



DEPARTAMENTO MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA DOS
SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE PORTO ALEGRE

**DEPARTAMENTO MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO
MUNICÍPIO DE PORTO ALEGRE**

COMITÊ DE INVESTIMENTOS DO PREVIMPA

ATA Nº 04/2020

Data e Hora	Local
13/02/2020	Sala reuniões 14º andar - PREVIMPA
Participantes	
<p>Cárin Cecília da Rosa Carvalho - Diretora Administrativo-financeira em exercício; Dalvin Gabriel José de Souza - chefe da Unidade de Investimentos - UINV/Previmpa; Rogério de Oliveira e Carlos Fabretti Patrício, Economistas da Unidade de Investimentos do Previmpa; Isabela Belém Meneghello - chefe da Unidade de Gestão de Ativos Imobiliários – UGAI/DAF; Giordana Zimmermann Besen - Atuária da Assessoria de Planejamento/Previmpa; Anelise Jacques Zilio, Procuradora e Christian Fouchard Justin - Representante do Conselho de Administração.</p>	
Assuntos	
<p>1 – Apresentação dos resultados de janeiro/2020. 2 – Análise e deliberação do Fundo BDR I e BB Retorno Total</p>	
Resumo da Reunião	
<p>A Diretora Administrativo-Financeira, em exercício, Cárin, apresenta aos membros do Comitê, o servidor Christian Fouchard Justin, membro indicado pelo Conselho de Administração. Em seguida, Dalvin, responsável pela Unidade de Investimentos apresenta o resultado acumulado dos rendimentos no mês de janeiro, salientando, no entanto, que o relatório deve ser ajustado quanto ao percentual informado da meta atuarial: meta atuarial 0,72%; rendimento no ano 0,72%; rendimento no mês 0,72%. Dalvin esclarece aos membros do Comitê sobre o resgate de R\$ 20.000.000,00 do Fundo BB IDKA2A visando aplicação no Fundo BB Tecnologia, conforme autorizado, anteriormente, pelo Comitê. Informa que, em virtude de o Fundo ter sido fechado, em 27/01/2020, sem que o Gestor houvesse comunicado o fato relevante, a alocação dos R\$ 20.000.000,00, naquele Fundo, restou prejudicada. Relata ainda que as providências para esclarecer o ocorrido já foram tomadas e o recurso foi aplicado no Fundo BB IRFM1. Ato contínuo foram apresentadas as seguintes propostas para alocação de recursos: a) alocação de R\$ 20.000.000,00, antes resgatados para alocação no BB Tecnologia, no Fundo BB Retorno Total; b) aumentar posição no BDR I em mais R\$ 20.000.000,00, reduzindo a posição em renda fixa. Apresentadas as propostas, a primeira foi aprovada por unanimidade, enquanto que a segunda proposta obteve voto favorável da maioria e um voto contrário. Não havendo outro assunto a ser tratado, a Presidente da mesa em exercício, Cárin Cecília da Rosa Carvalho, declara encerrada a presente reunião, sendo lavrada a presente ata que, após lida e aprovada, será assinada pelos representantes presentes</p>	
Encaminhamentos	

Solicitar à Sete Capital a correção do percentual da meta atuarial mensal para 0,70% e não 0,72% como constou.

Pendências

- Nenhuma pendência.



Documento assinado eletronicamente por **Carin Cecília da Rosa Carvalho, Diretor Administrativo-Financeiro em Substituição**, em 04/03/2020, às 09:43, conforme o art. 1º, III, "b", da Lei 11.419/2006, e o Decreto Municipal 18.916/2015.



Documento assinado eletronicamente por **Isabela Belém Meneghello, Chefe de Unidade**, em 04/03/2020, às 10:21, conforme o art. 1º, III, "b", da Lei 11.419/2006, e o Decreto Municipal 18.916/2015.



Documento assinado eletronicamente por **Rogério de Oliveira, Economista**, em 10/03/2020, às 15:14, conforme o art. 1º, III, "b", da Lei 11.419/2006, e o Decreto Municipal 18.916/2015.



Documento assinado eletronicamente por **Christian Fouchard Justin, Servidor Público**, em 26/03/2020, às 13:03, conforme o art. 1º, III, "b", da Lei 11.419/2006, e o Decreto Municipal 18.916/2015.



Documento assinado eletronicamente por **Giordana Zimmermann Besen, Atuário**, em 26/03/2020, às 13:35, conforme o art. 1º, III, "b", da Lei 11.419/2006, e o Decreto Municipal 18.916/2015.



Documento assinado eletronicamente por **Carlos Fabretti Patrício, Economista**, em 13/04/2020, às 16:20, conforme o art. 1º, III, "b", da Lei 11.419/2006, e o Decreto Municipal 18.916/2015.

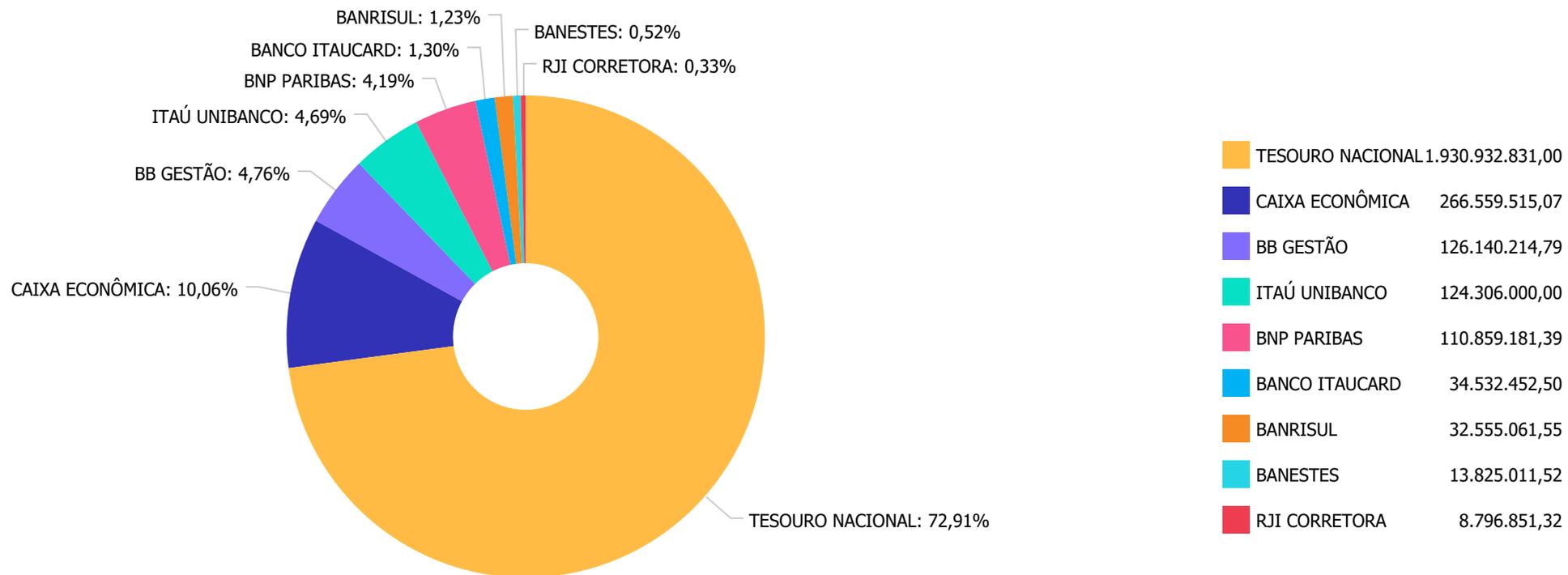


Documento assinado eletronicamente por **Dalvin Gabriel José de Souza, Chefe de Unidade**, em 06/05/2020, às 10:37, conforme o art. 1º, III, "b", da Lei 11.419/2006, e o Decreto Municipal 18.916/2015.

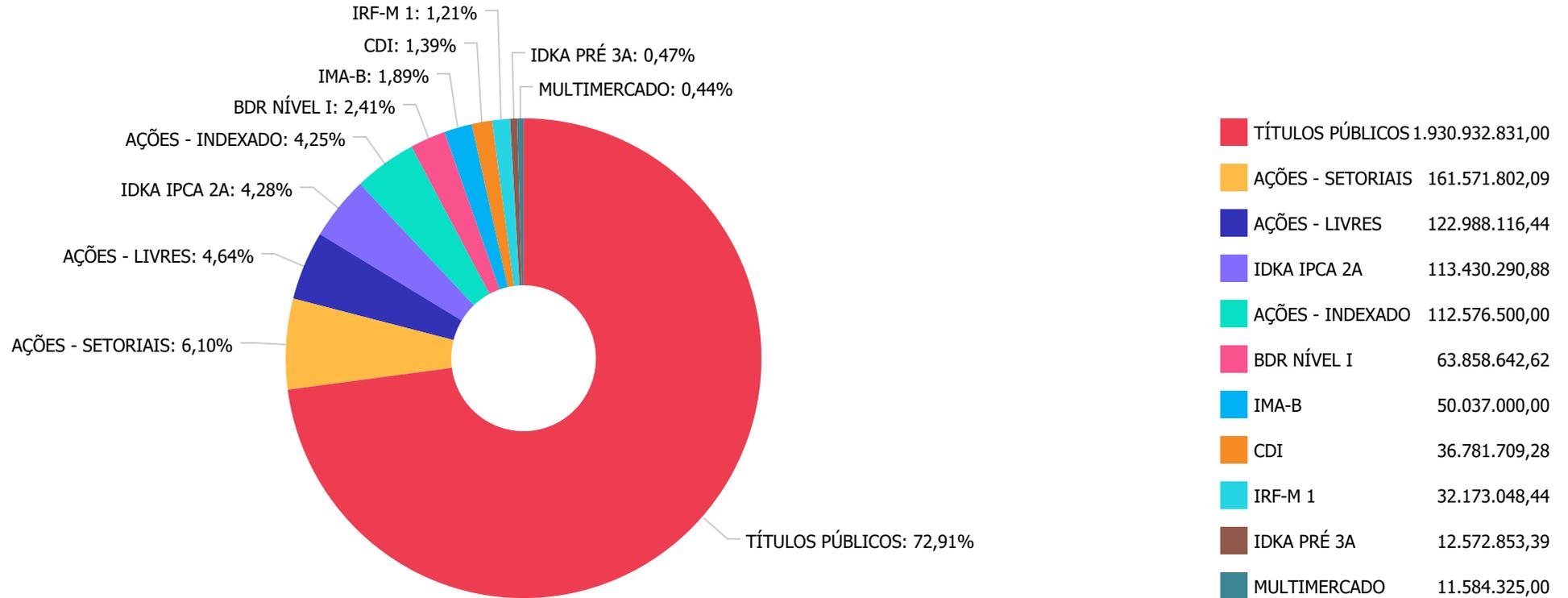


A autenticidade do documento pode ser conferida no site <http://sei.procempa.com.br/autenticidade/seipmpa> informando o código verificador **9664982** e o código CRC **B11C96D9**.

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



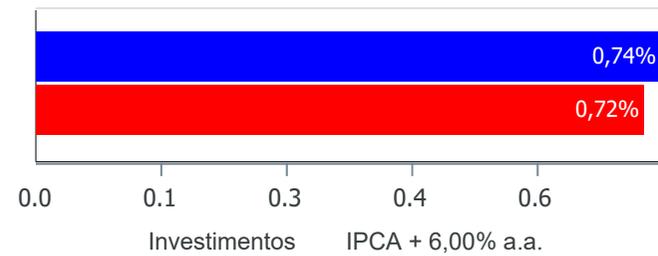
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Janeiro / 2020)



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
Janeiro	2.613.148.416,16	693.886.550,38	678.067.286,86	2.648.507.119,14	19.539.439,46	19.539.439,46	0,74%	0,74%	0,72%	0,72%	103,07%	5,79%

Investimentos x Meta Atuarial



Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



ANO

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
TÍTULOS PÚBLICOS	1.787.086.371,75	157.491.677,80	35.874.504,75	1.930.932.831,00	22.229.286,20	1,14%	-	-
MIRAE ASSET PRÉ FUNDO DE ÍNDICE RENDA FIXA - FIXA1...	12.452.826,15	0,00	0,00	12.572.853,39	120.027,24	0,96%	1,23%	1,08%
IT NOW ID ETF IMA-B FUNDO DE ÍNDICE - IMAB11	49.562.500,00	0,00	0,00	50.037.000,00	474.500,00	0,96%	0,24%	1,66%
BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	379.990,53	0,00	0,00	382.013,11	2.022,58	0,53%	0,53%	0,59%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	19.359.106,82	137.747.443,93	100.000.000,00	57.896.494,79	789.944,04	0,50%	0,46%	0,55%
BANRISUL ABSOLUTO FI RENDA FIXA LP	653.805,73	0,00	656.052,98	0,00	2.247,25	0,34%	0,36%	0,00%
BANRISUL FOCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	11.561.486,27	59.216.369,15	38.844.507,04	32.173.048,44	239.700,06	0,34%	0,42%	0,10%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	737.705,14	29.500.000,00	0,00	30.250.232,22	12.527,08	0,04%	0,37%	0,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	729.730,70	1.377.282,39	682.073,93	1.425.719,67	780,51	0,04%	0,29%	0,00%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	341.000,98	94.548.508,97	89.799.000,33	5.105.757,39	15.247,77	0,02%	0,30%	0,00%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	56.156.695,02	0,00	56.160.619,35	0,00	3.924,33	0,01%	0,05%	2,59%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	0,00	55.160.761,10	0,00	55.151.782,98	-8.978,12	-0,02%	0,38%	0,55%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	243.817.169,87	0,00	242.530.547,74	0,00	-1.286.622,13	-0,53%	-0,04%	2,62%
Total Renda Fixa	2.182.838.388,96	535.042.043,34	564.547.306,12	2.175.927.732,99	22.594.606,81	0,83%		0,66%

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
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇ...	13.550.363,57	0,00	0,00	13.825.011,52	274.647,95	2,03%	2,03%	6,60%
ISHARES BM&FBOVESPA SMALL CAP FUNDO DE ÍNDICE - SM...	59.478.279,00	0,00	0,00	59.978.828,00	500.549,00	0,84%	0,40%	9,29%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTI...	11.547.756,84	0,00	0,00	11.584.325,00	36.568,16	0,32%	0,32%	0,13%
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVA11	58.794.750,00	38.844.507,04	59.216.369,15	38.307.500,00	-115.387,89	-0,12%	-1,65%	9,94%
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES	0,00	20.000.000,00	0,00	19.928.640,59	-71.359,41	-0,36%	4,86%	9,01%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	30.980.278,64	0,00	0,00	30.551.973,04	-428.305,60	-1,38%	-1,38%	8,92%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	0,00	80.000.000,00	0,00	78.611.131,88	-1.388.868,12	-1,74%	3,17%	7,96%
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVV11	75.601.500,00	0,00	0,00	74.269.000,00	-1.332.500,00	-1,76%	-1,64%	9,95%
IT NOW IDIV FUNDO DE ÍNDICE - DIVO11	35.154.795,60	0,00	0,00	34.532.452,50	-622.343,10	-1,77%	-1,56%	7,87%
CAIXA PETROBRAS FI AÇÕES	55.904.200,57	0,00	54.303.611,59	0,00	-1.600.588,98	-2,86%	-5,24%	14,43%
AUSTRO INSTITUCIONAL PIPE BANCOS FIC AÇÕES	9.103.690,46	0,00	0,00	8.796.851,32	-306.839,14	-3,37%	-3,37%	5,38%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	0,00	20.000.000,00	0,00	19.252.931,17	-747.068,83	-3,74%	1,12%	8,13%
BB VALE FI AÇÕES	20.243.803,12	0,00	0,00	19.082.098,51	-1.161.704,61	-5,74%	-5,74%	15,85%
Total Renda Variável	370.359.417,80	158.844.507,04	113.519.980,74	408.720.743,53	-6.963.200,57	-1,68%		8,87%

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
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	59.950.609,40	0,00	0,00	63.858.642,62	3.908.033,22	6,52%	6,52%	5,77%
Total Renda Variável	59.950.609,40	0,00	0,00	63.858.642,62	3.908.033,22	6,52%		5,77%

Relatório Analítico dos Investimentos

em janeiro 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 (Janeiro / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
TÍTULOS PÚBLICOS			1.930.932.831,00	72,33%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "
BANRISUL FOCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+1	Não há	32.173.048,44	1,21%	309	1,99%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	57.896.494,79	2,17%	969	0,66%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	D+1	Não há	382.013,11	0,01%	853	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	55.151.782,98	2,07%	888	0,80%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
MIRAE ASSET PRÉ FUNDO DE ÍNDICE RENDA FIXA - FIX...	D+2	Não há	12.572.853,39	0,47%	500	6,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " c "
IT NOW ID ETF IMA-B FUNDO DE ÍNDICE - IMAB11	D+0	Não há	50.037.000,00	1,87%	4.641	1,59%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " c "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	9.327.971,07	0,35%	324	1,91%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	30.250.232,22	1,13%	684	0,57%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	12.945.028,04	0,48%	737	0,86%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	5.359.102,56	0,20%	651	0,18%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVV11	D+3	Não há	74.269.000,00	2,78%	9.408	1,00%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVA11	D+3	Não há	38.307.500,00	1,43%	56.474	0,32%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "
ISHARES BM&FBOVESPA SMALL CAP FUNDO DE ÍNDICE - ...	D+3	Não há	59.978.828,00	2,25%	33.649	2,41%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "
BB VALE FI AÇÕES	D+4	Não há	19.082.098,51	0,71%	32.663	2,70%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	30.551.973,04	1,14%	418	7,14%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES	D+3 du	Não há	19.928.640,59	0,75%	30.974	2,98%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	19.252.931,17	0,72%	11.169	3,02%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	78.611.131,88	2,94%	2.823	9,96%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC ...	D+34	Não há	13.825.011,52	0,52%	259	10,42%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "

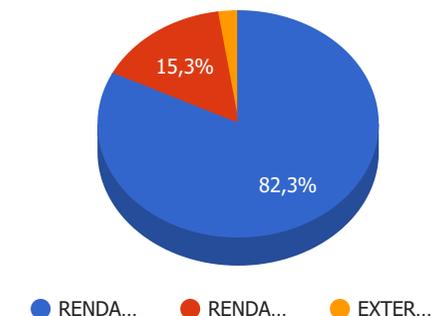
Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
IT NOW IDIV FUNDO DE ÍNDICE - DIVO11	D+3	Não há	34.532.452,50	1,29%	7.950	11,50%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MUL...	D+2	01/10/2020	11.584.325,00	0,43%	955	2,31%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	D+4	Não há	63.858.642,62	2,39%	74	8,01%	Artigo 9º - A, Inciso III
AUSTRO INSTITUCIONAL PIPE BANCOS FIC AÇÕES	D+31	0	8.796.851,32	0,33%	22	12,49%	Desenquadrado - RV
Total para cálculo dos limites da Resolução			2.669.607.743,75				

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%	1.930.932.831,00	72,33%	0,00%	70,00%	100,00%	738.674.912,75
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	145.603.339,32	5,45%	0,00%	2,00%	100,00%	2.524.004.404,43
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " c "	100,00%	62.609.853,39	2,35%	0,00%	0,00%	100,00%	2.606.997.890,36
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	133.480.387,19
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	80,00%	2.135.686.195,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	57.882.333,89	2,17%	0,00%	1,00%	30,00%	742.999.989,24
Artigo 7º, Inciso V, Alínea " a "	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	533.921.548,75
Artigo 7º, Inciso VI	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	15,00%	400.441.161,56
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	133.480.387,19
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	133.480.387,19
Total Renda Fixa	100,00%	2.197.028.357,60	82,30%	0,00%	80,00%	460,00%	

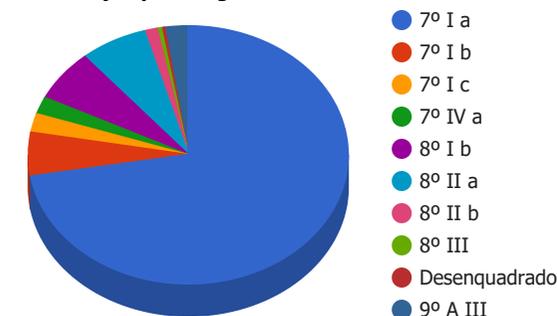
Distribuição por Segmento



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	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	6,00%	30,00%	800.882.323,13
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	800.882.323,13
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	30,00%	172.555.328,00	6,46%	0,00%	0,00%	0,00%	-172.555.328,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	6,00%	20,00%	533.921.548,75
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	181.251.786,71	6,79%	0,00%	0,00%	0,00%	-181.251.786,71
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	20,00%	34.532.452,50	1,29%	0,00%	0,00%	0,00%	-34.532.452,50
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	11.584.325,00	0,43%	0,00%	3,00%	15,00%	388.856.836,56
Artigo 8º, Inciso IV	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	133.480.387,19
Artigo 8º, Inciso V	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	133.480.387,19
Desenquadrado - RV	0,00%	8.796.851,32	0,33%	0,00%	0,00%	0,00%	-8.796.851,32
Total Renda Variável	30,00%	408.720.743,53	15,31%	0,00%	18,00%	105,00%	

Distribuição por Artigos



Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2020			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	63.858.642,62	2,39%	0,00%	1,00%	10,00%	203.102.131,76
Total Exterior	10,00%	63.858.642,62	2,39%	0,00%	1,00%	10,00%	

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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	1.930.932.831,00	72,33	-
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	270.781.728,75	10,14	0,05
ITAÚ UNIBANCO	158.838.452,50	5,95	0,01
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	143.018.625,72	5,36	0,01
BLACKROCK INVESTIMENTOS	98.286.328,00	3,68	0,61
BANRISUL CORRETORA	32.555.061,55	1,22	0,27
BANESTES DTVM	13.825.011,52	0,52	0,19
MIRAE ASSET	12.572.853,39	0,47	1,83
AUSTRO CAPITAL	8.796.851,32	0,33	1,66

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 " a "	1.930.932.831,00	72,33	0,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	145.603.339,32	5,45	0,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " c "	62.609.853,39	2,35	0,00	100,00
Artigo 7º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	0,00	0,00	0,00	80,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	57.882.333,89	2,17	0,00	30,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea " a "	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso VI	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 8º, Inciso I	0,00	0,00	0,00	30,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	0,00	0,00	0,00	30,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	172.555.328,00	6,46	0,00	0,00
Artigo 8º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	181.251.786,71	6,79	0,00	0,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	34.532.452,50	1,29	0,00	0,00
Artigo 8º, Inciso III	11.584.325,00	0,43	0,00	15,00
Artigo 8º, Inciso IV	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso V	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso III	63.858.642,62	2,39	0,00	10,00
Desenquadrado - RV	8.796.851,32	0,33	0,00	0,00

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
S&P/BM&F Índice de Futuros DI 3 anos ER (Benchmark)	-4,40%	-4,40%	-5,12%	-7,13%	-2,70%	-3,58%	-	-
MIRAE ASSET PRÉ FUNDO DE ÍNDICE RENDA FIXA - FIXA11	1,23%	1,23%	1,07%	5,12%	13,31%	-	0,01%	0,04%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,54%	0,54%	1,76%	4,74%	11,02%	22,45%	-	-
BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	0,53%	0,53%	1,53%	4,47%	10,40%	20,80%	0,01%	0,02%
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%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,44%	0,44%	1,20%	3,05%	6,61%	14,04%	-	-
BANRISUL FOCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,42%	0,42%	1,14%	2,94%	6,38%	13,56%	0,00%	0,00%
IMA-B (Benchmark)	0,26%	0,26%	-0,24%	5,64%	18,11%	34,79%	-	-
IT NOW ID ETF IMA-B FUNDO DE ÍNDICE - IMAB11	0,24%	0,24%	-0,31%	5,50%	-	-	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%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,29%	0,29%	0,87%	2,05%	4,65%	10,14%	0,00%	0,00%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,37%	0,37%	1,03%	2,44%	5,55%	12,08%	0,00%	0,00%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,30%	0,30%	0,92%	2,17%	4,90%	10,67%	0,00%	0,00%

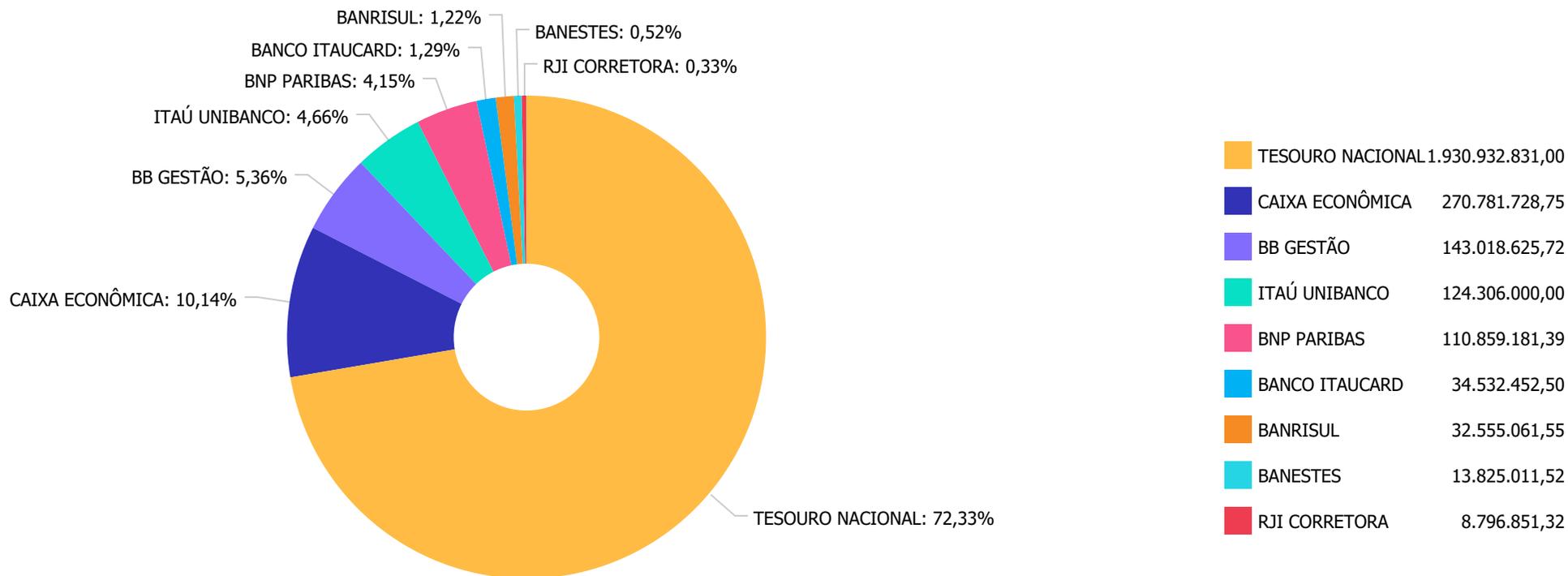
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDIV (Benchmark)	-1,58%	-1,58%	10,79%	17,15%	27,01%	50,76%	-	-
IT NOW IDIV FUNDO DE ÍNDICE - DIVO11	-1,56%	-1,56%	10,80%	17,03%	26,80%	50,48%	0,08%	0,11%
Ibovespa (Benchmark)	-1,63%	-1,63%	6,10%	11,74%	16,80%	33,97%	-	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	0,32%	0,32%	1,50%	3,09%	7,26%	-	0,00%	0,01%
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVA11	-1,65%	-1,65%	6,15%	11,72%	16,66%	33,62%	0,10%	0,09%
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES	4,86%	4,86%	25,63%	39,21%	65,56%	74,58%	0,09%	-
BB VALE FI AÇÕES	-5,74%	-5,74%	8,85%	2,56%	10,83%	23,98%	0,16%	0,20%
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVV11	-1,64%	-1,64%	6,17%	11,76%	16,85%	34,32%	0,10%	0,09%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	-1,38%	-1,38%	7,59%	13,66%	19,47%	37,50%	0,09%	0,09%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3,17%	3,17%	14,95%	20,83%	-	-	0,08%	-
AUSTRO INSTITUCIONAL PIPE BANCOS FIC AÇÕES	-3,37%	-3,37%	-3,09%	-7,22%	-2,50%	-	0,05%	0,11%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	1,12%	1,12%	14,12%	19,20%	36,62%	62,90%	0,08%	0,10%
SMLL (Benchmark)	0,45%	0,45%	18,98%	24,82%	45,25%	64,69%	-	-
ISHARES BM&FBOVESPA SMALL CAP FUNDO DE ÍNDICE - SMAL11	0,40%	0,40%	18,76%	24,36%	44,28%	63,13%	0,09%	0,14%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2,03%	2,03%	9,61%	15,76%	31,93%	59,36%	0,07%	0,09%

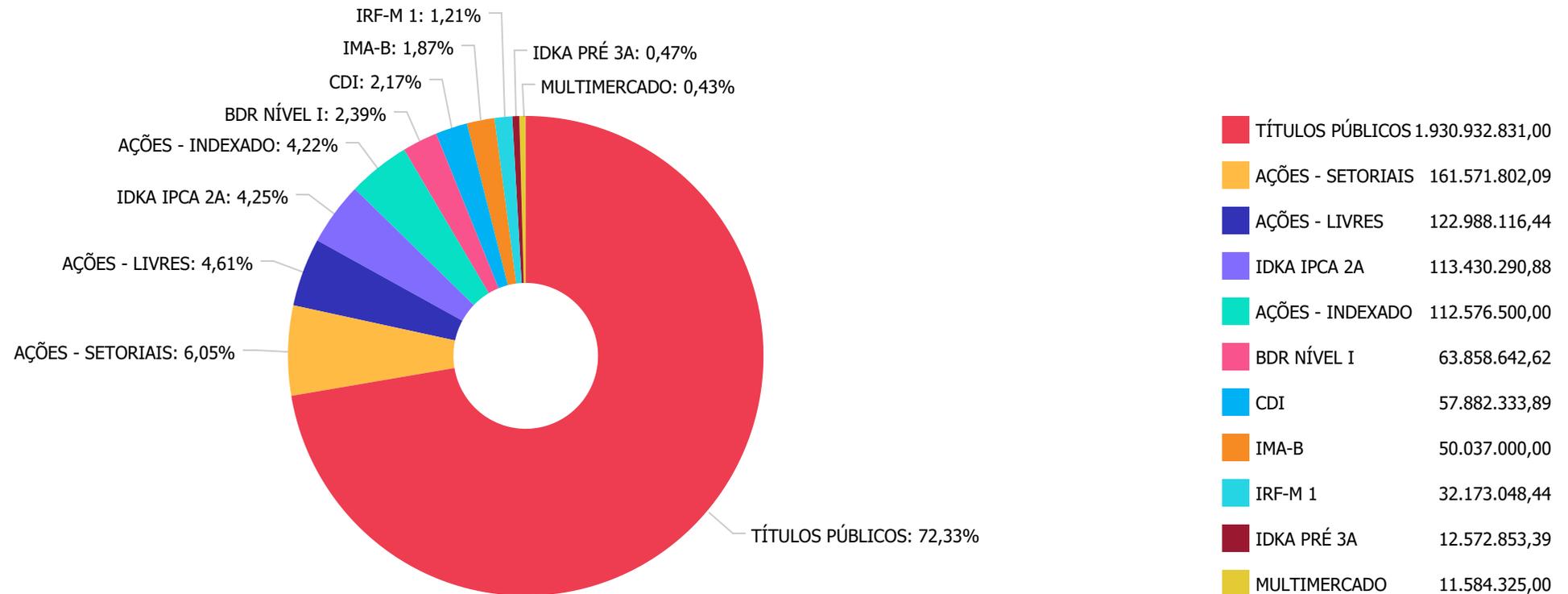
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2020 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	6,52%	6,52%	13,98%	22,36%	42,28%	55,39%	0,06%	0,15%

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



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



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

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
LTN - Letra do Tesouro Nacional	01/01/2022	21/03/2018	80.000	727,418914	910,746404	58.193.513,12	72.859.712,32	Mercado
LTN - Letra do Tesouro Nacional	01/01/2022	09/04/2018	200.000	732,978346	910,746404	146.595.669,20	182.149.280,80	Mercado
LTN - Letra do Tesouro Nacional	01/07/2022	26/06/2019	120.000	825,383252	883,393315	99.045.990,24	106.007.197,80	Mercado
LTN - Letra do Tesouro Nacional	01/07/2023	14/06/2019	190.000	753,636224	826,105720	143.190.882,56	156.960.086,80	Mercado
LTN - Letra do Tesouro Nacional	01/01/2024	03/01/2020	200.000	787,45838900	797,376321	157.491.677,80	159.475.264,20	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2028	06/06/2019	20.000	3.820,891426	4.163,181846	76.417.828,52	83.263.636,92	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2028	06/06/2019	30.000	3.820,891426	4.163,181846	114.626.742,78	124.895.455,38	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2028	06/06/2019	20.000	3.820,891426	4.163,181846	76.417.828,52	83.263.636,92	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	14/06/2019	15.600	4.053,157947	4.403,167763	63.229.263,97	68.689.417,10	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2050	01/08/2019	5.000	4.685,088810	4.855,886996	23.425.444,05	24.279.434,98	Mercado
NTN-F - Nota do Tesouro Nacional - Série F	01/01/2023	17/10/2017	50.000	1.051,661907	1.124,398754	52.583.095,35	56.219.937,70	Mercado
NTN-F - Nota do Tesouro Nacional - Série F	01/01/2023	13/10/2017	50.000	1.052,640809	1.124,398754	52.632.040,45	56.219.937,70	Mercado
NTN-F - Nota do Tesouro Nacional - Série F	01/01/2023	10/10/2017	25.000	1.050,747229	1.124,398754	26.268.680,73	28.109.968,85	Mercado
NTN-F - Nota do Tesouro Nacional - Série F	01/01/2025	14/11/2018	50.000	1.037,699013	1.165,032955	51.884.950,65	58.251.647,75	Mercado
NTN-F - Nota do Tesouro Nacional - Série F	01/01/2025	14/11/2018	140.000	1.038,996258	1.165,032955	145.459.476,12	163.104.613,70	Mercado
NTN-F - Nota do Tesouro Nacional - Série F	01/01/2025	13/10/2017	60.000	1.049,132984	1.165,032955	62.947.979,04	69.901.977,30	Mercado
NTN-F - Nota do Tesouro Nacional - Série F	01/01/2027	20/05/2019	100.000	1.092,532528	1.196,294255	109.253.252,80	119.629.425,50	Mercado
NTN-F - Nota do Tesouro Nacional - Série F	01/01/2029	25/05/2019	50.000	1.094,981011	1.221,739228	54.749.050,55	61.086.961,40	Mercado
NTN-F - Nota do Tesouro Nacional - Série F	01/01/2029	01/08/2019	60.000	1.192,017651	1.221,739228	71.521.059,06	73.304.353,68	Mercado
NTN-F - Nota do Tesouro Nacional - Série F	01/01/2029	12/11/2019	10.000	1.254,155389	1.221,739228	12.541.553,89	12.217.392,28	Mercado

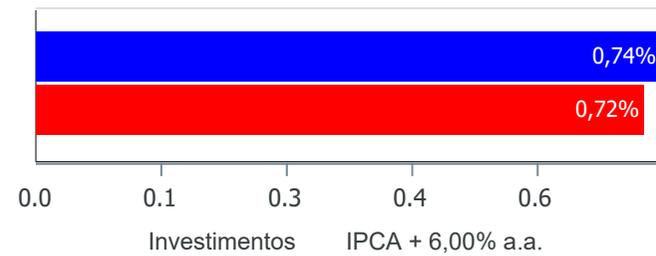
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Janeiro / 2020)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-F - Nota do Tesouro Nacional - Série F	01/01/2029	08/11/2019	140.000	1.257,994167	1.221,739228	176.119.183,38	171.043.491,92	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	2.632.923.382,27	697.509.577,57	691.667.390,65	2.658.338.535,94	19.572.966,75	19.572.966,75	0,74%	0,74%	0,72%	0,72%	102,87%	5,63%

Investimentos x Meta Atuarial



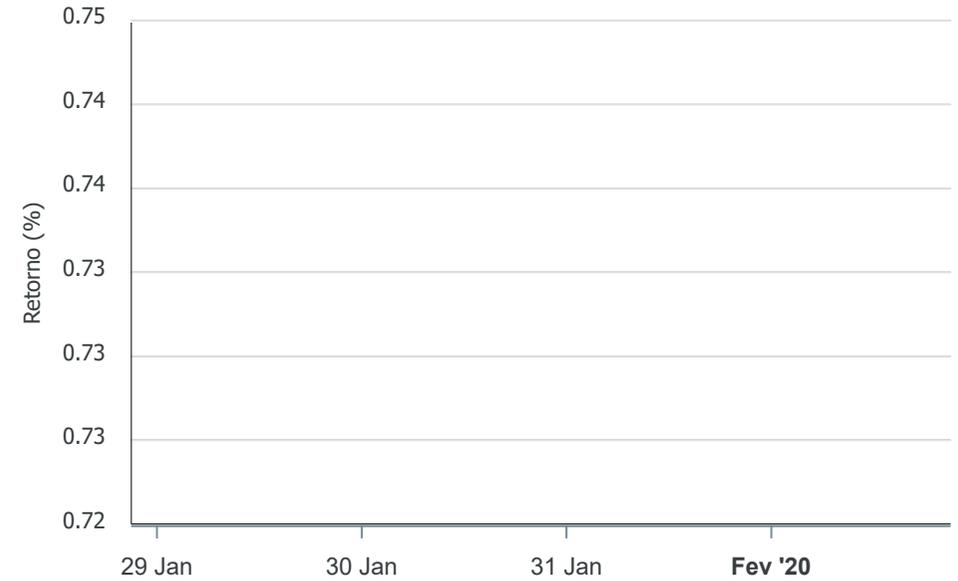
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
TÍTULOS PÚBLICOS	1.787.086.371,75	157.491.677,80	35.874.504,75	1.930.932.831,00	22.229.286,20	1,14%	-	-
MIRAE ASSET PRÉ FUNDO DE ÍNDICE RENDA FIXA - FIXA1...	12.452.826,15	0,00	0,00	12.572.853,39	120.027,24	0,96%	1,23%	1,08%
IT NOW ID ETF IMA-B FUNDO DE ÍNDICE - IMAB11	49.562.500,00	0,00	0,00	50.037.000,00	474.500,00	0,96%	0,24%	1,66%
BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	379.990,53	0,00	0,00	382.013,11	2.022,58	0,53%	0,53%	0,59%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	19.359.106,82	137.747.443,93	100.000.000,00	57.896.494,79	789.944,04	0,50%	0,46%	0,55%
BANRISUL ABSOLUTO FI RENDA FIXA LP	653.805,73	0,00	656.052,98	0,00	2.247,25	0,34%	0,36%	0,00%
BANRISUL FOCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	11.561.486,27	59.216.369,15	38.844.507,04	32.173.048,44	239.700,06	0,34%	0,42%	0,10%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	4.405.366,00	935.822,58	0,00	5.359.102,56	17.913,98	0,34%	0,35%	0,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	11.164.209,94	3.709.493,69	1.959.013,11	12.945.028,04	30.337,52	0,20%	0,29%	0,00%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	737.705,14	29.500.000,00	0,00	30.250.232,22	12.527,08	0,04%	0,37%	0,01%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	15.437.696,01	97.198.283,61	103.338.210,56	9.327.971,07	30.202,01	0,03%	0,30%	0,00%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	56.156.695,02	0,00	56.160.619,35	0,00	3.924,33	0,01%	0,05%	2,59%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	0,00	55.160.761,10	0,00	55.151.782,98	-8.978,12	-0,02%	0,38%	0,55%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	243.817.169,87	0,00	242.530.547,74	0,00	-1.286.622,13	-0,53%	-0,04%	2,62%
Total Renda Fixa	2.212.774.929,23	540.959.851,86	579.363.455,53	2.197.028.357,60	22.657.032,04	0,82%		0,61%

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
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇ...	13.550.363,57	0,00	0,00	13.825.011,52	274.647,95	2,03%	2,03%	6,60%
ISHARES BM&FBOVESPA SMALL CAP FUNDO DE ÍNDICE - SM...	59.478.279,00	0,00	0,00	59.978.828,00	500.549,00	0,84%	0,40%	9,29%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTI...	11.547.756,84	0,00	0,00	11.584.325,00	36.568,16	0,32%	0,32%	0,13%
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVA11	58.794.750,00	38.844.507,04	59.216.369,15	38.307.500,00	-115.387,89	-0,12%	-1,65%	9,94%
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES	0,00	20.000.000,00	0,00	19.928.640,59	-71.359,41	-0,36%	4,86%	9,01%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	30.980.278,64	0,00	0,00	30.551.973,04	-428.305,60	-1,38%	-1,38%	8,92%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	0,00	80.000.000,00	0,00	78.611.131,88	-1.388.868,12	-1,74%	3,17%	7,96%
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVV11	75.601.500,00	0,00	0,00	74.269.000,00	-1.332.500,00	-1,76%	-1,64%	9,95%
IT NOW IDIV FUNDO DE ÍNDICE - DIVO11	35.154.795,60	0,00	0,00	34.532.452,50	-622.343,10	-1,77%	-1,56%	7,87%
CAIXA PETROBRAS FI AÇÕES	55.904.200,57	0,00	54.303.611,59	0,00	-1.600.588,98	-2,86%	-5,24%	14,43%
AUSTRO INSTITUCIONAL PIPE BANCOS FIC AÇÕES	9.103.690,46	0,00	0,00	8.796.851,32	-306.839,14	-3,37%	-3,37%	5,38%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	0,00	20.000.000,00	0,00	19.252.931,17	-747.068,83	-3,74%	1,12%	8,13%
BB VALE FI AÇÕES	20.243.803,12	0,00	0,00	19.082.098,51	-1.161.704,61	-5,74%	-5,74%	15,85%
Total Renda Variável	370.359.417,80	158.844.507,04	113.519.980,74	408.720.743,53	-6.963.200,57	-1,68%		8,87%

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
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	59.950.609,40	0,00	0,00	63.858.642,62	3.908.033,22	6,52%	6,52%	5,77%
Total Renda Variável	59.950.609,40	0,00	0,00	63.858.642,62	3.908.033,22	6,52%		5,77%

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

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
LTN - Letra do Tesouro Nacional	01/01/2022	21/03/2018	80.000	727,418914	910,746404	58.193.513,12	72.859.712,32	Mercado
LTN - Letra do Tesouro Nacional	01/01/2022	09/04/2018	200.000	732,978346	910,746404	146.595.669,20	182.149.280,80	Mercado
LTN - Letra do Tesouro Nacional	01/07/2022	26/06/2019	120.000	825,383252	883,393315	99.045.990,24	106.007.197,80	Mercado
LTN - Letra do Tesouro Nacional	01/07/2023	14/06/2019	190.000	753,636224	826,105720	143.190.882,56	156.960.086,80	Mercado
LTN - Letra do Tesouro Nacional	01/01/2024	03/01/2020	200.000	787,45838900	797,376321	157.491.677,80	159.475.264,20	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2028	06/06/2019	20.000	3.820,891426	4.163,181846	76.417.828,52	83.263.636,92	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2028	06/06/2019	30.000	3.820,891426	4.163,181846	114.626.742,78	124.895.455,38	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2028	06/06/2019	20.000	3.820,891426	4.163,181846	76.417.828,52	83.263.636,92	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	14/06/2019	15.600	4.053,157947	4.403,167763	63.229.263,97	68.689.417,10	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2050	01/08/2019	5.000	4.685,088810	4.855,886996	23.425.444,05	24.279.434,98	Mercado
NTN-F - Nota do Tesouro Nacional - Série F	01/01/2023	10/10/2017	25.000	1.050,747229	1.124,398754	26.268.680,73	28.109.968,85	Mercado
NTN-F - Nota do Tesouro Nacional - Série F	01/01/2023	13/10/2017	50.000	1.052,640809	1.124,398754	52.632.040,45	56.219.937,70	Mercado
NTN-F - Nota do Tesouro Nacional - Série F	01/01/2023	17/10/2017	50.000	1.051,661907	1.124,398754	52.583.095,35	56.219.937,70	Mercado
NTN-F - Nota do Tesouro Nacional - Série F	01/01/2025	13/10/2017	60.000	1.049,132984	1.165,032955	62.947.979,04	69.901.977,30	Mercado
NTN-F - Nota do Tesouro Nacional - Série F	01/01/2025	14/11/2018	140.000	1.038,996258	1.165,032955	145.459.476,12	163.104.613,70	Mercado
NTN-F - Nota do Tesouro Nacional - Série F	01/01/2025	14/11/2018	50.000	1.037,699013	1.165,032955	51.884.950,65	58.251.647,75	Mercado
NTN-F - Nota do Tesouro Nacional - Série F	01/01/2027	20/05/2019	100.000	1.092,532528	1.196,294255	109.253.252,80	119.629.425,50	Mercado
NTN-F - Nota do Tesouro Nacional - Série F	01/01/2029	25/05/2019	50.000	1.094,981011	1.221,739228	54.749.050,55	61.086.961,40	Mercado
NTN-F - Nota do Tesouro Nacional - Série F	01/01/2029	01/08/2019	60.000	1.192,017651	1.221,739228	71.521.059,06	73.304.353,68	Mercado
NTN-F - Nota do Tesouro Nacional - Série F	01/01/2029	08/11/2019	140.000	1.257,994167	1.221,739228	176.119.183,38	171.043.491,92	Mercado

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

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-F - Nota do Tesouro Nacional - Série F	01/01/2029	12/11/2019	10.000	1.254,155389	1.221,739228	12.541.553,89	12.217.392,28	Mercado

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
TÍTULOS PÚBLICOS			1.930.932.831,00	72,91%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " a "
BANRISUL FOCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+1	Não há	32.173.048,44	1,21%	309	1,99%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	57.896.494,79	2,19%	969	0,66%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	D+1	Não há	382.013,11	0,01%	853	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	55.151.782,98	2,08%	888	0,80%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
IT NOW ID ETF IMA-B FUNDO DE ÍNDICE - IMAB11	D+0	Não há	50.037.000,00	1,89%	4.641	1,59%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " c "
MIRAE ASSET PRÉ FUNDO DE ÍNDICE RENDA FIXA - FIX...	D+2	Não há	12.572.853,39	0,47%	500	6,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " c "
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	5.105.757,39	0,19%	324	1,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	30.250.232,22	1,14%	684	0,57%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.425.719,67	0,05%	737	0,09%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVA11	D+3	Não há	38.307.500,00	1,45%	56.474	0,32%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "
ISHARES BM&FBOVESPA SMALL CAP FUNDO DE ÍNDICE - ...	D+3	Não há	59.978.828,00	2,26%	33.649	2,41%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVV11	D+3	Não há	74.269.000,00	2,80%	9.408	1,00%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	78.611.131,88	2,97%	2.823	9,96%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB VALE FI AÇÕES	D+4	Não há	19.082.098,51	0,72%	32.663	2,70%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	30.551.973,04	1,15%	418	7,14%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES	D+3 du	Não há	19.928.640,59	0,75%	30.974	2,98%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	19.252.931,17	0,73%	11.169	3,02%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC ...	D+34	Não há	13.825.011,52	0,52%	259	10,42%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "
IT NOW IDIV FUNDO DE ÍNDICE - DIVO11	D+3	Não há	34.532.452,50	1,30%	7.950	11,50%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MUL...	D+2	01/10/2020	11.584.325,00	0,44%	955	2,31%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	D+4	Não há	63.858.642,62	2,41%	74	8,01%	Artigo 9º - A, Inciso III
AUSTRO INSTITUCIONAL PIPE BANCOS FIC AÇÕES	D+31	0	8.796.851,32	0,33%	22	12,49%	Desenquadrado - RV
Total para cálculo dos limites da Resolução			2.648.507.119,14				