

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos
Relatório Analítico dos Investimentos

em abril de 2020

Carteira consolidada de investimentos - base (Abril / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	4.989.894,73	2,45%	670	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	24.461.661,22	11,99%	958	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	12.673.175,56	6,21%	595	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	10.027.158,70	4,92%	1.370	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	13.513.965,53	6,62%	883	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	10.804.578,44	5,30%	618	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVID...	D+0	15/08/2022	1.524.233,31	0,75%	115	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2030	1.416.735,00	0,69%	34	0,65%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	25.999.133,22	12,75%	743	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENC...	D+0	16/05/2023	2.463.922,90	1,21%	51	0,72%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	2.930.176,08	1,44%	700	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	16/08/2020	4.152.187,99	2,04%	107	0,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	5.869.326,51	2,88%	913	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	5.073.567,91	2,49%	88	1,27%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	163.850,94	0,08%	421	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.628.549,52	1,78%	746	0,22%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	4.644.185,90	2,28%	88	0,58%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES LP	D+0	Não há	779.285,66	0,38%	2.029	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	10.602.411,64	5,20%	284	0,21%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	4.804.451,29	2,36%	172	0,40%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Abril / 2020)

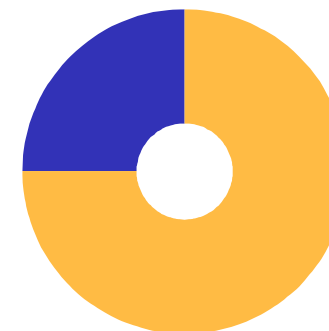
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO...	D+30 ou...	Não há	1.910.012,74	0,94%	74	0,33%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIV...	D+0	3 anos	693.283,60	0,34%	72	0,39%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b ' '
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	2.338.970,49	1,15%	8.563	0,38%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' '
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	23/08/2017	3.203.150,61	1,57%	154	0,00%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' '
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GENESIS FIC AÇÃO...	D+24	Não há	935.107,47	0,46%	8	0,57%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' '
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	1.521.521,96	0,75%	2.563	0,24%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' '
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	2.114.205,68	1,04%	51.174	0,00%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' '
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	2.458.517,06	1,21%	164	0,00%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' '
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	1.512.353,07	0,74%	103	0,00%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' '
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	2.308.228,70	1,13%	206	0,39%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' '
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	7.341.949,31	3,60%	1.360	1,11%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' '
GERAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	1.919.994,73	0,94%	16.215	0,71%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' '
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	2.370.557,71	1,16%	6.441	0,00%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' '
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	2.115.293,99	1,04%	21.188	0,09%	Artigo 8º, Inciso III
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	5.975.336,68	2,93%	201	1,25%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	10.350.931,01	5,07%	18.875	0,24%	Artigo 8º, Inciso III
BRASIL AGRO II MULTIELABRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	3.142.158,47	1,54%	17	4,42%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a ' '
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	1.251.560,00	0,61%		0,63%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b ' '

Carteira consolidada de investimentos - base (Abril / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
Total para cálculo dos limites da Resolução			203.985.585,33				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			21.934,07	Artigo 6º			
PL Total			204.007.519,40				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (REDA FIXA) - base (Abril / 2020)

Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	120.826.149,19	59,23%	15,00%	25,00%	90,00%	62.760.877,61
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	122.391.351,20
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	29.696.302,86	14,56%	10,00%	30,00%	40,00%	51.897.931,27
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	30.597.837,80
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	10.199.279,27
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	2.603.296,34	1,28%	0,00%	5,00%	5,00%	7.595.982,93
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	10.199.279,27
Total Renda Fixa	100,00%	153.125.748,39	75,07%	25,00%	70,00%	220,00%	



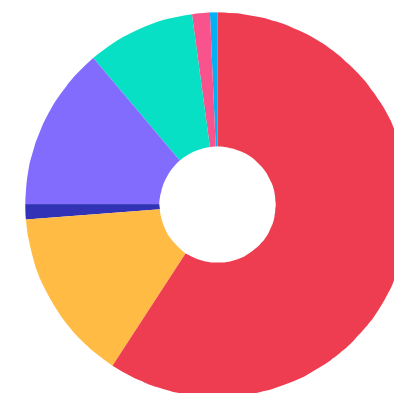
REDA FIXA 153.125.748,39

REDA VARIÁVEL 50.859.836,94

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (REDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Abril / 2020)

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	28.024.556,79	13,74%	7,00%	15,00%	20,00%	12.772.560,28
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	18.441.561,68	9,04%	7,00%	10,00%	10,00%	1.956.996,85
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	5,00%	3.142.158,47	1,54%	2,00%	2,00%	5,00%	7.057.120,80
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	5,00%	1.251.560,00	0,61%	1,00%	3,00%	5,00%	8.947.719,27
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	10.199.279,27
Total Renda Variável	30,00%	50.859.836,94	24,93%	17,00%	30,00%	45,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2020			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	20.398.558,53
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	88.022.644,14	43,15	0,02
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	67.755.794,80	33,22	0,00
ITAÚ UNIBANCO	25.672.173,85	12,59	0,00
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	7.112.679,99	3,49	0,00
VINCI PARTNERS	4.715.503,68	2,31	0,02
AGBI REAL ASSETS	3.142.158,47	1,54	4,42
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	2.370.557,71	1,16	0,00
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	2.338.970,49	1,15	0,22
GENIAL INVESTIMENTOS	1.919.994,73	0,94	0,04
ITAÚ DTVM	935.107,47	0,46	0,00

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 ' b '	120.826.149,19	59,23	15,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	29.696.302,86	14,56	10,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	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 '	2.603.296,34	1,28	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	28.024.556,79	13,74	7,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	18.441.561,68	9,04	7,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	3.142.158,47	1,54	2,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	1.251.560,00	0,61	1,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Abril/2020 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA Geral ex-C (Benchmark)	0,84%	-0,17%	-0,67%	0,03%	8,34%	19,04%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,91%	-0,28%	-0,76%	-0,26%	8,60%	19,45%	0,05%	0,04%

IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,57%	0,57%	0,03%	1,79%	8,62%	18,84%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,32%	-0,34%	-0,73%	1,02%	6,95%	16,67%	0,03%	0,03%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,43%	0,02%	-0,44%	1,13%	7,34%	17,02%	0,03%	0,03%

IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	0,15%	2,14%	1,41%	4,83%	8,57%	20,71%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,82%	0,34%	-0,32%	1,04%	10,95%	23,30%	0,04%	0,04%

IRF-M 1 (Benchmark)	0,45%	1,88%	1,44%	2,65%	6,60%	13,72%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,43%	1,82%	1,39%	2,55%	6,39%	13,32%	0,00%	0,00%

IMA-B 5 (Benchmark)	0,49%	-0,09%	-0,64%	0,86%	8,67%	19,47%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,47%	-0,18%	-0,72%	0,69%	8,37%	18,91%	0,03%	0,04%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,49%	-0,12%	-0,67%	0,76%	8,48%	19,01%	0,03%	0,04%

IMA-B (Benchmark)	1,31%	-5,08%	-5,33%	-5,55%	8,94%	25,91%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,30%	-5,12%	-5,36%	-5,65%	8,71%	25,32%	0,09%	0,11%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	1,53%	-3,82%	-4,01%	-4,58%	11,67%	28,88%	0,10%	0,10%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Abril/2020 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,02%	-3,60%	-3,57%	-2,00%	-1,14%	0,94%	0,01%	0,04%
IRF-M (Benchmark)	1,15%	2,59%	1,70%	2,75%	11,69%	22,07%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,07%	2,47%	1,60%	2,60%	11,40%	21,53%	0,05%	0,03%
CDI (Benchmark)	0,28%	1,30%	0,92%	2,07%	5,19%	11,87%	-	-
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES LP	0,27%	1,23%	0,87%	1,98%	5,03%	11,52%	0,00%	0,00%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,20%	0,95%	0,67%	1,54%	4,07%	9,49%	0,00%	0,00%
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	0,62%	4,89%	4,73%	6,32%	13,19%	-	0,00%	0,03%
IPCA (Benchmark)	-0,31%	0,22%	0,01%	1,89%	2,40%	7,46%	-	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,43%	-0,48%	-1,30%	0,43%	7,30%	18,83%	0,03%	0,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,40%	-0,07%	-0,61%	0,83%	8,54%	29,24%	0,03%	0,03%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,39%	0,13%	-1,17%	2,23%	3,27%	8,21%	0,00%	0,04%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,87%	-0,54%	-1,34%	-0,20%	10,96%	21,81%	0,06%	0,06%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,14%	1,28%	0,93%	1,98%	9,19%	18,37%	0,03%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1,11%	2,44%	1,60%	2,52%	13,47%	24,61%	0,05%	0,04%
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,02%	-0,30%	-0,73%	-0,40%	8,12%	18,37%	0,05%	0,04%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Abril/2020 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,31%	1,35%	0,96%	2,07%	5,25%	11,69%	0,00%	0,00%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	0,30%	2,76%	1,86%	5,79%	10,62%	25,30%	-	-
BRASIL AGRO II MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	26,00%	18,18%	-	0,00%	-

IDIV (Benchmark)	3,76%	-28,65%	-27,50%	-19,68%	-7,18%	10,38%	-	-
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	7,24%	-25,99%	-27,10%	-19,26%	-7,99%	9,76%	0,21%	0,33%

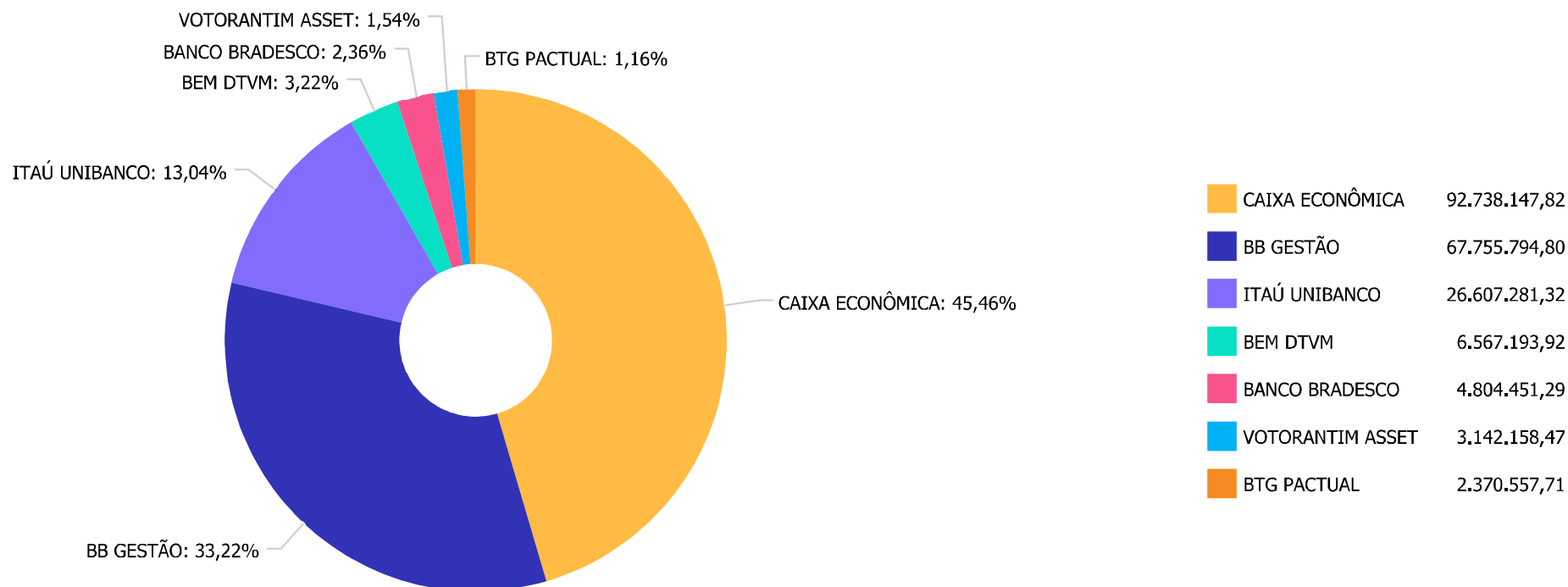
Ibovespa (Benchmark)	10,25%	-30,39%	-29,23%	-24,92%	-16,45%	-6,51%	-	-
GERAÇÃO FI AÇÕES	9,15%	-30,84%	-29,96%	-26,55%	-18,24%	-6,47%	0,20%	0,35%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	16,50%	-24,62%	-26,12%	-19,00%	-3,08%	16,44%	0,25%	0,40%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	8,90%	-28,31%	-29,52%	-16,48%	-0,78%	22,03%	0,22%	0,38%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	9,17%	-41,59%	-42,43%	-33,70%	-23,73%	-10,30%	0,27%	0,48%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	8,39%	-29,05%	-28,01%	-20,57%	-13,78%	5,57%	0,23%	0,33%
BRANCO SELECTION FI AÇÕES	6,84%	-35,78%	-34,94%	-32,16%	-22,88%	-12,15%	0,22%	0,37%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	11,03%	-32,47%	-32,34%	-25,59%	-9,53%	3,07%	0,26%	0,39%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	12,64%	-27,85%	-30,07%	-19,61%	-	-	0,24%	-
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GENESIS FIC AÇÕES	12,62%	-26,90%	-27,72%	-19,40%	-	-	0,23%	-

CDI (Benchmark)	0,28%	1,30%	0,92%	2,07%	5,19%	11,87%	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,70%	-0,11%	-0,23%	1,48%	6,09%	13,55%	0,01%	0,02%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	3,40%	-7,85%	-7,62%	-4,77%	0,70%	8,18%	0,06%	0,11%

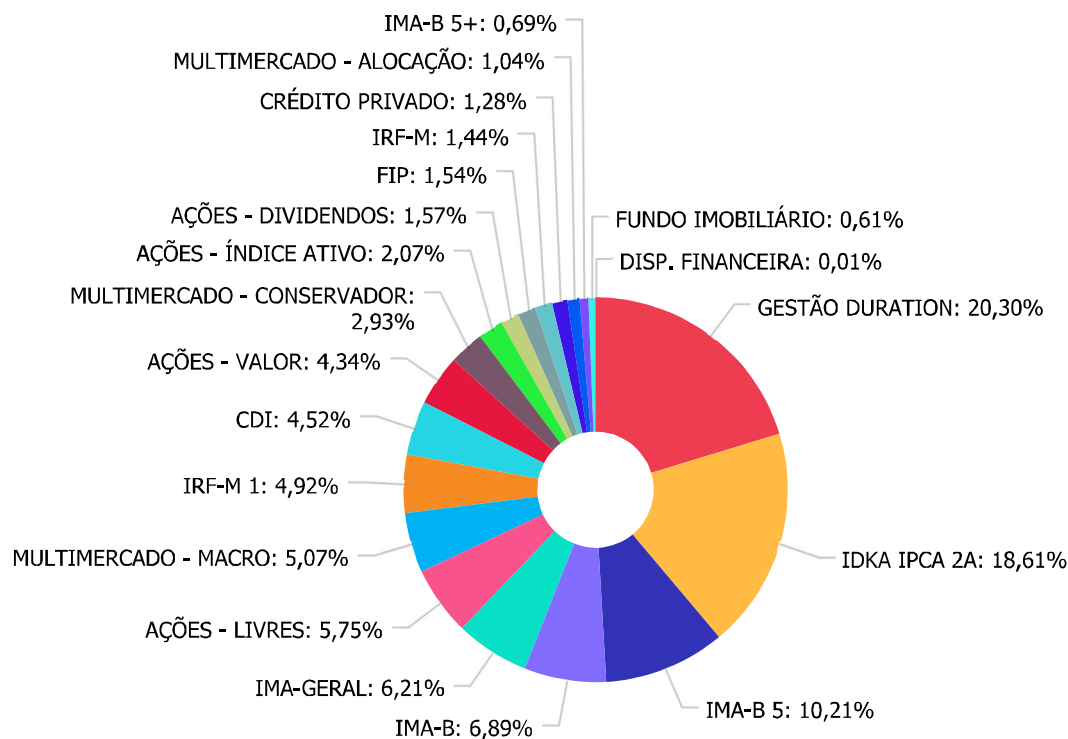
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Abril/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	2,63%	-3,64%	-4,29%	-0,87%	7,95%	19,59%	0,05%	0,08%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	9,76%	-28,15%	-29,52%	-17,60%	-1,76%	13,43%	0,22%	0,38%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	7,78%	-16,00%	-28,48%	4,82%	23,31%	19,20%	0,31%	0,40%

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



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

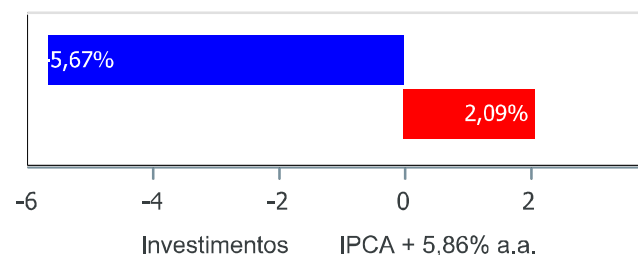


GESTÃO DURATION	41.405.996,15
IDKA IPCA 2A	37.975.626,75
IMA-B 5	20.826.092,94
IMA-B	14.051.618,85
IMA-GERAL	12.673.175,56
AÇÕES - LIVRES	11.738.880,37
MULTIMERCADO - MACRO	10.350.931,01
IRF-M 1	10.027.158,70
CDI	9.215.872,02
AÇÕES - VALOR	8.854.302,38
MULTIMERCADO - CONSERVADOR	5.975.336,68
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	4.228.223,43
AÇÕES - DIVIDENDOS	3.203.150,61
FIP	3.142.158,47
IRF-M	2.930.176,08
CRÉDITO PRIVADO	2.603.296,34
MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	2.115.293,99
IMA-B 5+	1.416.735,00
FUNDO IMOBILIÁRIO	1.251.560,00

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

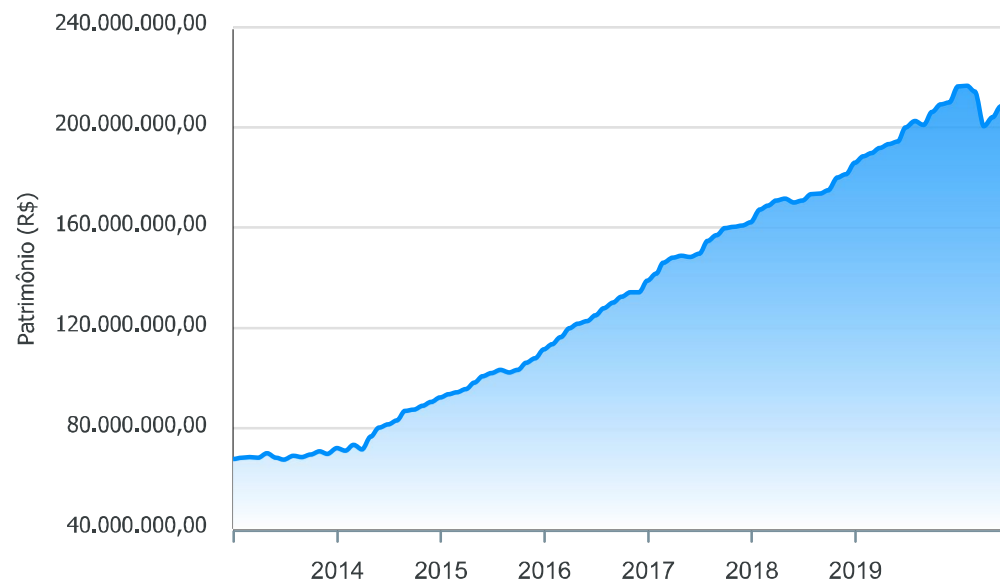
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	214.207.749,87	1.322.881,96	2.484.374,30	214.203.168,74	1.156.911,21	1.156.911,21	0,54%	0,54%	0,71%	0,71%	76,13%	2,29%
Fevereiro	214.203.168,74	5.969.817,04	7.600.836,88	209.874.462,79	-2.697.686,11	-1.540.774,90	-1,26%	-0,73%	0,66%	1,37%	-52,90%	3,69%
Março	209.874.462,79	3.902.301,44	1.064.632,86	198.242.123,80	-14.470.007,57	-16.010.782,47	-6,80%	-7,48%	0,57%	1,95%	-383,70%	12,66%
Abril	198.242.123,80	1.597.480,71	2.250.943,89	201.466.086,24	3.877.425,62	-12.133.356,85	1,96%	-5,67%	0,14%	2,09%	-270,81%	6,37%

Investimentos x Meta Atuarial



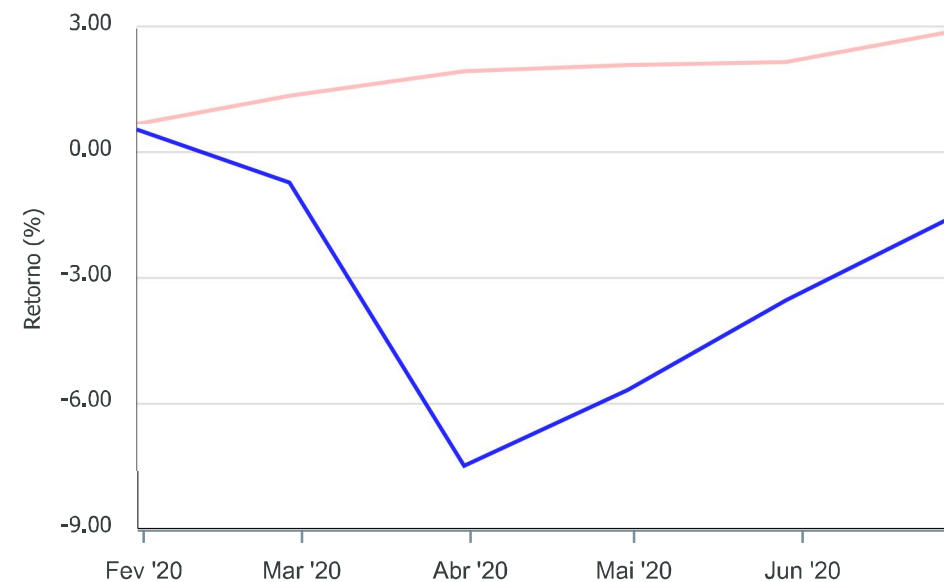
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Abril/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	4.997.099,41	0,00	0,00	5.073.567,91	76.468,50	1,53%	1,53%	9,95%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	4.925.945,90	0,00	0,00	4.989.894,73	63.948,83	1,30%	1,30%	8,99%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	25.713.383,29	0,00	0,00	25.999.133,22	285.749,93	1,11%	1,11%	4,96%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.899.096,83	0,00	0,00	2.930.176,08	31.079,25	1,07%	1,07%	4,99%
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	4.755.798,48	0,00	0,00	4.804.451,29	48.652,81	1,02%	1,02%	5,14%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12.558.566,38	0,00	0,00	12.673.175,56	114.609,18	0,91%	0,91%	4,82%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	687.296,00	0,00	0,00	693.283,60	5.987,60	0,87%	0,87%	5,71%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	2.443.876,62	0,00	0,00	2.463.922,90	20.046,28	0,82%	0,82%	4,29%
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	4.615.574,35	0,00	0,00	4.644.185,90	28.611,55	0,62%	0,62%	0,49%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	10.752.267,22	0,00	0,00	10.804.578,44	52.311,22	0,49%	0,49%	3,19%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	5.842.145,27	0,00	0,00	5.869.326,51	27.181,24	0,47%	0,47%	3,24%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	9.983.903,28	0,00	0,00	10.027.158,70	43.255,42	0,43%	0,43%	0,49%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	1.901.830,17	0,00	0,00	1.910.012,74	8.182,57	0,43%	0,43%	2,86%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	24.357.942,34	0,00	0,00	24.461.661,22	103.718,88	0,43%	0,43%	2,75%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDEN...	1.518.238,29	0,00	0,00	1.524.233,31	5.995,02	0,39%	0,39%	2,78%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.411.297,00	0,00	0,00	1.416.735,00	5.438,00	0,39%	0,39%	0,14%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	13.470.361,48	0,00	0,00	13.513.965,53	43.604,05	0,32%	0,32%	2,68%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	163.341,92	0,00	0,00	163.850,94	509,02	0,31%	0,31%	0,12%
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES LP	1.414.640,68	0,00	638.213,12	779.285,66	2.858,10	0,20%	0,27%	0,00%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.504.906,80	1.870.710,12	1.755.235,69	3.628.549,52	8.168,29	0,15%	0,20%	0,01%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Abril/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	10.587.242,37	0,00	0,00	10.602.411,64	15.169,27	0,14%	0,14%	2,58%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.153.159,94	0,00	0,00	4.152.187,99	-971,95	-0,02%	-0,02%	0,72%
Total Renda Fixa	152.657.914,02	1.870.710,12	2.393.448,81	153.125.748,39	990.573,06	0,64%		3,55%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Abril/2020

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.034.835,27	0,00	0,00	2.370.557,71	335.722,44	16,50%	16,50%	25,47%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	1.350.798,46	0,00	0,00	1.521.521,96	170.723,50	12,64%	12,64%	24,36%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GENESIS FIC AÇÕES	830.338,18	0,00	0,00	935.107,47	104.769,29	12,62%	12,62%	23,36%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1.904.209,39	0,00	0,00	2.114.205,68	209.996,29	11,03%	11,03%	25,89%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	1.377.909,57	0,00	0,00	1.512.353,07	134.443,50	9,76%	9,76%	21,87%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	2.252.049,57	0,00	0,00	2.458.517,06	206.467,49	9,17%	9,17%	26,98%
GERAÇÃO FI AÇÕES	1.758.982,86	0,00	0,00	1.919.994,73	161.011,87	9,15%	9,15%	20,24%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	2.147.736,11	0,00	0,00	2.338.970,49	191.234,38	8,90%	8,90%	21,79%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	6.773.668,58	0,00	0,00	7.341.949,31	568.280,73	8,39%	8,39%	22,73%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	2.986.928,73	0,00	0,00	3.203.150,61	216.221,88	7,24%	7,24%	21,08%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.169.990,00	0,00	0,00	1.251.560,00	81.570,00	6,97%	6,97%	30,55%
BRANCO SELECTION FI AÇÕES	2.160.391,06	0,00	0,00	2.308.228,70	147.837,64	6,84%	6,84%	21,82%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	2.045.826,63	0,00	0,00	2.115.293,99	69.467,36	3,40%	3,40%	6,42%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	10.085.742,26	0,00	0,00	10.350.931,01	265.188,75	2,63%	2,63%	4,66%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	5.934.053,26	0,00	0,00	5.975.336,68	41.283,42	0,70%	0,70%	1,25%
BRASIL AGRO II MULTIESTRATÉGIA FIP	3.144.779,68	0,00	0,00	3.142.158,47	-2.621,21	-0,08%	-0,08%	0,02%
Total Renda Variável	47.958.239,61	0,00	0,00	50.859.836,94	2.901.597,33	6,05%		14,86%