



# 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
TÍTULOS PÚBLICOS			88.764.801,64	15,26%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	46.351.750,24	7,97%	583	0,44%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	58.670.091,56	10,09%	435	0,38%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	48.386.824,44	8,32%	717	0,48%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	55.888.282,94	9,61%	969	0,64%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	55.245.324,43	9,50%	674	0,85%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	57.541.549,19	9,89%	1.213	0,78%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BRA1 FI RENDA FIXA	D+1445	Não há	967.348,56	0,17%	16	4,17%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1800	Não há	1.261.627,74	0,22%	11	1,18%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	D+1009	Não há	3.841.852,52	0,66%	28	5,28%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	46.002.253,56	7,91%	288	0,88%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	1.924.644,38	0,33%	70	2,53%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 4	Não se ...	Não se aplica	555,18	0,00%		0,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se ...	Não se aplica	1.850.735,78	0,32%	98	2,17%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	Não se ...	Não se aplica	1.103,36	0,00%		0,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 3	Não se ...	Não se aplica	1.038,46	0,00%		0,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	22.712.999,00	3,91%	11.903	2,17%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	25.767.693,12	4,43%	7.351	1,62%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
ITAU DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	29.675.044,90	5,10%	58.612	0,65%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	17.577.225,87	3,02%	2.008	5,11%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "

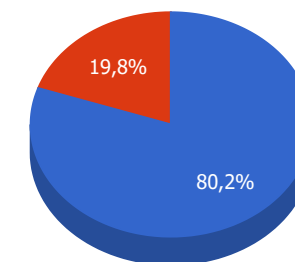
**Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2020)**

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+1	Não há	239.167,64	0,04%	12	14,12%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	7.273.216,45	1,25%	33	2,72%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
BRASIL ÓLEO & GÁS MULTISTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	601,69	0,00%	15	0,40%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
ÁTICO FLORESTAL BRASIL FICFIP	Não se ...	Não se aplica	1.287.336,83	0,22%	17	5,42%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRCR11	S/Info	Não se aplica	373.160,16	0,06%		0,02%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se ...	Não se aplica	2.040.989,41	0,35%		5,76%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
RIO BRAVO RENDA VAREJO FII - RBVA11	Não se ...	Não se aplica	3.020.200,00	0,52%		0,49%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	S/Info	Não se aplica	4.930.268,73	0,85%		8,46%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>581.597.687,78</b>				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			<b>266.247,18</b>				Artigo 6º
<b>PL Total</b>			<b>581.863.934,96</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%	88.764.801,64	15,26%	5,00%	15,00%	100,00%	492.832.886,14
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	322.083.822,80	55,38%	10,00%	52,50%	100,00%	259.513.864,98
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " c "	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	29.079.884,39
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	29.079.884,39
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	116.319.537,56
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	116.319.537,56
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	52.073.082,38	8,95%	0,00%	10,00%	40,00%	180.565.992,73
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	29.079.884,39
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	3.778.077,16	0,65%	0,00%	0,50%	3,00%	13.669.853,47
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>466.699.783,98</b>	<b>80,24%</b>	<b>15,00%</b>	<b>78,00%</b>	<b>298,00%</b>	

**Distribuição por Segmento**

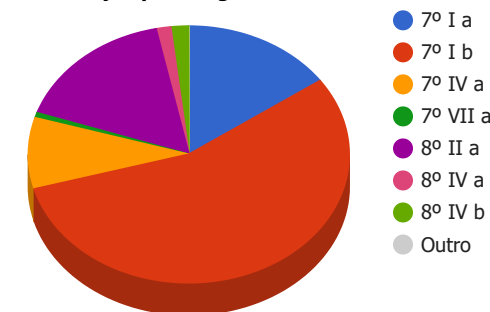


● RENDA FIXA ● RENDA VARIÁVEL

**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 I, Alínea " a "	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	10,00%	58.159.768,78
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	25,00%	145.399.421,95
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	95.732.962,89	16,46%	0,00%	14,00%	20,00%	20.586.574,67
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	29.079.884,39
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	239.167,64	0,04%	0,00%	0,50%	3,00%	17.208.762,99
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	8.561.154,97	1,47%	0,00%	1,00%	5,00%	20.518.729,42
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	10.364.618,30	1,78%	0,00%	1,00%	5,00%	18.715.266,09
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " c "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	29.079.884,39
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>114.897.903,80</b>	<b>19,76%</b>	<b>0,00%</b>	<b>22,00%</b>	<b>78,00%</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%	0,00%	5,00%	29.079.884,39
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	29.079.884,39
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	29.079.884,39
<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>15,00%</b>	

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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	162.945.198,94	28,02	0,03
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	159.138.623,86	27,36	0,01
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	88.764.801,64	15,26	-
ITAÚ UNIBANCO	75.677.298,46	13,01	0,00
AZ QUEST INVESTIMENTOS	48.480.692,12	8,34	0,14
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	17.577.225,87	3,02	0,03
ÁTICO ASSET MANAGEMENT	8.560.553,28	1,47	36,04
GRAPHEN INVESTIMENTOS LTDA	6.005.664,54	1,03	6,05
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	5.897.617,29	1,01	-
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	3.020.200,00	0,52	0,34
REDITUS INVESTIMENTOS	2.040.989,41	0,35	-
PETRA CAPITAL	1.850.735,78	0,32	0,22
VERITAS CAPITAL MANAGEMENT	1.261.627,74	0,22	0,06
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	373.160,16	0,06	0,00
BRASIL PLURAL	2.697,00	0,00	0,00
VALORA INVESTIMENTOS	601,69	0,00	0,00

**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 "	88.764.801,64	15,26	50,00	90,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	322.083.822,80	55,38	20,00	50,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	52.073.082,38	8,95	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	3.778.077,16	0,65	0,00	0,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	0,00	0,00	5,00	10,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	95.732.962,89	16,46	10,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	239.167,64	0,04	0,00	0,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	8.561.154,97	1,47	0,00	0,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	10.364.618,30	1,78	0,00	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)

**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%	-	-
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>IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)</b>	0,80%	0,80%	3,62%	5,65%	11,52%	23,76%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-0,11%	-0,11%	-0,71%	-1,83%	-0,15%	1.261,32%	0,01%	0,01%
<b>120% do CDI (Benchmark)</b>	0,45%	0,45%	1,36%	3,13%	6,98%	15,22%	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 4	-	-	-	-	-	-	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 3	-	-	-	-	-	-	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	-	-	-	-	-	-	-	-
<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%	-	-
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,05%	0,05%	-0,63%	-6,45%	-23,75%	-14,88%	0,04%	0,18%

**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-B (Benchmark)</b>	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%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	0,24%	0,24%	-0,29%	2,54%	8,67%	-	0,01%	0,03%
BRA1 FI RENDA FIXA	-0,48%	-0,48%	-30,41%	-29,01%	-62,04%	-58,19%	0,01%	0,51%

<b>IRF-M (Benchmark)</b>	0,88%	0,88%	1,04%	4,50%	11,47%	23,54%	-	-
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>IPCA (Benchmark)</b>	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%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,82%	0,82%	0,91%	4,67%	14,10%	25,30%	0,01%	0,04%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,54%	-0,54%	-0,90%	-1,39%	-9,49%	-16,62%	0,01%	0,06%



**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>IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)</b>	1,09%	1,09%	4,45%	7,40%	15,18%	31,97%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	0,00%	0,00%

<b>IPCA + 11,00% ao ano (Benchmark)</b>	1,13%	1,13%	4,57%	7,65%	15,70%	33,17%	-	-
BRASIL ÓLEO & GÁS MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	0,03%	1,18%

<b>Ibovespa (Benchmark)</b>	-1,63%	-1,63%	6,10%	11,74%	16,80%	33,97%	-	-
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	3,82%	3,82%	10,95%	16,92%	24,29%	47,97%	0,11%	0,09%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-0,19%	-0,19%	9,98%	18,27%	31,46%	59,14%	0,09%	0,10%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	-0,77%	-0,77%	6,44%	13,17%	22,79%	41,50%	0,09%	0,09%

<b>SMLL (Benchmark)</b>	0,45%	0,45%	18,98%	24,82%	45,25%	64,69%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	6,67%	6,67%	23,12%	31,03%	49,98%	84,85%	0,10%	0,14%

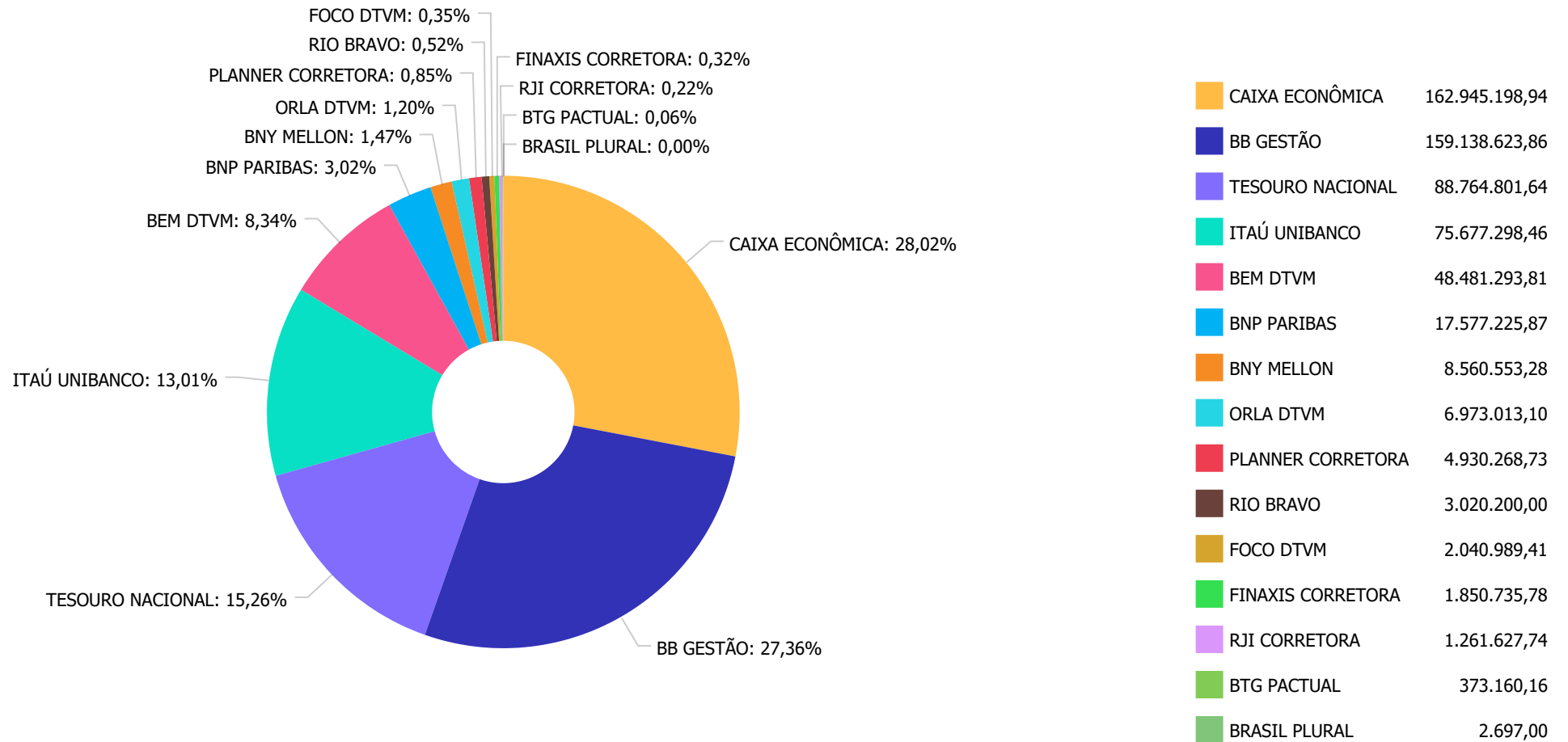
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,38%	0,38%	1,14%	2,60%	5,78%	12,53%	-	-
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	7,82%	7,82%	5,96%	3,21%	6,62%	-94,41%	0,14%	0,08%

<b>Não Informado (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	1,31%	1,31%	-18,36%	108,71%	108,71%	108,71%	-	-
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRCR11	-2,33%	-2,33%	24,31%	18,36%	12,43%	9,17%	0,09%	0,22%

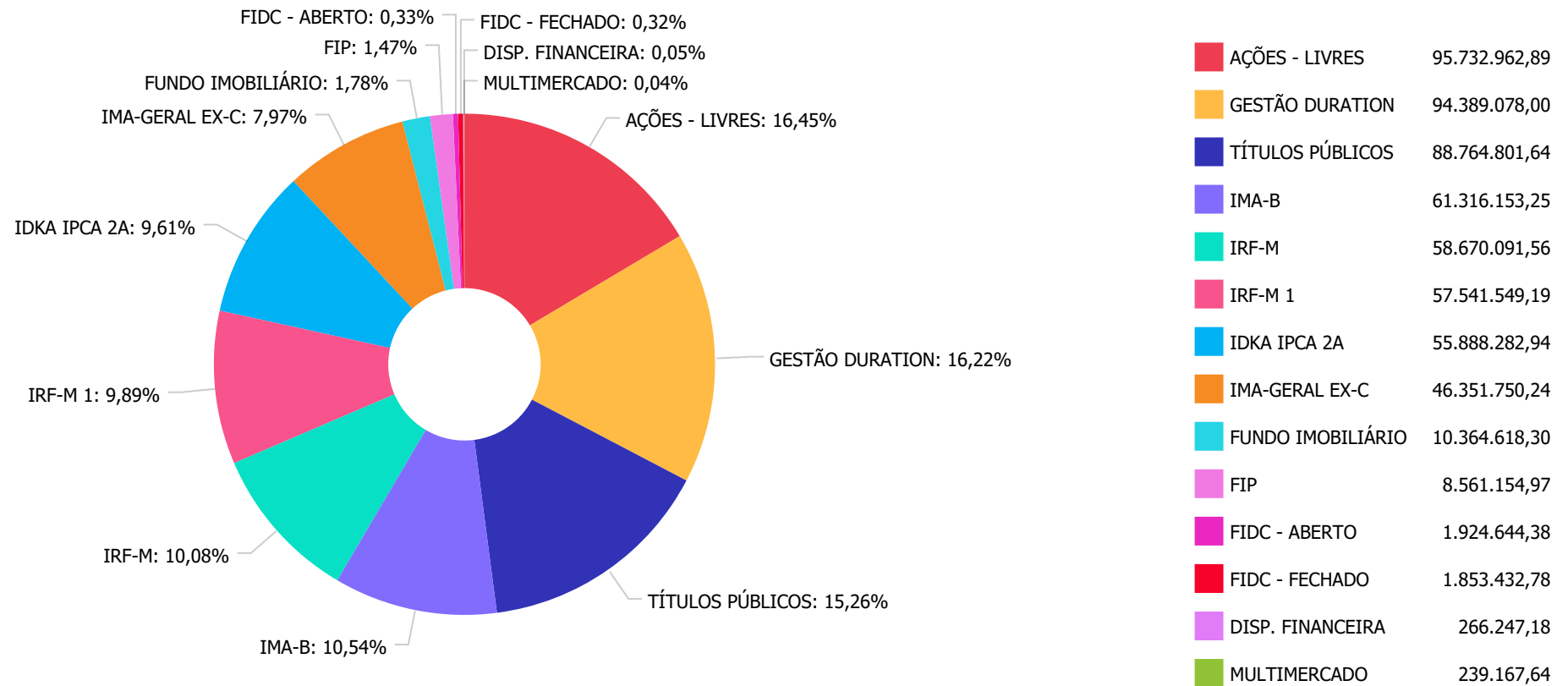
**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2020 - RENDA VARIÁVEL**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
ÁTICO FLORESTAL BRASIL FICFIP	-	-	-	-	-	-	0,00%	0,12%
ÁQUILLA FII - AQLL11	0,28%	0,28%	-7,43%	-24,79%	-19,77%	-15,05%	0,00%	0,26%
RIO BRAVO RENDA VAREJO FII - RBVA11	-10,64%	-10,64%	7,33%	7,10%	-87,31%	-88,14%	0,14%	0,24%

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	15/08/2024	08/10/2004	750	1.322,840000	3.906,544681	992.130,00	2.929.908,51	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	22/09/2004	760	1.314,210000	3.906,544681	998.799,60	2.968.973,96	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	02/09/2004	770	1.299,461390	3.906,544681	1.000.585,27	3.008.039,40	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	22/07/2004	850	1.322,487235	3.906,544681	1.124.114,15	3.320.562,98	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	06/04/2004	750	1.342,192893	3.906,544681	1.006.644,67	2.929.908,51	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	17/03/2004	750	1.333,000000	3.906,544681	999.750,00	2.929.908,51	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	14/12/2004	1.100	1.352,073136	3.906,544681	1.487.280,45	4.297.199,15	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	04/01/2005	630	1.364,164873	3.906,544681	859.423,87	2.461.123,15	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	04/01/2005	100	1.364,164800	3.906,544681	136.416,48	390.654,47	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	07/01/2005	730	1.366,595342	3.906,544681	997.614,60	2.851.777,62	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	20/01/2004	1.100	1.345,077073	3.906,544681	1.479.584,78	4.297.199,15	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	18/11/2003	880	1.247,941000	3.906,544681	1.098.188,08	3.437.759,32	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	17/11/2004	610	1.468,534148	4.658,342786	895.805,83	2.841.589,10	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	18/11/2004	1.010	1.468,534139	4.658,342786	1.483.219,48	4.704.926,21	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	19/11/2004	1.180	1.468,534144	4.658,342786	1.732.870,29	5.496.844,49	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	29/04/2005	916	1.363,723504	4.658,342786	1.249.170,73	4.267.041,99	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	20/03/2003	600	1.601,028617	4.494,372515	960.617,17	2.696.623,51	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	15/04/2003	938	1.577,117868	4.494,372515	1.479.336,56	4.215.721,42	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	29/05/2003	500	1.596,101000	4.494,372515	798.050,50	2.247.186,26	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	09/09/2003	690	1.452,455942	4.494,372515	1.002.194,60	3.101.117,04	Mercado

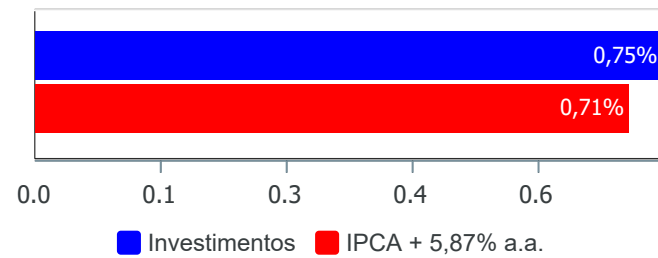
**Carteira de Títulos Públicos no mês de (Janeiro / 2020)**

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	20/03/2003	600	1.601,028617	4.494,372515	960.617,17	2.696.623,51	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	15/04/2003	938	1.577,117868	4.494,372515	1.479.336,56	4.215.721,42	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	29/05/2003	500	1.596,101000	4.494,372515	798.050,50	2.247.186,26	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	09/09/2003	690	1.452,455942	4.494,372515	1.002.194,60	3.101.117,04	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	03/07/2003	180	1.433,575000	4.494,372515	258.043,50	808.987,05	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	18/06/2003	631	1.441,834834	4.494,372515	909.797,78	2.835.949,06	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	08/10/2003	300	1.432,180667	4.494,372515	429.654,20	1.348.311,75	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	21/03/2003	1.300	1.602,545169	4.494,372515	2.083.308,72	5.842.684,27	Mercado

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

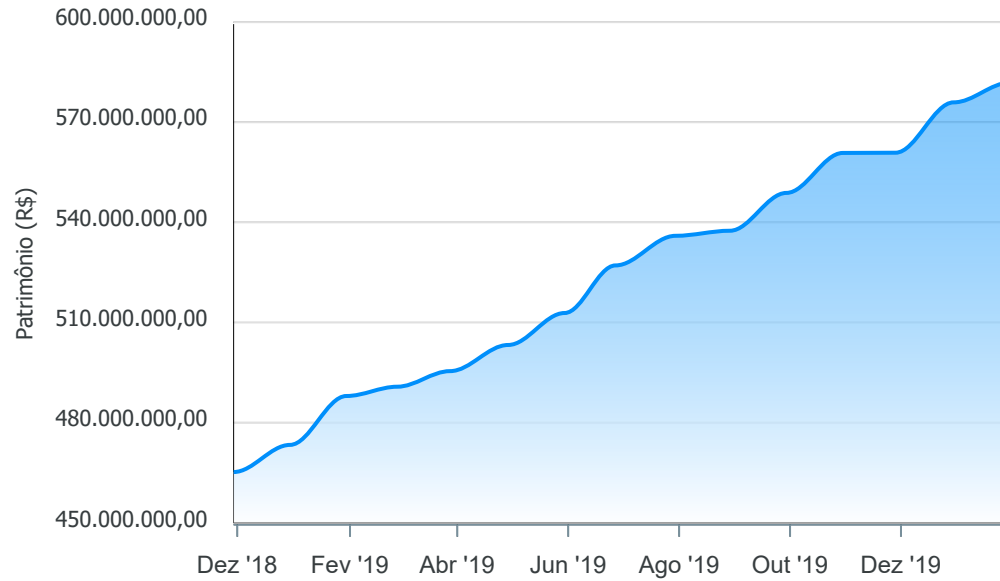
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	567.916.838,93	5.240.000,00	3.230.017,76	574.187.723,07	4.260.901,90	4.260.901,90	0,75%	0,75%	0,71%	0,71%	105,26%	2,48%

Investimentos x Meta Atuarial



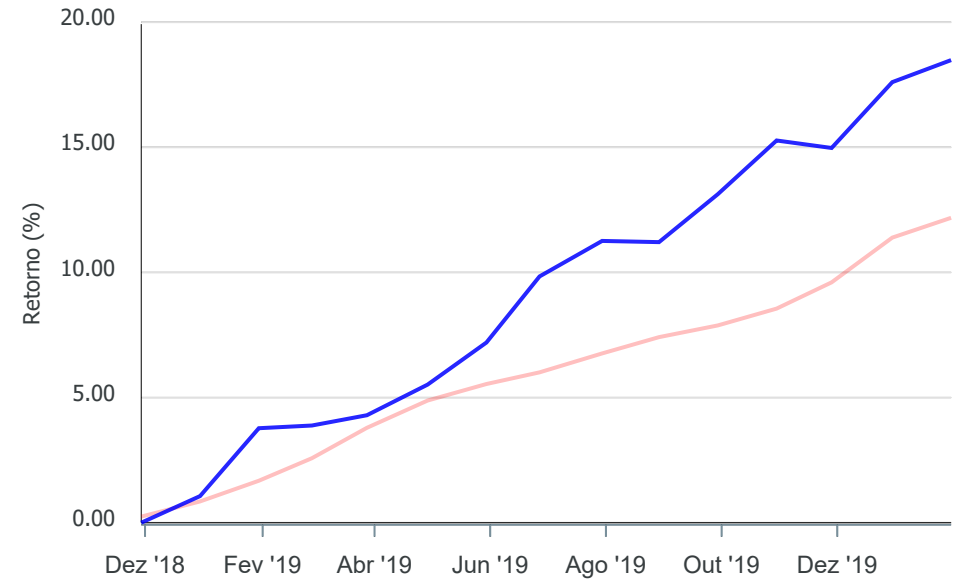
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	58.182.748,23	0,00	0,00	58.670.091,56	487.343,33	0,84%	0,84%	0,64%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	47.993.612,34	0,00	0,00	48.386.824,44	393.212,10	0,82%	0,82%	0,64%
TÍTULOS PÚBLICOS	88.318.065,99	0,00	0,00	88.764.801,64	446.735,65	0,51%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	46.127.643,40	0,00	0,00	46.351.750,24	224.106,84	0,49%	0,49%	0,72%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	55.633.950,24	0,00	0,00	55.888.282,94	254.332,70	0,46%	0,46%	0,55%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	55.608.050,96	5.240.000,00	3.550.000,00	57.541.549,19	243.498,23	0,40%	0,42%	0,09%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	45.846.027,99	0,00	0,00	46.002.253,56	156.225,57	0,34%	0,34%	0,00%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	55.102.065,89	0,00	0,00	55.245.324,43	143.258,54	0,26%	0,26%	1,65%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	3.832.557,60	0,00	0,00	3.841.852,52	9.294,92	0,24%	0,24%	0,75%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.261.044,81	0,00	0,00	1.261.627,74	582,93	0,05%	0,05%	3,71%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1.926.713,32	0,00	0,00	1.924.644,38	-2.068,94	-0,11%	-0,11%	0,62%
BRA1 FI RENDA FIXA	971.978,74	0,00	0,00	967.348,56	-4.630,18	-0,48%	-0,48%	1,13%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.860.759,49	0,00	0,00	1.850.735,78	-10.023,71	-0,54%	-0,54%	0,56%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 4	886,02	0,00	0,00	555,18	-330,84	-37,34%	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	1.760,88	0,00	0,00	1.103,36	-657,52	-37,34%	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 3	1.657,31	0,00	0,00	1.038,46	-618,85	-37,34%	-	-
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>462.669.523,21</b>	<b>5.240.000,00</b>	<b>3.550.000,00</b>	<b>466.699.783,98</b>	<b>2.340.260,77</b>	<b>0,50%</b>		<b>0,63%</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
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	221.821,76	0,00	0,00	239.167,64	17.345,88	7,82%	7,82%	13,98%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	24.155.652,52	0,00	0,00	25.767.693,12	1.612.040,60	6,67%	6,67%	10,11%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	21.877.760,32	0,00	0,00	22.712.999,00	835.238,68	3,82%	3,82%	10,56%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	4.903.018,34	0,00	0,00	4.930.268,73	27.250,39	0,56%	0,00%	-
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	7.275.542,15	0,00	0,00	7.273.216,45	-2.325,70	-0,03%	-0,03%	0,01%
ÁQUILLA FII - AQLL11	2.044.456,38	0,00	0,00	2.040.989,41	-3.466,97	-0,17%	0,28%	0,46%
ÁTICO FLORESTAL BRASIL FICFIP	1.289.720,88	0,00	0,00	1.287.336,83	-2.384,05	-0,18%	-0,18%	0,02%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	29.731.209,04	0,00	0,00	29.675.044,90	-56.164,14	-0,19%	-0,19%	8,70%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	17.713.357,78	0,00	0,00	17.577.225,87	-136.131,91	-0,77%	-0,77%	9,32%
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRGR11	382.054,20	0,00	1.817,76	373.160,16	-7.076,28	-1,85%	-2,33%	9,15%
BRASIL ÓLEO & GÁS MULTISTRATÉGIA FIP	640,98	0,00	0,00	601,69	-39,29	-6,13%	-6,13%	2,52%
RIO BRAVO RENDA VAREJO FII - RBVA11	3.380.000,00	0,00	28.200,00	3.020.200,00	-331.600,00	-9,81%	-10,64%	13,70%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>112.975.234,35</b>	<b>0,00</b>	<b>30.017,76</b>	<b>114.897.903,80</b>	<b>1.952.687,21</b>	<b>1,73%</b>		<b>8,83%</b>