

Relatório Analítico dos Investimentos em fevereiro 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 (Fevereiro / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	8.605.032,71	3,93%	1.214	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2024	8.004.433,07	3,66%	104	1,78%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	8.200.748,77	3,75%	941	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	13.160.574,86	6,02%	593	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	14.124.938,86	6,46%	968	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	16.081.080,05	7,35%	922	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+0	15/08/2022	4.306.881,02	1,97%	95	0,87%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	5.779.609,32	2,64%	622	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	15/08/2022	389.327,08	0,18%	165	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	8.533.487,03	3,90%	888	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	44.097.017,57	20,16%	731	0,41%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	2.661.356,48	1,22%	707	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	2.197.106,77	1,00%	429	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.417.810,59	1,11%	740	0,18%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRANCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	258.810,33	0,12%	291	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.461.033,90	1,58%	100	0,39%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	1.879.801,52	0,86%	283	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	17.577.812,17	8,04%	61	1,22%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	5.280.943,92	2,41%	172	0,43%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	2.300.526,98	1,05%	1.949	0,73%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '

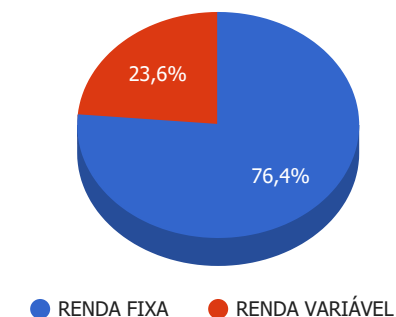
Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	2.287.340,66	1,05%	6.682	0,12%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' '
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	3.141.174,03	1,44%	1.560	0,39%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' '
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	7.067.088,23	3,23%	210	0,83%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' '
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	14.179.970,90	6,48%	20.282	0,92%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' '
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	2.309.857,31	1,06%	13.394	0,23%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' '
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	4.934.979,64	2,26%	57.633	0,12%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' '
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	4.030.934,28	1,84%	8.531	0,49%	Artigo 8º, Inciso III
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	D+2	Não há	1.071.669,53	0,49%	44	0,27%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	8.318.337,18	3,80%	25.577	0,14%	Artigo 8º, Inciso III
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII ...	Não se ...	Não se aplica	2.039.999,15	0,93%		0,98%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b ' '
Total para cálculo dos limites da Resolução			218.699.683,91				

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 ' b '	100,00%	136.141.593,59	62,25%	15,00%	30,00%	90,00%	60.688.121,93
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	131.219.810,35
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	30.876.212,43	14,12%	10,00%	30,00%	40,00%	56.603.661,13
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	32.804.952,59
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	10.934.984,20
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	10.934.984,20
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	10.934.984,20
Total Renda Fixa	100,00%	167.017.806,02	76,37%	25,00%	70,00%	220,00%	

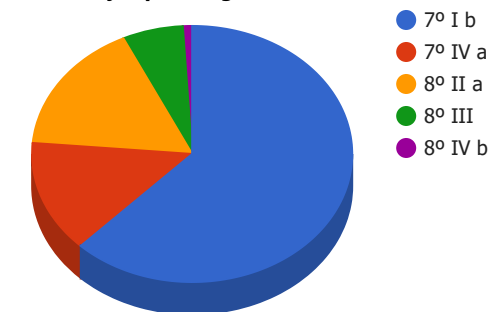
Distribuição por Segmento



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 II, Alínea ' a '	20,00%	36.220.937,75	16,56%	7,00%	10,00%	20,00%	7.518.999,03
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	13.420.940,99	6,14%	7,00%	10,00%	10,00%	8.449.027,40
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	10.934.984,20
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	2.039.999,15	0,93%	0,00%	5,00%	5,00%	8.894.985,05
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	10.934.984,20
Total Renda Variável	30,00%	51.681.877,89	23,63%	14,00%	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%	21.869.968,39
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	

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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	132.781.445,34	60,71	0,03
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	48.995.253,12	22,40	0,00
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	12.606.842,48	5,76	0,00
ITAÚ UNIBANCO	6.814.781,16	3,12	0,00
WESTERN ASSET	4.030.934,28	1,84	0,01
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	3.461.033,90	1,58	0,00
AZ QUEST INVESTIMENTOS	2.309.857,31	1,06	0,01
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	2.300.526,98	1,05	0,00
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	2.287.340,66	1,05	0,00
ZION INVEST	2.039.999,15	0,93	0,42
SAFRA ASSET MANAGEMENT	1.071.669,53	0,49	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 '	136.141.593,59	62,25	15,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30.876.212,43	14,12	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 '	36.220.937,75	16,56	7,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	13.420.940,99	6,14	7,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	2.039.999,15	0,93	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 Fevereiro/2020 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA Geral ex-C (Benchmark)	0,44%	0,95%	1,87%	4,36%	11,07%	21,89%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,46%	0,94%	1,91%	4,31%	11,46%	22,39%	0,01%	0,03%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,69%	1,22%	2,44%	5,37%	11,19%	22,52%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,63%	1,02%	2,18%	5,12%	10,31%	20,84%	0,01%	0,01%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,60%	1,06%	2,17%	4,96%	10,35%	20,98%	0,01%	0,02%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,38%	0,82%	1,25%	2,87%	6,52%	13,85%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,35%	0,77%	1,17%	2,72%	6,24%	13,31%	0,00%	0,00%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,64%	1,20%	2,45%	5,66%	12,17%	23,49%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,63%	1,18%	2,40%	5,51%	11,87%	22,95%	0,01%	0,02%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,65%	1,21%	2,42%	5,56%	11,96%	23,02%	0,01%	0,02%
IMA-B (Benchmark)	0,45%	0,71%	2,73%	6,54%	18,00%	34,65%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,44%	0,69%	2,69%	6,35%	17,63%	34,00%	0,02%	0,06%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,66%	-0,87%	0,60%	4,23%	10,63%	16,32%	0,05%	0,06%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,41%	0,61%	1,53%	4,15%	9,09%	20,06%	0,00%	0,01%
IRF-M (Benchmark)	0,65%	1,53%	2,17%	4,91%	11,86%	22,99%	-	-

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 IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,63%	1,49%	2,11%	4,80%	11,62%	22,46%	0,01%	0,03%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,63%	1,48%	2,09%	4,79%	11,51%	22,34%	0,01%	0,03%
Selic (Benchmark)	0,29%	0,67%	1,05%	2,39%	5,57%	12,34%	-	-
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,25%	0,62%	0,99%	2,26%	5,41%	12,03%	0,00%	0,00%
CDI (Benchmark)	0,29%	0,67%	1,05%	2,39%	5,57%	12,34%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,22%	0,50%	0,79%	1,85%	4,45%	9,95%	0,00%	0,00%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,32%	0,72%	1,10%	2,36%	5,55%	12,16%	0,00%	0,00%
IPCA (Benchmark)	0,25%	0,46%	1,62%	2,20%	4,00%	8,05%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,73%	1,37%	2,57%	5,75%	12,96%	25,03%	0,01%	0,02%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,26%	0,60%	0,95%	2,60%	9,60%	19,17%	0,00%	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,62%	1,44%	2,04%	5,45%	14,23%	25,27%	0,01%	0,04%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,27%	0,61%	1,01%	4,81%	11,66%	17,39%	0,00%	0,03%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,39%	0,82%	1,67%	4,16%	10,71%	21,41%	0,01%	0,03%

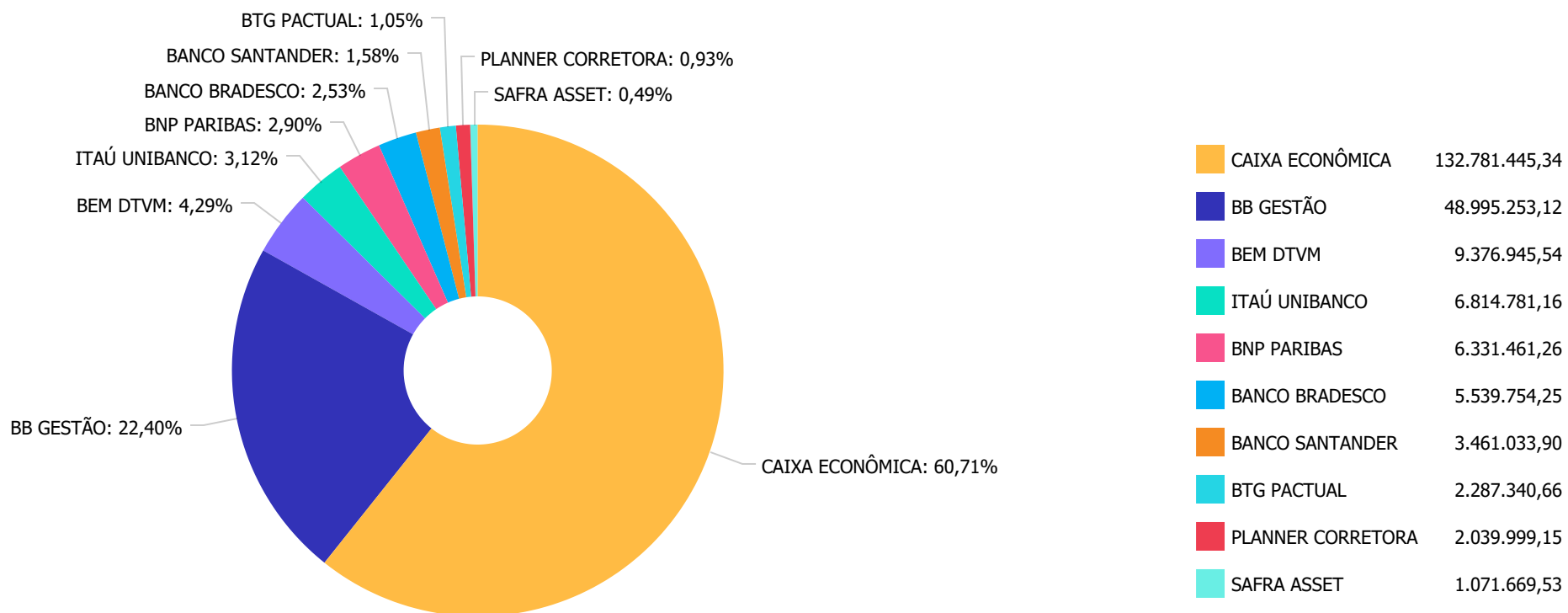
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
S&P 500 (Benchmark)	-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%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	-7,44%	-7,10%	-4,66%	3,24%	10,24%	17,08%	0,15%	0,15%
Ibovespa (Benchmark)	-8,43%	-9,92%	-3,75%	3,00%	8,98%	22,05%	-	-
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-7,13%	-5,24%	1,57%	5,51%	24,91%	47,72%	0,15%	0,13%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	-8,29%	-4,78%	2,39%	6,09%	16,76%	33,08%	0,16%	0,13%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	-6,90%	-7,62%	-1,43%	7,19%	15,32%	33,37%	0,14%	0,13%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-8,96%	-10,27%	-2,37%	3,90%	13,67%	34,53%	0,15%	0,14%
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	-11,06%	-12,20%	-5,89%	-3,70%	6,90%	22,97%	0,17%	0,15%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-9,79%	-9,96%	-2,64%	5,05%	20,11%	42,38%	0,15%	0,16%
SMLL (Benchmark)	-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%
CDI (Benchmark)	0,29%	0,67%	1,05%	2,39%	5,57%	12,34%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	-1,51%	-0,84%	1,24%	4,45%	12,95%	25,31%	0,03%	0,03%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	3,48%	-7,75%	13,33%	-23,72%	-30,00%	-41,95%	0,12%	0,46%

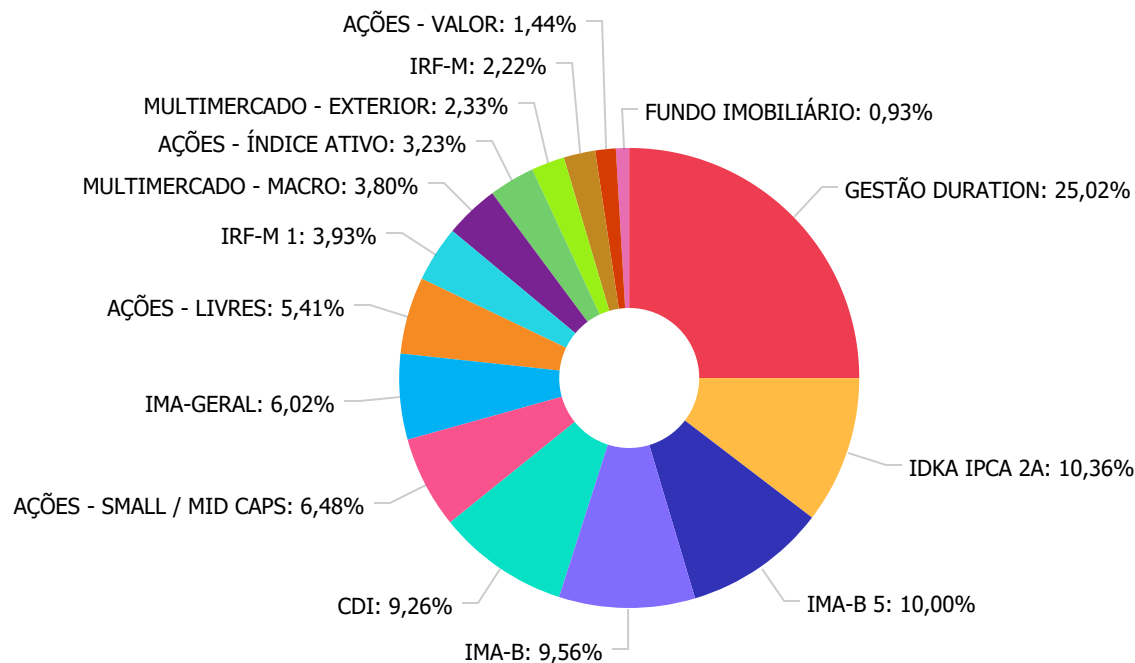
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2020 - RENDA VARIÁVEL

Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
-----	-----	----	----	-----	-----	---------	------------------

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



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

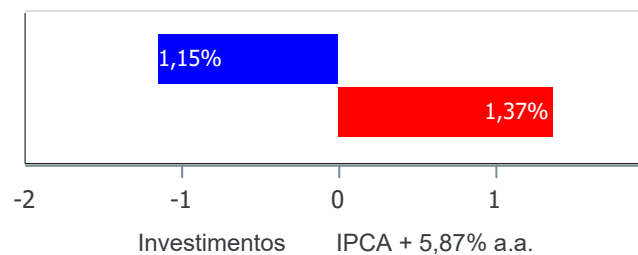


GESTÃO DURATION	54.718.796,91
IDKA IPCA 2A	22.658.425,89
IMA-B 5	21.860.689,37
IMA-B	20.901.389,94
CDI	20.254.433,09
AÇÕES - SMALL / MID CAPS	14.179.970,90
IMA-GERAL	13.160.574,86
AÇÕES - LIVRES	11.832.704,59
IRF-M 1	8.605.032,71
MULTIMERCADO - MACRO	8.318.337,18
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	7.067.088,23
MULTIMERCADO - EXTERIOR	5.102.603,81
IRF-M	4.858.463,25
AÇÕES - VALOR	3.141.174,03
FUNDO IMOBILIÁRIO	2.039.999,15

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

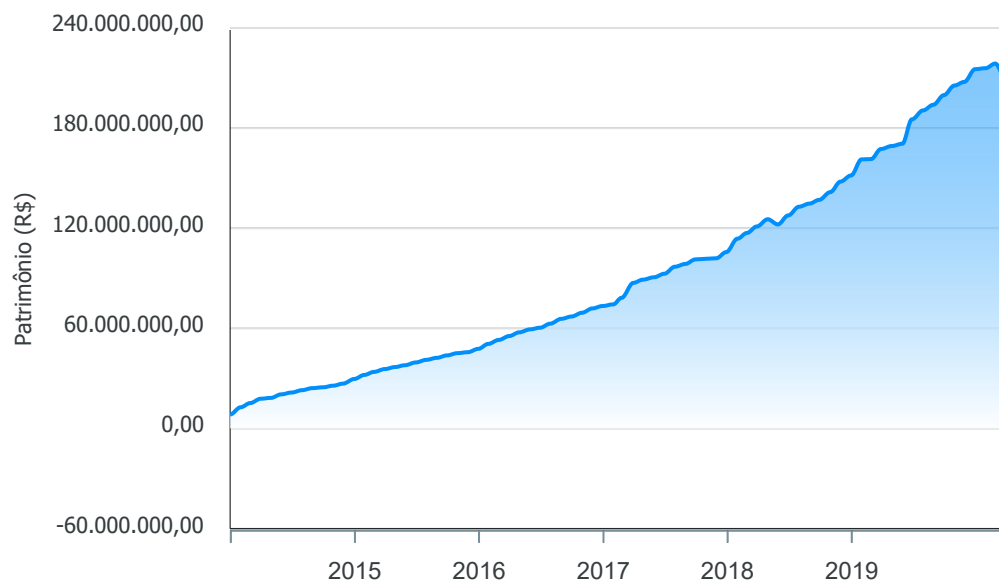
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	215.323.630,36	11.203.932,19	11.215.351,57	215.920.428,04	608.217,06	608.217,06	0,28%	0,28%	0,71%	0,71%	39,77%	2,41%
Fevereiro	215.920.428,04	9.956.730,84	4.002.545,34	218.699.683,91	-3.174.929,63	-2.566.712,57	-1,43%	-1,15%	0,66%	1,37%	-83,87%	4,08%

Investimentos x Meta Atuarial



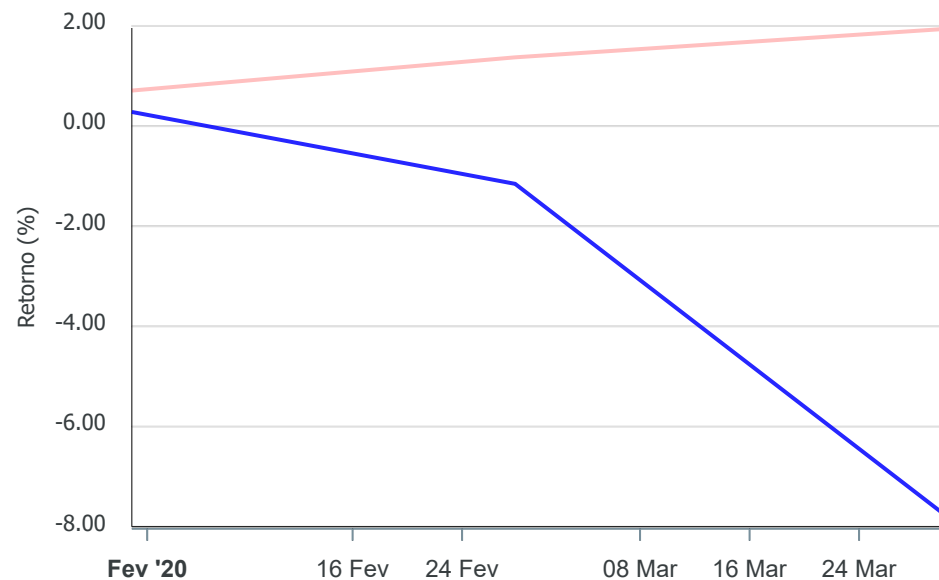
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Fevereiro/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENC...	4.385.708,49	0,00	110.537,30	4.306.881,02	31.709,83	0,72%	0,73%	0,83%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.139.600,76	0,00	192.187,35	8.004.433,07	57.019,66	0,70%	-1,66%	4,70%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	5.742.247,03	0,00	0,00	5.779.609,32	37.362,29	0,65%	0,65%	0,85%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.644.621,58	0,00	0,00	2.661.356,48	16.734,90	0,63%	0,63%	0,92%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	2.183.298,88	0,00	0,00	2.197.106,77	13.807,89	0,63%	0,63%	0,91%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	15.980.476,31	0,00	0,00	16.081.080,05	100.603,74	0,63%	0,63%	0,86%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	8.480.216,95	0,00	0,00	8.533.487,03	53.270,08	0,63%	0,63%	0,67%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	43.826.565,06	0,00	0,00	44.097.017,57	270.452,51	0,62%	0,62%	0,91%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	14.040.491,49	0,00	0,00	14.124.938,86	84.447,37	0,60%	0,60%	0,69%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.100.836,12	0,00	0,00	13.160.574,86	59.738,74	0,46%	0,46%	1,08%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	8.164.911,18	0,00	0,00	8.200.748,77	35.837,59	0,44%	0,44%	2,42%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	398.156,42	0,00	10.462,01	389.327,08	1.632,67	0,41%	0,41%	0,39%
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	5.260.426,69	0,00	0,00	5.280.943,92	20.517,23	0,39%	0,39%	1,04%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	8.574.768,85	0,00	0,00	8.605.032,71	30.263,86	0,35%	0,35%	0,07%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	14.551.419,80	6.411.782,52	3.444.330,00	17.577.812,17	58.939,85	0,28%	0,32%	0,04%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	3.451.853,27	0,00	0,00	3.461.033,90	9.180,63	0,27%	0,27%	0,13%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	1.874.971,08	0,00	0,00	1.879.801,52	4.830,44	0,26%	0,26%	0,01%
BRANCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	258.167,48	0,00	0,00	258.810,33	642,85	0,25%	0,25%	0,02%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.613.774,31	1.044.948,32	245.028,68	2.417.810,59	4.116,64	0,15%	0,22%	0,01%
Total Renda Fixa	162.672.511,75	7.456.730,84	4.002.545,34	167.017.806,02	891.108,77	0,54%		0,97%

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
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	1.971.427,75	0,00	0,00	2.039.999,15	68.571,40	3,48%	3,48%	12,26%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	8.445.816,49	0,00	0,00	8.318.337,18	-127.479,31	-1,51%	-1,51%	3,40%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	2.471.068,40	0,00	0,00	2.300.526,98	-170.541,42	-6,90%	-6,90%	14,08%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.462.923,19	0,00	0,00	2.287.340,66	-175.582,53	-7,13%	-7,13%	15,15%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	1.157.853,97	0,00	0,00	1.071.669,53	-86.184,44	-7,44%	-7,44%	14,55%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	4.357.918,67	0,00	0,00	4.030.934,28	-326.984,39	-7,50%	-7,50%	14,68%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	0,00	2.500.000,00	0,00	2.309.857,31	-190.142,69	-7,61%	-8,29%	16,03%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	15.514.099,34	0,00	0,00	14.179.970,90	-1.334.128,44	-8,60%	-8,60%	18,15%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	3.450.426,30	0,00	0,00	3.141.174,03	-309.252,27	-8,96%	-8,96%	15,23%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	5.470.698,48	0,00	0,00	4.934.979,64	-535.718,84	-9,79%	-9,79%	14,94%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	7.945.683,70	0,00	0,00	7.067.088,23	-878.595,47	-11,06%	-11,06%	16,86%
Total Renda Variável	53.247.916,29	2.500.000,00	0,00	51.681.877,89	-4.066.038,40	-7,29%		14,13%