

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

Relatório Analítico dos Investimentos

em fevereiro de 2020

Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 2020)

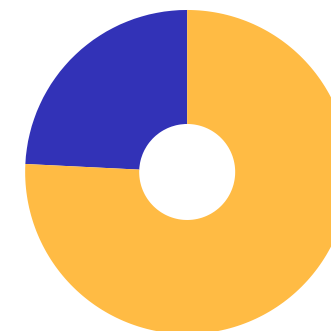
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
TÍTULOS PÚBLICOS			111.768.742,65	8,10%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	84.478.531,29	6,12%	968	1,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	14.764.185,03	1,07%	74	1,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	16/08/2020	3.708.888,58	0,27%	107	0,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	52.241.509,49	3,79%	941	0,79%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	15/08/2030	16.469.831,82	1,19%	27	4,52%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	7.127.694,08	0,52%	6	13,63%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	15/08/2022	10.484.585,67	0,76%	165	1,55%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	67.738.964,04	4,91%	351	2,95%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	49.503.936,71	3,59%	187	9,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	79.301.503,30	5,75%	622	1,75%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	78.195.362,82	5,67%	731	0,74%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	24.347.886,50	1,76%	392	0,57%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	D+1 du ...	Não há	11.720.537,39	0,85%	16.306	1,92%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO H NILO FI RENDA FIXA	D+4	Não há	111.424.010,99	8,07%	24	12,50%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	174.660.244,49	12,66%	119	8,85%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	92.332.641,11	6,69%	283	1,81%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAU IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	45.268.480,59	3,28%	95	12,76%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	10.327.503,82	0,75%	397	0,15%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	5.833,94	0,00%	740	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, 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
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	S/Info	Não se aplica	7.551.608,88	0,55%		13,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
Total para cálculo dos limites da Resolução			1.380.093.999,93				

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%	111.768.742,65	8,10%	0,00%	5,00%	25,00%	233.254.757,33
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	464.014.992,83	33,62%	20,00%	25,00%	70,00%	502.050.807,12
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	4,00%	70,00%	966.065.799,95
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	470.087.138,83	34,06%	10,00%	25,00%	50,00%	219.959.861,14
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	69.004.700,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	53.335,05	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	137.956.064,94
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	207.014.099,99
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	138.009.399,99
Total Renda Fixa	100,00%	1.045.924.209,36	75,79%	30,00%	60,00%	255,00%	

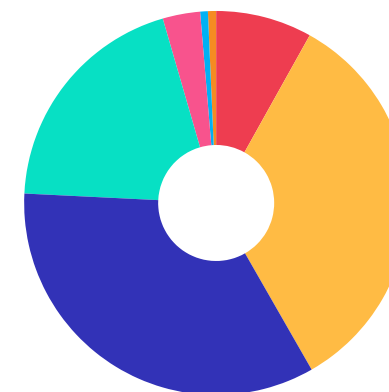


RENDA FIXA 1.045.924.209,36

RENDA VARIÁVEL 334.169.790,57

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%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	138.009.399,99
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	138.009.399,99
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	272.212.810,46	19,72%	7,00%	20,00%	30,00%	141.815.389,52
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	43.503.730,61	3,15%	2,00%	10,00%	10,00%	94.505.669,38
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	8.933.323,18	0,65%	0,00%	5,00%	5,00%	60.071.376,82
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	9.519.926,32	0,69%	0,00%	5,00%	5,00%	59.484.773,68
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	138.009.399,99
Total Renda Variável	30,00%	334.169.790,57	24,21%	9,00%	40,00%	80,00%	



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%	69.004.700,00
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	138.009.399,99
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	138.009.399,99
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	25,00%	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	341.945.159,57	24,78	0,07
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	296.411.759,30	21,48	0,03
ITAU UNIBANCO	178.486.324,39	12,93	0,01
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	111.768.742,65	8,10	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	89.791.922,91	6,51	0,01
WESTERN ASSET	81.546.714,26	5,91	0,18
NAVI CAPITAL	49.177.327,74	3,56	2,75
VINCI PARTNERS	37.156.263,46	2,69	0,17
VINCI GESTÃO DE PATRIMÔNIO LTD...	33.751.616,60	2,45	0,15
AZ QUEST INVESTIMENTOS	33.570.864,79	2,43	0,10
ITAU DTVM	33.358.078,98	2,42	0,00
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	31.261.048,38	2,27	2,40
XP GESTÃO DE RECURSOS	23.906.342,47	1,73	0,00
XP VISTA ASSET MANAGEMENT	11.720.537,39	0,85	0,00
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	7.551.608,88	0,55	1,71
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	7.127.694,08	0,52	0,01
A5 CAPITAL PARTNERS	5.266.346,99	0,38	-
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	2.109.142,55	0,15	0,00
REAG GESTORA DE RECURSOS	1.968.317,44	0,14	1,23
ROMA ASSET	1.226.004,56	0,09	-
CAPITÂNIA	607.018,41	0,04	0,01
BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUT...	331.829,08	0,02	0,01
GRADUAL INVESTIMENTOS	53.335,05	0,00	0,03

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 '	111.768.742,65	8,10	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	464.014.992,83	33,62	20,00	70,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	5,00	70,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	470.087.138,83	34,06	10,00	50,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	53.335,05	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	272.212.810,46	19,72	7,00	30,00
Artigo 8º, Inciso III	43.503.730,61	3,15	2,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	8.933.323,18	0,65	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	9.519.926,32	0,69	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	10,00
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
130% do CDI (Benchmark)	0,38%	0,87%	1,37%	3,12%	7,31%	16,33%	-	-
SILVERADO MAXIMUM II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	-1,51%	-3,08%	-6,08%	-12,37%	-	-40,18%	-	-
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,69%	1,22%	2,44%	5,37%	11,19%	22,52%	-	-
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%
IMA-B 5+ (Benchmark)	0,32%	0,35%	2,96%	7,23%	22,04%	43,07%	-	-
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%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,64%	1,20%	2,45%	5,66%	12,17%	23,49%	-	-
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	0,57%	1,27%	2,58%	5,60%	12,24%	24,08%	0,01%	0,03%
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%
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%
IMA-B (Benchmark)	0,45%	0,71%	2,73%	6,54%	18,00%	34,65%	-	-
BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	0,46%	0,73%	2,76%	6,61%	17,85%	34,37%	0,03%	0,07%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,44%	0,69%	2,69%	6,35%	17,63%	34,01%	0,02%	0,06%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	0,70%	0,91%	2,97%	6,97%	19,63%	36,12%	0,03%	0,07%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,67%	-0,88%	0,60%	4,22%	10,22%	16,46%	0,05%	0,06%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,51%	-0,37%	0,73%	4,44%	13,64%	23,62%	0,05%	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 VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,41%	0,61%	1,53%	4,15%	9,09%	20,06%	0,00%	0,01%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-2,44%	-2,47%	-1,71%	0,58%	1,55%	4,76%	0,05%	0,04%
BRDESCO H NILO FI RENDA FIXA	0,55%	0,92%	2,99%	7,00%	19,24%	36,44%	0,03%	0,07%
Selic (Benchmark)	0,29%	0,67%	1,05%	2,39%	5,57%	12,34%	-	-
BRDESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	0,27%	0,63%	0,99%	2,29%	5,38%	11,94%	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%
IPCA (Benchmark)	0,25%	0,46%	1,62%	2,20%	4,00%	8,05%	-	-
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%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,29%	0,68%	1,06%	2,39%	5,57%	12,08%	0,00%	0,00%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,99%	-1,48%	-0,39%	2,89%	6,56%	11,51%	0,04%	0,05%

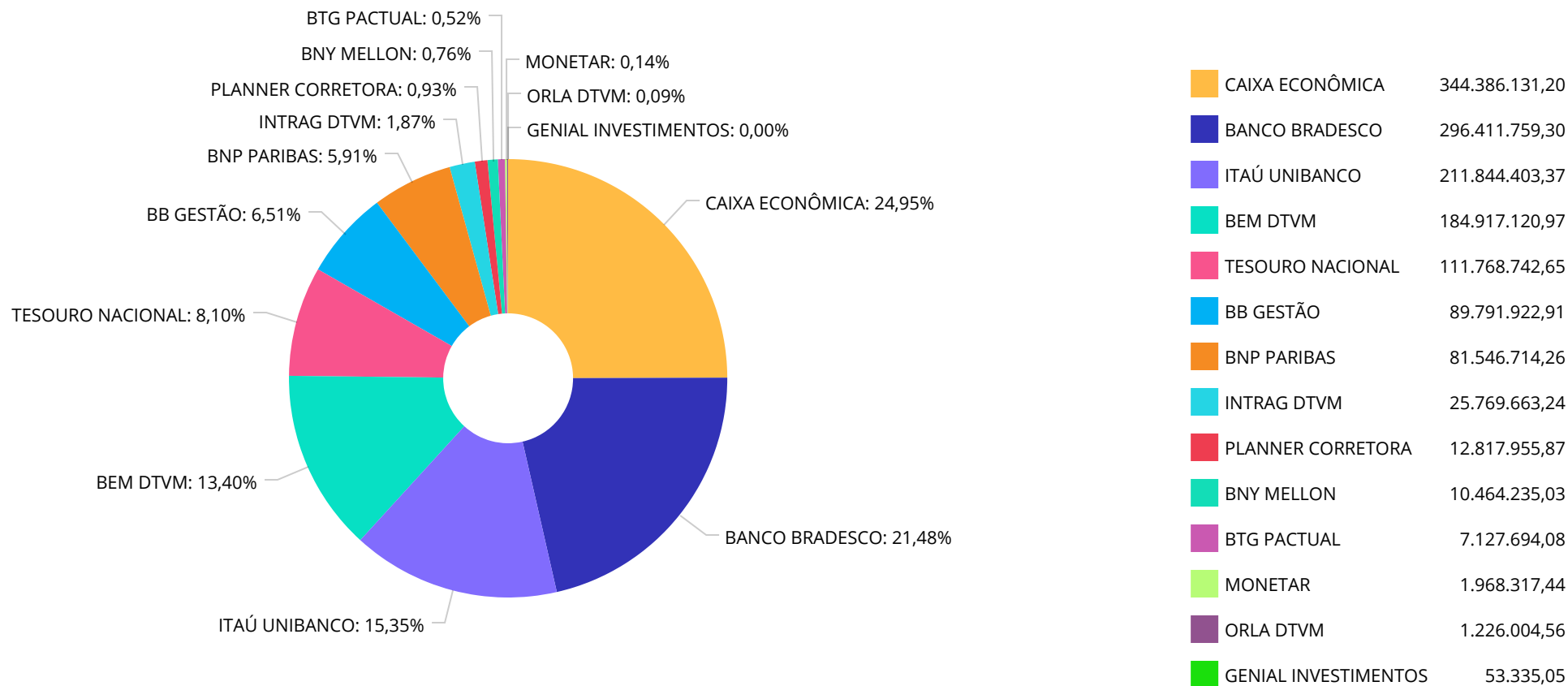
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	0,97%	2,07%	4,10%	7,38%	14,88%	31,88%	-	-
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	-	-
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%	-4,74%	3,26%	10,30%	17,58%	0,15%	0,15%
IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	0,80%	1,70%	3,53%	6,17%	12,29%	25,99%	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	-	-	-	-	-	-	-	-
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	0,74%	1,55%	3,29%	5,68%	11,26%	23,67%	-	-
REAG RENDA IMOBILIÁRIA FII - DOMC11	-0,81%	3,36%	19,66%	19,42%	11,82%	4,24%	0,14%	0,29%
IDIV (Benchmark)	-6,18%	-7,66%	1,56%	7,52%	21,63%	42,31%	-	-
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	-6,89%	-5,54%	1,35%	11,32%	30,22%	61,78%	0,13%	0,13%
Ibovespa (Benchmark)	-8,43%	-9,92%	-3,75%	3,00%	8,98%	22,05%	-	-
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	-7,78%	-7,15%	0,53%	6,88%	15,97%	31,15%	0,15%	0,13%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	-7,99%	-8,61%	-0,77%	6,52%	12,73%	31,52%	0,15%	0,13%
VINCI SELECTION EQUITIES FI AÇÕES	-5,96%	-5,59%	1,68%	8,03%	16,91%	37,96%	0,13%	0,11%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-6,28%	-8,43%	-0,15%	5,34%	17,00%	49,89%	0,15%	0,13%

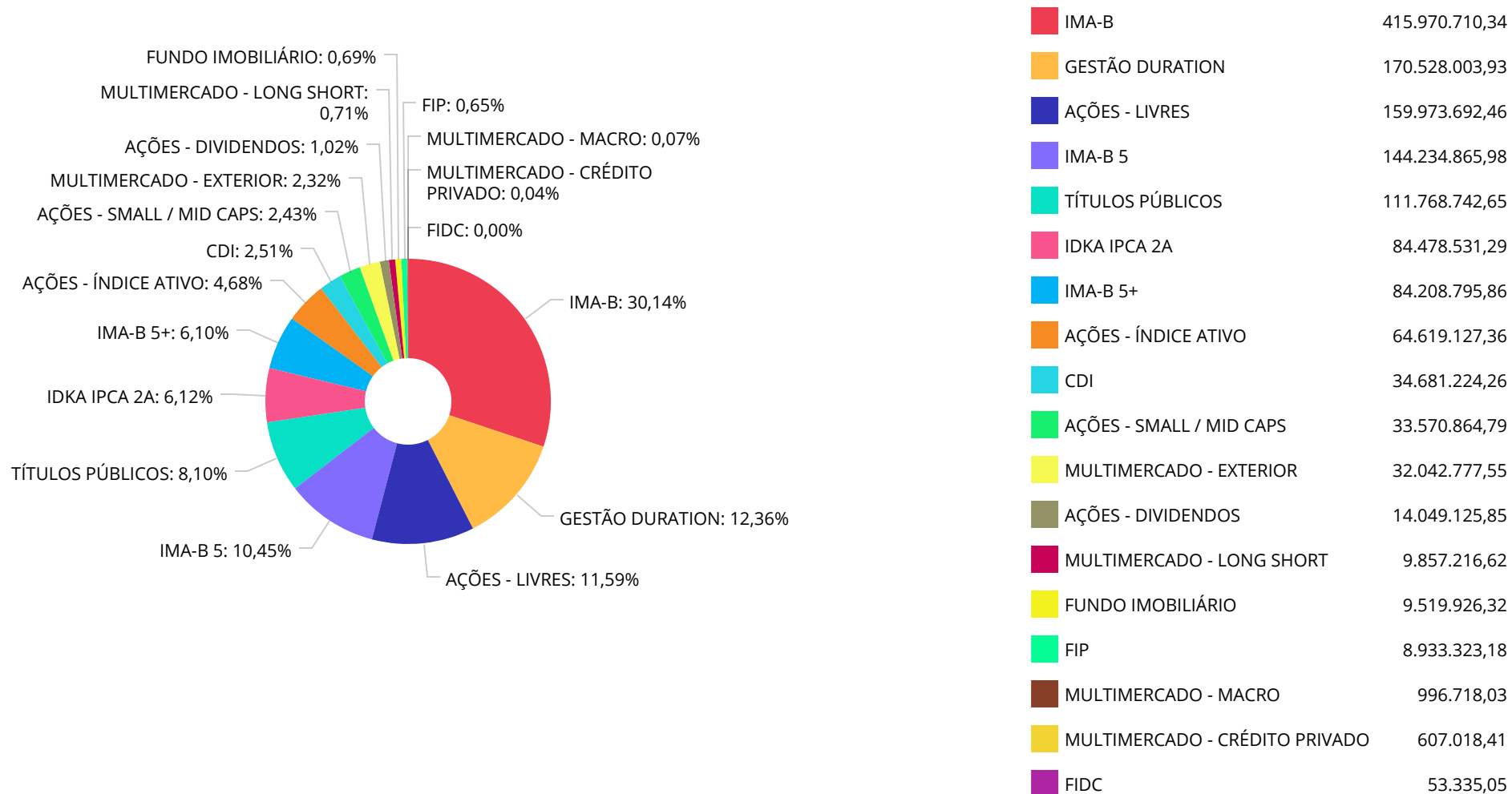
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-9,79%	-9,96%	-2,64%	5,05%	20,11%	42,38%	0,15%	0,16%
VINCI MOSAICO FI AÇÕES	-5,42%	-3,77%	8,11%	16,15%	30,01%	53,28%	0,14%	0,15%
SMLL (Benchmark)	-8,27%	-7,86%	3,80%	13,95%	35,70%	51,63%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	-6,19%	0,07%	10,90%	20,59%	44,87%	70,86%	0,17%	0,16%
CDI (Benchmark)	0,29%	0,67%	1,05%	2,39%	5,57%	12,34%	-	-
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-0,11%	0,04%	-0,70%	-11,86%	-24,40%	-26,51%	0,00%	0,15%
XP LONG SHORT 60 FIC MULTIMERCADO	0,24%	1,70%	1,30%	1,36%	2,72%	11,44%	0,02%	0,03%
ITAÚ VISION INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	-2,12%	-2,34%	-1,36%	0,14%	-	-	0,04%	-
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	0,56%	1,87%	-17,91%	109,87%	109,87%	109,87%	-	-
BRASIL ENERGIA RENOVÁVEL MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	-	-
LSH FIP	-	-	-	-	-	-	0,00%	0,00%
XP DIVIDENDOS 30 FIC AÇÕES	-6,81%	-5,47%	1,45%	11,36%	29,73%	60,24%	0,13%	0,12%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-6,01%	-0,14%	-	-	-	-	0,17%	-

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



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



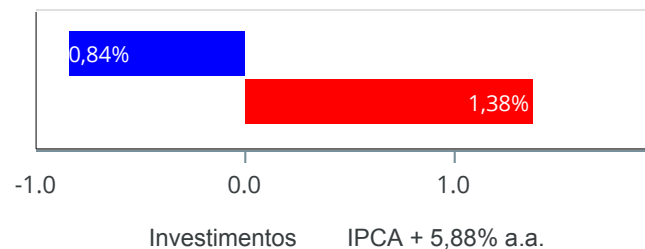
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Fevereiro / 2020)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2021	17/08/2016	4.750	2.964,257204	3.561,620984	14.080.221,72	16.917.699,67	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2023	03/09/2015	6.730	2.515,509771	3.793,177492	16.929.380,76	25.528.084,52	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	14/03/2014	6.185	2.315,991673	3.836,944137	14.324.408,50	23.731.499,49	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2026	27/04/2016	2.200	2.838,144079	3.969,945575	6.243.916,97	8.733.880,27	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	21/12/2015	8.310	2.412,107871	4.435,328364	20.044.616,41	36.857.578,70	Mercado

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

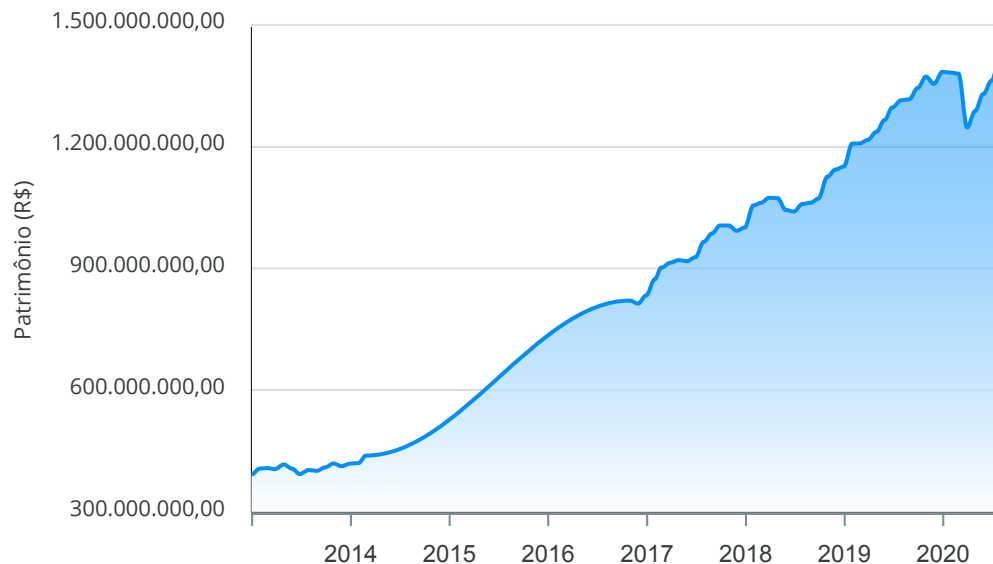
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	1.373.686.132,44	33.835.716,37	42.059.233,95	1.372.103.025,60	6.640.410,74	6.640.410,74	0,48%	0,48%	0,71%	0,71%	67,98%	3,08%
Fevereiro	1.372.103.025,60	55.461.648,94	39.561.380,36	1.369.766.496,11	-18.236.798,07	-11.596.387,33	-1,31%	-0,84%	0,66%	1,38%	-60,83%	5,03%

Investimentos x Meta Atuarial



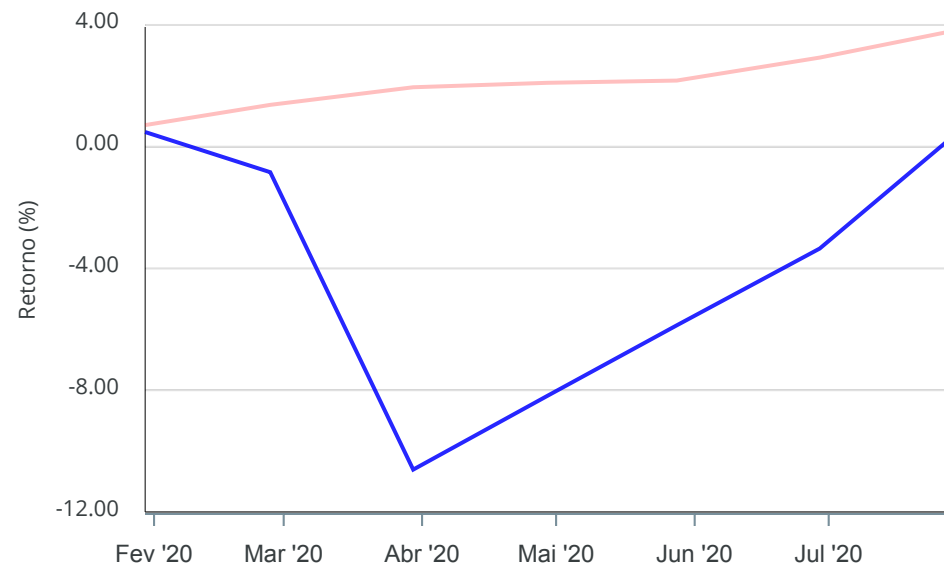
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	49.001.531,09	0,00	0,00	49.503.936,71	502.405,62	1,03%	1,03%	1,55%
TÍTULOS PÚBLICOS	111.796.290,84	0,00	818.510,55	111.768.742,65	790.962,36	0,71%	-	-
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	15.014.796,48	0,00	355.810,23	14.764.185,03	105.198,78	0,70%	-1,67%	4,72%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	44.954.075,80	0,00	0,00	45.268.480,59	314.404,79	0,70%	0,70%	2,66%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	16.722.040,80	0,00	361.153,48	16.469.831,82	108.944,50	0,65%	-1,51%	4,80%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	78.788.858,71	0,00	0,00	79.301.503,30	512.644,59	0,65%	0,65%	0,85%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	94.904.866,23	0,00	11.000.000,00	84.478.531,29	573.665,06	0,60%	0,60%	0,69%
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	11.653.778,96	0,00	0,00	11.720.537,39	66.758,43	0,57%	0,57%	1,09%
BRADESCO H NILO FI RENDA FIXA	110.817.113,22	0,00	0,00	111.424.010,99	606.897,77	0,55%	0,55%	2,75%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	62.774.912,71	15.000.000,00	0,00	78.195.362,82	420.450,11	0,54%	0,62%	0,91%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.272.269,28	0,00	182.881,48	7.127.694,08	38.306,28	0,53%	-1,99%	4,42%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	173.865.906,69	0,00	0,00	174.660.244,49	794.337,80	0,46%	0,46%	2,51%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	52.013.212,08	0,00	0,00	52.241.509,49	228.297,41	0,44%	0,44%	2,42%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	10.722.359,74	0,00	281.742,04	10.484.585,67	43.967,97	0,41%	0,41%	0,39%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	67.542.149,61	0,00	0,00	67.738.964,04	196.814,43	0,29%	0,29%	3,75%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	10.504.216,77	0,00	205.069,89	10.327.503,82	28.356,94	0,27%	0,27%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	92.095.377,99	0,00	0,00	92.332.641,11	237.263,12	0,26%	0,26%	0,01%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.801.594,85	0,00	102.080,66	3.708.888,58	9.374,39	0,25%	-2,44%	4,80%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	28.668.290,63	22.011.106,62	26.411.581,13	24.347.886,50	80.070,38	0,16%	0,29%	0,03%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12.757,40	40.649,39	47.620,79	5.833,94	47,94	0,09%	0,22%	0,01%

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
SILVERADO MAXIMUM II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	54.151,95	0,00	0,00	53.335,05	-816,90	-1,51%	-	-
Total Renda Fixa	1.042.980.551,83	37.051.756,01	39.766.450,25	1.045.924.209,36	5.658.351,77	0,52%		1,86%

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
XP LONG SHORT 60 FIC MULTIMERCADO	9.833.987,94	0,00	0,00	9.857.216,62	23.228,68	0,24%	0,24%	2,42%
REAG RENDA IMOBILIÁRIA FII - DOMC11	1.966.726,33	0,00	0,00	1.968.317,44	1.591,11	0,08%	-0,81%	14,46%
LSH FIP	1.226.659,59	0,00	0,00	1.226.004,56	-655,03	-0,05%	-0,05%	0,01%
BRASIL ENERGIA RENOVÁVEL MULTISTRATÉGIA FIP	332.077,61	0,00	0,00	331.829,08	-248,53	-0,07%	-	-
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	607.692,49	0,00	0,00	607.018,41	-674,08	-0,11%	-0,11%	0,17%
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	5.273.801,95	0,00	0,00	5.266.346,99	-7.454,96	-0,14%	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	2.119.721,80	0,00	0,00	2.109.142,55	-10.579,25	-0,50%	-	-
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	7.618.296,46	0,00	0,00	7.551.608,88	-66.687,58	-0,88%	-0,88%	-
ITAÚ VISION INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	1.018.258,95	0,00	0,00	996.718,03	-21.540,92	-2,12%	-2,12%	4,40%
VINCI SELECTION EQUITIES FI AÇÕES	35.889.292,62	0,00	0,00	33.751.616,60	-2.137.676,02	-5,96%	-5,96%	12,57%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	6.279.052,01	0,00	0,00	5.901.791,40	-377.260,61	-6,01%	-6,01%	16,84%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	29.495.664,86	0,00	0,00	27.669.073,39	-1.826.591,47	-6,19%	-6,19%	17,23%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	52.472.116,87	0,00	0,00	49.177.327,74	-3.294.789,13	-6,28%	-6,28%	15,26%
VINCI MOSAICO FI AÇÕES	21.408.296,52	18.409.892,93	0,00	37.156.263,46	-2.661.925,99	-6,69%	-5,42%	14,46%
XP DIVIDENDOS 30 FIC AÇÕES	9.482.894,20	0,00	0,00	8.837.451,72	-645.442,48	-6,81%	-6,81%	12,65%
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	5.597.104,70	0,00	0,00	5.211.674,13	-385.430,57	-6,89%	-6,89%	12,82%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	34.642.047,89	0,00	0,00	32.042.777,55	-2.599.270,34	-7,50%	-7,50%	14,68%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	36.170.674,76	0,00	0,00	33.358.078,98	-2.812.595,78	-7,78%	-7,78%	15,11%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	33.973.726,73	0,00	0,00	31.261.048,38	-2.712.678,35	-7,98%	-7,98%	14,98%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	44.218.596,26	0,00	0,00	39.888.484,66	-4.330.111,60	-9,79%	-9,79%	14,94%

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
Total Renda Variável	339.626.690,54	18.409.892,93	0,00	334.169.790,57	-23.866.792,90	-6,67%		14,31%