

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
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	81.292.311,73	12,25%	353	4,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	123.113.945,33	18,56%	670	2,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	12.550.284,45	1,89%	275	2,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	D+0	15/08/2024	6.714.227,38	1,01%	93	1,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	15.470.896,69	2,33%	1.370	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	49.807.966,76	7,51%	743	0,44%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	3.710.446,43	0,56%	631	0,14%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	20.085.635,74	3,03%	16	3,75%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	26.423.591,59	3,98%	10.362	7,77%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	122.508.467,84	18,47%	116	6,60%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	38.797.725,22	5,85%	51	15,33%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	0,01	0,00%		0,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se ...	Não se aplica	12.461,23	0,00%	47	0,37%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO...	D+30 ou...	Não há	9.133.208,26	1,38%	74	1,57%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+4	Não há	4.661.104,86	0,70%	47	0,72%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	D+4	Não há	10.106.265,90	1,52%	94	1,15%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	10.808.345,93	1,63%	33.869	1,28%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	9.869.056,19	1,49%	12.868	1,41%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	D+4	Não há	4.020.449,43	0,61%	22.891	1,37%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	11.386.348,07	1,72%	16.228	1,18%	Artigo 8º, Inciso II, 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
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	D+4	Não há	18.804.385,10	2,83%	14.482	3,06%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	23.901.201,59	3,60%	13.757	1,72%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+3	Não há	10.747.217,75	1,62%	7.612	8,95%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	17.640.606,36	2,66%	8.390	2,28%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	551.282,94	0,08%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE...	Não se ...	Não se aplica	2.135.462,48	0,32%	105	0,61%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	S/Info	Não se aplica	976.519,59	0,15%		2,07%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se ...	Não se aplica	1.081.457,61	0,16%		3,05%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
SANTANDER GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERI...	D+8 du	Não há	8.294.477,52	1,25%	30	3,30%	Artigo 9º - A, Inciso II
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	18.803.100,66	2,83%	10.923	3,22%	Artigo 9º - A, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			663.408.450,64				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	663.408.450,64
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	288.949.632,34	43,56%	10,00%	40,95%	100,00%	374.458.818,30
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	663.408.450,64
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	33.170.422,53
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	398.045.070,38
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	398.045.070,38
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	211.525.866,82	31,88%	0,00%	23,00%	40,00%	53.837.513,44
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	265.363.380,26
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	132.681.690,13
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	99.511.267,60
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	99.511.267,60
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	12.461,24	0,00%	0,00%	0,05%	5,00%	33.157.961,29
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	9.133.208,26	1,38%	0,00%	1,00%	5,00%	24.037.214,27
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	33.170.422,53
Total Renda Fixa	100,00%	509.621.168,66	76,82%	10,00%	65,00%	570,00%	

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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	30,00%	14.767.370,76	2,23%	0,00%	4,00%	30,00%	184.255.164,43
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	199.022.535,19
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	89.537.004,06	13,50%	2,00%	20,00%	20,00%	43.144.686,07
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	132.681.690,13
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	17.640.606,36	2,66%	0,00%	4,00%	10,00%	48.700.238,70
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	2.686.745,42	0,40%	0,00%	1,00%	5,00%	30.483.677,11
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	2.057.977,20	0,31%	0,00%	1,00%	5,00%	31.112.445,33
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	33.170.422,53
Total Renda Variável	30,00%	126.689.703,80	19,10%	2,00%	30,00%	125,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2020			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	66.340.845,06
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	8.294.477,52	1,25%	0,00%	2,00%	10,00%	58.046.367,54
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	18.803.100,66	2,83%	0,00%	3,00%	10,00%	47.537.744,40
Total Exterior	10,00%	27.097.578,18	4,08%	0,00%	5,00%	30,00%	

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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	186.868.174,25	28,17	0,04
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	168.247.840,51	25,36	0,01
BRANCO ASSET MANAGEMENT	161.306.193,06	24,31	0,02
WESTERN ASSET	69.079.627,21	10,41	0,16
ICATU VANGUARDA	50.324.793,18	7,59	0,14
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	12.955.582,38	1,95	0,00
AZ QUEST INVESTIMENTOS	9.869.056,19	1,49	0,04
PÁTRIA INVESTIMENTOS	2.135.462,48	0,32	0,03
REDITUS INVESTIMENTOS	1.081.457,61	0,16	-
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	976.519,59	0,15	0,22
ÁTICO ASSET MANAGEMENT	551.282,94	0,08	1,32
VILA RICA CAPITAL	12.461,23	0,00	0,54
BRASIL PLURAL	0,01	0,00	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 ' a '	0,00	0,00	0,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	288.949.632,34	43,56	10,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	0,00	0,00	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	60,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	211.525.866,82	31,88	0,00	40,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	40,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	12.461,24	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	9.133.208,26	1,38	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	14.767.370,76	2,23	0,00	30,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	89.537.004,06	13,50	2,00	20,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	17.640.606,36	2,66	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	2.686.745,42	0,40	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	2.057.977,20	0,31	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso I	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º - A, Inciso II	8.294.477,52	1,25	0,00	10,00
Artigo 9º - A, Inciso III	18.803.100,66	2,83	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
CDI + 3,50% ao ano (Benchmark)	0,56%	2,44%	1,75%	3,79%	8,89%	19,82%	-	-
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-40,08%	-35,88%	-33,57%	2,72%	-54,98%	-76,93%	-	0,78%
IRF-M 1+ (Benchmark)	1,50%	2,96%	1,83%	2,84%	13,92%	25,80%	-	-
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	1,47%	2,47%	1,20%	1,95%	15,69%	29,73%	0,11%	0,05%
IMA-B 5+ (Benchmark)	2,01%	-8,82%	-8,85%	-10,25%	8,47%	30,32%	-	-
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	1,97%	-9,34%	-9,31%	-10,81%	7,64%	28,89%	0,14%	0,16%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,95%	-8,95%	-8,91%	-10,50%	7,94%	29,14%	0,14%	0,16%
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%	-	-
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	0,90%	0,44%	-0,46%	0,82%	11,43%	23,76%	0,07%	0,05%
110% do CDI (Benchmark)	0,31%	1,43%	1,01%	2,28%	5,73%	13,13%	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	-	-	-	-	-	-	-	-
IMA-B (Benchmark)	1,31%	-5,08%	-5,33%	-5,55%	8,94%	25,91%	-	-

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
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%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	1,36%	-5,25%	-5,51%	-5,82%	8,68%	25,40%	0,09%	0,11%
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	1,69%	-4,48%	-5,00%	-5,47%	11,61%	30,30%	0,12%	0,12%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,42%	-0,40%	-0,92%	0,49%	8,71%	19,63%	0,03%	0,04%
CDI (Benchmark)	0,28%	1,30%	0,92%	2,07%	5,19%	11,87%	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,26%	0,85%	0,50%	1,55%	4,55%	11,05%	0,00%	0,01%
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%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1,11%	2,43%	1,60%	2,52%	13,47%	24,61%	0,05%	0,04%

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 + 10,50% ao ano (Benchmark)	0,48%	3,53%	2,42%	6,98%	13,20%	31,16%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	-	-
S&P 500 (Benchmark)	12,68%	-9,85%	-9,71%	-4,12%	-1,13%	9,98%	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	11,77%	-11,92%	-12,24%	-6,15%	-1,79%	14,06%	0,20%	0,25%
IBX-50 (Benchmark)	10,48%	-31,05%	-29,73%	-25,91%	-18,39%	-9,72%	-	-
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	9,94%	-31,68%	-30,56%	-26,07%	-18,29%	-11,92%	0,23%	0,36%
IMOB (Benchmark)	7,49%	-41,37%	-43,55%	-29,78%	-2,07%	14,58%	-	-
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	7,52%	-41,40%	-43,64%	-30,20%	-2,97%	13,33%	0,35%	0,52%
ICON (Benchmark)	17,67%	-24,81%	-27,47%	-16,35%	1,02%	9,88%	-	-
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	17,43%	-24,90%	-27,36%	-16,03%	2,00%	6,91%	0,25%	0,42%
IDIV (Benchmark)	3,76%	-28,65%	-27,50%	-19,68%	-7,18%	10,38%	-	-
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	6,08%	-29,98%	-30,41%	-24,37%	-11,75%	9,04%	0,22%	0,34%
Ibovespa (Benchmark)	10,25%	-30,39%	-29,23%	-24,92%	-16,45%	-6,51%	-	-
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	11,33%	-32,93%	-32,27%	-26,73%	-18,27%	-9,25%	0,24%	0,39%

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

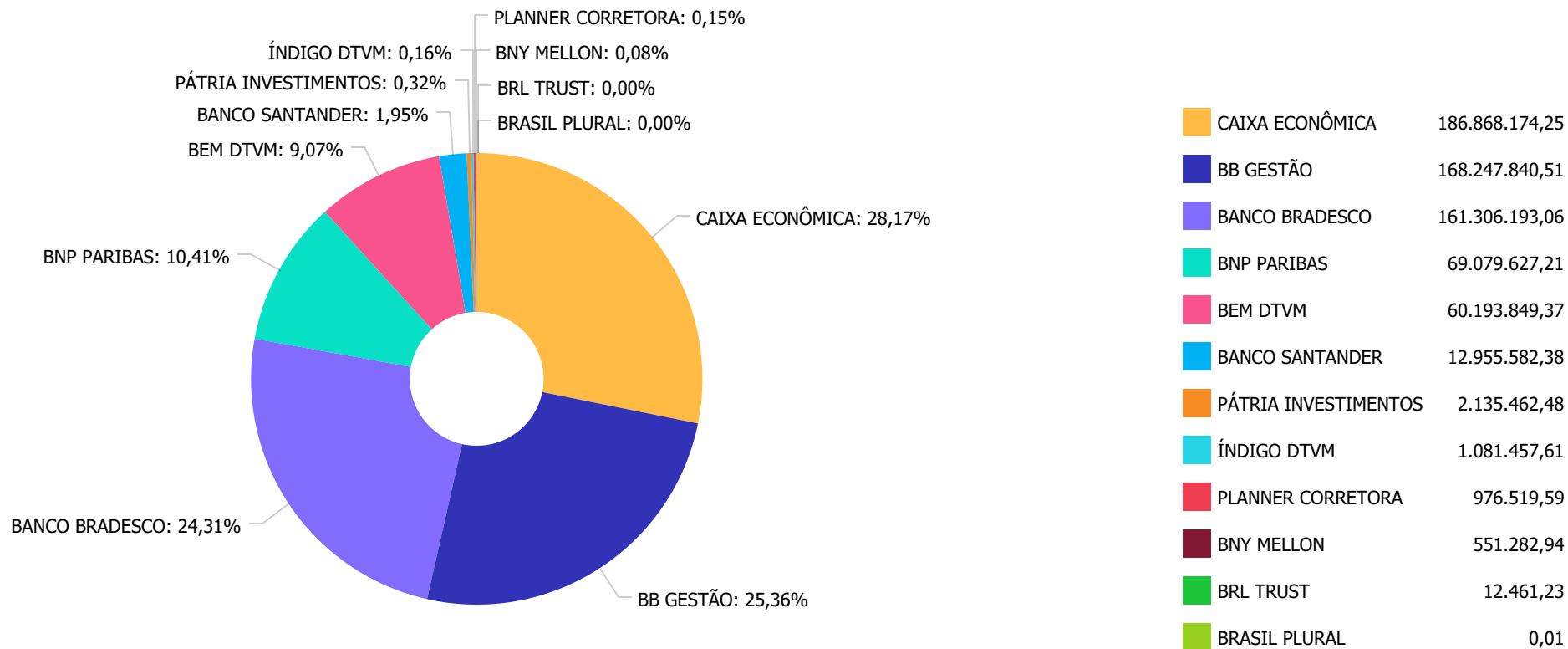
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	11,36%	-31,54%	-34,06%	-26,84%	-16,84%	-7,32%	0,23%	0,41%
SMLL (Benchmark)	10,19%	-34,07%	-34,37%	-21,91%	-4,59%	5,90%	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	11,33%	-33,59%	-33,92%	-21,69%	-5,18%	2,17%	0,24%	0,43%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	0,00%	0,28%	0,00%	-7,43%	-13,01%	-31,88%	0,00%	0,25%
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	-	-	-	-38,73%	-39,07%	-	0,00%	0,38%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	0,00%	-17,96%	-19,02%	-33,88%	69,02%	69,02%	-	-
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	8,83%	-28,58%	-29,34%	-18,63%	-4,61%	11,58%	0,18%	0,36%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	13,81%	-27,65%	-29,40%	-20,03%	-9,73%	4,05%	0,25%	0,40%

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

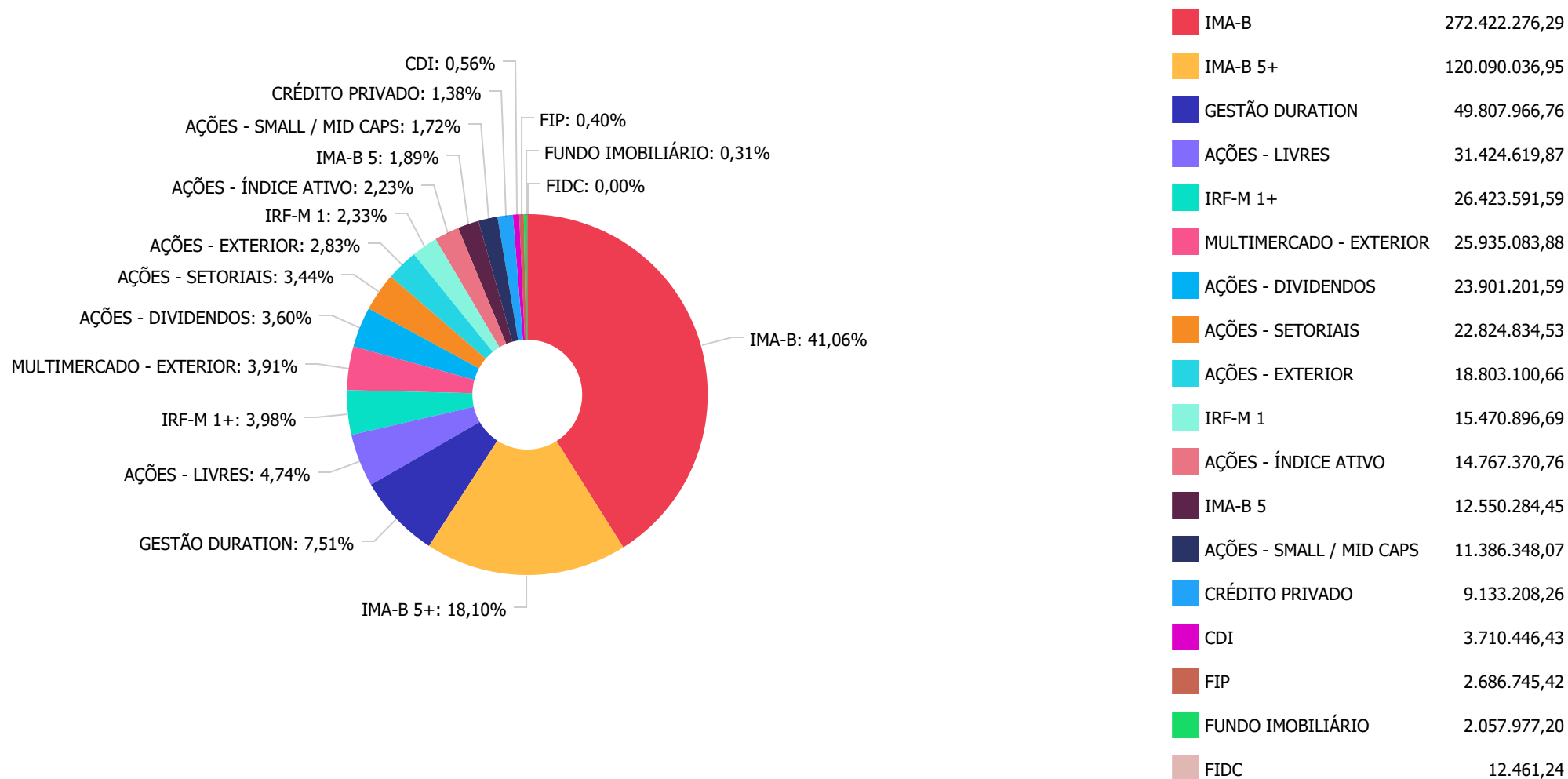
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	16,32%	23,16%	15,68%	32,24%	39,49%	79,08%	-	-
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	19,81%	29,16%	20,27%	38,14%	45,12%	85,39%	0,18%	0,23%

CDI (Benchmark)	0,28%	1,30%	0,92%	2,07%	5,19%	11,87%	-	-
SANTANDER GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCAD...	18,04%	25,29%	17,69%	31,88%	37,21%	56,42%	0,13%	0,22%

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



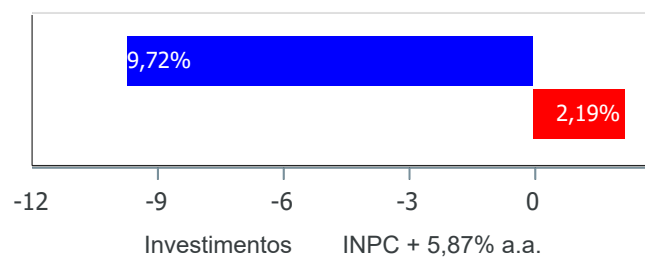
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Abril / 2020)



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

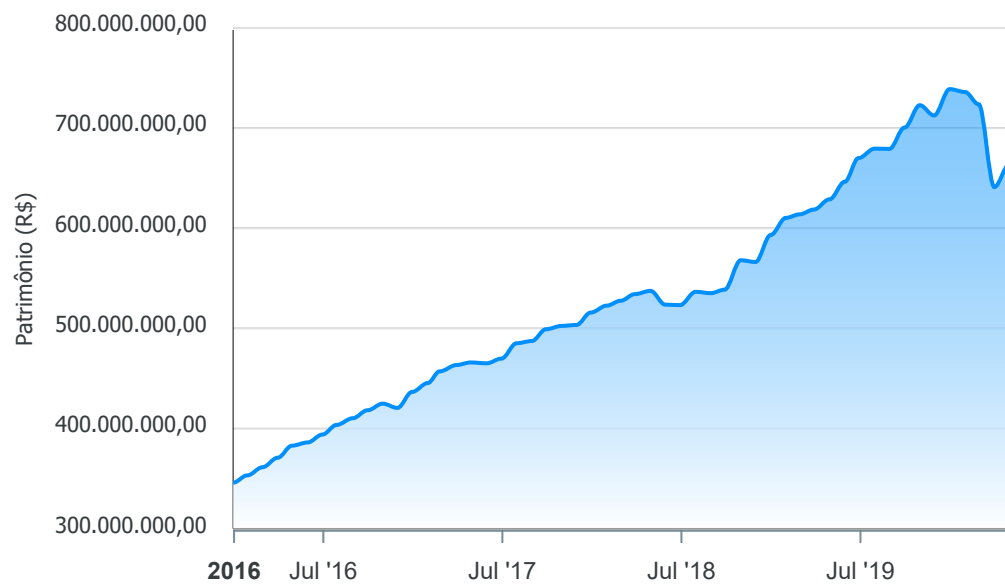
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	738.948.979,87	43.219.308,10	49.983.272,64	736.089.095,98	3.904.080,65	3.904.080,65	0,53%	0,53%	0,69%	0,69%	76,55%	3,62%
Fevereiro	736.089.095,98	8.085.665,26	7.963.323,56	723.797.162,06	-12.414.275,62	-8.510.194,97	-1,69%	-1,17%	0,58%	1,27%	-91,65%	5,75%
Março	723.797.162,06	10.150.834,34	8.531.768,26	641.154.532,77	-84.261.695,37	-92.771.890,34	-11,62%	-12,65%	0,68%	1,96%	-644,62%	24,39%
Abril	641.154.532,77	23.706.289,22	22.986.242,51	663.408.450,64	21.533.871,16	-71.238.019,18	3,35%	-9,72%	0,22%	2,19%	-443,88%	12,30%

Investimentos x Meta Atuarial



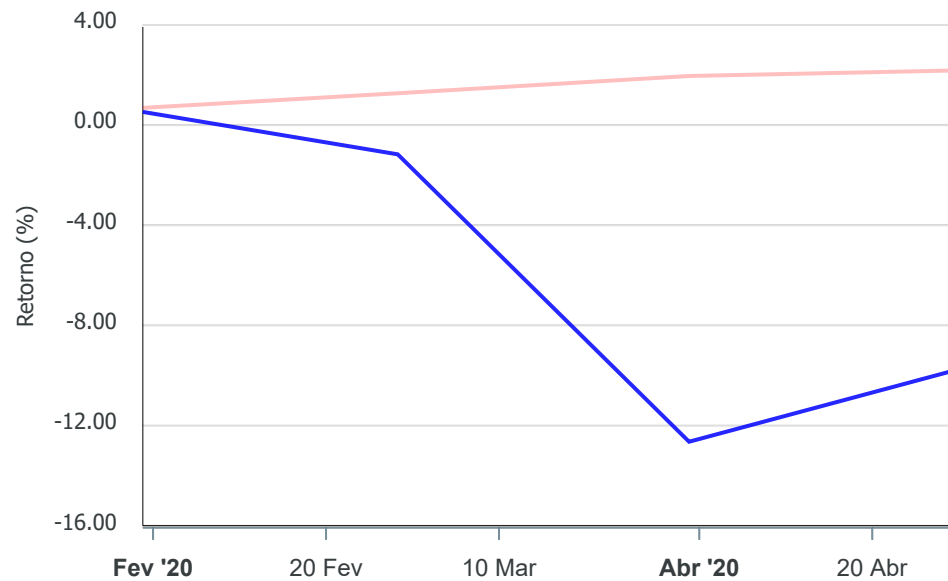
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	94.282.418,29	0,00	15.000.000,00	81.292.311,73	2.009.893,44	2,13%	1,95%	14,33%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	38.046.578,88	0,00	0,00	38.797.725,22	751.146,34	1,97%	1,97%	14,28%
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	19.751.748,50	0,00	0,00	20.085.635,74	333.887,24	1,69%	1,69%	11,91%
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	26.040.213,68	0,00	0,00	26.423.591,59	383.377,91	1,47%	1,47%	10,68%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	120.863.314,71	0,00	0,00	122.508.467,84	1.645.153,13	1,36%	1,36%	9,48%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	121.536.157,88	0,00	0,00	123.113.945,33	1.577.787,45	1,30%	1,30%	8,99%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	49.260.539,90	0,00	0,00	49.807.966,76	547.426,86	1,11%	1,11%	4,96%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	12.438.735,03	0,00	0,00	12.550.284,45	111.549,42	0,90%	0,90%	6,95%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	9.094.081,22	0,00	0,00	9.133.208,26	39.127,04	0,43%	0,43%	2,86%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.685.863,06	0,00	0,00	6.714.227,38	28.364,32	0,42%	0,42%	3,32%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	0,00	15.437.745,84	0,00	15.470.896,69	33.150,85	0,21%	0,43%	0,49%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	3.399.233,27	8.268.543,38	7.978.431,70	3.710.446,43	21.101,48	0,18%	0,26%	0,12%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	20.795,15	0,00	7.810,81	12.461,23	-523,11	-2,52%	-	-
Total Renda Fixa	501.419.679,58	23.706.289,22	22.986.242,51	509.621.168,66	7.481.442,37	1,49%		9,61%

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
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	16.013.443,73	0,00	0,00	18.804.385,10	2.790.941,37	17,43%	17,43%	24,60%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	9.443.014,37	0,00	0,00	10.747.217,75	1.304.203,38	13,81%	13,81%	24,91%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	15.782.430,37	0,00	0,00	17.640.606,36	1.858.175,99	11,77%	11,77%	20,05%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	8.861.987,79	0,00	0,00	9.869.056,19	1.007.068,40	11,36%	11,36%	22,71%
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	4.186.725,34	0,00	0,00	4.661.104,86	474.379,52	11,33%	11,33%	23,72%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	10.227.802,18	0,00	0,00	11.386.348,07	1.158.545,89	11,33%	11,33%	24,21%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	9.192.168,21	0,00	0,00	10.106.265,90	914.097,69	9,94%	9,94%	22,85%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	9.931.520,30	0,00	0,00	10.808.345,93	876.825,63	8,83%	8,83%	18,12%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	3.739.408,77	0,00	0,00	4.020.449,43	281.040,66	7,52%	7,52%	35,02%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	22.531.985,69	0,00	0,00	23.901.201,59	1.369.215,90	6,08%	6,08%	22,28%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	972.617,28	0,00	0,00	976.519,59	3.902,31	0,40%	0,00%	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	1.082.926,94	0,00	0,00	1.081.457,61	-1.469,33	-0,14%	0,00%	0,00%
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE F...	2.138.608,92	0,00	0,00	2.135.462,48	-3.146,44	-0,15%	-0,15%	0,00%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	2.909.286,58	0,00	0,00	551.282,94	-2.358.003,64	-81,05%	-	-
Total Renda Variável	117.013.926,47	0,00	0,00	126.689.703,80	9.675.777,33	8,27%		22,33%

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	15.694.288,34	0,00	0,00	18.803.100,66	3.108.812,32	19,81%	19,81%	17,86%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	7.026.638,38	0,00	0,00	8.294.477,52	1.267.839,14	18,04%	18,04%	13,46%
Total Renda Variável	22.720.926,72	0,00	0,00	27.097.578,18	4.376.651,46	19,26%		16,52%