		Renda fixa				
Time de Ative	Enguadramenta	Alocação Atual - %	Limite Le	egislação	Limite do	Regras especificas
Tipo de Ativo	Enquadramento	Alocação Aluai - %	Com CI	Sem CI	Conjunto	Regras especificas
Títulos Públicos	Art. 7º, I, "a"	-	100%	100%		
Fundos 100% Títulos Públicos	Art. 7º, I, "b"	66,35%	100%	100%		15% do PL do fundo
Fundos de Índice 100% Títulos Públicos	Art. 7º, I, "c"	-	100%	100%		15% do PL do Idildo
Operações Compromissadas	Art. 7º, II	-	5%	5%		
Fundos Renda Fixa Referenciados	Art. 7º, III, "a"	-	70%	60%		
Fundos de Índice Renda Fixa Referenciados	Art. 7º, III, "b"	-	70%	60%	100%	15% do PL do fundo
Fundos de Renda Fixa	Art. 7º, IV, "a"	13,25%	50%	40%		13/8 do FE do Idildo
Fundos de Índice de Renda Fixa	Art. 7º, IV, "b"	-	50%	40%		
Letras Imobiliárias Garantidas	Art. 7º, V, "b"	-	20%	20%		
Cédula de Depósito Bancário	Art. 7º, VI, "a"	-	15%	15%		
Poupança	Art. 7º, VI, "b"	-	15%	15%		
Cota Sênior de FIDC	Art. 7º, VII, "a"	0,01%	10%	5%		
Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	Art. 7º, VII, "b"	-	15%	5%	25%	5% do PL do fundo
Fundo de Debêntures	Art. 7º, VII, "c"	-	10%	5%		
Total de Renda Fixa		79,61%	100%	100%	100%	
		Renda Variavel				
Tipo de Ativo	Enquadramento	Alocação Atual - %	Limite Legislação		Limite do	Regras especificas
Tipo de Alivo	Liiquuurumento	Alobagao Ataal 70	Com CI	Sem CI	Conjunto	riegius especificus
Fundos de Ações Referenciados	Art. 8º, I, "a"	1,12%	40%	30%		
Fundos de Índices Referenciados	Art. 8º, I, "b"	0,73%	40%	30%		15% do PL
Fundos de Ações	Art. 8º, II, "a"	14,12%	30%	20%		1070 001 2
Fundos de Índice de Ações	Art. 8º, II, "b"	-	30%	20%	40%	
Fundos Multimercados	Art. 8º, III	2,78%	10%	10%	4070	
Fundos de Participações	Art. 8º, IV, "a"	1,64%	5%	5%		5% do PL
Fundos de Investimentos Imobiliários	Art. 8º, IV, "b"	-	10%	5%		070 00 1 2
Fundos de Ações - Mercado de Acesso	Art. 8º, IV, "c"	-	5%	5%		
Total de Renda Variavel		20,39%	40%	40%	40%	
	Inves	timentos no exterior				
Tipo de Ativo	Enquadramento	Alocação Atual - %	Limite Le	egislação	Limite do	Regras especificas
<u> </u>			Com CI	Sem CI	Conjunto	
Renda Fixa - Dívida Externa	Art. 9ºA, I	-	10%	10%		
Fundos de Investimento no Exterior	Art. 9ºA, II	-	10%	10%	10,00%	
Ações - BDR Nível I	Art. 9º A, III	-	10%	10%		
Total Investimentos no Exterior		0,00%	10%	10%	10,00%	

Tipo de Ativo	Enquadramento	Limite Inferior	Alocação Objetivo	Alocação Atual	Limite Superior
Títulos Públicos	Art. 7º, I, "a"	0%	0%	-	20%
Fundos 100% Títulos Públicos	Art. 7º, I, "b"	0%	58,00%	66,35%	75%
Fundos de Índice 100% Títulos Públicos	Art. 7º, I, "c"	0%	0%	-	20%
Operações Compromissadas	Art. 7º, II	0%	0%	-	1%
Fundos Renda Fixa Referenciados	Art. 7º, III, "a"	0%	0%	-	1%
Fundos de Índice Renda Fixa Referenciados	Art. 7º, III, "b"	0%	0%	-	1%
Fundos de Renda Fixa	Art. 7º, IV, "a"	0%	15,00%	13,25%	40%
Fundos de Índice de Renda Fixa	Art. 7º, IV, "b"	0%	0%	-	1%
Letras Imobiliárias Garantidas	Art. 7º, V, "b"	0%	0%	-	1%
Cédula de Depósito Bancário	Art. 7º, VI, "a"	0%	0%	-	1%
Poupança	Art. 7º, VI, "b"	0%	0%	-	1%
Cota Sênior de FIDC	Art. 7º, VII, "a"	0%	0%	0,01%	2%
Fundos Renda Fixa "Crédito Privado"	Art. 7º, VII, "b"	0%	0%	-	5%
Fundo de Debêntures	Art. 7º, VII, "c"	0%	0%	-	1%
Total			73%	79,61%	

Tipo de Ativo	Enquadramento	Limite Inferior	Alocação Objetivo	Alocação Atual	Limite Superior
Fundos de Ações Referenciados	Art. 8º, I, "a"	0%	0%	1,12%	10%
Fundos de Índices Referenciados	Art. 8º, I, "b"	0%	3,00%	0,73%	10%
Fundos de Ações	Art. 8º, II, "a"	0%	18,50%	14,12%	20%
Fundos de Índice de Ações	Art. 8º, II, "b"	0%	0%	-	2%
Fundos Multimercados	Art. 8º, III	0%	3,00%	2,78%	10%
Fundos de Participações	Art. 8º, IV, "a"	0%	1,50%	1,64%	2%
Fundos de Investimentos Imobiliários	Art. 8º, IV, "b"	0%	0%	-	5%
Fundos de Ações - Mercado de Acesso	Art. 8º, IV, "c"	0%	0%	-	1%
Total			26%	20,39%	

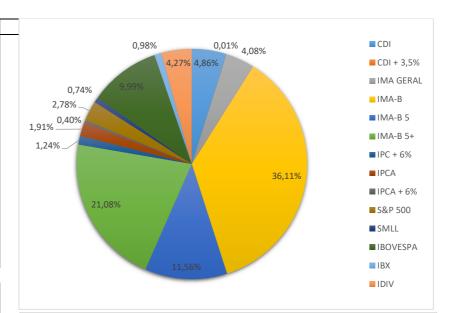
Tipo de Ativo	Enquadramento	Limite Inferior	Alocação Objetivo	Alocação Atual	Limite Superior
Renda Fixa - Dívida Externa	Art. 9ºA, I	0%	0%	-	1%
Fundos de Investimento no Exterior	Art. 9ºA, II	0%	0,50%	-	5%
Ações - BDR Nível I	Art. 9º A, III	0%	0,50%	-	5%
Total			1%	0,00%	

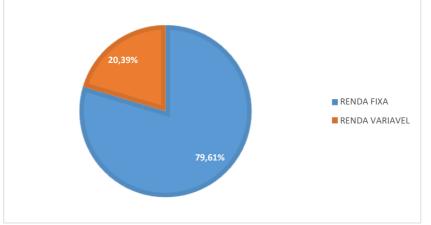
			investido /	Total investido /	
Art. 7º, I, "b"	Total Investido pelo IPMJ	PL do Fundo	PL do	Total da	Status
			Fundo	Carteira	
FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RF LONGO PRAZO	79.565.283,71	5.890.819.394,91	1,35%	14,88%	OK
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TP RF LONGO PRAZO FI CAIXA BRASIL IMA-B5 TP RF LONGO PRAZO	21.814.587,23	1.326.400.859,08	1,64% 0,09%	4,08% 1,54%	OK OK
FI CAIXA BRASIL IMA-B5 1P RF LONGO PRAZO  FI CAIXA BRASIL IMA-B5+ TP RF LONGO PRAZO	8.236.300,19 48.595.419,76	9.363.308.744,85 1.935.373.241,51	2,51%	9,09%	OK
FIC CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	10.214.229,46	11.020.077.699,37	0,09%	1,91%	OK
SUL AMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA	68.664.583,70	1.326.400.110,95	5,18%	12,84%	OK
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5 LP FIC FI	38.177.995,57	4.397.326.460,64	0,87%	7,14%	OK
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5+ TP FI	64.160.018,67	1.940.264.057,52	3,31%	12,00%	OK
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO	15.409.557,74	620.106.851,00	2,48%	2,88%	OK
Subtotal	354.837.976,03		Total	66,35%	
Art. 7º, IV, "a"	Total Investido pelo IPMJ	PL do Fundo	investido / PL do Fundo	Total investido / Total da Carteira	Status
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI	3.665.796,12	5.019.962.419,71	0,07%	0,69%	OK
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI (T.A)	10.901.603,46	5.019.962.419,71	0,22%	2,04%	OK
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FI	44.897.314,50	1.522.221.858,52	2,95%	8,39%	OK
BB PREVIDENCIARIO PERFIL RF LP REFERENCIADO DI SANTANDER ATIVO RENDA FIXA FIC	0,00 5.446.185,95	2.725.355.805,79 877.373.790,60	0,00%	1,02%	OK OK
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	1.795.193,92	3.385.573.184,27	0,05%	0,34%	OK
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI (T.A)	4.182.349,38	3.385.573.184,27	0,12%	0,78%	OK
Subtotal	70.888.443,33	0.000.070.101,27	0,1270	13,25%	- Oit
Art. 7º, VII, "a"	Total Investido pelo IPMJ	PL do Fundo	Total investido / PL do Fundo	Total investido / Total da Carteira	Status
FIDC FECHADO MULTISETORIAL MASTER III	29.013,06	1.003.618,68	2,89%	0,01%	OK
Subtotal	29.013,06			0,01%	
Art. 8º, I, "a"	Total Investido pelo IPMJ	PL do Fundo	Total investido / PL do Fundo	Total investido / Total da Carteira	Status
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	6.013.229,41	577.164.782,78	1,04%	1,12%	OK
Subtotal	6.013.229,41			1,12%	
Art. 8º, I, "b"	Total Investido pelo IPMJ	PL do Fundo	Total investido / PL do Fundo	Total investido / Total da Carteira	Status
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVV11	3.907.629,00	6.413.247.065,49	0,06%	0,73%	OK
Subtotal  Art. 8º, II, "a"	3.907.629,00  Total Investido pelo IPMJ	PL do Fundo	Total investido / PL do Fundo	0,73%  Total investido / Total da Carteira	Status
OCCAM FIC DE FI AÇÕES SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	3.463.182,13 5.746.960,80	487.274.088,21	0,71% 0,74%	0,65% 1,07%	OK OK
BNP PARIBAS SMALL CAPS FIA	3.945.336,44	778.576.947,68 467.606.855,85	0,74%	0,74%	OK
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC FI	8.264.472,53	2.717.755.336,40	0,30%	1,55%	OK
BRADESCO FIC FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	5.232.709,72	156.581.962,53	3,34%	0,98%	OK
BRADESCO FI AÇÕES SELECTION	3.851.383,52	557.582.118,41	0,69%	0,72%	OK
NAVI INSTITUCIONAL FI EM AÇÕES	22.206.917,39	792.607.115,72	2,80%	4,15%	OK
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	22.819.472,49	1.330.411.885,84	1,72%	4,27%	OK
Subtotal	75.530.435,01		Total	14,12%	
Art. 8º, III	Total Investido pelo IPMJ	PL do Fundo	investido / PL do Fundo	Total investido / Total da Carteira	Status
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	14.850.334,13	659.959.524,67	2,25%	2,78%	OK
Subtotal  Art. 8°, IV, "a"	14.850.334,13  Total Investido pelo IPMJ	PL do Fundo	Total investido / PL do Fundo	2,78%  Total investido /  Total da  Carteira	Status
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FIC FIP	2.138.608,92	351.108.022,56	0,61%	0,40%	OK
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I	6.634.706,38	211.647.127,49	3,13%	1,24%	OK
Subtotal	8.773.315,31	i	1	1,64%	

Retorno						
Nome	no trimestre - diária	no ano - diária	nos últimos 6 meses - diária		nos últimos 24 meses - diária	Retorno do Fundo / Meta atuarial - nos
	03/02/2020 até	02/01/2020 até	30/08/2019 até	28/02/2019 até	28/02/2018 até	últimos 12 meses
	28/02/2020	28/02/2020	28/02/2020	28/02/2020	28/02/2020	
DD TMA D ET DENDA ETVA DDEVIDENCTÁDIO	IMA-B	6 500/	2.000/	0.210/	22.200/	86,86%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO  CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-6,50%	-6,50%	-3,88%	8,21% 8,21%	23,30% 23,36%	86,90%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	-6,46% -7,37%	-6,46% -7,37%	-3,94% -4,35%	7,34%	23,50%	77,73%
IMA-B	-6,97%	-6,31%	-3,64%	8,68%	24,10%	77,7370
III U	IMA-B5	0,3170	3,0476	0,0070	24,1070	
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	-0,60%	-0,60%	1,92%	8,85%	18,91%	93,68%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,64%	-0,64%	1,86%	8,76%	18,84%	92,69%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	-0,46%	-0,46%	2,37%	11,23%	23,22%	118,84%
IMA-B 5	-1,75%	-0,57%	2,03%	9,07%	19,39%	,
	IMA-B5+	<u> </u>	<u> </u>		<u> </u>	<u> </u>
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-10,58%	-10,58%	-7,80%	7,58%	26,53%	80,22%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-10,68%	-10,68%	-8,13%	7,17%	25,87%	75,87%
IMA-B 5+	-10,93%	-10,62%	-7,92%	7,65%	26,94%	
	IMA-GERAL					
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,06%	-1,06%	0,76%	7,83%	17,87%	82,87%
IMA Geral	-1,98%	-0,99%	0,89%	8,22%	18,79%	
	IPCA					
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	1,31%	1,31%	3,13%	12,99%	23,65%	137,50%
IPCA	0,07%	0,53%	2,31%	3,25%	8,03%	
	IPCA + 6%					
PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FICFIP	-0,44%	-0,44%	-38,70%	-39,03%	-	-413,10%
IPCA + 6%	0,58%	1,98%	5,33%	9,44%	21,38%	
	IPC + 6%					
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I MULTIESTRATÉGIA FIP						#VALOR!
IPC-FIPE + 6%	0,70%	1,10%	2,91%	3,80%	8,65%	
	CDI					
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,58%	0,58%	1,69%	4,76%	11,43%	50,39%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,13%	1,13%	2,34%	9,55%	18,58%	101,11%
BB PREVIDENCIARIO PERFIL RF LP REFERENCIADO DI	0,59%	0,59%	1,74%	4,76%	11,34%	50,41%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,70%	0,70%	3,07%	10,68%	16,52%	113,06%
CDI	0,34%	1,01%	2,26%	5,39%	12,12%	
	CDI + 3,5%					
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR						#VALOR!
CDI + 3,5%	0,64%	1,87%	4,04%	9,07%	20,11%	
	IBOV					
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	-39,89%	-39,89%	-34,30%	-26,96%	-17,46%	-285,34%
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVV11	-36,85%	-36,85%	-30,24%	-23,42%	-14,26%	-247,85%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-39,18%	-39,18%	-31,38%	-17,57%	-4,42%	-185,99%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	-36,25%	-36,25%	-28,08%	-19,92%	-9,77%	-210,83%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-33,94%	-33,94%	-25,53%	-15,48%	5,24%	-163,88%
OCCAM FIC AÇÕES	-33,33%	-33,33%	-28,56%	-15,88%	-4,48%	-168,08%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	-42,92%	-42,92%	-35,29%	-24,16%	-9,17%	-255,74%
Ibovespa	-29,90%	-36,86%	-30,29%	-23,45%	-14,46%	
~	IBX		1			
BRADESCO INSTITUCIONAL IBRX ALPHA FIC AÇÕES	-36,29%	-36,29%	-29,30%	-20,29%	-9,56%	-214,73%
IBX	-30,09%	-36,64%	-29,86%	-22,20%	-12,35%	
	IDIV					
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	-33,99%	-33,99%	-27,38%	-14,28%	1,70%	-151,10%
IDIV	-25,53%	-31,24%	-21,42%	-7,65%	4,87%	
~	SMLL					
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	-43,18%	-43,18%	-31,25%	-16,98%	-10,58%	-179,69%
SMLL	-35,07%	-40,17%	-27,52%	-12,53%	-1,62%	
	S&P 500					
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	-21,20%	-21,20%	-14,24%	-9,14%	2,65%	-96,74%
S&P 500	1,10%	3,18%	8,39%	20,26%	53,08%	
*****		4.6		0.7=	84 555	400
INPC + 6%	0,69%	1,99%	5,38%	9,45%	21,50%	100,00%

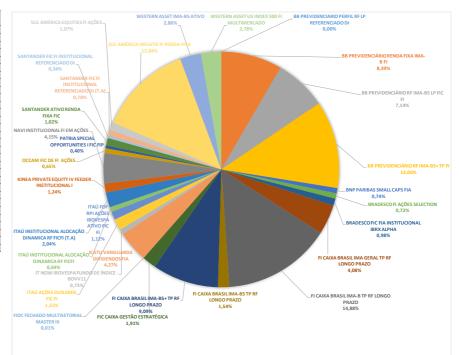
CDI	25.991.128,83
CDI + 3,5%	29.013,06
IMA GERAL	21.814.587,23
IMA-B	193.127.181,91
IMA-B 5	61.823.853,50
IMA-B 5+	112.755.438,43
IPC + 6%	6.634.706,38
IPCA	10.214.229,46
IPCA + 6%	2.138.608,92
S&P 500	14.850.334,13
SMLL	3.945.336,44
IBOVESPA	53.453.774,77
IBX	5.232.709,72
IDIV	22.819.472,49
TOTAL	534.830.375,28

TOTAL	534.830.375,28
RENDA VARIAVEL	109.074.942,86
RENDA FIXA	425.755.432,42

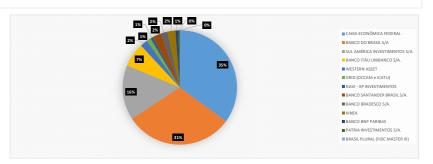




FUNDO	R\$ DO IPMJ
BB PREVIDENCIARIO PERFIL RF LP REFERENCIADO DI	
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FI	44.897.314,5
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5 LP FIC FI	38.177.995,5
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5+ TP FI	64.160.018,6
BNP PARIBAS SMALL CAPS FIA	3.945.336,4
BRADESCO FI AÇÕES SELECTION	3.851.383,5
BRADESCO FIC FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	5.232.709,7
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TP RF LONGO PRAZO	21.814.587,2
FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RF LONGO PRAZO	79.565.283,7
FI CAIXA BRASIL IMA-B5 TP RF LONGO PRAZO	8.236.300,:
FI CAIXA BRASIL IMA-B5+ TP RF LONGO PRAZO	48.595.419,7
FIC CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	10.214.229,
FIDC FECHADO MULTISETORIAL MASTER III	29.013,
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	22.819.472,4
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVV11	3.907.629,
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC FI	8.264.472,
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	6.013.229,4
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI	3.665.796,
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI (T.A)	10.901.603,
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I	6.634.706,
NAVI INSTITUCIONAL FI EM AÇÕES	22.206.917,
OCCAM FIC DE FI AÇÕES	3.463.182,
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FIC FIP	2.138.608,9
SANTANDER ATIVO RENDA FIXA FIC	5.446.185,9
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	1.795.193,9
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI (T.A)	4.182.349,
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	5.746.960,8
SUL AMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA	68.664.583,
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO	15.409.557,
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	14.850.334,3



INSTITUIÇÃO	R\$	%
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	168.425.820,34	35,09%
BANCO DO BRASIL S/A	147.235.328,74	30,67%
SUL AMÉRICA INVESTIMENTOS S/A.	74.411.544,51	15,50%
BANCO ITÁU UNIBANCO S/A.	32.752.730,52	6,82%
WESTERN ASSET	9.929.310,18	2,07%
GRID (OCCAM e ICATU)	6.046.237,92	1,26%
NAVI - XP INVESTIMENTOS	3.463.182,13	0,72%
BANCO SANTANDER BRASIL S/A.	11.724.504,10	2,44%
BANCO BRADESCO S/A.	9.084.093,23	
KINEA	10.901.603,46	2,27%
BANCO BNP PARIBAS	3.851.383,52	0,80%
PATRIA INVESTIMENTOS S/A.	2.138.608,92	0,45%
BRASIL PLURAL (FIDC MASTER III)	29.013,06	0,01%
TOTAL	479.993.360.64	100.00%



	Sharpe - CDI						
	no trimestre - diária		nos últimos 6 meses - diária	nos últimos 12 meses - diáris	nos últimos 2 meses - diári		
	IMA-8						
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-2.27	-1.40	-0.75	0.29	0.58		
CAIXA BRASIL IMA-B TÎTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-2.34	-1.38	-0.75	0.29	0.58		
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FINA LP	-2.27	-1.57	-0.91	0.22	0.60		
IMA-9	-2.21	-1.36	-0.72	0.33	0.62		
****	IMA-85						
BB IMA-B S FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRDO LP	-1.65	-0.73	-0.08	0.73	0.79		
CAIXA BRASIL IMA-B S TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1.65	-0.74	-0.10	0.71	0.77		
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATTVO FI RENDA FIXA	4.0	-0.32	0.07	0.73	0.76		
IMA-8 S	-1.62	-0.71	-0.04	0.77	0.93		
	IMA-85+						
BB IMA-B S+ TÎTULOS PÚBLICOS FI RENDA FEXA PREVIDENCIÁRIO	-2.30	-1.40	-0.79	0.21	0.52		
CAZKA BRASIL IMA-B S+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-2.29	-1.60	-0.91	0.18	0.50		
29A-9.5+	-2.29	-1.39	-0.79	0.21	0.53		
	IMA-GERAL						
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1.70	-0.00	-0.43	0.51	0.65		
IMA Geral	-1.76	-0.00	-0.40	0.60	0.77		
	IPCA				9211		
CADKA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	-0.36	0.17	0.28	1.34	1.13		
1974	-29204639709500.30	-27.98	0.30	.0.52	-2.05		
	IPCA + 6%	21,772		,,,,,	1,000		
PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNETIES I FICEIP	-9502-16	-4716.61	-1.52	-1.17	-0.92		
1PCA + 6%	25369482808316.50	56.00	20.92	15.69	15.03		
201100	CDI				11,117		
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FEXA REFERENCIADO DE	-10.63	.576	-5.01	-1.33	-2.20		
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.64	1.06	0.45	2.94	1.73		
BB PREVIDENCIARIO PERFIL RF LP REFERENCIADO DI	-11.25	-6.56	-5.37	-2.77	-2.96		
SANTANDER ATTVO FIC RENDA FIXA	-1.57	-1.19	1.33	2.32	0.91		
CRI	0.00	0.00	0.00	0.00	0.00		
	CDI+3.5%						
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÉMICR							
CDI + 1.5%	225.49	229.73	113.00	63.10	70.41		
	IBOV						
BRADESCO SELECTION FLACÕES	-3.03	-2.43	-1.39	-0.71	-0.31		
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÎNDICE - BOVVII	-2.75	-2.15	-1.14	-0.59	-0.25		
ITAÚ DUNAMIS FIC ACÔES	-2.21	-2.51	-1.29	-0.45	-0.10		
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC ACÕES	-2.95	-2.11	-1.04	-0.49	-0.19		
NAVI INSTITUCIONAL FIC ACÕES	-2.52	-1.95	-0.93	-0.37	0.05		
OCCAM FIC ACÕES	-2.72	-2.06	-1.17	-0.40	-0.11		
SULAMÉRICA EQUETIES FLACÕES	-3.60	-2.44	-1.29	-0.55	-0.14		
Iboverpa	-2.75	-2.15	-1.15	-0.59	-0.25		
	IBX						
BRADESCO INSTITUCIONAL IBRX ALPHA FIC ACÕES	-2.67	-2.14	-1.12	-0.51	-0.17		
TRY	-2.60	-2.15	-1.14	-0.56	-0.22		
	IDW						
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI ACÕES	-2.34	-2.39	-1.26	-0.43	-0.04		
IDIV	-3.03	-2.28	-0.99	-0.24	0.02		
	SMLL						
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI ACÕES	-2.59	-2.60	-1.13	-0.36	-0.19		
SMLL	-3.27	-2.29	-0.92	-0.23	-0.03		
	S&P 500						
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	-1.80	-1.60	-0.72	-0.27	-0.09		
SBP 500	0.48	0.42	0.50	0.62	0.77		
		7.0					
THISC + CH	2004145250100120	403.60	10.50	11.00	43.60		

	VaR					
	no trimestre - diária	no ano - diária	nos últimos 6 meses - diária	nos últimos 12 meses - diária	nos últimos 2- meses - diário	
	IMA-B				_	
88 IMA-9 FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	16.53%	9,90%	7,14%	5.26%	4.21%	
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FE RENDA FIXA LP	16,65%	9,97%	7,19%	5.30%	4.24%	
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	16,70%	9,99%	7,16%	5,24%	4,16%	
DMA-B	16,55%	9,91%	7,15%	5,27%	4,22%	
	IMA-85					
BB IMA-B 5 FIC RENDA FEXA PREVEDENCIÁREO LP	6,79%	4,04%	2,90%	2,16%	1,04%	
CADA BRASIL IMA-B 5 TÎTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	6,90%	4,05%	2,91%	2,17%	1,05%	
WESTERN ASSET IMA-B S ATIVO FI RENDA FIXA	11,97%	7,12%	5,09%	3,73%	3,10%	
3MA-0 5	6,80%	4,05%	2,91%	2,17%	1,04%	
	IMA-85+					
BB IMA-B S+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	25,25%	15,12%	10,89%	7,99%	6,35%	
CADKA BRASIL IMA-B S+ TÎTULOS PÜBLICOS FI RENDA FEKA LP IMA-B S+	25,40%	15,21%	10,96%	8,03%	6,37%	
	IMA-GERAL	15,21%	10,96%	9,07%	5,27%	
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.16%	4.27%	3.06%	2.26%	1.02%	
IMA Geral	6,95%	4,15%	2,99%	2,20%	1,92%	
INCORA.	IPCA	7,177	2,000	2,20%	2,43%	
CADA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	7.65%	4.53%	3.24%	2.52%	2,10%	
IPCA	0.00%	0.03%	0.13%	0.11%	0.12%	
	IPCA + 6%					
PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FICFIP	0.00%	0.00%	25.70%	19,17%	12.87%	
IPCA + 6/6	0.00%	0.03%	0.12%	0.11%	0.12%	
	CDI				•	
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,21%	0,14%	0,11%	0,09%	0,06%	
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,36%	0,22%	0,15%	0,63%	0,77%	
BB PREVIDENCIARIO PERFIL RF LP REFERENCIADO DI	0,19%	0,12%	0,09%	0,07%	0,06%	
SANTANDER ATTVO FIC RENDA FIXA	0,94%	0,50%	0,56%	1,01%	1,02%	
CDG	0,01%	0,01%	0,01%	0,03%	0,02%	
	CDI + 3,5%					
MASTER III FEDC MULTISSETORIAL SÉNIOR						
CDI + 3,5%	0,01%	0,01%	0,01%	0,03%	0,02%	
BRADESCO SELECTION FI ACÔES	IBOV					
ERADESCO SELECTION FI AÇUES IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÎNDICE - BOVV11	57,04% 57,94%	35,49% 35,70%	25,43%	19,97%	15,28%	
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE INDICE - BOVV11 ITAÚ DUNAMIS FIC ACÔES	57,94%	35,70%	25,57%	19,00%	15,42%	
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC ACÕES	57,80%	35,56%	25,43%	18,79%	14,59%	
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	57,35%	35,34%	25,16%	18,57%	14,67%	
OCCAM FIC ACÕES	52,79%	22,14%	23,80%	17,99%	14,54%	
SULAMÉRICA EQUITIES FI ACÕES	62,30%	39,39%	27,53%	20,26%	15,88%	
Doversa	57,92%	25,69%	25,57%	18,99%	15,42%	
annaps .	IRX		E-1/4-1-10	10,77.5	237.2.13	
BRADESCO INSTITUCIONAL IBRX ALPHA FIC ACÕES	57.14%	15.25%	25.23%	18.72%	15.11%	
18X	57,57%	35.47%	25.39%	19.92%	15.23%	
	IDW					
ICATU VANGUARDA DEVIDENDOS FI AÇÕES	49,32%	20,32%	21,74%	16,15%	12,91%	
100/	46,07%	29,61%	20,62%	15,55%	13,03%	
	SMIL					
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	59,04%	36,83%	26,46%	19,56%	15,45%	
SMLL	60,07%	27,32%	26,78%	19,90%	15,54%	
	S&P 500					
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	41,01%	25,61%	19,26%	13,75%	10,80%	
SAP 500	37,45%	23,37%	16,88%	12,82%	11,32%	
	1					
INPC + 6%	0,00%	0,00%	0,14%	0,12%	0,14%	

			Volstifidade				
Nome	no trimestre - diária	no ano - diáris	nos últimos 6 meses - diária	nos últimos 12 meses - diária	nos último 24 meses diária		
IMA-B							
EG IMA-G FI RENDA FEXA PREVIDENCIÁRIO	34,81%	20,85%	15,04%	11,00%	8,87%		
CATKA BRASIL IMA-B TÎTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	35,07%	21,01%	15,15%	11,16%	8,93%		
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	35,16%	21,02%	15,00%	11,03%	8,75%		
3MA-B	34,86%	20,89%	15,05%	11,09%	8,89%		
IMA-85							
BB IMA-B S FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRDO LP	14,27%	9,50%	6,11%	4,55%	3,87%		
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÎTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	14,33%	9,54%	6,14%	4,52%	3,89%		
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	25,21%	14,99%	10,73%	7,05%	6,52%		
IMA-0 S	14,32%	9,53%	6,13%	4,52%	3,89%		
	IMA-85+						
BB IMA-B S+ TÎTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	53,18%	21,85%	22,94%	16,81%	13,37%		
CAIXA BRASIL IMA-B S+ TÎTULOS PÜBLICOS FI RENDA FIXA LP	53,49%	32,03%	23,09%	16,91%	13,42%		
IMA-0 S+	53,49%	32,04%	23,09%	16,91%	13,45%		
	MA-GERAL			_			
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	15,08%	8,99%	6,45%	4,75%	3,94%		
IMA Geral	14,64%	9,73%	6,27%	4,62%	3,85%		
IPCA							
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	16,11%	9,55%	6,83%	5,32%	4,43%		
IPCA	0,00%	0,07%	0,29%	0,24%	0,26%		
	PCA + 6%						
PÁTRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FICFIP	0,00%	0,00%	54,13%	19,27%	27,10%		
IPCA + 6%	0,00%	0,07%	0,29%	0,24%	0,26%		
	CDI						
SANTANDER INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DE	0,44%	0,30%	0,22%	0,19%	0,14%		
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,77%	0,45%	0,32%	1,32%	1,63%		
BB PREVIDENCIARIO PERFIL RF LP REFERENCIADO DI	0,39%	0,26%	0,19%	0,16%	0,12%		
SANTANDER ATTIVO FIC RENDA FIXA	1,79%	1,06%	1,19%	2,12%	2,15%		
CDE	0,02%	0,02%	0,03%	0,05%	0,05%		
	D0 + 3,5%						
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÉNIOR							
CDI + 3,5%	0,02%	0,02%	0,03%	0,05%	0,05%		
	IBOV						
ERADESCO SELECTION FI AÇÕES	120,12%	74,74%	53,56%	39,95%	32,19%		
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÎNDOCE - BOVV11	122,02%	75,18%	53,85%	40,00%	32,47%		
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	115,93%	71,59%	51,26%	39,21%	30,72%		
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AQÕES	121,73%	74,99%	53,55%	19,57%	31,52%		
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	120,78%	74,21%	52,99%	39,10%	30,90%		
OCCAM FIC AQUES	111,18%	69,79%	50,12%	27,69%	30,63%		
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	131,21%		57,97%	42,66%	33,44%		
Ibovespa	122,00%	75,17%	53,45%	40,00%	32,47%		
BRADESCO INSTITUCIONAL IBRY ALPHA FIC ACÕES	120.34%	74,24%	53.12%	19.42%	21.92%		
BRADESCO INSTITUCIONAL IBRX ALPHA FIC AÇDES	120,34%	74,24%	53,13%	39,42% 39,64%	32,07%		
mx .	121,24% IDIV	74,70%	52,47%	29,64%	32,07%		
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI ACÕES	104.00%	63.87%	45.79%	24.00%	27,19%		
ICATU YANGUARDA DOVIDENDOS FI AÇOES	97,03%	60,26%	45,79%	24,00% 32,75%	27,19%		
100/	97,03% SMIT	60,26%	42,42%	22,75%	27,45%		
		77 52%	55.71%	41.70%	12 54%		
BNP PARIBAS SHALL CAPS IT AÇÕES	124,34%						
SMLL	126,51% S&P 500	79,62%	56,41%	41,69%	32,72%		
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	58-P 500 86-37%	53,92%	28.46%	28.96%	22.74%		
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO SAP 500	79,97%	49,21%	39,46% 35,55%	26,99%	22,74%		
58F 500	79,97%	49,21%	15,55%	25,99%	23,94%		

FUNDO	APLICAÇÕES	RESTAGES	APRs
FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RF LONGO PRAZO		30.000.000,00	50
FI CAIXA BRASIL IMA GERAL TP RF LONGO PRAZO			
FI CAIXA BRASIL IMA-B5 TP RF LONGO PRAZO			
FI CAIXA BRASIL IMA-B5+ TP RF LONGO PRAZO	30.000.000,00		51
FIC CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA			
SUL AMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA			
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5 LP FIC FI		50.000.000,00	52
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5+ TP FI	50.000.000,00		53
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO			
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI			
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI (T.A)	1.922.246,95		25
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FI	1.223.369,59		03, 34, 38, 62
BB PREVIDENCIARIO PERFIL RF LP REFERENCIADO DI	417.030,51	417.085,42	32,33
SANTANDER ATIVO RENDA FIXA FIC			
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	16.159.200,00	19.315.452,19	02, 05, 08, 11, 12, 13, 16, 17, 20, 21, 27, 28, 29, 30, 35, 36, 41, 45, 46, 48, 54, 56, 60, 64, 65, 67, 75, 77, 79, 81
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI (T.A)	4.683.667,25	195.000,00	23, 26, 31, 37, 39, 40, 42, 43, 44, 47, 49, 55
FIDC FECHADO MULTISETORIAL MASTER III			
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI			
OCCAM FIC DE FI AÇÕES			
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES			
BNP PARIBAS SMALL CAPS FIA			
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC FI			
BRADESCO FIC FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA			
BRADESCO FI AÇÕES SELECTION			
NAVI INSTITUCIONAL FI EM AÇÕES			
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA		6.000.000,00	18
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	6.000.000,00		19
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FIC FIP			
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I	584.562,00		74
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVV11			