

# Relatório Analítico dos Investimentos em janeiro 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 (Janeiro / 2020)**

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	2.337.954,67	0,87%	31	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	48.000.253,24	17,81%	583	0,46%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	114.578,46	0,04%	888	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVID...	D+0	15/08/2024	28.317.716,55	10,51%	31	9,83%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	27.156.319,76	10,07%	717	0,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	2.406.489,36	0,89%	1.213	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	15/08/2022	6.146.964,84	2,28%	165	0,89%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVI...	D+2	Não há	13.504.590,18	5,01%	332	0,59%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENC...	D+0	16/05/2023	7.825.678,24	2,90%	51	2,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	16/08/2020	2.587.124,00	0,96%	107	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	22.010.470,79	8,17%	1.361	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRDESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZ...	D+0	Não há	8.880.636,29	3,29%	1.506	1,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.082.197,31	1,14%	737	0,21%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	8.165.001,37	3,03%	279	0,50%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	2.007.620,57	0,74%	52	0,59%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	4.298.693,11	1,59%	118	0,22%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	2.917.191,19	1,08%	169	0,26%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	D+0	Não há	20.387.937,85	7,56%	95	1,92%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	12.738,49	0,00%	324	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	507.404,35	0,19%	651	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "

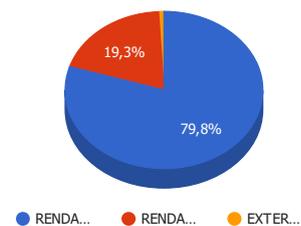
**Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2020)**

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	2.014.929,77	0,75%	96	0,24%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	522,61	0,00%	392	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO...	D+30 ou...	Não há	2.473.381,48	0,92%	74	0,42%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	D+4	Não há	7.750.776,47	2,88%	1.956	0,35%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BRADESCO VALUATION IBOVESPA FIC AÇÕES	D+4	Não há	3.822.025,39	1,42%	736	4,40%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
MOAT CAPITAL FIC AÇÕES	D+17	Não há	4.516.716,08	1,68%	16.915	0,12%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
XP INVESTOR FI AÇÕES	D+4	Não há	2.208.076,35	0,82%	3.570	0,46%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	9.842.710,39	3,65%	4.330	0,83%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ALASKA BLACK INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+32	Não há	3.311.638,90	1,23%	118.402	0,15%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	7.550.463,08	2,80%	58.612	0,16%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	1.146.704,55	0,43%	26.307	0,02%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MUL...	D+2	01/10/2020	6.958.236,01	2,58%	955	1,39%	Artigo 8º, Inciso III
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	3.424.599,00	1,27%	858	0,38%	Artigo 8º, Inciso III
FP2 MULTISTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não há	1.536.048,53	0,57%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO...	D+5	Não há	2.321.396,46	0,86%	38	3,92%	Artigo 9º - A, Inciso II
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>269.545.785,69</b>				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			<b>1.192.352,08</b>				Artigo 6º
<b>PL Total</b>			<b>270.738.137,77</b>				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA 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%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	100,00%	269.545.785,69
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	160.408.140,09	59,51%	40,00%	50,00%	100,00%	109.137.645,60
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " c "	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	269.545.785,69
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	13.477.289,28
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	161.727.471,41
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	161.727.471,41
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	52.274.872,91	19,39%	0,00%	8,00%	40,00%	55.543.441,37
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	107.818.314,28
Artigo 7º, Inciso V, Alínea " b "	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	53.909.157,14
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	15,00%	40.431.867,85
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " b "	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	40.431.867,85
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	13.477.289,28
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	2.473.381,48	0,92%	0,00%	2,00%	5,00%	11.003.907,80
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	13.477.289,28
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>215.156.394,48</b>	<b>79,82%</b>	<b>40,00%</b>	<b>65,00%</b>	<b>570,00%</b>	

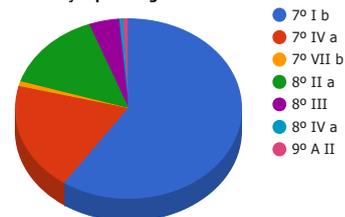
Distribuição por Segmento



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%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	30,00%	80.863.735,71
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	80.863.735,71
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	39.002.406,66	14,47%	0,00%	15,00%	20,00%	14.906.750,48
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	53.909.157,14
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	11.529.539,56	4,28%	0,00%	5,00%	10,00%	15.425.039,01
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	1.536.048,53	0,57%	0,00%	1,00%	5,00%	11.941.240,75
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	13.477.289,28
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " c "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	13.477.289,28
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>52.067.994,75</b>	<b>19,32%</b>	<b>0,00%</b>	<b>30,00%</b>	<b>125,00%</b>	

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%	13.477.289,28
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	2.321.396,46	0,86%	0,00%	1,00%	5,00%	11.155.892,82
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	5,00%	13.477.289,28
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>2.321.396,46</b>	<b>0,86%</b>	<b>0,00%</b>	<b>5,00%</b>	<b>15,00%</b>	

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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	140.932.193,23	52,29	0,01
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	59.871.593,60	22,21	0,01
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	29.677.465,63	11,01	0,00
ITAÚ UNIBANCO	10.975.062,08	4,07	0,00
NAVI CAPITAL	9.842.710,39	3,65	0,54
MOAT CAPITAL	4.516.716,08	1,68	0,04
ALASKA ASSET MANAGEMENT	3.311.638,90	1,23	0,02
SAFRA ASSET MANAGEMENT	2.337.954,67	0,87	0,00
XP VISTA ASSET MANAGEMENT	2.321.396,46	0,86	0,00
XP GESTÃO DE RECURSOS	2.208.076,35	0,82	0,00
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	2.014.929,77	0,75	0,00
FL ASSET MANAGEMENT	1.536.048,53	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 "	160.408.140,09	59,51	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 "	52.274.872,91	19,39	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 "	2.473.381,48	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 "	39.002.406,66	14,47	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	11.529.539,56	4,28	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	1.536.048,53	0,57	0,00	5,00
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 Janeiro/2020 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IMA Geral ex-C (Benchmark)</b>	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%
<b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>	0,54%	0,54%	1,76%	4,74%	11,02%	22,45%	-	-
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%
<b>IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)</b>	0,72%	0,72%	3,37%	5,14%	10,47%	21,46%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,67%	0,67%	1,36%	5,48%	14,05%	26,86%	0,01%	0,03%
<b>IMA-B 5+ (Benchmark)</b>	0,03%	0,03%	-1,54%	6,07%	22,33%	43,41%	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,05%	0,05%	-1,45%	6,13%	22,08%	42,79%	0,03%	0,09%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA	0,35%	0,35%	0,04%	6,13%	18,32%	-	0,02%	0,07%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	-0,03%	-0,03%	-1,66%	5,90%	21,84%	42,45%	0,03%	0,10%
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	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%
<b>IMA-B (Benchmark)</b>	0,26%	0,26%	-0,24%	5,64%	18,11%	34,79%	-	-
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,03%	-0,03%	1,62%	0,60%	1,84%	5,31%	0,00%	0,04%

## 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
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,20%	0,20%	1,55%	3,91%	9,21%	20,11%	0,00%	0,01%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	0,27%	0,27%	-0,33%	5,66%	17,92%	34,49%	0,02%	0,07%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,26%	0,26%	-0,27%	5,54%	17,77%	34,16%	0,02%	0,06%
<b>Selic (Benchmark)</b>								
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	0,38%	0,38%	1,14%	2,60%	5,78%	12,54%	-	-
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	0,36%	0,36%	1,09%	2,52%	5,60%	12,13%	0,00%	0,00%
<b>CDI (Benchmark)</b>								
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	0,38%	0,38%	1,14%	2,60%	5,78%	12,53%	-	-
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	0,36%	0,36%	1,06%	2,47%	5,64%	12,62%	0,00%	0,00%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,29%	0,29%	0,87%	2,05%	4,65%	10,14%	0,00%	0,00%
BRADESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,15%	0,15%	0,49%	1,27%	3,09%	6,83%	0,00%	0,00%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,30%	0,30%	0,92%	2,17%	4,90%	10,67%	0,00%	0,00%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,35%	0,35%	1,05%	2,45%	5,55%	12,19%	0,00%	0,00%
<b>IPCA (Benchmark)</b>								
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	0,21%	0,21%	1,88%	2,05%	4,19%	8,13%	-	-
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%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,34%	0,34%	0,93%	4,14%	11,91%	17,78%	0,00%	0,03%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,83%	0,83%	1,75%	5,13%	11,51%	23,87%	0,01%	0,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,69%	0,69%	1,38%	5,35%	13,63%	26,26%	0,01%	0,03%

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
-----	-----	----	----	-----	-----	---------	------------------

## 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
<b>S&amp;P 500 (Benchmark)</b>	-0,16%	-0,16%	6,19%	8,23%	19,28%	14,23%	-	-
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	0,36%	0,36%	6,98%	10,07%	23,39%	22,53%	0,06%	0,12%
<b>Ibovespa (Benchmark)</b>	-1,63%	-1,63%	6,10%	11,74%	16,80%	33,97%	-	-
BRADESCO VALUATION IBOVESPA FIC AÇÕES	1,22%	1,22%	9,99%	16,46%	24,30%	41,86%	0,10%	0,09%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-2,30%	-2,30%	6,69%	15,24%	22,87%	63,81%	0,10%	0,11%
MOAT CAPITAL FIC AÇÕES	-0,67%	-0,67%	12,83%	15,96%	27,04%	70,19%	0,10%	0,12%
XP INVESTOR FI AÇÕES	3,18%	3,18%	17,70%	24,85%	41,22%	72,27%	0,10%	0,11%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	0,32%	0,32%	1,50%	3,09%	7,26%	-	0,00%	0,01%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-0,19%	-0,19%	9,98%	18,27%	31,46%	59,14%	0,09%	0,10%
<b>CDI (Benchmark)</b>	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%
<b>Não Informado (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
FP2 MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	-	-
ALASKA BLACK INSTITUCIONAL FI AÇÕES	1,59%	1,59%	13,64%	18,55%	22,07%	66,76%	0,11%	0,14%
<b>Não definido (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	1,61%	1,61%	15,57%	21,71%	35,76%	71,51%	0,09%	0,11%

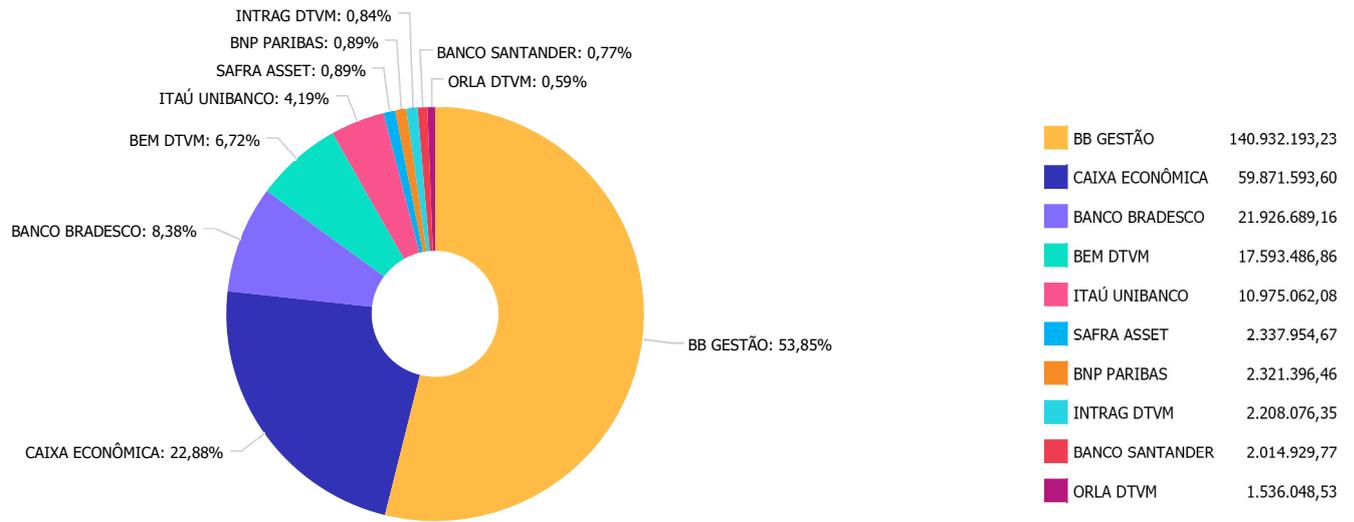
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2020 - RENDA VARIÁVEL

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

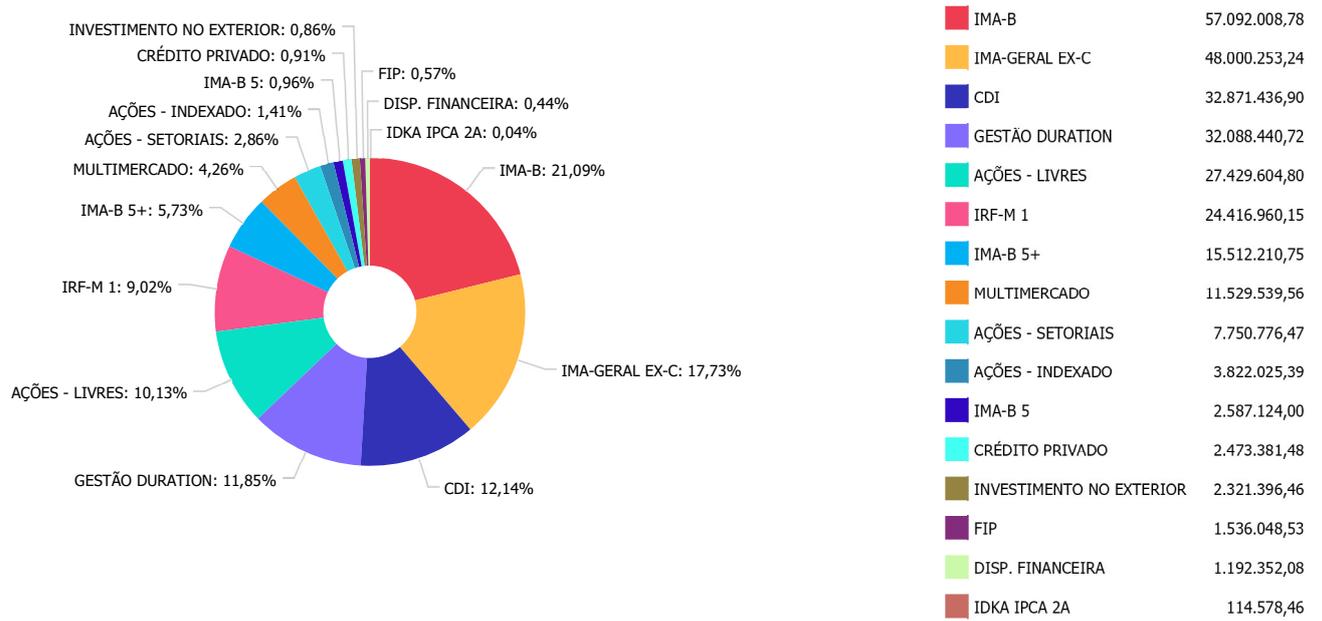
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2020 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕ...	8,81%	8,81%	-	-	-	-	0,08%	-

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



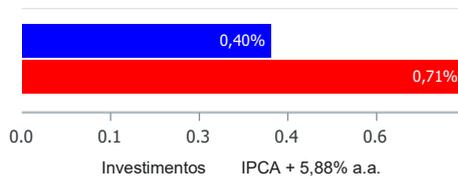
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Janeiro / 2020)



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%

Investimentos x Meta Atuarial



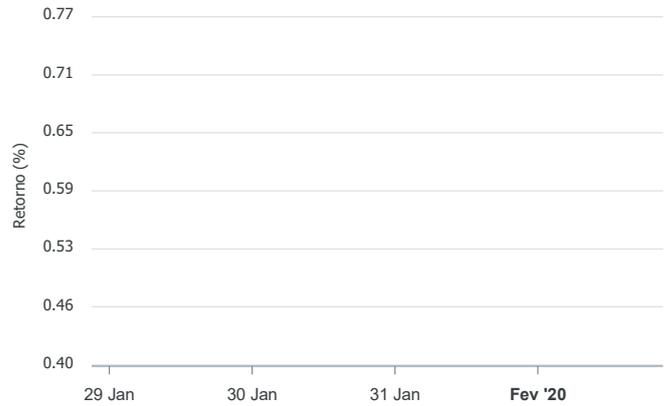
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	2.452.937,28	0,00	0,00	2.473.381,48	20.444,20	0,83%	0,83%	0,67%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	26.935.635,85	0,00	0,00	27.156.319,76	220.683,91	0,82%	0,82%	0,64%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDEN...	28.123.302,25	0,00	0,00	28.317.716,55	194.414,30	0,69%	0,69%	0,78%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	7.773.848,83	0,00	0,00	7.825.678,24	51.829,41	0,67%	0,67%	0,79%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	47.768.176,02	0,00	0,00	48.000.253,24	232.077,22	0,49%	0,49%	0,72%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.904.735,21	0,00	0,00	2.917.191,19	12.455,98	0,43%	0,43%	0,65%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	21.917.851,95	0,00	0,00	22.010.470,79	92.618,84	0,42%	0,42%	0,09%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	2.396.440,01	0,00	0,00	2.406.489,36	10.049,35	0,42%	0,42%	0,09%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	114.139,03	0,00	0,00	114.578,46	439,43	0,38%	0,38%	0,55%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	20.315.315,13	0,00	0,00	20.387.937,85	72.622,72	0,36%	0,36%	0,02%
BRDESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	520,75	0,00	0,00	522,61	1,86	0,36%	0,36%	0,00%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA	2.329.755,32	0,00	0,00	2.337.954,67	8.199,35	0,35%	0,35%	1,89%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	505.635,49	0,00	0,00	507.404,35	1.768,86	0,35%	0,35%	0,01%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	2.008.066,83	0,00	0,00	2.014.929,77	6.862,94	0,34%	0,34%	0,03%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	12.700,08	0,00	0,00	12.738,49	38,41	0,30%	0,30%	0,00%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	4.286.911,01	0,00	0,00	4.298.693,11	11.782,10	0,27%	0,27%	1,70%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.143.575,27	0,00	0,00	8.165.001,37	21.426,10	0,26%	0,26%	1,66%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.305.557,00	1.152.621,22	1.385.012,46	3.082.197,31	9.031,55	0,20%	0,29%	0,00%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	6.134.902,96	0,00	0,00	6.146.964,84	12.061,88	0,20%	0,20%	0,38%
BRDESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	11.641.299,35	15.705.267,98	18.485.113,09	8.880.636,29	19.182,05	0,07%	0,15%	0,00%

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
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	13.498.192,77	0,00	0,00	13.504.590,18	6.397,41	0,05%	0,05%	2,59%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.588.008,00	0,00	0,00	2.587.124,00	-884,00	-0,03%	-0,03%	0,31%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	2.008.308,28	0,00	0,00	2.007.620,57	-687,71	-0,03%	-0,03%	2,62%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>217.165.814,67</b>	<b>16.857.889,20</b>	<b>19.870.125,55</b>	<b>215.156.394,48</b>	<b>1.002.816,16</b>	<b>0,43%</b>		<b>0,72%</b>

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
XP INVESTOR FI AÇÕES	2.139.992,49	0,00	0,00	2.208.076,35	68.083,86	3,18%	3,18%	10,44%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	7.627.656,71	0,00	0,00	7.750.776,47	123.119,76	1,61%	1,61%	9,02%
ALASKA BLACK INSTITUCIONAL FI AÇÕES	3.259.708,68	0,00	0,00	3.311.638,90	51.930,22	1,59%	1,59%	11,25%
BRADESCO VALUATION IBOVESPA FIC AÇÕES	3.776.125,64	0,00	0,00	3.822.025,39	45.899,75	1,22%	1,22%	10,14%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.138.919,18	0,00	0,00	1.146.704,55	7.785,37	0,68%	0,68%	1,97%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	3.412.230,98	0,00	0,00	3.424.599,00	12.368,02	0,36%	0,36%	6,06%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTI...	6.936.270,99	0,00	0,00	6.958.236,01	21.965,02	0,32%	0,32%	0,13%
FP2 MULTISTRATÉGIA FIP	1.535.984,39	0,00	0,00	1.536.048,53	64,14	0,00%	-	-
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	7.564.753,38	0,00	0,00	7.550.463,08	-14.290,30	-0,19%	-0,19%	8,70%
MOAT CAPITAL FIC AÇÕES	4.547.148,70	0,00	0,00	4.516.716,08	-30.432,62	-0,67%	-0,67%	10,05%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	10.074.237,27	0,00	0,00	9.842.710,39	-231.526,88	-2,30%	-2,30%	9,51%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>52.013.028,41</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>52.067.994,75</b>	<b>54.966,34</b>	<b>0,11%</b>		<b>7,87%</b>

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO E...	0,00	2.300.000,00	0,00	2.321.396,46	21.396,46	0,93%	8,81%	8,00%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>0,00</b>	<b>2.300.000,00</b>	<b>0,00</b>	<b>2.321.396,46</b>	<b>21.396,46</b>	<b>0,93%</b>		<b>8,00%</b>