

# Relatório Analítico dos Investimentos em fevereiro de 2020

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

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	12.737.639,75	1,76%	187	2,39%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	130.660.132,75	18,05%	679	2,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	D+0	15/08/2024	6.817.200,28	0,94%	93	1,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	105.826.633,36	14,62%	351	4,61%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	49.324.995,44	6,81%	731	0,46%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	42.905.775,13	5,93%	50	13,15%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	130.241.390,51	17,99%	119	6,60%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	21.315.473,63	2,94%	16	6,29%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	26.328.243,34	3,64%	10.596	6,62%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	1.176.166,92	0,16%	644	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se ...	Não se aplica	18.400,79	0,00%		0,37%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	141,72	0,00%		0,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO...	D+30 ou...	Não há	9.282.975,19	1,28%	74	1,57%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+4	Não há	6.264.245,29	0,87%	42	0,70%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	D+4	Não há	13.289.752,07	1,84%	95	1,10%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	14.092.317,87	1,95%	37.528	1,22%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	D+4	Não há	23.284.356,46	3,22%	17.507	2,58%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	13.726.665,97	1,90%	13.394	1,39%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	15.749.138,51	2,18%	20.282	1,02%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB MULTI SETORIAL QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+3	Não há	13.934.485,80	1,93%	8.717	7,95%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '

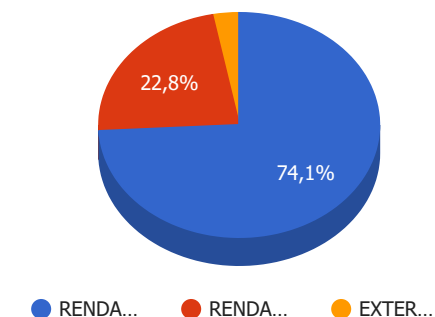
**Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 2020)**

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	31.941.876,20	4,41%	16.024	1,63%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	D+4	Não há	6.360.997,54	0,88%	28.852	0,96%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	18.593.218,17	2,57%	8.531	2,28%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	2.909.286,58	0,40%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE...	Não se ...	Não se aplica	2.141.939,55	0,30%	105	0,61%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se ...	Não se aplica	1.084.524,14	0,15%		3,06%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	S/Info	Não se aplica	1.614.698,85	0,22%		2,78%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
SANTANDER GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERI...	D+8 du	Não há	6.848.611,96	0,95%	29	3,29%	Artigo 9º - A, Inciso II
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	15.325.878,29	2,12%	9.215	3,32%	Artigo 9º - A, Inciso III
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>723.797.162,06</b>				

## 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%	0,00%	100,00%	723.797.162,06
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	305.366.601,58	42,19%	10,00%	40,95%	100,00%	418.430.560,48
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	723.797.162,06
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	36.189.858,10
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	434.278.297,24
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	434.278.297,24
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	221.967.049,53	30,67%	0,00%	23,00%	40,00%	67.551.815,29
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	289.518.864,82
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	144.759.432,41
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	108.569.574,31
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	108.569.574,31
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	18.542,51	0,00%	0,00%	0,05%	5,00%	36.171.315,59
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	9.282.975,19	1,28%	0,00%	1,00%	5,00%	26.906.882,91
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	36.189.858,10
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>536.635.168,81</b>	<b>74,14%</b>	<b>10,00%</b>	<b>65,00%</b>	<b>570,00%</b>	

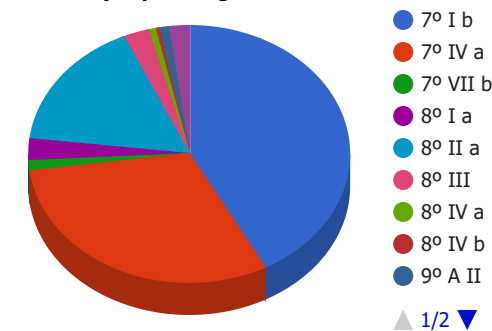
Distribuição por Segmento



## Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (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%	19.553.997,36	2,70%	0,00%	4,00%	30,00%	197.585.151,26
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	217.139.148,62
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	119.089.838,35	16,45%	2,00%	20,00%	20,00%	25.669.594,06
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	144.759.432,41
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	18.593.218,17	2,57%	0,00%	4,00%	10,00%	53.786.498,04
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	5.051.226,13	0,70%	0,00%	1,00%	5,00%	31.138.631,97
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	2.699.222,99	0,37%	0,00%	1,00%	5,00%	33.490.635,11
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	36.189.858,10
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>164.987.503,00</b>	<b>22,79%</b>	<b>2,00%</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%	0,00%	10,00%	72.379.716,21
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	6.848.611,96	0,95%	0,00%	2,00%	10,00%	65.531.104,25
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	15.325.878,29	2,12%	0,00%	3,00%	10,00%	57.053.837,92
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>22.174.490,25</b>	<b>3,06%</b>	<b>0,00%</b>	<b>5,00%</b>	<b>30,00%</b>	



**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
<b>CDI + 3,50% ao ano (Benchmark)</b>	0,54%	1,22%	1,89%	4,15%	9,25%	20,33%	-	-
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-1,91%	-5,32%	-3,63%	-25,68%	42,05%	-68,25%	0,03%	5,51%
<b>IRF-M 1+ (Benchmark)</b>	0,80%	1,92%	2,66%	6,01%	14,22%	27,05%	-	-
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	0,85%	2,11%	2,94%	6,76%	16,72%	31,70%	0,02%	0,05%
<b>IMA-B 5+ (Benchmark)</b>	0,32%	0,35%	2,96%	7,23%	22,04%	43,07%	-	-
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	0,29%	0,26%	2,86%	7,08%	21,56%	42,12%	0,04%	0,10%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,29%	0,25%	2,82%	6,92%	21,46%	41,77%	0,04%	0,10%
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	0,64%	1,20%	2,45%	5,66%	12,17%	23,49%	-	-
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	1,03%	1,94%	3,37%	7,08%	15,24%	28,81%	0,02%	0,04%
<b>110% do CDI (Benchmark)</b>	0,32%	0,74%	1,15%	2,63%	6,15%	13,66%	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	-97,43%	-98,39%	-98,75%	-99,38%	-99,71%	-99,92%	-	-
<b>IMA-B (Benchmark)</b>	0,45%	0,71%	2,73%	6,54%	18,00%	34,65%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,44%	0,70%	2,69%	6,44%	17,76%	33,99%	0,02%	0,06%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	0,46%	0,73%	2,76%	6,61%	17,85%	34,37%	0,03%	0,07%
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	0,81%	1,37%	3,56%	7,86%	20,96%	39,97%	0,03%	0,08%

**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
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,57%	1,10%	2,30%	5,45%	12,48%	24,14%	0,01%	0,02%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,29%	0,67%	1,05%	2,39%	5,57%	12,34%	-	-
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%
<b>IPCA (Benchmark)</b>	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%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,59%	1,41%	2,01%	5,42%	14,20%	25,23%	0,01%	0,04%

**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
<b>IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)</b>	0,97%	2,07%	4,10%	7,38%	14,88%	31,88%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>S&amp;P 500 (Benchmark)</b>	-8,41%	-8,56%	-5,95%	0,95%	6,10%	8,86%	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	-7,50%	-7,16%	-4,73%	3,26%	10,30%	17,58%	0,15%	0,15%
<b>IBX-50 (Benchmark)</b>	-8,66%	-10,38%	-4,50%	2,05%	6,61%	18,16%	-	-
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	-8,68%	-10,15%	-3,79%	2,67%	7,32%	15,99%	0,16%	0,13%
<b>IMOB (Benchmark)</b>	-10,58%	-7,13%	9,05%	17,84%	52,15%	69,80%	-	-
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	-11,10%	-7,58%	8,19%	16,50%	50,45%	66,69%	0,18%	0,26%
<b>ICON (Benchmark)</b>	-10,00%	-6,70%	0,78%	4,44%	34,77%	34,01%	-	-
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	-10,05%	-7,01%	0,64%	4,73%	34,98%	29,06%	0,16%	0,18%
<b>IDIV (Benchmark)</b>	-6,18%	-7,66%	1,56%	7,52%	21,63%	42,31%	-	-
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	-7,55%	-6,98%	0,01%	5,04%	20,48%	49,06%	0,12%	0,12%
<b>Ibovespa (Benchmark)</b>	-8,43%	-9,92%	-3,75%	3,00%	8,98%	22,05%	-	-
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	-8,98%	-9,87%	-2,99%	3,63%	10,84%	21,96%	0,16%	0,13%

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

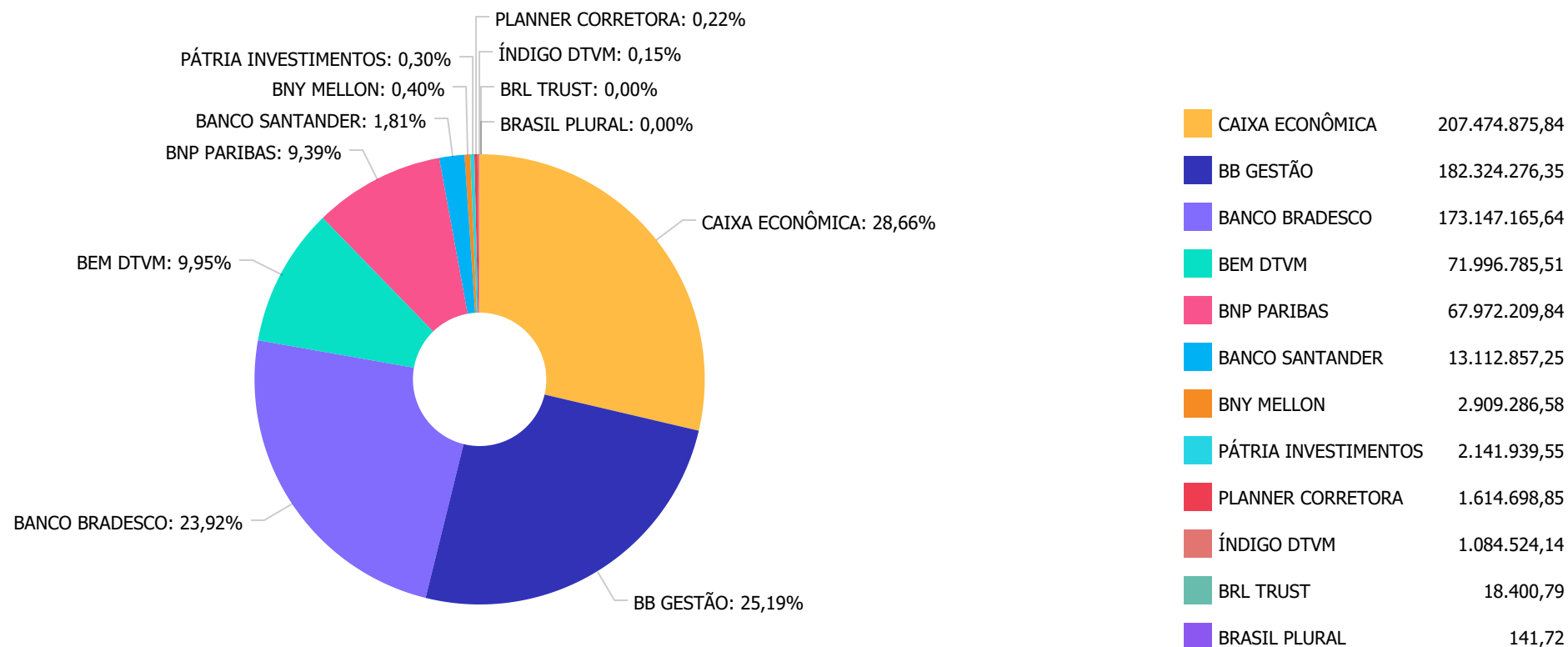
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	-8,29%	-4,78%	2,39%	6,09%	16,76%	33,08%	0,16%	0,13%
<b>SMLL (Benchmark)</b>	-8,27%	-7,86%	3,80%	13,95%	35,70%	51,63%	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	-8,60%	-8,14%	3,39%	12,78%	32,42%	43,20%	0,18%	0,17%
<b>Não Informado (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	0,00%	0,28%	0,28%	-23,19%	-13,01%	-15,05%	0,00%	0,25%
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	-	-	-	-	-	-	0,00%	0,38%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	0,56%	1,87%	-17,90%	109,87%	109,87%	109,87%	-	-
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	-8,09%	-7,10%	1,93%	10,93%	27,42%	45,80%	0,18%	0,14%
<b>Não definido (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
BB MULTI SETORIAL QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-9,07%	-6,82%	2,16%	7,53%	21,74%	35,79%	0,17%	0,14%

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

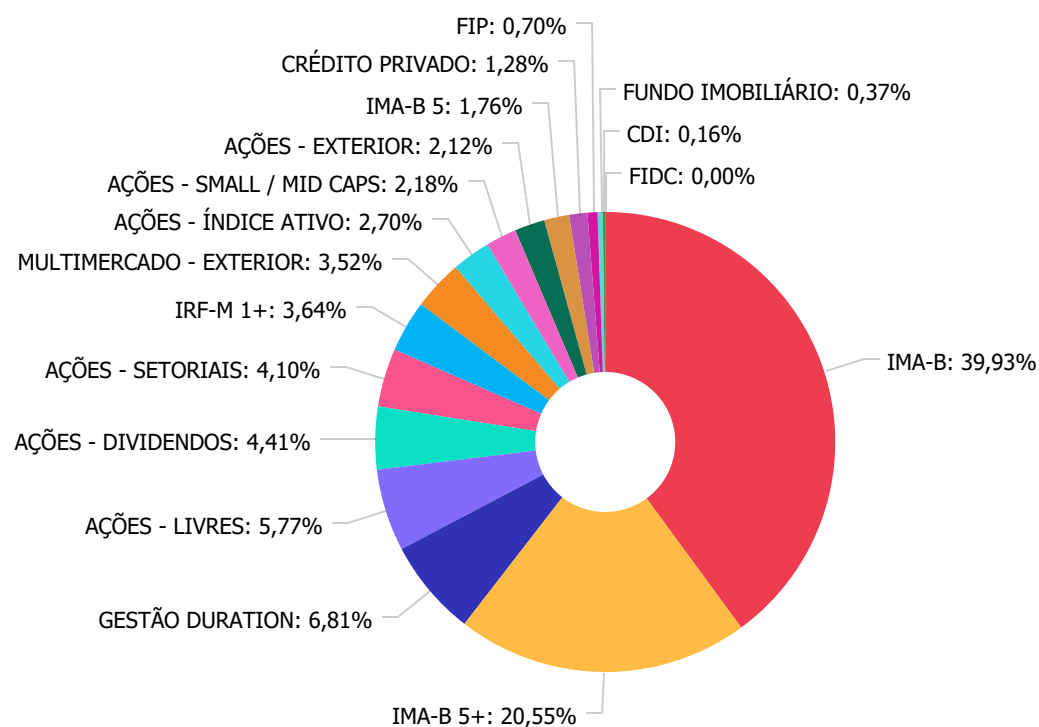
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>Global BDRX (Benchmark)</b>	-5,70%	0,39%	-1,13%	9,15%	27,61%	52,03%	-	-
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-0,85%	6,48%	4,79%	12,95%	35,58%	60,92%	0,14%	0,16%

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,29%	0,67%	1,05%	2,39%	5,57%	12,34%	-	-
SANTANDER GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCAD...	-0,39%	6,04%	3,72%	13,46%	25,66%	39,68%	0,11%	0,15%

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



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

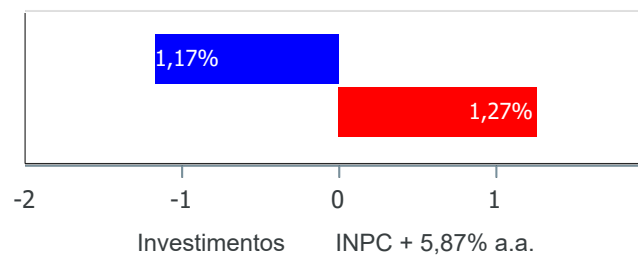


IMA-B	289.034.197,17
IMA-B 5+	148.732.408,49
GESTÃO DURATION	49.324.995,44
AÇÕES - LIVRES	41.753.469,64
AÇÕES - DIVIDENDOS	31.941.876,20
AÇÕES - SETORIAIS	29.645.354,00
IRF-M 1+	26.328.243,34
MULTIMERCADO - EXTERIOR	25.441.830,13
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	19.553.997,36
AÇÕES - SMALL / MID CAPS	15.749.138,51
AÇÕES - EXTERIOR	15.325.878,29
IMA-B 5	12.737.639,75
CRÉDITO PRIVADO	9.282.975,19
FIP	5.051.226,13
FUNDO IMOBILIÁRIO	2.699.222,99
CDI	1.176.166,92
FIDC	18.542,51

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

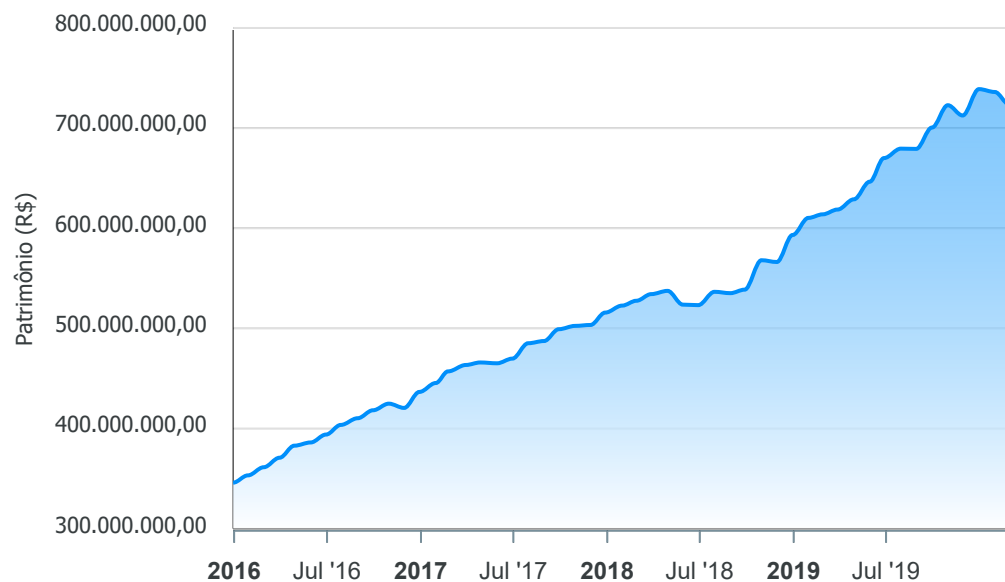
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	738.948.979,87	43.219.308,10	49.983.272,64	736.089.095,98	3.904.080,65	3.904.080,65	0,53%	0,53%	0,69%	0,69%	76,55%	3,62%
Fevereiro	736.089.095,98	8.085.665,26	7.963.323,56	723.797.162,06	-12.414.275,62	-8.510.194,97	-1,69%	-1,17%	0,58%	1,27%	-91,65%	5,75%

Investimentos x Meta Atuarial



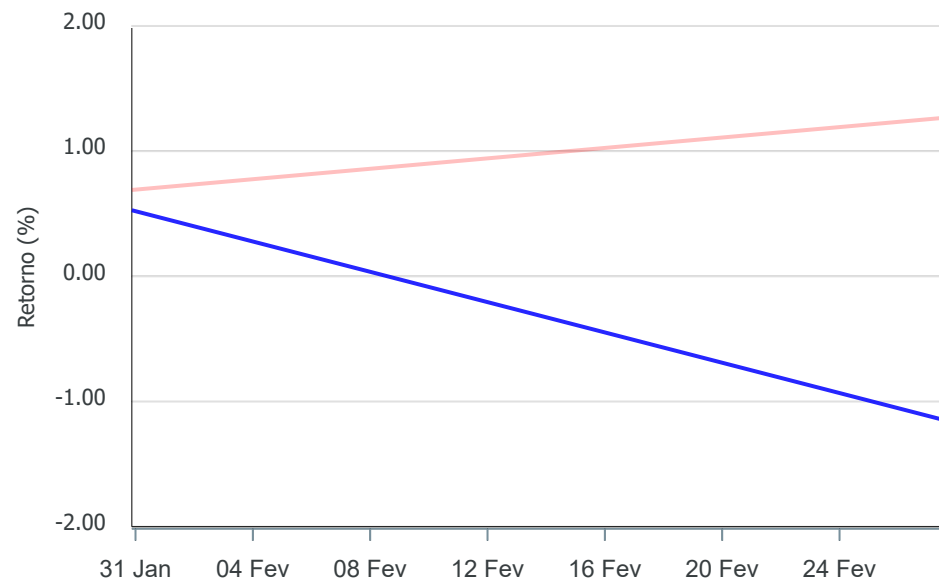
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO



- 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
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	12.608.367,97	0,00	0,00	12.737.639,75	129.271,78	1,03%	1,03%	1,55%
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	26.111.182,84	0,00	0,00	26.328.243,34	217.060,50	0,83%	0,83%	1,83%
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	21.143.539,68	0,00	0,00	21.315.473,63	171.933,95	0,81%	0,81%	3,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	49.022.479,08	0,00	0,00	49.324.995,44	302.516,36	0,62%	0,62%	0,91%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.949.571,42	0,00	173.888,45	6.817.200,28	41.517,31	0,60%	0,60%	0,85%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	129.649.065,35	0,00	0,00	130.241.390,51	592.325,16	0,46%	0,46%	2,51%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	130.091.812,65	0,00	0,00	130.660.132,75	568.320,10	0,44%	0,44%	2,42%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	9.253.618,36	0,00	0,00	9.282.975,19	29.356,83	0,32%	0,32%	0,94%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	42.780.216,29	0,00	0,00	42.905.775,13	125.558,84	0,29%	0,29%	3,75%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	105.519.155,87	0,00	0,00	105.826.633,36	307.477,49	0,29%	0,29%	3,75%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	868.641,14	8.085.665,26	7.789.435,11	1.176.166,92	11.295,63	0,13%	0,27%	0,02%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	18.759,17	0,00	0,00	18.400,79	-358,38	-1,91%	-1,91%	2,67%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	551,39	0,00	0,00	141,72	-409,67	-74,30%	-	-
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>534.016.961,21</b>	<b>8.085.665,26</b>	<b>7.963.323,56</b>	<b>536.635.168,81</b>	<b>2.495.865,90</b>	<b>0,47%</b>		<b>2,59%</b>

## 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
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	2.909.286,58	0,00	0,00	2.909.286,58	0,00	0,00%	-	-
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE F...	2.144.668,38	0,00	0,00	2.141.939,55	-2.728,83	-0,13%	-0,13%	0,00%
ÁQUILLA FII - AQLL11	1.086.062,14	0,00	0,00	1.084.524,14	-1.538,00	-0,14%	0,00%	0,00%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	1.628.958,11	0,00	0,00	1.614.698,85	-14.259,26	-0,88%	-0,88%	-
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	34.346.511,33	0,00	0,00	31.941.876,20	-2.404.635,13	-7,00%	-7,00%	12,16%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	20.101.476,97	0,00	0,00	18.593.218,17	-1.508.258,80	-7,50%	-7,50%	14,68%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	15.296.802,28	0,00	0,00	14.092.317,87	-1.204.484,41	-7,87%	-7,87%	17,86%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	14.966.731,05	0,00	0,00	13.726.665,97	-1.240.065,08	-8,29%	-8,29%	16,03%
BB MULTI SETORIAL QUANTITATIVO FIC AÇÕES	15.222.809,22	0,00	0,00	13.934.485,80	-1.288.323,42	-8,46%	-8,46%	17,25%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	17.230.902,73	0,00	0,00	15.749.138,51	-1.481.764,22	-8,60%	-8,60%	18,15%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	14.553.543,27	0,00	0,00	13.289.752,07	-1.263.791,20	-8,68%	-8,68%	15,80%
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	6.882.104,17	0,00	0,00	6.264.245,29	-617.858,88	-8,98%	-8,98%	16,32%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	25.885.395,70	0,00	0,00	23.284.356,46	-2.601.039,24	-10,05%	-10,05%	16,24%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	7.133.056,38	0,00	0,00	6.360.997,54	-772.058,84	-10,82%	-10,82%	17,73%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>179.388.308,31</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>164.987.503,00</b>	<b>-14.400.805,31</b>	<b>-8,03%</b>		<b>15,35%</b>

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
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	15.633.862,32	0,00	0,00	15.325.878,29	-307.984,03	-1,97%	-1,97%	13,72%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	7.049.964,14	0,00	0,00	6.848.611,96	-201.352,18	-2,86%	-2,83%	10,63%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>22.683.826,46</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>22.174.490,25</b>	<b>-509.336,21</b>	<b>-2,25%</b>		<b>12,77%</b>