	28.317.716,55	0,00	693.993,11	27.825.476,00	201.752,56	0,71%	0,72%	1,01%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA	2.337.954,67	0,00	0,00	2.353.096,85	15.142,18	0,65%	0,65%	2,74%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	114.578,46	0,00	0,00	115.298,21	719,75	0,63%	0,63%	0,67%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	27.156.319,76	0,00	0,00	27.323.900,66	167.580,90	0,62%	0,62%	0,91%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	4.298.693,11	0,00	0,00	4.318.332,46	19.639,35	0,46%	0,46%	2,51%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	48.000.253,24	0,00	0,00	48.219.130,44	218.877,20	0,46%	0,46%	1,08%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	6.146.964,84	0,00	161.518,40	6.010.652,61	25.206,17	0,41%	0,41%	0,39%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.165.001,37	0,00	0,00	8.197.896,80	32.895,43	0,40%	0,40%	2,41%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.917.191,19	0,00	0,00	2.928.569,10	11.377,91	0,39%	0,39%	1,04%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	22.010.470,79	0,00	0,00	22.090.424,63	79.953,84	0,36%	0,36%	0,07%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	2.406.489,36	0,00	0,00	2.414.982,85	8.493,49	0,35%	0,35%	0,07%
BRADESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	8.880.636,29	15.096.406,07	14.288.525,88	9.767.169,38	78.652,90	0,33%	0,11%	0,00%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	2.473.381,48	0,00	0,00	2.481.228,21	7.846,73	0,32%	0,32%	0,94%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	13.504.590,18	0,00	0,00	13.544.973,18	40.383,00	0,30%	0,30%	3,74%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	2.007.620,57	0,00	0,00	2.013.512,88	5.892,31	0,29%	0,29%	3,75%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	20.387.937,85	0,00	0,00	20.445.111,46	57.173,61	0,28%	0,28%	0,02%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	507.404,35	0,00	0,00	508.790,15	1.385,80	0,27%	0,27%	0,02%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	522,61	0,00	0,00	524,03	1,42	0,27%	0,27%	0,01%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	2.014.929,77	0,00	0,00	2.020.288,72	5.358,95	0,27%	0,27%	0,13%

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
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.587.124,00	0,00	69.469,61	2.524.034,00	6.379,61	0,25%	-2,44%	4,80%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	12.738,49	69.433,11	0,00	82.253,38	81,78	0,10%	0,23%	0,00%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.082.197,31	3.093.347,63	2.178.303,86	3.999.045,18	1.804,10	0,03%	0,22%	0,01%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	0,00	3.000.000,00	0,00	2.948.766,49	-51.233,51	-1,71%	-0,14%	2,22%
Total Renda Fixa	215.156.394,48	21.259.186,81	17.391.810,86	220.019.436,13	995.665,70	0,45%		1,09%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTI...	6.958.236,01	0,00	0,00	6.976.801,87	18.565,86	0,27%	0,27%	0,09%
FP2 MULTISTRATÉGIA FIP	1.536.048,53	0,00	0,00	1.535.944,08	-104,45	-0,01%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.146.704,55	0,00	0,00	1.129.396,44	-17.308,11	-1,51%	-1,51%	3,40%
XP INVESTOR FI AÇÕES	2.208.076,35	0,00	0,00	2.078.278,42	-129.797,93	-5,88%	-5,88%	15,48%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	9.842.710,39	0,00	0,00	9.224.674,42	-618.035,97	-6,28%	-6,28%	15,26%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	3.424.599,00	0,00	0,00	3.166.371,61	-258.227,39	-7,54%	-7,54%	14,76%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	7.750.776,47	0,00	0,00	7.137.745,25	-613.031,22	-7,91%	-7,91%	17,25%
MOAT CAPITAL FIC AÇÕES	4.516.716,08	0,00	0,00	4.121.689,27	-395.026,81	-8,75%	-8,75%	16,88%
BRADESCO VALUATION IBOVESPA FIC AÇÕES	3.822.025,39	0,00	0,00	3.458.880,47	-363.144,92	-9,50%	-9,50%	17,18%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	7.550.463,08	0,00	0,00	6.811.083,03	-739.380,05	-9,79%	-9,79%	14,94%
ALASKA BLACK INSTITUCIONAL FI AÇÕES	3.311.638,90	0,00	0,00	2.967.447,86	-344.191,04	-10,39%	-10,39%	16,82%
Total Renda Variável	52.067.994,75	0,00	0,00	48.608.312,72	-3.459.682,03	-6,64%		13,34%

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO E...	2.321.396,46	0,00	0,00	2.252.356,74	-69.039,72	-2,97%	-2,97%	11,39%
Total Renda Variável	2.321.396,46	0,00	0,00	2.252.356,74	-69.039,72	-2,97%		11,39%