

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos
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
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	16/08/2020	4.305.739,24	1,99%	107	0,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	2.884.062,00	1,33%	709	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENC...	D+0	16/05/2023	2.471.865,27	1,14%	51	0,72%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	24.569.480,34	11,35%	969	0,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVID...	D+0	15/08/2022	1.573.107,88	0,73%	115	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	5.911.839,77	2,73%	922	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2030	1.433.526,00	0,66%	34	0,65%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	5.272.712,60	2,44%	674	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	10.877.602,31	5,02%	615	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	12.769.887,62	5,90%	583	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	9.889.635,74	4,57%	1.361	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	13.612.602,54	6,29%	888	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	25.589.118,53	11,82%	717	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	6.970.776,63	3,22%	737	0,46%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	10.504.498,15	4,85%	288	0,20%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES LP	D+0	Não há	422.428,00	0,20%	1.761	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	5.285.670,73	2,44%	91	1,58%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	162.290,68	0,07%	383	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	4.839.545,35	2,24%	169	0,43%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	4.434.655,02	2,05%	97	0,50%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '

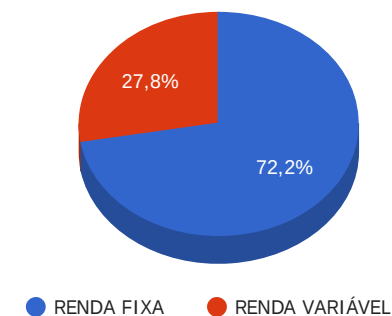
Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIV...	D+0	3 anos	702.718,80	0,32%	75	0,38%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO...	D+30 ou...	Não há	1.935.193,90	0,89%	74	0,33%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GENESIS FIC AÇÕ...	D+24	Não há	1.293.777,75	0,60%	6	0,67%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
GERAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	2.741.306,90	1,27%	16.553	0,79%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	3.208.570,38	1,48%	6.534	0,16%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	3.318.608,89	1,53%	9.049	0,54%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	23/08/2017	4.394.106,24	2,03%	147	0,47%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	10.199.017,97	4,71%	1.504	1,23%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	3.547.910,26	1,64%	211	0,37%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	4.270.792,67	1,97%	165	0,17%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	3.124.728,71	1,44%	58.612	0,07%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	2.289.748,02	1,06%	26.379	0,07%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	10.814.769,19	5,00%	26.307	0,17%	Artigo 8º, Inciso III
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	5.989.257,49	2,77%	205	1,16%	Artigo 8º, Inciso III
BRASIL AGRO II MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	3.150.167,68	1,45%	17	5,65%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	1.750.000,00	0,81%		0,63%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
Total para cálculo dos limites da Resolução			216.511.719,25				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			43.474,24	Artigo 6º			
PL Total			216.555.193,49				

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 ' b '	100,00%	121.161.179,84	55,96%	15,00%	25,00%	90,00%	73.699.367,49
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	129.907.031,55
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	32.619.864,56	15,07%	10,00%	30,00%	40,00%	53.984.823,14
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	32.476.757,89
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	10.825.585,96
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	2.637.912,70	1,22%	0,00%	5,00%	5,00%	8.187.673,26
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	10.825.585,96
Total Renda Fixa	100,00%	156.418.957,10	72,25%	25,00%	70,00%	220,00%	

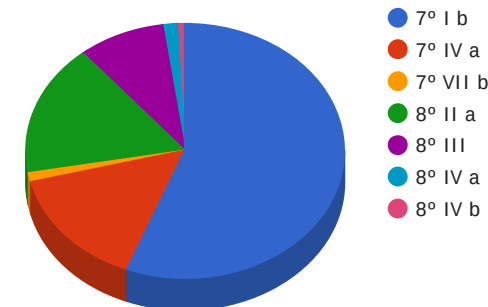
Distribuição por Segmento



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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	36.098.819,77	16,67%	7,00%	15,00%	20,00%	7.203.524,08
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	19.093.774,70	8,82%	7,00%	10,00%	10,00%	2.557.397,23
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	5,00%	3.150.167,68	1,45%	2,00%	2,00%	5,00%	7.675.418,28
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	5,00%	1.750.000,00	0,81%	1,00%	3,00%	5,00%	9.075.585,96
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	10.825.585,96
Total Renda Variável	30,00%	60.092.762,15	27,75%	17,00%	30,00%	45,00%	

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%	0,00%	10,00%	21.651.171,93
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	

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

Gestão	Valor	% SI/ Carteira	% SI/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	87.418.866,31	40,38	0,02
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	74.556.086,21	34,44	0,00
ITAÚ UNIBANCO	28.042.773,28	12,95	0,00
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	8.387.455,61	3,87	0,00
VINCI PARTNERS	4.394.106,24	2,03	0,02
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	3.318.608,89	1,53	0,26
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	3.208.570,38	1,48	0,00
AGBI REAL ASSETS	3.150.167,68	1,45	-
GENIAL INVESTIMENTOS	2.741.306,90	1,27	0,04
ITAÚ DTVM	1.293.777,75	0,60	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 '	121.161.179,84	55,96	15,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	32.619.864,56	15,07	10,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	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 '	2.637.912,70	1,22	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	36.098.819,77	16,67	7,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	19.093.774,70	8,82	7,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	3.150.167,68	1,45	2,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	1.750.000,00	0,81	1,00	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

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%	-	-
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%
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%
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	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%
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%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,56%	0,56%	1,51%	5,04%	12,06%	23,36%	-	-
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%
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%
IMA-B (Benchmark)	0,26%	0,26%	-0,24%	5,64%	18,11%	34,79%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,26%	0,26%	-0,30%	5,54%	17,83%	34,11%	0,02%	0,06%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	0,21%	0,21%	-0,59%	5,76%	19,42%	35,88%	0,02%	0,07%

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
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%
IRF-M (Benchmark)	0,88%	0,88%	1,04%	4,50%	11,47%	23,54%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,85%	0,85%	0,98%	4,38%	11,22%	23,04%	0,01%	0,03%
CDI (Benchmark)	0,38%	0,38%	1,14%	2,60%	5,78%	12,53%	-	-
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES LP	0,36%	0,36%	1,10%	2,53%	5,63%	12,21%	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%
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	0,16%	0,16%	1,53%	4,16%	9,83%	-	0,00%	0,02%
IPCA (Benchmark)	0,21%	0,21%	1,88%	2,05%	4,19%	8,13%	-	-
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 IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,55%	0,55%	1,46%	4,79%	11,93%	32,69%	0,01%	0,02%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,32%	1,32%	3,44%	2,38%	4,57%	8,63%	0,00%	0,04%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,81%	0,81%	1,16%	5,80%	15,24%	25,27%	0,01%	0,04%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,34%	0,34%	1,04%	2,66%	9,69%	19,74%	0,00%	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,82%	0,82%	0,91%	4,67%	14,10%	25,30%	0,01%	0,04%
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,43%	0,43%	0,33%	3,87%	10,74%	21,90%	0,01%	0,03%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-

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
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,39%	0,39%	1,09%	2,59%	5,76%	12,25%	0,00%	0,00%

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 + 8,00% ao ano (Benchmark)	0,89%	0,89%	3,86%	6,15%	12,56%	26,08%	-	-
BRASIL AGRO II MULTIESTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	0,00%	-

IDIV (Benchmark)	-1,58%	-1,58%	10,79%	17,15%	27,01%	50,76%	-	-
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1,53%	1,53%	10,76%	17,94%	28,52%	51,11%	0,08%	0,09%

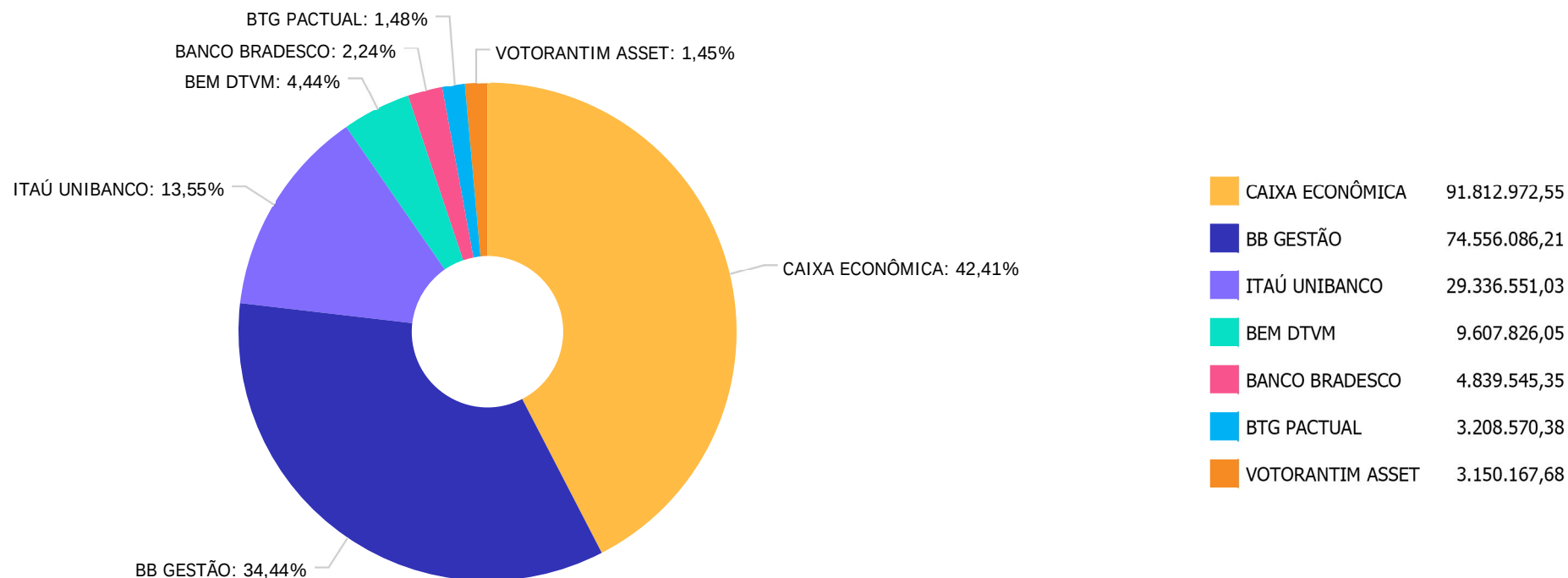
Ibovespa (Benchmark)	-1,63%	-1,63%	6,10%	11,74%	16,80%	33,97%	-	-
GERAÇÃO FI AÇÕES	-1,25%	-1,25%	4,86%	11,84%	18,21%	34,36%	0,09%	0,09%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2,03%	2,03%	9,64%	15,80%	32,00%	59,43%	0,08%	0,09%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	1,72%	1,72%	18,50%	23,43%	37,26%	76,86%	0,08%	0,13%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1,47%	1,47%	15,18%	17,48%	31,03%	65,96%	0,10%	0,11%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-1,44%	-1,44%	10,33%	13,10%	20,92%	48,45%	0,10%	0,10%
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	-1,29%	-1,29%	4,28%	11,26%	18,91%	40,76%	0,11%	0,09%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-0,19%	-0,19%	9,98%	18,27%	31,46%	59,14%	0,09%	0,10%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GENESIS FIC AÇÕES	1,14%	1,14%	11,52%	19,16%	-	-	0,09%	-

CDI (Benchmark)	0,38%	0,38%	1,14%	2,60%	5,78%	12,53%	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,13%	0,13%	1,71%	4,37%	8,28%	16,24%	0,01%	0,01%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	-0,25%	-0,25%	3,09%	6,01%	9,71%	18,68%	0,03%	0,03%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,68%	0,68%	3,58%	6,70%	14,67%	28,07%	0,02%	0,02%

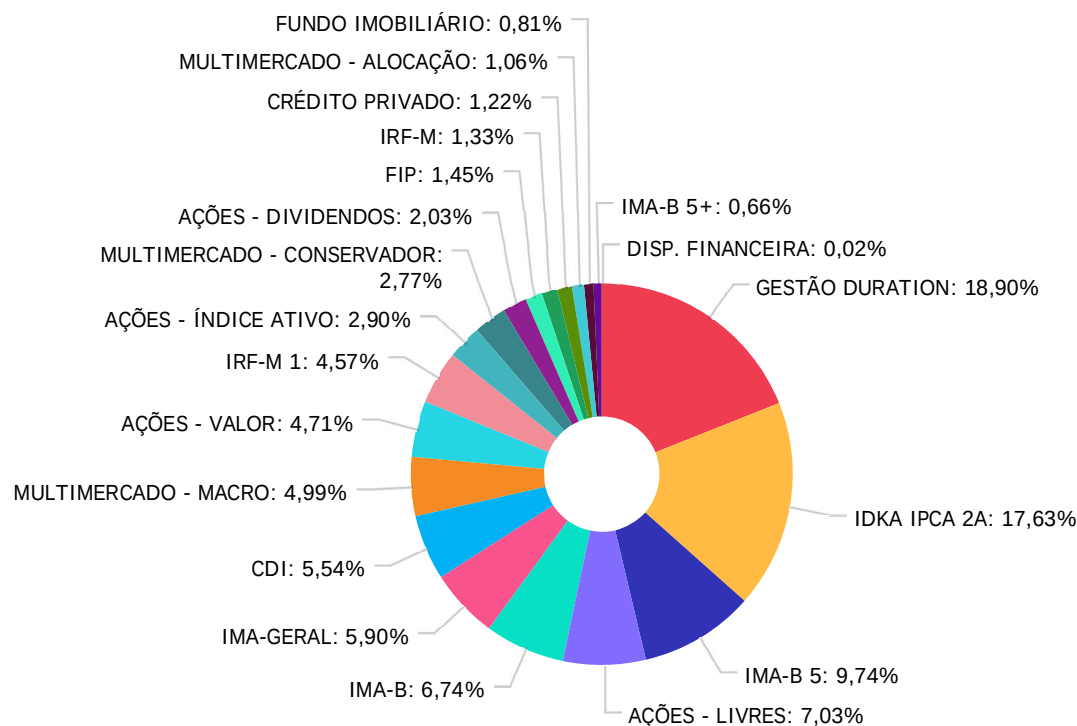
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	17,45%	17,45%	46,57%	62,48%	67,46%	50,21%	0,22%	0,23%

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



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

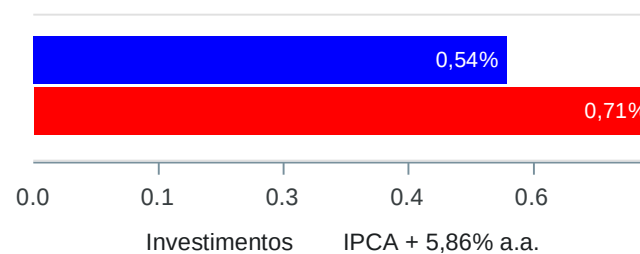


GESTÃO DURATION	40.933.162,03
IDKA IPCA 2A	38.182.082,88
IMA-B 5	21.095.181,32
AÇÕES - LIVRES	15.216.478,40
IMA-B	14.603.356,48
IMA-GERAL	12.769.887,62
CDI	11.990.150,33
MULTIMERCADO - MACRO	10.814.769,19
AÇÕES - VALOR	10.199.017,97
IRF-M 1	9.889.635,74
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	6.289.217,16
MULTIMERCADO - CONSERVADOR	5.989.257,49
AÇÕES - DIVIDENDOS	4.394.106,24
FIP	3.150.167,68
IRF-M	2.884.062,00
CRÉDITO PRIVADO	2.637.912,70
MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	2.289.748,02
FUNDO IMOBILIÁRIO	1.750.000,00
IMA-B 5+	1.433.526,00

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

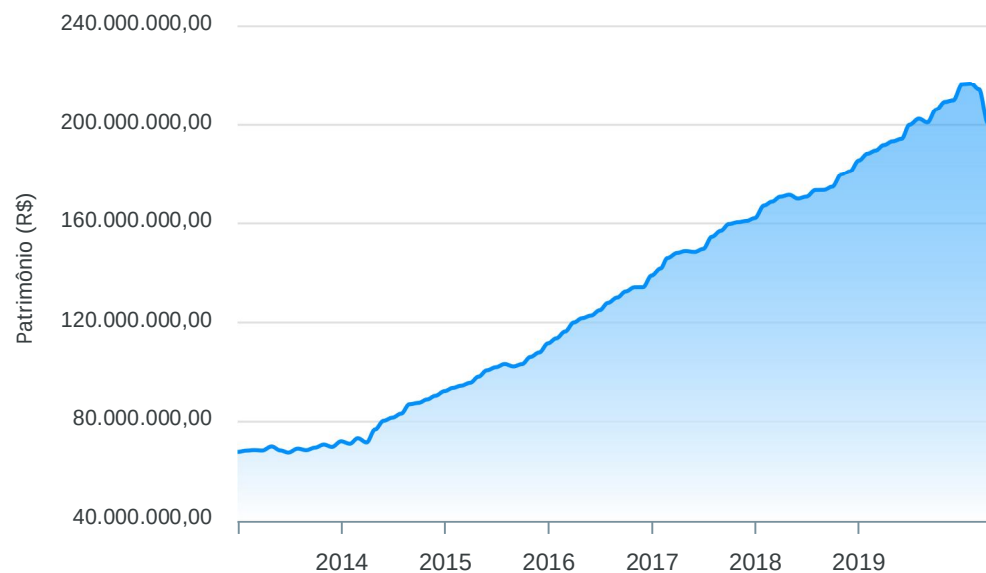
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	214.207.749,87	1.322.881,96	2.484.374,30	214.203.168,74	1.156.911,21	1.156.911,21	0,54%	0,54%	0,71%	0,71%	76,13%	2,29%

Investimentos x Meta Atuarial



Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

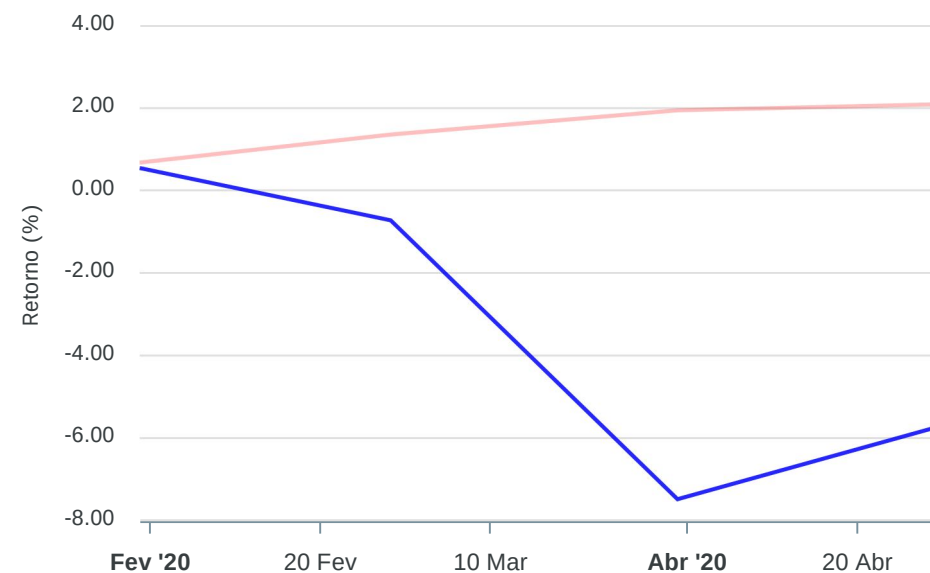
Evolução do Patrimônio



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
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.414.836,00	0,00	0,00	1.433.526,00	18.690,00	1,32%	1,32%	0,23%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.859.632,95	0,00	0,00	2.884.062,00	24.429,05	0,85%	0,85%	0,65%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	1.919.198,19	0,00	0,00	1.935.193,90	15.995,71	0,83%	0,83%	0,67%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	25.381.170,36	0,00	0,00	25.589.118,53	207.948,17	0,82%	0,82%	0,64%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	697.070,40	0,00	0,00	702.718,80	5.648,40	0,81%	0,81%	0,97%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	2.455.494,13	0,00	0,00	2.471.865,27	16.371,14	0,67%	0,67%	0,79%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	10.817.474,50	0,00	0,00	10.877.602,31	60.127,81	0,56%	0,56%	0,62%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDEN...	1.564.554,02	0,00	0,00	1.573.107,88	8.553,86	0,55%	0,55%	0,65%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	5.879.847,40	0,00	0,00	5.911.839,77	31.992,37	0,54%	0,54%	0,64%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12.708.146,27	0,00	0,00	12.769.887,62	61.741,35	0,49%	0,49%	0,72%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	24.457.671,18	0,00	0,00	24.569.480,34	111.809,16	0,46%	0,46%	0,55%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	4.818.881,21	0,00	0,00	4.839.545,35	20.664,14	0,43%	0,43%	0,65%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	9.848.020,70	0,00	0,00	9.889.635,74	41.615,04	0,42%	0,42%	0,09%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	161.666,12	0,00	0,00	162.290,68	624,56	0,39%	0,39%	0,03%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	13.560.396,64	0,00	0,00	13.612.602,54	52.205,90	0,38%	0,38%	0,55%
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	10.468.824,44	0,00	0,00	10.504.498,15	35.673,71	0,34%	0,34%	0,00%
ITAU SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES LP	1.009.286,18	0,00	590.030,43	422.428,00	3.172,25	0,31%	0,36%	0,00%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	5.259.039,75	0,00	0,00	5.272.712,60	13.672,85	0,26%	0,26%	1,65%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.180.693,35	1.567.231,63	796.719,24	6.970.776,63	19.570,89	0,25%	0,29%	0,00%
ITAU IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	5.274.853,99	0,00	0,00	5.285.670,73	10.816,74	0,21%	0,21%	1,70%

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
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	4.427.648,54	0,00	0,00	4.434.655,02	7.006,48	0,16%	0,16%	0,42%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.307.210,47	0,00	0,00	4.305.739,24	-1.471,23	-0,03%	-0,03%	0,31%
Total Renda Fixa	155.471.616,79	1.567.231,63	1.386.749,67	156.418.957,10	766.858,35	0,49%		0,57%

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
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.489.990,00	0,00	40.500,00	1.750.000,00	300.510,00	20,17%	17,45%	22,09%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3.144.677,26	0,00	0,00	3.208.570,38	63.893,12	2,03%	2,03%	8,44%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	3.262.550,39	0,00	0,00	3.318.608,89	56.058,50	1,72%	1,72%	8,40%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	4.327.918,32	0,00	0,00	4.394.106,24	66.187,92	1,53%	1,53%	8,42%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	4.209.042,73	0,00	0,00	4.270.792,67	61.749,94	1,47%	1,47%	9,71%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GENESIS FIC AÇÕES	1.279.175,05	0,00	0,00	1.293.777,75	14.602,70	1,14%	0,82%	9,45%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	10.741.344,05	0,00	0,00	10.814.769,19	73.425,14	0,68%	0,68%	1,97%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	5.981.638,82	0,00	0,00	5.989.257,49	7.618,67	0,13%	0,13%	1,10%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MUL...	1.128.461,34	0,00	1.127.970,21	0,00	-491,13	-0,04%	-	-
BRASIL AGRO II MULTIELABRATÉGIA FIP	3.152.642,59	0,00	0,00	3.150.167,68	-2.474,91	-0,08%	-0,10%	0,03%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	3.130.642,70	0,00	0,00	3.124.728,71	-5.913,99	-0,19%	-0,19%	8,70%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	2.295.484,45	0,00	0,00	2.289.748,02	-5.736,43	-0,25%	-0,25%	2,96%
GERAÇÃO FI AÇÕES	2.776.044,23	0,00	0,00	2.741.306,90	-34.737,33	-1,25%	-1,25%	9,14%
BRANESCO SELECTION FI AÇÕES	3.594.243,30	0,00	0,00	3.547.910,26	-46.333,04	-1,29%	-1,29%	10,86%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	10.347.948,60	0,00	0,00	10.199.017,97	-148.930,63	-1,44%	-1,44%	9,53%
Total Renda Variável	60.861.803,83	0,00	1.168.470,21	60.092.762,15	399.428,53	0,66%		6,78%