



CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

Posição 31/01/2020

CDI ACUMULADO NO MÊS / ANO :

0,3766% 0,3766%

DESEMPENHO DOS FUNDOS NO MÊS / ANO :

0,1235% 0,1235% META MÊS 18,23% META ANO 18,23%

META ATUARIAL ACUMULADA NO MÊS / ANO :

0,6777% 0,6777%

BANCO / FUNDO	R\$	% PATRIMÔNIO	LIMITE Resolução 3922 de 25/11/10	Política Investimentos 2020		Rendimento do fundo no mês	Rendimento do fundo no ano	BENCHMARK FUNDO X CDI		BENCHMARK FUNDO X META		VaR	Índice de Sharpe		
				ALVO	MAXIMO			% Mês	% Ano	% Mês	% Ano			Mês	Mês
FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RF LONGO PRAZO	115.150.765,97	18,70%	Art. 7º I b 100%	58,00%	75%	0,2467	0,2467	65,49	65,49	36,40	36,40	1,67%	-0,41		
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TP RF LONGO PRAZO	22.156.023,57	3,60%	61,71%			0,4865	0,4865	129,18	129,18	71,79	71,79	0,64%	0,93		
FI CAIXA BRASIL IMA-B5 TP RF LONGO PRAZO	8.334.556,01	1,35%				0,5441	0,5441	144,47	144,47	80,29	80,29	0,64%	1,42		
FI CAIXA BRASIL IMA-B5+ TP RF LONGO PRAZO	24.470.404,10	3,97%				-0,0385	-0,0385	-10,24	-10,24	-5,69	-5,69	2,62%	-0,83		
FIC CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	10.164.867,28	1,65%				0,8193	0,8193	217,54	217,54	120,90	120,90	0,64%	3,77		
SUL AMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA	73.870.544,90	12,00%				-0,3476	-0,3476	-92,30	-92,30	-51,30	-51,30	1,82%	-2,14		
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5 LP FIC FI	88.299.796,92	14,34%				0,5558	0,5558	147,58	147,58	82,02	82,02	0,62%	1,58		
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5+ TP FI	21.932.534,10	3,56%				0,0474	0,0474	12,58	12,58	6,99	6,99	2,59%	-0,66		
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO	15.619.705,20	2,54%				0,9018	0,9018	239,44	239,44	133,07	133,07	1,07%	2,67		
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI	3.637.146,20	0,59%	Art. 7º IV a 40%	15,00%	40%	0,3408	0,3408	90,48	90,48	50,28	50,28	0,00%	-443,59		
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RF FICFI (T.A)	10.816.402,33	1,76%	12,30%			0,3408	0,3408	90,48	90,48	50,28	50,28	0,00%	-443,59		
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FI	47.299.634,84	7,68%				0,2631	0,2631	69,86	69,86	38,82	38,82	1,66%	-0,35		
SANTANDER ATIVO RENDA FIXA FIC	6.009.343,38	0,98%				0,3418	0,3418	90,75	90,75	50,43	50,43	0,03%	-6,36		
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	3.406.689,69	0,55%				0,3748	0,3748	99,51	99,51	55,30	55,30	0,00%	-2,75		
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI (T.A)	4.589.015,46	0,75%				0,3748	0,3748	99,51	99,51	55,30	55,30	0,00%	-2,75		
FIDC FECHADO MULTISSETORIAL MASTER III	28.377,81	0,00%	Art. 7º VII a 5%	0,00%	2%	-37,1678	-37,1678	-9868,67	-9868,67	-5484,56	-5484,56	16,45%	-6,79		
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	9.496.635,88	1,54%	Art. 8º I a 30%	0,00%	10%	0,6759	0,6759	179,46	179,46	99,74	99,74	9,13%	0,27		
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVV11	6.067.206,00	0,99%	Art. 8º I b 30%	3,00%	10%	-1,7625	-1,7625	-467,98	-490,31	-260,08	-272,51	9,95%	-1,01		
OCCAM FIC DE FI AÇÕES	5.244.227,69	0,85%	Art. 8º II a 20%	18,50%	20%	0,9532	0,9532	253,10	253,10	140,66	140,66	10,58%	0,4		
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	10.261.070,39	1,67%	19,21%			1,9184	1,9184	509,37	509,37	283,08	283,08	9,87%	0,94		
BNP PARIBAS SMALL CAPS FIA	7.083.919,25	1,15%				2,0164	2,0164	535,39	535,39	297,55	297,55	9,02%	1,07		
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC FI	13.561.656,94	2,20%				-0,1889	-0,1889	-50,16	-50,16	-27,88	-27,88	8,70%	-0,27		
BRADESCO FIC FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	8.192.773,79	1,33%				-0,2553	-0,2553	-67,78	-67,78	-37,67	-37,67	9,75%	-0,25		
BRADESCO FI AÇÕES SELECTION	6.324.948,91	1,03%				-1,2891	-1,2891	-342,28	-342,28	-190,22	-190,22	10,86%	-0,73		
NAVI INSTITUCIONAL FI EM AÇÕES	32.845.814,56	5,33%				-2,2982	-2,2982	-610,21	-610,21	-339,13	-339,13	9,51%	-1,45		
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	34.784.740,32	5,65%				0,6210	0,6210	164,88	164,88	91,63	91,63	7,23%	0,26		
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	18.914.301,70	3,07%	Art. 8º III 10%	3,00%	10%	0,3671	0,3671	97,48	97,48	54,18	54,18	6,04%	0,05		
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FIC FIP	2.144.668,38	0,35%	Art. 8º IV a 5%	1,50%	2%	-0,1535	-0,1535	-40,75	-40,75	-22,64	-22,64	0,00%	-4927,64		
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I	5.117.299,42	0,83%		1,18%		-0,4320	-0,4320	-114,71	-114,71	-63,75	-63,75	-	-		