

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
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	8.244.030,86	18,68%	717	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	1.520.433,89	3,44%	615	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	1.034.871,93	2,34%	583	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	2.040.316,21	4,62%	969	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	3.139.513,17	7,11%	1.213	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	4.584.573,01	10,39%	888	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	5.146.211,55	11,66%	737	0,34%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	1.099.720,55	2,49%	288	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	616.589,32	1,40%	651	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
UM INVEST IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	1.165.905,61	2,64%	6	3,19%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	D+1471	Não há	607.596,87	1,38%	26	0,72%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	2.011.656,58	4,56%	31	0,50%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	D+1009	Não há	1.439.410,29	3,26%	28	1,98%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se ...	Não se aplica	22.049,44	0,05%	98	0,03%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	105.397,51	0,24%	70	0,14%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	2.022.205,50	4,58%	33	1,05%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "
META VALOR FI AÇÕES	D+4	Não há	3.019.413,08	6,84%	137	1,31%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	908.891,00	2,06%	2.698	0,28%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
FRANKLIN TEMPLETON VALOR E FVL FI AÇÕES	D+4	Não há	948.689,85	2,15%	6.267	0,20%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	2.288.166,48	5,18%	9.049	0,37%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "

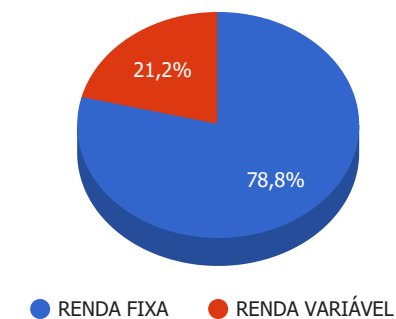
Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	1.218.028,25	2,76%	26.307	0,02%	Artigo 8º, Inciso III
OSASCO PROPERTIES FII	Não se ...	Não se aplica	952.940,57	2,16%		0,23%	Desenquadrado - RV
Total para cálculo dos limites da Resolução			44.136.611,52				

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%	20.563.739,07	46,59%	20,00%	30,00%	90,00%	19.159.211,30
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	26.481.966,91
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	12.087.090,77	27,39%	10,00%	30,00%	40,00%	5.567.553,84
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	6.620.491,73
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	2.149.652,45	4,87%	0,00%	0,00%	5,00%	57.178,13
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.206.830,58
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.206.830,58
Total Renda Fixa	100,00%	34.800.482,29	78,85%	30,00%	70,00%	220,00%	

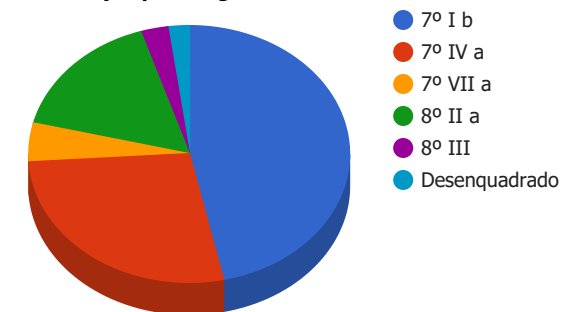
Distribuição por Segmento



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 II, Alínea " a "	20,00%	7.165.160,41	16,23%	7,00%	15,00%	20,00%	1.662.161,89
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	1.218.028,25	2,76%	7,00%	10,00%	10,00%	3.195.632,90
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	2.206.830,58
Desenquadrado - RV	0,00%	952.940,57	2,16%	0,00%	0,00%	0,00%	-952.940,57
Total Renda Variável	30,00%	9.336.129,23	21,15%	14,00%	30,00%	35,00%	

Distribuição por Artigos



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	16.042.192,87	36,35	0,00
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	11.502.375,32	26,06	0,00
META ASSET MANAGEMENT	3.019.413,08	6,84	-
RJI CORRETORA DE VALORES	2.619.253,45	5,93	0,42
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	2.288.166,48	5,18	0,18
AURORA CAPITAL	2.022.205,50	4,58	2,74
GRAPHEN INVESTIMENTOS LTDA	1.544.807,80	3,50	1,56
UM ASSET	1.165.905,61	2,64	0,15
ITAÚ UNIBANCO	1.099.720,55	2,49	0,00
CADENCE GESTORA	952.940,57	2,16	-
FRANKLIN TEMPLETON INVESTIMENT...	948.689,85	2,15	0,02
PERFIN INVESTIMENTOS	908.891,00	2,06	0,01
PETRA CAPITAL	22.049,44	0,05	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 " b "	20.563.739,07	46,59	20,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	12.087.090,77	27,39	10,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	2.149.652,45	4,87	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 "	7.165.160,41	16,23	7,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	1.218.028,25	2,76	7,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00	0,00	5,00
Desenquadrado - RV	952.940,57	2,16	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
IMA Geral ex-C (Benchmark)	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%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	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%
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%
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	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%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	-5,11%	-5,11%	-4,98%	-9,06%	-13,16%	-27,14%	0,11%	0,09%
IRF-M 1 (Benchmark)	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%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,56%	0,56%	1,51%	5,04%	12,06%	23,36%	-	-
UM INVEST IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,69%	0,69%	1,07%	4,85%	11,38%	18,91%	0,01%	0,03%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,34%	0,34%	1,74%	2,94%	5,09%	-15,07%	0,01%	0,05%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	0,03%	0,03%	-0,53%	1,27%	2,61%	-8,60%	0,01%	0,04%
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%

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
IMA-B (Benchmark)	0,26%	0,26%	-0,24%	5,64%	18,11%	34,79%	-	-
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	0,24%	0,24%	-0,29%	2,54%	8,67%	-	0,01%	0,03%
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%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,29%	0,29%	0,87%	2,05%	4,65%	10,14%	0,00%	0,00%
IPCA (Benchmark)	0,21%	0,21%	1,88%	2,05%	4,19%	8,13%	-	-
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%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,34%	0,34%	1,04%	2,66%	9,69%	19,74%	0,00%	0,02%

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

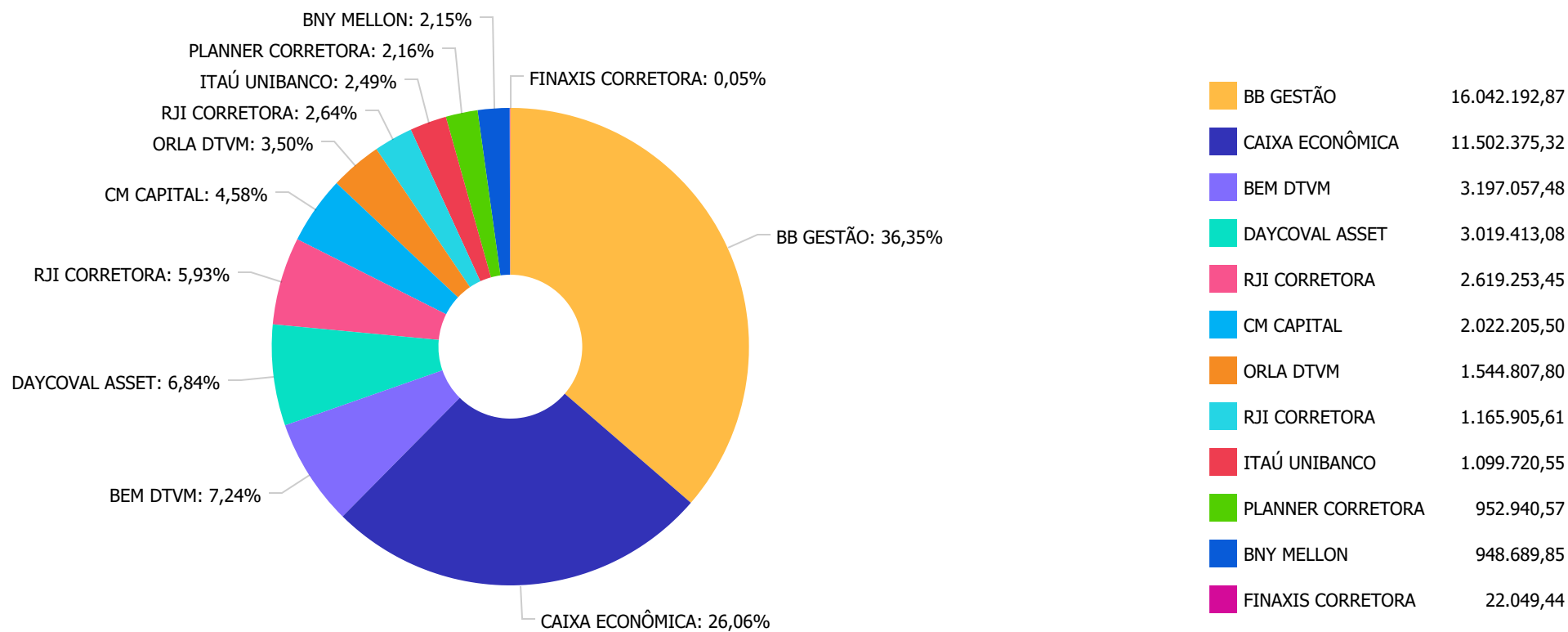
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IBX (Benchmark)	-1,25%	-1,25%	6,95%	12,64%	18,97%	37,28%	-	-
META VALOR FI AÇÕES	2,97%	2,97%	20,15%	21,61%	26,94%	52,80%	0,12%	0,15%

Ibovespa (Benchmark)	-1,63%	-1,63%	6,10%	11,74%	16,80%	33,97%	-	-
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2,12%	2,12%	13,99%	20,79%	32,59%	52,15%	0,07%	0,09%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	1,72%	1,72%	18,50%	23,43%	37,26%	76,86%	0,08%	0,13%

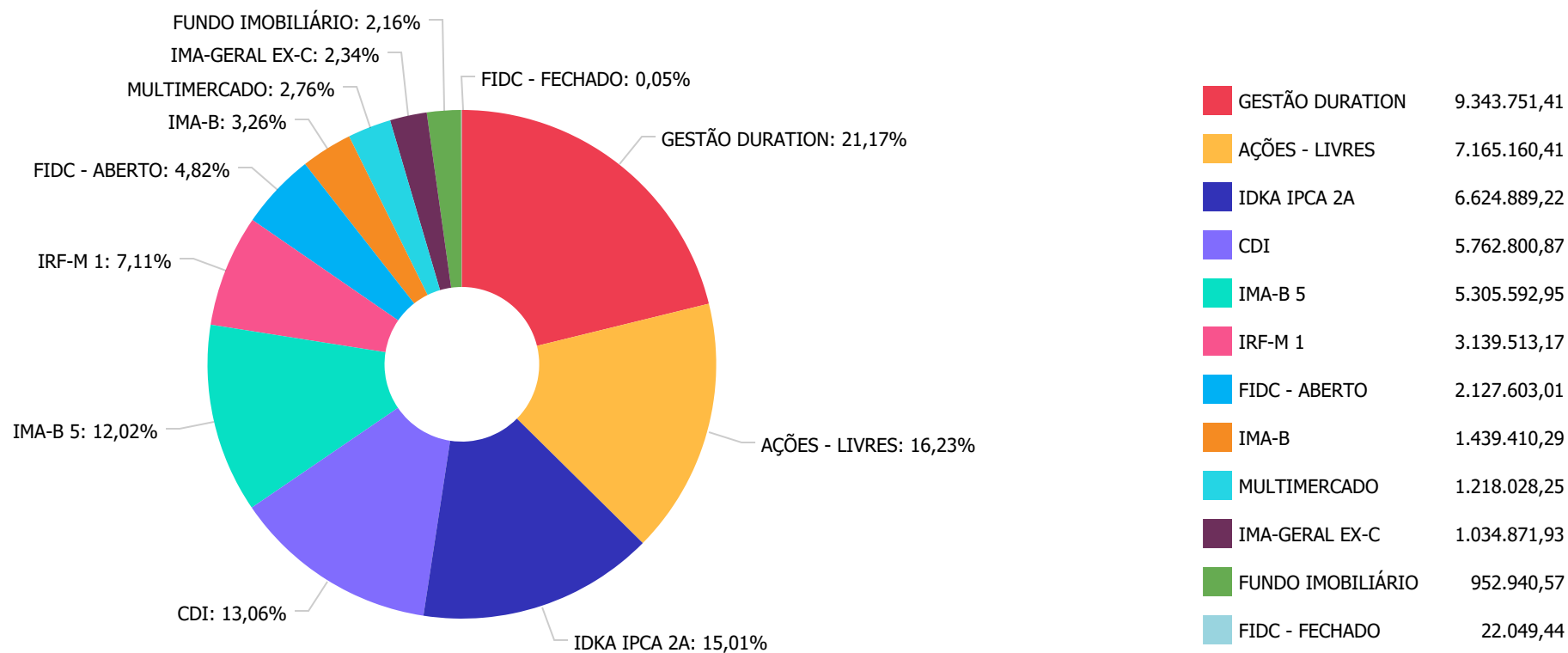
CDI (Benchmark)	0,38%	0,38%	1,14%	2,60%	5,78%	12,53%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,68%	0,68%	3,58%	6,70%	14,67%	28,07%	0,02%	0,02%

Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
OSASCO PROPERTIES FII	-0,14%	-0,14%	-0,27%	443.674.239,07%	443.674.239,07%	-	-	-
FRANKLIN TEMPLETON VALOR E FVL FI AÇÕES	0,01%	0,01%	8,46%	16,24%	21,73%	41,37%	0,09%	0,09%

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



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



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
-----	----------------	------------	----------	--------------	---------	--------------	-------------	--------------	----------	-----------	----------	-----

⚠ ATENÇÃO! Meta Atuarial de **2020** não está cadastrada !!!

Investimentos x Meta Atuarial



Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



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

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
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	2.131.029,03	0,00	126.184,53	2.022.205,50	17.361,00	0,81%	-5,11%	10,98%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	8.076.269,98	101.591,93	0,00	8.244.030,86	66.168,95	0,81%	0,82%	0,64%
UM INVEST IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.157.906,42	0,00	0,00	1.165.905,61	7.999,19	0,69%	0,69%	1,07%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.512.029,43	0,00	0,00	1.520.433,89	8.404,46	0,56%	0,56%	0,62%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.029.868,41	0,00	0,00	1.034.871,93	5.003,52	0,49%	0,49%	0,72%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	2.031.031,29	0,00	0,00	2.040.316,21	9.284,92	0,46%	0,46%	0,55%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	3.126.402,75	0,00	0,00	3.139.513,17	13.110,42	0,42%	0,42%	0,09%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	4.566.990,64	0,00	0,00	4.584.573,01	17.582,37	0,38%	0,38%	0,55%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	614.439,83	0,00	0,00	616.589,32	2.149,49	0,35%	0,35%	0,01%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2.004.912,30	0,00	0,00	2.011.656,58	6.744,28	0,34%	0,34%	0,64%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.960.033,29	559.344,67	388.269,29	5.146.211,55	15.102,88	0,27%	0,29%	0,00%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	1.435.927,79	0,00	0,00	1.439.410,29	3.482,50	0,24%	0,24%	0,75%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	0,00	1.097.654,71	0,00	1.099.720,55	2.065,84	0,19%	0,34%	0,00%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	607.426,54	0,00	0,00	607.596,87	170,33	0,03%	0,03%	0,57%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	105.510,80	0,00	0,00	105.397,51	-113,29	-0,11%	-0,11%	0,62%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	22.168,86	0,00	0,00	22.049,44	-119,42	-0,54%	-0,54%	0,56%
Total Renda Fixa	33.381.947,36	1.758.591,31	514.453,82	34.800.482,29	174.397,44	0,50%		1,07%

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
META VALOR FI AÇÕES	2.932.459,35	0,00	0,00	3.019.413,08	86.953,73	2,97%	2,97%	12,02%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	890.007,96	0,00	0,00	908.891,00	18.883,04	2,12%	2,12%	6,74%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	2.249.514,38	0,00	0,00	2.288.166,48	38.652,10	1,72%	1,72%	8,40%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.209.758,66	0,00	0,00	1.218.028,25	8.269,59	0,68%	0,68%	1,97%
FRANKLIN TEMPLETON VALOR E FVL FI AÇÕES	948.573,87	0,00	0,00	948.689,85	115,98	0,01%	0,01%	9,15%
OSASCO PROPERTIES FII	954.303,12	0,00	0,00	952.940,57	-1.362,55	-0,14%	0,00%	-
Total Renda Variável	9.184.617,34	0,00	0,00	9.336.129,23	151.511,89	1,65%		8,68%