CARTEIRA DE INVESTIMENTOS

Posição 31/12/2020

CDI ACUMULADO NO MÊS / ANO :	**0,16%**	**2,76%**
DESEMPENHO DOS FUNDOS NO MÊS / ANO :	**5,04%**	**1,004%**
META ATUARIAL ACUMULADA NO MÊS / ANO :	**2,24%**	**12,44%**

META MÊS 225,2% **META ANO** 8,07%

BANCO / FUNDO	R$	% PATRIMÔNIO	LIMITE Resolução 3922 de 25/11/10	Política Investimentos 2020		Rendimento do fundo		BENCHMARK FUNDO X CDI		BENCHMARK FUNDO X META		VaR	Índice de Sharpe
				ALVO	MÁXIMO	% Mês	% Ano	% Mês	% Ano	% Mês	% Ano	Mês	Ano
FI CAIXA BRASIL IMA-B TP RF LONGO PRAZO	90.220.493,25	14,35%	**Art. 7º I b 100%**	**52%**	**75%**	4,84	6,06	2943,38	219,37	216,22	48,72	2,93%	14,20
FI CAIXA BRASIL IMA-B5 TP RF LONGO PRAZO	19.011.694,88	3,02%	**53,72%**			1,82	7,75	1106,58	280,35	81,29	62,27	0,80%	22,89
FI CAIXA BRASIL IMA-B5+ TP RF LONGO PRAZO	25.514.755,81	4,06%				7,56	5,23	4598,90	189,38	337,83	42,06	4,85%	12,78
FIC CAIXA GESTÃO ESTRATÉGICA	31.824.724,80	5,06%				1,32	6,66	803,07	241,18	58,99	53,57	0,71%	19,61
SUL AMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA	64.535.453,08	10,26%				4,58	4,97	2787,94	179,87	204,80	39,95	3,02%	12,13
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5 LP FIC FI	61.557.420,53	9,79%				1,81	7,78	1098,73	281,57	80,71	62,54	0,81%	22,84
BB PREVIDENCIÁRIO RF IMA-B5+ TP FI	28.075.299,57	4,46%				7,47	5,06	4545,19	183,14	333,88	40,68	4,82%	12,73
WESTERN ASSET IMA-B5 ATIVO	17.056.649,02	2,71%				3,24	10,18	1972,15	368,56	144,87	81,86	1,77%	20,02
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI	0,00	0,00%	**Art. 7º IV a 40%**	**14%**	**40%**	0,20	2,86	122,93	103,56	9,03	23,00	0,01%	2,53
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINAMICA RF FICFI (T.A)	11.088.160,49	1,76%	**12,51%**			0,20	2,86	122,93	103,56	9,03	23,00	0,01%	2,53
BB PREVIDENCIÁRIO RENDA FIXA IMA-B FI	50.856.868,69	8,09%				4,81	5,91	2923,00	214,04	214,72	47,54	2,96%	13,84
SANTANDER ATIVO RENDA FIXA FIC	13.619.563,45	2,17%				0,61	2,70	371,71	97,73	27,30	21,71	0,25%	15,49
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI	942.109,72	0,15%				0,27	2,10	166,02	75,89	12,20	16,86	0,01%	59,63
SANTANDER FIC FI INSTITUCIONAL REFERENCIADO DI (T.A)	2.164.700,95	0,34%				0,27	2,10	166,02	75,89	12,20	16,86	0,01%	59,63
FIDC FECHADO MULTISETORIAL MASTER III	59.347,29	0,01%	**Art. 7º VII a 5%**	**0,50%**	**2%**	-8,25	-7,87	-5014,29	2641,76	-368,34	586,75	-	-
ITAÚ FOF RPI AÇÕES IBOVESPA ATIVO FIC FI	0,00	0,00%	**Art. 8º II a 20%**	**18,50%**	**20%**	8,37	2,14	5086,95	77,55	373,68	17,22	5,22%	12,76
OCCAM FIC DE FI AÇÕES	5.603.319,37	0,89%	**18,76%**			10,11	7,87	6147,14	284,66	451,56	63,22	7,60%	10,88
SUL AMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	8.802.001,77	1,40%				7,70	-12,57	4679,93	-455,03	343,78	-101,06	7,25%	10,06
BNP PARIBAS SMALL CAPS FIA	6.759.902,19	1,07%				8,50	-2,65	5171,26	-95,89	379,87	-21,30	5,96%	13,96
ITAÚ AÇÕES DUNAMIS FIC FI	12.925.126,79	2,06%				6,30	-4,87	3828,07	-176,37	281,20	-39,17	6,23%	3,22
BRADESCO FIC FIA INSTITUCIONAL IBRX ALPHA	8.593.606,84	1,37%				9,43	4,62	5733,04	167,36	421,14	37,17	6,38%	12,19
BRADESCO FI AÇÕES SELECTION	6.172.242,51	0,98%				7,90	-3,67	4806,43	-132,90	353,07	-29,52	6,27%	9,29
NAVI INSTITUCIONAL FI EM AÇÕES	34.755.245,97	5,53%				11,35	3,38	6904,60	122,37	507,20	27,18	7,44%	14,55
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FIA	31.304.455,26	4,98%				7,96	-9,45	4843,20	-341,85	355,77	-75,93	5,97%	11,72
META VALOR FIA	3.040.497,23	0,48%				2,34	2,34	1420,69	84,55	104,36	18,78	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	31.867.562,67	5,07%	**Art. 8º III 10%**	**5%**	**10%**	3,19	12,17	1939,35	440,55	142,46	97,85	4,34%	10,36
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I FIC FIP	8.849,34	0,0014%	**Art. 8º IVa 5%**	**1%**	**2%**	-0,76	-99,59	-462,04	-3603,96	-33,94	-800,46	-	-
KINEA PRIVATE EQUITY IV FEEDER INSTITUCIONAL I	6.750.456,59	1,07%	**1,07%**			0,25	-3,41	152,51	-641,61	11,20	-142,50	-	-
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVV11	12.817.735,78	2,04%	**Art. 8º I b 30%**	**2%**	**10%**	9,09	3,03	5524,48	109,52	405,82	24,33	6,80%	12,86
AXA WF FRAMLINGTON DIGITAL ECONOMY ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	16.339.765,20	2,60%	**Art. 9ºA, II 10%**	**6%**	**10%**	5,26	10,43	3199,75	377,61	235,05	83,87	4,06%	6,62
ASHMORE EMERGING MARKETS EQUITY ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	16.667.094,78	2,65%	**6,04%**			7,42	7,89	4510,13	285,45	331,31	63,40	6,78%	13,08
SCHRODER SUSTENTABILIDADE AÇÕES GLOBAIS INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕES	4.962.836,71	0,79%				0,23	-0,02	140,61	-0,87	10,33	-0,19	7,99%	-9,98
SAFRA CONSUMO AMERICANO FIA BDR-NIVEL I PB	4.942.526,88	0,79%	**Art. 9º A, III 10%**	**1%**	**10%**	0,35	1,29	210,94	46,60	15,50	10,35	7,37%	-6,59
TOTAL	**628.840.467,43**	**100%**											