

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
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	12.608.367,97	1,71%	100	2,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	130.091.812,65	17,67%	674	2,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	D+0	15/08/2024	6.949.571,42	0,94%	93	1,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	105.519.155,87	14,34%	359	4,65%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	49.022.479,08	6,66%	717	0,48%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	42.780.216,29	5,81%	52	12,60%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' '
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	129.649.065,35	17,61%	118	6,64%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' '
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	21.143.539,68	2,87%	16	6,64%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' '
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	26.111.182,84	3,55%	9.851	6,98%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	868.641,14	0,12%	651	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' '
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se ...	Não se aplica	18.759,17	0,00%		0,37%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a ' '
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	551,39	0,00%		0,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a ' '
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO...	D+30 ou...	Não há	9.253.618,36	1,26%	74	1,57%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b ' '
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+4	Não há	6.882.104,17	0,93%	41	0,70%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a ' '
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	D+4	Não há	14.553.543,27	1,98%	92	1,13%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a ' '
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	15.296.802,28	2,08%	32.965	1,47%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' '
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	D+4	Não há	25.885.395,70	3,52%	16.647	2,70%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' '
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	14.966.731,05	2,03%	11.903	1,43%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' '
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	17.230.902,73	2,34%	18.810	1,08%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' '
BB MULTI SETORIAL QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+3	Não há	15.222.809,22	2,07%	7.814	9,14%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' '

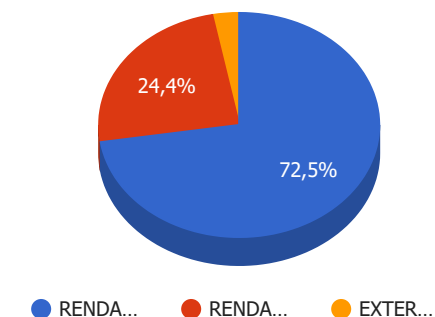
Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	34.346.511,33	4,67%	16.684	1,61%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	D+4	Não há	7.133.056,38	0,97%	28.315	1,00%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	20.101.476,97	2,73%	7.332	2,37%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	2.909.286,58	0,40%	33	1,09%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE...	Não se ...	Não se aplica	2.144.668,38	0,29%	105	0,61%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se ...	Não se aplica	1.086.062,14	0,15%		3,06%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	S/Info	Não se aplica	1.628.958,11	0,22%		2,78%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
SANTANDER GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERI...	D+8 du	Não há	7.049.964,14	0,96%	27	3,49%	Artigo 9º - A, Inciso II
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	15.633.862,32	2,12%	5.473	3,96%	Artigo 9º - A, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			736.089.095,98				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Janeiro / 2020)

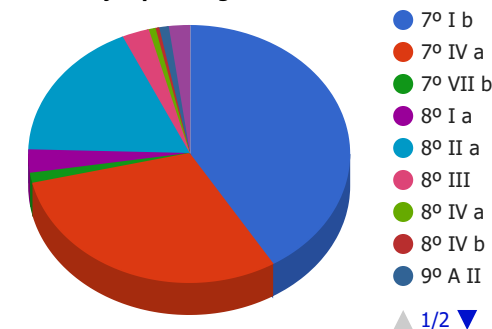
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	736.089.095,98
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	304.191.386,99	41,33%	10,00%	40,95%	100,00%	431.897.708,99
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	736.089.095,98
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	36.804.454,80
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	441.653.457,59
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	441.653.457,59
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	220.552.645,30	29,96%	0,00%	23,00%	40,00%	73.882.993,09
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	294.435.638,39
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	147.217.819,20
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	110.413.364,40
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	110.413.364,40
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	19.310,56	0,00%	0,00%	0,05%	5,00%	36.785.144,24
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	9.253.618,36	1,26%	0,00%	1,00%	5,00%	27.550.836,44
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	36.804.454,80
Total Renda Fixa	100,00%	534.016.961,21	72,55%	10,00%	65,00%	570,00%	

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%	21.435.647,44	2,91%	0,00%	4,00%	30,00%	199.391.081,35
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	220.826.728,79
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	130.082.208,69	17,67%	2,00%	20,00%	20,00%	17.135.610,51
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	147.217.819,20
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	20.101.476,97	2,73%	0,00%	4,00%	10,00%	53.507.432,63
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	5.053.954,96	0,69%	0,00%	1,00%	5,00%	31.750.499,84
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	2.715.020,25	0,37%	0,00%	1,00%	5,00%	34.089.434,55
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	36.804.454,80
Total Renda Variável	30,00%	179.388.308,31	24,37%	2,00%	30,00%	125,00%	

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%	73.608.909,60
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	7.049.964,14	0,96%	0,00%	2,00%	10,00%	66.558.945,46
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	15.633.862,32	2,12%	0,00%	3,00%	10,00%	57.975.047,28
Total Exterior	10,00%	22.683.826,46	3,08%	0,00%	5,00%	30,00%	

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
CDI + 3,50% ao ano (Benchmark)	0,68%	0,68%	2,01%	4,43%	9,50%	20,53%	-	-
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-3,47%	-3,47%	54,63%	-26,06%	285,17%	-84,57%	0,03%	5,56%
IRF-M 1+ (Benchmark)	1,11%	1,11%	0,99%	5,27%	13,57%	27,70%	-	-
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	1,26%	1,26%	0,75%	5,60%	15,87%	32,66%	0,01%	0,05%
IMA-B 5+ (Benchmark)	0,03%	0,03%	-1,54%	6,07%	22,33%	43,41%	-	-
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	-0,03%	-0,03%	-1,66%	5,90%	21,84%	42,45%	0,03%	0,10%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,04%	-0,04%	-1,75%	5,77%	21,74%	42,13%	0,03%	0,09%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,56%	0,56%	1,51%	5,04%	12,06%	23,36%	-	-
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	0,90%	0,90%	1,29%	5,76%	14,49%	28,70%	0,01%	0,04%
110% do CDI (Benchmark)	0,41%	0,41%	1,25%	2,87%	6,38%	13,87%	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	-37,34%	-37,34%	-64,25%	-77,97%	-89,55%	-96,82%	-	-
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%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	0,27%	0,27%	-0,33%	5,66%	17,92%	34,49%	0,02%	0,07%
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	0,55%	0,55%	-0,49%	6,18%	20,45%	39,96%	0,02%	0,08%

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 X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,53%	0,53%	1,43%	4,95%	12,36%	24,12%	0,01%	0,02%
CDI (Benchmark)	0,38%	0,38%	1,14%	2,60%	5,78%	12,53%	-	-
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%
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%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,82%	0,82%	0,91%	4,67%	14,10%	25,30%	0,01%	0,04%

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 + 10,50% ao ano (Benchmark)	1,09%	1,09%	4,45%	7,40%	15,18%	31,97%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	0,00%	0,00%
S&P 500 (Benchmark)	-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%
IBX-50 (Benchmark)	-1,88%	-1,88%	5,44%	10,57%	14,75%	29,92%	-	-
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	-1,61%	-1,61%	6,46%	11,64%	15,12%	27,89%	0,10%	0,09%
IMOB (Benchmark)	3,86%	3,86%	24,40%	31,08%	60,46%	82,57%	-	-
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	3,96%	3,96%	23,83%	30,50%	60,15%	80,11%	0,11%	0,23%
ICON (Benchmark)	3,66%	3,66%	15,32%	21,23%	43,29%	43,57%	-	-
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	3,38%	3,38%	15,59%	21,53%	42,76%	38,33%	0,10%	0,15%
IDIV (Benchmark)	-1,58%	-1,58%	10,79%	17,15%	27,01%	50,76%	-	-
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	0,62%	0,62%	8,68%	15,29%	27,77%	60,37%	0,07%	0,09%
Ibovespa (Benchmark)	-1,63%	-1,63%	6,10%	11,74%	16,80%	33,97%	-	-
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	-0,98%	-0,98%	8,18%	14,11%	19,51%	34,42%	0,10%	0,09%

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

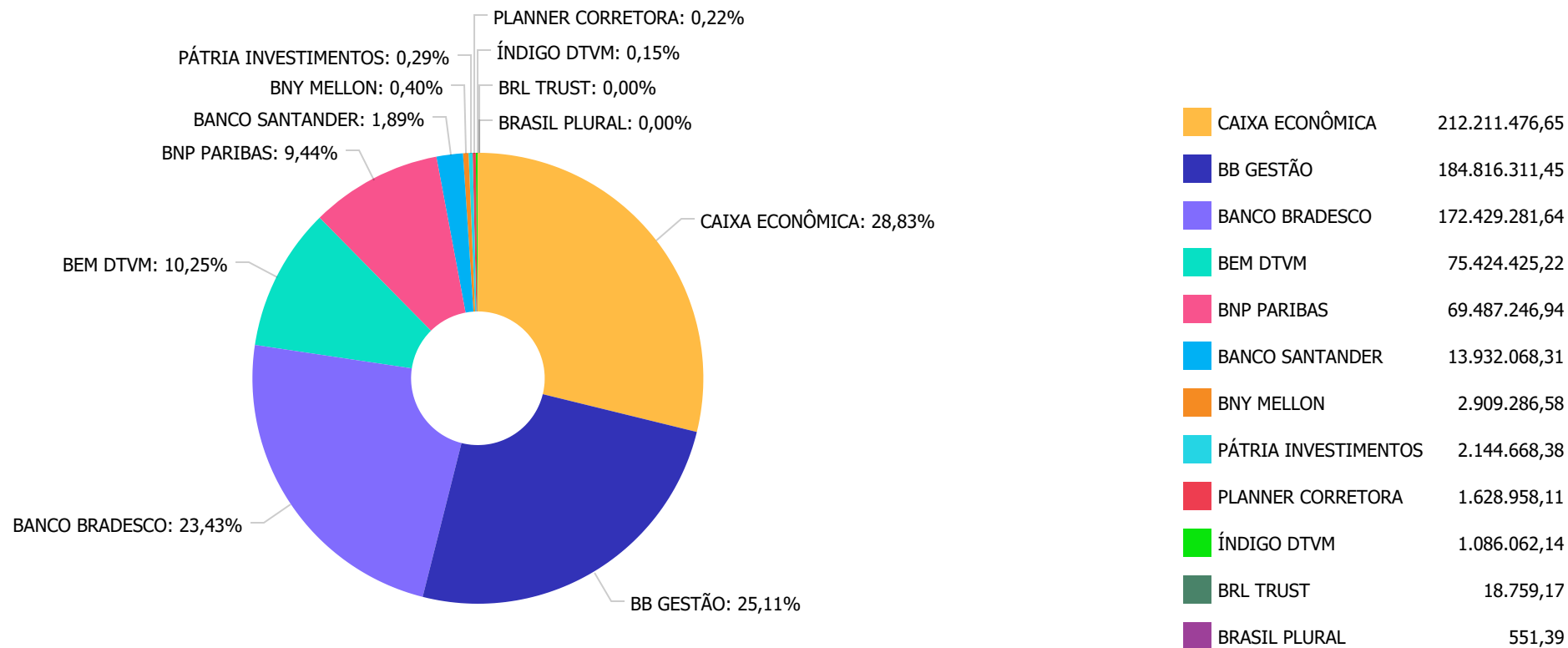
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	3,82%	3,82%	10,95%	16,92%	24,29%	47,97%	0,11%	0,09%
SMLL (Benchmark)	0,45%	0,45%	18,98%	24,82%	45,25%	64,69%	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	0,50%	0,50%	18,51%	24,23%	41,26%	56,18%	0,09%	0,14%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	0,28%	0,28%	-7,43%	-24,79%	-19,77%	-15,05%	0,00%	0,26%
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	-	-	-	-	-	-	0,00%	0,38%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	1,31%	1,31%	-18,36%	108,71%	108,71%	108,71%	-	-
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	1,08%	1,08%	15,16%	26,80%	36,07%	58,54%	0,12%	0,11%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BB MULTI SETORIAL QUANTITATIVO FIC AÇÕES	2,47%	2,47%	13,28%	17,89%	29,13%	48,09%	0,10%	0,11%

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

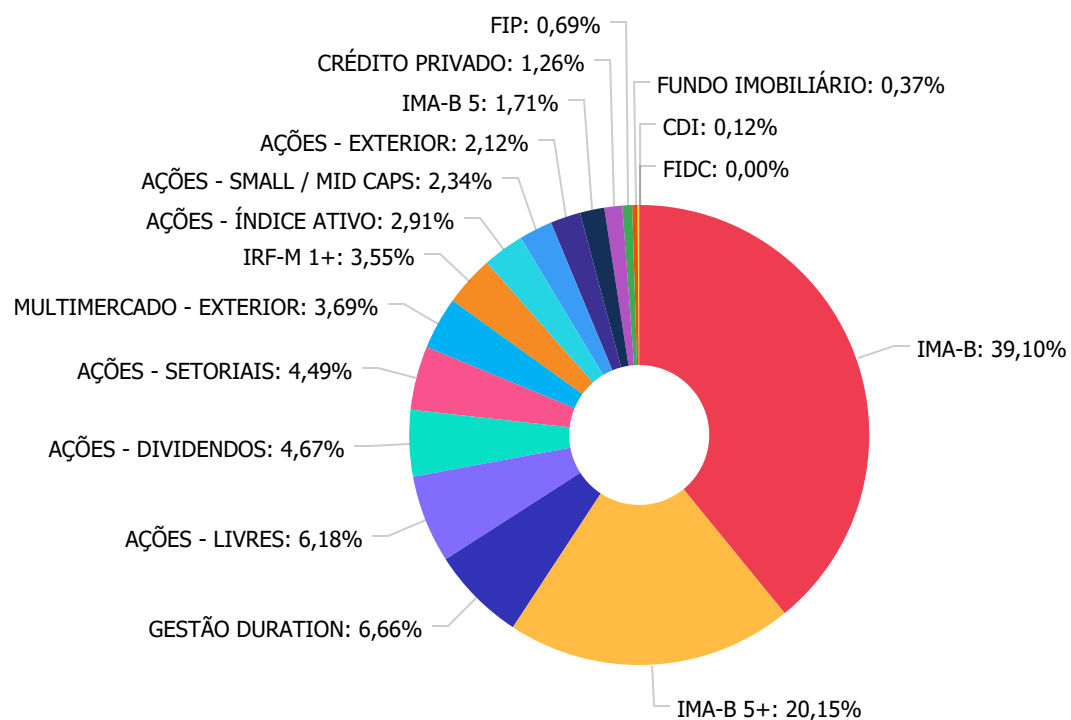
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	6,47%	6,47%	14,32%	22,76%	43,40%	59,20%	-	-
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	7,39%	7,39%	14,86%	21,68%	43,86%	57,71%	0,06%	0,15%

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,38%	0,38%	1,14%	2,60%	5,78%	12,53%	-	-
SANTANDER GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCAD...	6,46%	6,46%	12,06%	21,29%	32,89%	37,89%	0,05%	-

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



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

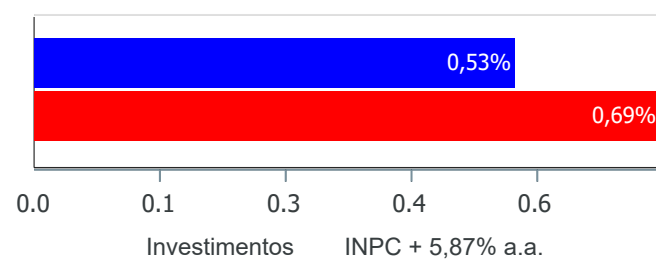


IMA-B	287.833.989,10
IMA-B 5+	148.299.372,16
GESTÃO DURATION	49.022.479,08
AÇÕES - LIVRES	45.486.342,55
AÇÕES - DIVIDENDOS	34.346.511,33
AÇÕES - SETORIAIS	33.018.452,08
MULTIMERCADO - EXTERIOR	27.151.441,11
IRF-M 1+	26.111.182,84
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	21.435.647,44
AÇÕES - SMALL / MID CAPS	17.230.902,73
AÇÕES - EXTERIOR	15.633.862,32
IMA-B 5	12.608.367,97
CRÉDITO PRIVADO	9.253.618,36
FIP	5.053.954,96
FUNDO IMOBILIÁRIO	2.715.020,25
CDI	868.641,14
FIDC	19.310,56

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

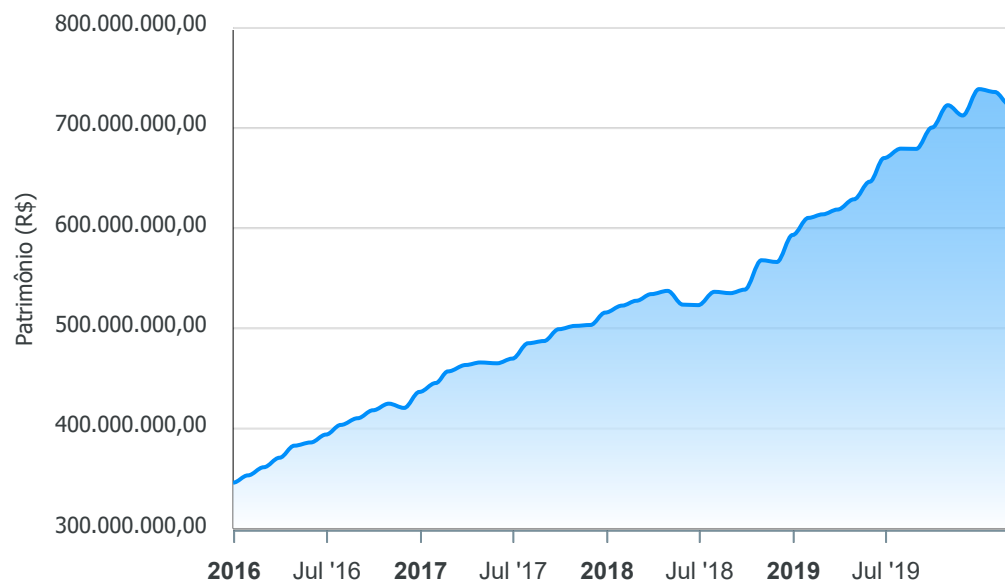
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	738.948.979,87	43.219.308,10	49.983.272,64	736.089.095,98	3.904.080,65	3.904.080,65	0,53%	0,53%	0,69%	0,69%	76,55%	3,62%

Investimentos x Meta Atuarial



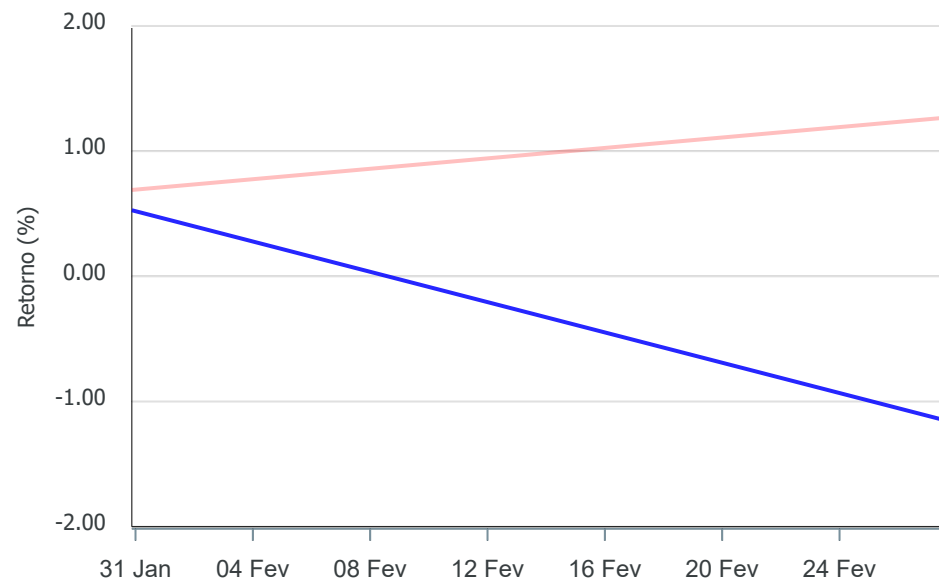
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	25.786.886,57	0,00	0,00	26.111.182,84	324.296,27	1,26%	1,26%	1,23%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	33.320.279,41	0,00	21.000.000,00	12.608.367,97	288.088,56	0,86%	0,90%	1,07%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	9.177.130,83	0,00	0,00	9.253.618,36	76.487,53	0,83%	0,83%	0,67%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	54.584.691,50	0,00	6.000.000,00	49.022.479,08	437.787,58	0,80%	0,82%	0,64%
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	21.027.462,70	0,00	0,00	21.143.539,68	116.076,98	0,55%	0,55%	2,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.912.924,96	0,00	0,00	6.949.571,42	36.646,46	0,53%	0,53%	0,64%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	1.870.424,87	238.391,65	1.246.018,81	868.641,14	5.843,43	0,28%	0,35%	0,01%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	129.293.716,22	0,00	0,00	129.649.065,35	355.349,13	0,27%	0,27%	1,70%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	129.754.467,11	0,00	0,00	130.091.812,65	337.345,54	0,26%	0,26%	1,65%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	42.794.870,80	0,00	0,00	42.780.216,29	-14.654,51	-0,03%	-0,03%	2,62%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	105.559.847,34	0,00	0,00	105.519.155,87	-40.691,47	-0,04%	-0,04%	2,62%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	19.433,76	0,00	0,00	18.759,17	-674,59	-3,47%	-3,47%	2,87%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	879,98	0,00	0,00	551,39	-328,59	-37,34%	-	-
Total Renda Fixa	560.103.016,05	238.391,65	28.246.018,81	534.016.961,21	1.921.572,32	0,34%		1,79%

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
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	14.416.350,52	0,00	0,00	14.966.731,05	550.380,53	3,82%	3,82%	10,56%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	25.038.338,74	0,00	0,00	25.885.395,70	847.056,96	3,38%	3,38%	10,01%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	34.134.539,88	0,00	0,00	34.346.511,33	211.971,45	0,62%	0,62%	7,23%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	1.619.954,59	0,00	0,00	1.628.958,11	9.003,52	0,56%	0,56%	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	17.144.834,59	0,00	0,00	17.230.902,73	86.068,14	0,50%	0,50%	9,31%
BB MULTI SETORIAL QUANTITATIVO FIC AÇÕES	7.903.932,61	7.245.751,28	0,00	15.222.809,22	73.125,33	0,48%	2,47%	10,26%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	2.910.216,86	0,00	0,00	2.909.286,58	-930,28	-0,03%	-0,03%	0,01%
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE F...	2.147.964,57	0,00	0,00	2.144.668,38	-3.296,19	-0,15%	-0,15%	0,00%
ÁQUILLA FII - AQLL11	1.087.907,00	0,00	0,00	1.086.062,14	-1.844,86	-0,17%	0,28%	0,46%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	7.842.787,67	7.489.413,90	0,00	15.296.802,28	-35.399,29	-0,23%	1,08%	11,57%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	13.166.404,34	7.000.000,00	0,00	20.101.476,97	-64.927,37	-0,32%	0,37%	6,04%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	0,00	7.245.751,27	0,00	7.133.056,38	-112.694,89	-1,56%	3,96%	10,78%
BRANCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	22.082.480,61	0,00	21.737.253,83	0,00	-345.226,78	-1,56%	-2,72%	9,11%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	14.791.807,74	0,00	0,00	14.553.543,27	-238.264,47	-1,61%	-1,61%	10,04%
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	0,00	7.000.000,00	0,00	6.882.104,17	-117.895,83	-1,68%	-0,98%	10,26%
Total Renda Variável	164.287.519,72	35.980.916,45	21.737.253,83	179.388.308,31	857.125,97	0,48%		8,86%

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
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	14.558.444,10	0,00	0,00	15.633.862,32	1.075.418,22	7,39%	7,39%	5,95%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	0,00	7.000.000,00	0,00	7.049.964,14	49.964,14	0,71%	6,46%	5,43%
Total Renda Variável	14.558.444,10	7.000.000,00	0,00	22.683.826,46	1.125.382,36	5,22%		5,79%