

# 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
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	5.742.247,03	2,66%	615	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	15/08/2022	398.156,42	0,18%	165	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	8.480.216,95	3,93%	888	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	2.644.621,58	1,22%	709	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	43.826.565,06	20,30%	717	0,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	2.183.298,88	1,01%	435	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	8.574.768,85	3,97%	1.213	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2024	8.139.600,76	3,77%	104	1,78%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	13.100.836,12	6,07%	583	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	8.164.911,18	3,78%	941	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	14.040.491,49	6,50%	969	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	15.980.476,31	7,40%	922	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+0	15/08/2022	4.385.708,49	2,03%	95	0,87%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	5.260.426,69	2,44%	169	0,47%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.451.853,27	1,60%	96	0,40%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.613.774,31	0,75%	737	0,11%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	1.874.971,08	0,87%	288	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRANCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	258.167,48	0,12%	295	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	14.551.419,80	6,74%	62	1,19%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	15.514.099,34	7,19%	18.810	0,98%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '

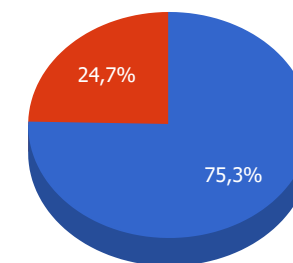
Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	5.470.698,48	2,53%	58.612	0,12%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	2.471.068,40	1,14%	2.008	0,72%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	2.462.923,19	1,14%	6.534	0,12%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	3.450.426,30	1,60%	1.504	0,42%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	7.945.683,70	3,68%	211	0,82%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	8.445.816,49	3,91%	26.307	0,13%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	4.357.918,67	2,02%	7.332	0,51%	Artigo 8º, Inciso III
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	D+2	Não há	1.157.853,97	0,54%	43	0,28%	Artigo 8º, Inciso III
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII ...	Não se ...	Não se aplica	1.971.427,75	0,91%		0,98%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>215.920.428,04</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 ' b '	100,00%	135.661.899,12	62,83%	15,00%	30,00%	90,00%	58.666.486,12
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	129.552.256,82
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	27.010.612,63	12,51%	10,00%	30,00%	40,00%	59.357.558,59
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	32.388.064,21
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	10.796.021,40
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	10.796.021,40
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	10.796.021,40
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>162.672.511,75</b>	<b>75,34%</b>	<b>25,00%</b>	<b>70,00%</b>	<b>220,00%</b>	

**Distribuição por Segmento**

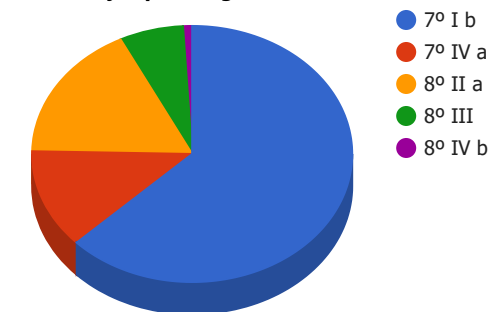


● RENDA FIXA ● RENDA VARIÁVEL

**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 II, Alínea ' a '	20,00%	37.314.899,41	17,28%	7,00%	10,00%	20,00%	5.869.186,20
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	13.961.589,13	6,47%	7,00%	10,00%	10,00%	7.630.453,67
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	10.796.021,40
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	1.971.427,75	0,91%	0,00%	5,00%	5,00%	8.824.593,65
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	10.796.021,40
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>53.247.916,29</b>	<b>24,66%</b>	<b>14,00%</b>	<b>30,00%</b>	<b>45,00%</b>	

**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%	21.592.042,80
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>10,00%</b>	

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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	130.846.679,31	60,60	0,03
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	48.390.756,05	22,41	0,00
BRASESCO ASSET MANAGEMENT	13.464.277,87	6,24	0,00
ITAÚ UNIBANCO	7.345.669,56	3,40	0,00
WESTERN ASSET	4.357.918,67	2,02	0,01
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	3.451.853,27	1,60	0,00
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	2.471.068,40	1,14	0,00
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	2.462.923,19	1,14	0,00
ZION INVEST	1.971.427,75	0,91	0,40
SAFRA ASSET MANAGEMENT	1.157.853,97	0,54	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 '	135.661.899,12	62,83	15,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	27.010.612,63	12,51	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 '	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 II, Alínea ' a '	37.314.899,41	17,28	7,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	13.961.589,13	6,47	7,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	1.971.427,75	0,91	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

**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%
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%
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	0,44%	0,44%	1,20%	3,05%	6,61%	14,04%	-	-
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 5 (Benchmark)</b>	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%
<b>IMA-B (Benchmark)</b>	0,26%	0,26%	-0,24%	5,64%	18,11%	34,79%	-	-
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%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,80%	0,80%	1,29%	3,49%	9,98%	15,87%	0,01%	0,06%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,20%	0,20%	1,55%	3,91%	9,21%	20,11%	0,00%	0,01%
<b>IRF-M (Benchmark)</b>	0,88%	0,88%	1,04%	4,50%	11,47%	23,54%	-	-

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

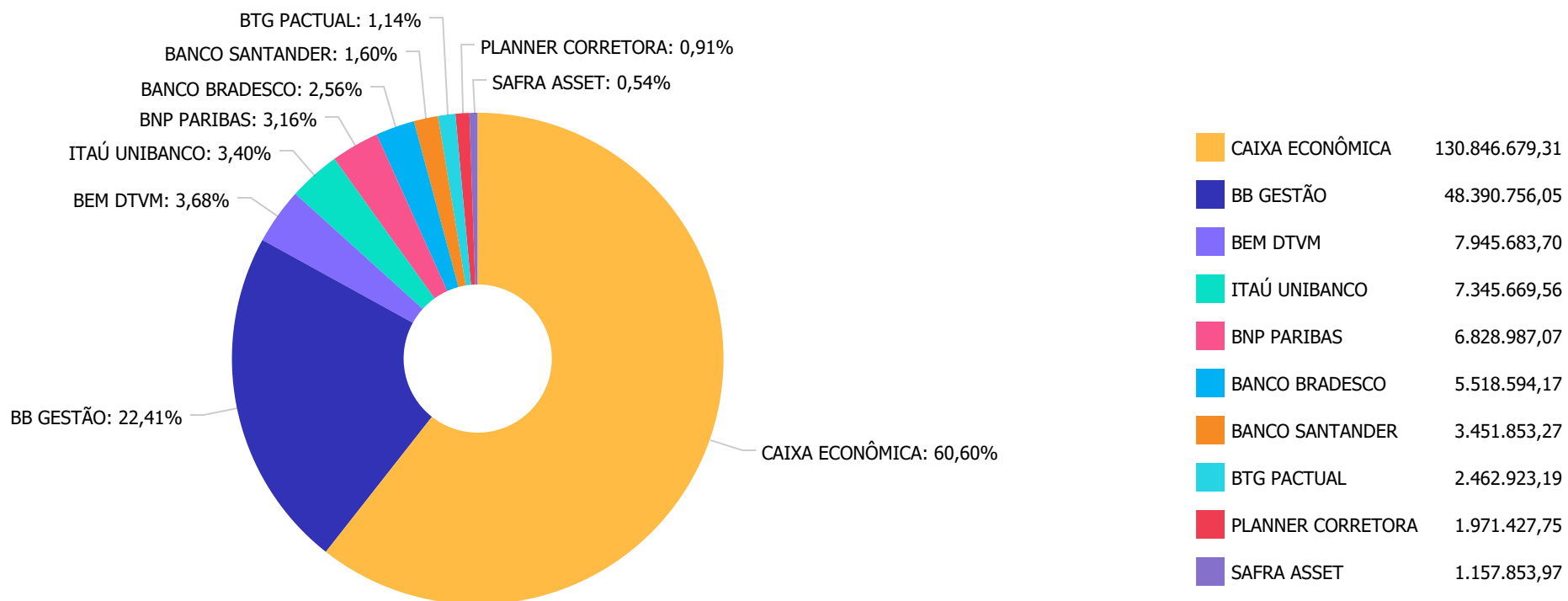
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,85%	0,85%	0,98%	4,38%	11,22%	23,04%	0,01%	0,03%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,84%	0,84%	0,96%	4,33%	11,12%	22,99%	0,01%	0,03%
<b>Selic (Benchmark)</b>	0,38%	0,38%	1,14%	2,60%	5,78%	12,54%	-	-
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,37%	0,37%	1,07%	2,51%	5,66%	12,30%	0,00%	0,00%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,38%	0,38%	1,14%	2,60%	5,78%	12,53%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,29%	0,29%	0,87%	2,05%	4,65%	10,14%	0,00%	0,00%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,40%	0,40%	1,03%	2,54%	5,72%	12,30%	0,00%	0,00%
<b>IPCA (Benchmark)</b>	0,21%	0,21%	1,88%	2,05%	4,19%	8,13%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,64%	0,64%	1,44%	5,05%	12,70%	24,79%	0,01%	0,02%
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%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,34%	0,34%	0,93%	4,14%	11,91%	17,78%	0,00%	0,03%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,43%	0,43%	0,33%	3,87%	10,74%	21,90%	0,01%	0,03%



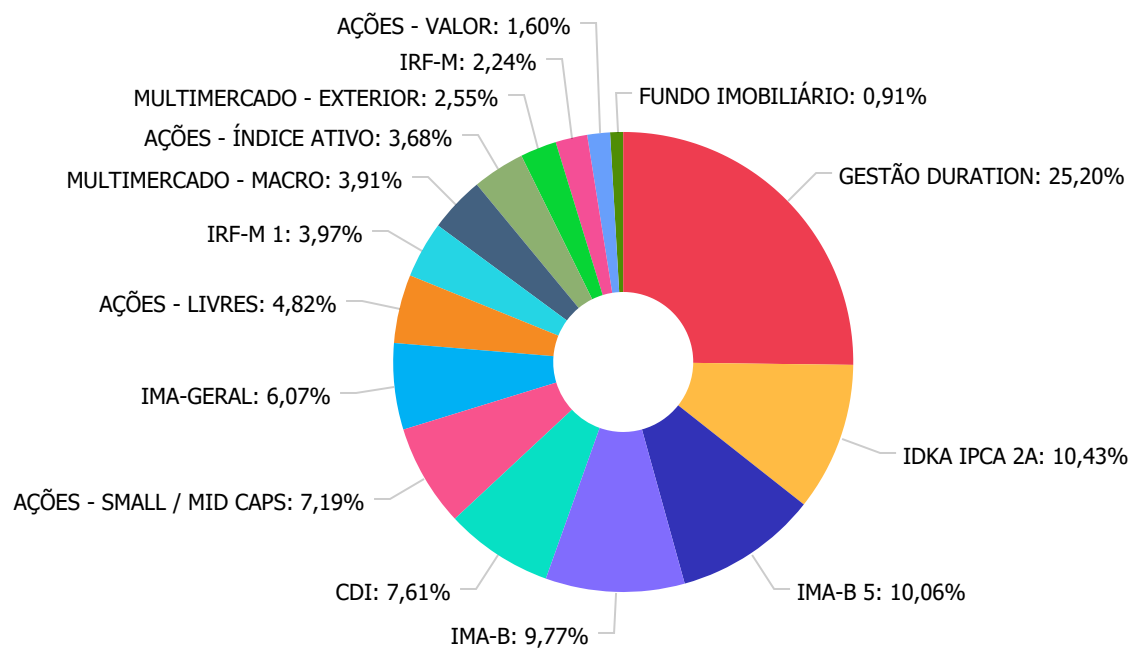
**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2020 - RENDA VARIÁVEL**

	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%	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	0,37%	0,37%	6,95%	10,06%	23,30%	22,94%	0,06%	0,12%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	0,37%	0,37%	6,91%	9,92%	23,14%	22,42%	0,06%	0,12%
<b>Ibovespa (Benchmark)</b>	-1,63%	-1,63%	6,10%	11,74%	16,80%	33,97%	-	-
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2,03%	2,03%	9,64%	15,80%	32,00%	59,43%	0,08%	0,09%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	-0,77%	-0,77%	6,44%	13,17%	22,79%	41,50%	0,09%	0,09%
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%
<b>SMLL (Benchmark)</b>	0,45%	0,45%	18,98%	24,82%	45,25%	64,69%	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	0,50%	0,50%	18,51%	24,23%	41,26%	56,18%	0,09%	0,14%
<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>	-	-	-	-	-	-	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	-10,85%	-10,85%	-14,18%	-27,67%	-34,29%	-48,89%	0,10%	0,46%

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



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

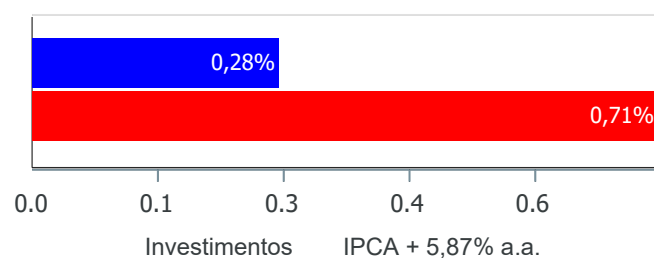


GESTÃO DURATION	54.413.816,10
IDKA IPCA 2A	22.520.708,44
IMA-B 5	21.722.723,34
IMA-B	21.088.376,85
CDI	16.423.361,59
AÇÕES - SMALL / MID CAPS	15.514.099,34
IMA-GERAL	13.100.836,12
AÇÕES - LIVRES	10.404.690,07
IRF-M 1	8.574.768,85
MULTIMERCADO - MACRO	8.445.816,49
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	7.945.683,70
MULTIMERCADO - EXTERIOR	5.515.772,64
IRF-M	4.827.920,46
AÇÕES - VALOR	3.450.426,30
FUNDO IMOBILIÁRIO	1.971.427,75

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

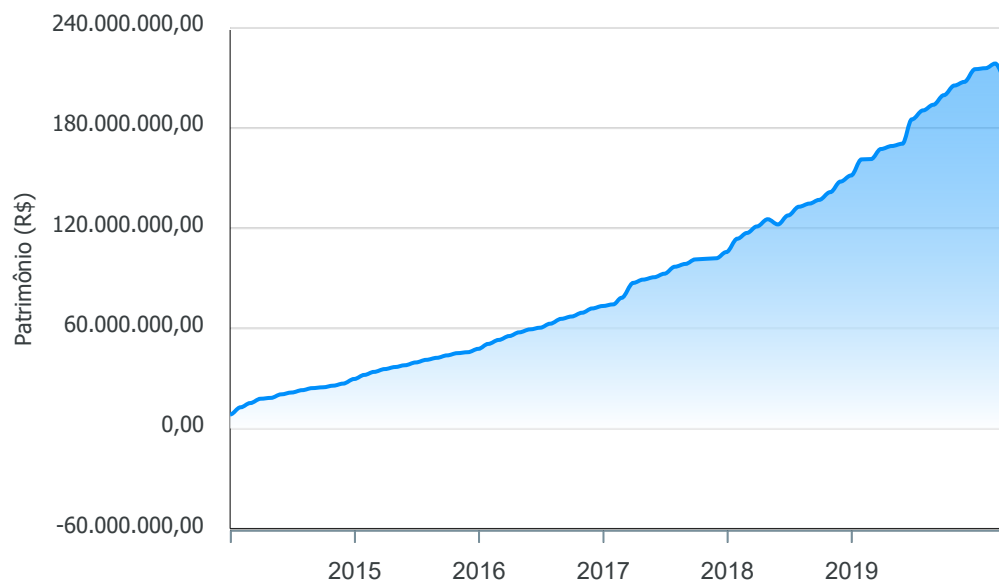
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	215.323.630,36	11.203.932,19	11.215.351,57	215.920.428,04	608.217,06	608.217,06	0,28%	0,28%	0,71%	0,71%	39,77%	2,41%

Investimentos x Meta Atuarial



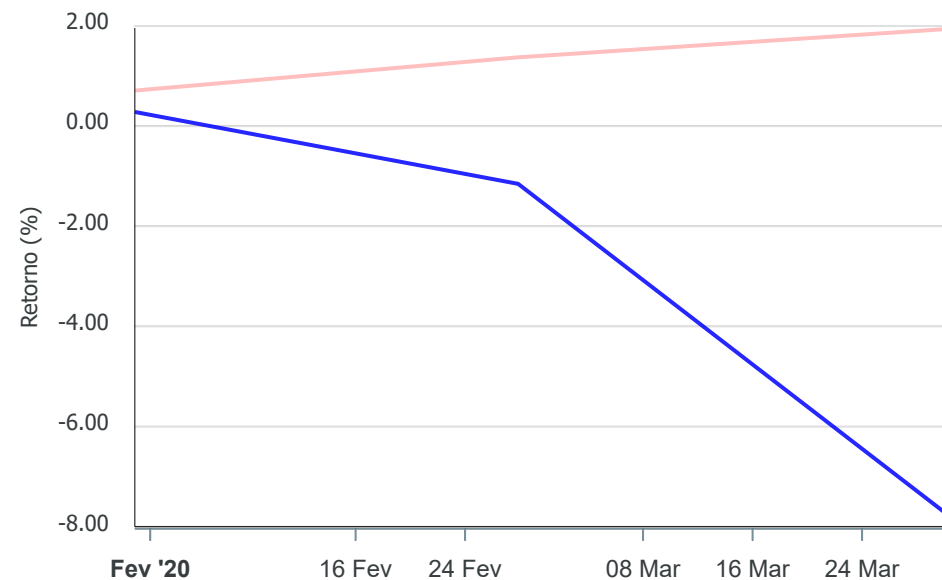
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.622.220,68	0,00	0,00	2.644.621,58	22.400,90	0,85%	0,85%	0,65%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	2.165.163,30	0,00	0,00	2.183.298,88	18.135,58	0,84%	0,84%	0,64%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.075.023,23	0,00	0,00	8.139.600,76	64.577,53	0,80%	0,80%	1,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	38.511.116,49	5.000.000,00	0,00	43.826.565,06	315.448,57	0,72%	0,82%	0,64%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENC...	4.357.790,85	0,00	0,00	4.385.708,49	27.917,64	0,64%	0,64%	0,73%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	5.710.505,77	0,00	0,00	5.742.247,03	31.741,26	0,56%	0,56%	0,62%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	15.893.996,76	0,00	0,00	15.980.476,31	86.479,55	0,54%	0,54%	0,64%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.037.494,67	0,00	0,00	13.100.836,12	63.341,45	0,49%	0,49%	0,72%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	13.976.596,95	0,00	0,00	14.040.491,49	63.894,54	0,46%	0,46%	0,55%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	5.237.965,45	0,00	0,00	5.260.426,69	22.461,24	0,43%	0,43%	0,65%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	8.538.961,14	0,00	0,00	8.574.768,85	35.807,71	0,42%	0,42%	0,09%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	8.447.694,34	0,00	0,00	8.480.216,95	32.522,61	0,38%	0,38%	0,55%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	24.268.998,63	264.358,96	10.075.327,72	14.551.419,80	93.389,93	0,38%	0,40%	0,03%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	257.215,87	0,00	0,00	258.167,48	951,61	0,37%	0,37%	0,01%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	3.440.096,11	0,00	0,00	3.451.853,27	11.757,16	0,34%	0,34%	0,03%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	1.868.603,60	0,00	0,00	1.874.971,08	6.367,48	0,34%	0,34%	0,00%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	8.144.821,08	0,00	0,00	8.164.911,18	20.090,10	0,25%	0,25%	1,67%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.808.623,60	939.573,23	1.140.023,85	1.613.774,31	5.601,33	0,20%	0,29%	0,00%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	397.375,14	0,00	0,00	398.156,42	781,28	0,20%	0,20%	0,38%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>166.760.263,66</b>	<b>6.203.932,19</b>	<b>11.215.351,57</b>	<b>162.672.511,75</b>	<b>923.667,47</b>	<b>0,53%</b>		<b>0,59%</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
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	8.388.474,97	0,00	0,00	8.445.816,49	57.341,52	0,68%	0,68%	1,97%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	15.436.606,61	0,00	0,00	15.514.099,34	77.492,73	0,50%	0,50%	9,31%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	1.153.567,81	0,00	0,00	1.157.853,97	4.286,16	0,37%	0,37%	5,97%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	4.341.977,80	0,00	0,00	4.357.918,67	15.940,87	0,37%	0,37%	6,04%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	5.481.052,54	0,00	0,00	5.470.698,48	-10.354,06	-0,19%	-0,19%	8,70%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	0,00	2.500.000,00	0,00	2.471.068,40	-28.931,60	-1,16%	-0,77%	9,32%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	8.049.448,35	0,00	0,00	7.945.683,70	-103.764,65	-1,29%	-1,29%	10,86%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	3.500.810,97	0,00	0,00	3.450.426,30	-50.384,67	-1,44%	-1,44%	9,53%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,00	2.500.000,00	0,00	2.462.923,19	-37.076,81	-1,48%	2,03%	8,44%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	2.211.427,65	0,00	0,00	1.971.427,75	-239.999,90	-10,85%	-10,85%	9,86%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>48.563.366,70</b>	<b>5.000.000,00</b>	<b>0,00</b>	<b>53.247.916,29</b>	<b>-315.450,41</b>	<b>-0,59%</b>		<b>7,97%</b>