

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 TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENC...	D+0	16/05/2023	7.800.533,48	2,91%	51	2,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	16/08/2020	2.494.862,00	0,93%	107	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	D+2	Não há	2.775.799,55	1,04%	25.945	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	2.234.271,20	0,83%	31	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	47.636.725,90	17,76%	595	0,45%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	113.748,22	0,04%	883	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVID...	D+0	15/08/2024	27.399.197,84	10,22%	31	9,83%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	27.591.445,74	10,29%	743	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	2.439.431,69	0,91%	1.251	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVI...	D+2	Não há	12.302.023,20	4,59%	320	0,63%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	15/08/2022	5.938.516,71	2,21%	165	0,89%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	4.061.936,77	1,51%	116	0,22%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' '
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	D+0	Não há	20.442.894,35	7,62%	80	3,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.825,80	0,00%	317	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' '
BRADESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZ...	D+0	Não há	8.925.974,39	3,33%	1.544	1,15%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' '
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	2.031.140,86	0,76%	97	0,23%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' '
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	527,09	0,00%	422	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.040.486,17	0,76%	746	0,12%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' '
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.820.727,38	0,68%	51	0,72%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' '
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	7.707.439,84	2,87%	279	0,54%	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
BRASESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	2.896.037,12	1,08%	172	0,24%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO...	D+30 ou...	Não há	2.441.197,30	0,91%	74	0,42%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b'
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.319.185,79	0,49%	19.387	0,36%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
ALASKA BLACK INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+32	Não há	2.297.062,37	0,86%	122.450	0,14%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	5.108.677,72	1,91%	51.174	0,18%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
XP INVESTOR 30 FIC AÇÕES	D+33	Não há	2.004.255,57	0,75%	3.936	0,36%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
BRASESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	D+4	Não há	5.589.149,35	2,08%	2.155	0,32%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
BRASESCO VALUATION IBOVESPA FIC AÇÕES	D+4	Não há	2.552.258,05	0,95%	716	4,37%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
INDIE FIC AÇÕES	D+32	Não há	2.319.295,59	0,86%	18.529	0,35%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
MOAT CAPITAL FIC AÇÕES	D+17	Não há	3.180.627,66	1,19%	3.000	0,21%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
XP INVESTOR FI AÇÕES	D+4	Não há	1.474.066,02	0,55%	3.388	0,47%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	7.467.749,36	2,78%	3.894	0,85%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	1.097.523,16	0,41%	18.875	0,03%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MUL...	D+2	01/10/2020	7.034.190,68	2,62%	956	1,39%	Artigo 8º, Inciso III
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	3.013.932,07	1,12%	913	0,36%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	23.939.471,15	8,93%	59	18,88%	Artigo 8º, Inciso III
FP2 MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não há	1.535.735,20	0,57%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO...	D+5	Não há	7.130.299,47	2,66%	390	4,32%	Artigo 9º - A, Inciso II

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			268.161.221,81				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			1.238.245,42	Artigo 6º			
PL Total			269.399.467,23				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENTA 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%	1,00%	100,00%	268.161.221,81
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	138.726.555,53	51,73%	40,00%	50,00%	100,00%	129.434.666,28
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	268.161.221,81
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	13.408.061,09
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	160.896.733,09
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	160.896.733,09
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	40,00%	49.929.989,77	18,62%	0,00%	8,00%	40,00%	57.334.498,95
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'b'	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	107.264.488,72
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	53.632.244,36
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea 'a'	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	15,00%	40.224.183,27
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea 'b'	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	40.224.183,27
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	13.408.061,09
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b'	5,00%	2.441.197,30	0,91%	0,00%	2,00%	5,00%	10.966.863,79
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	13.408.061,09
Total Renda Fixa	100,00%	191.097.742,60	71,26%	40,00%	65,00%	570,00%	

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 I, Alínea 'a'	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	30,00%	80.448.366,54
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'b'	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	80.448.366,54
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	33.312.327,48	12,42%	0,00%	15,00%	20,00%	20.319.916,88
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'b'	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	53.632.244,36
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	35.085.117,06	13,08%	0,00%	5,00%	10,00%	-8.268.994,88
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	5,00%	1.535.735,20	0,57%	0,00%	1,00%	5,00%	11.872.325,89
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	13.408.061,09
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	13.408.061,09
Total Renda Variável	30,00%	69.933.179,74	26,08%	0,00%	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%	1,00%	5,00%	13.408.061,09
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	7.130.299,47	2,66%	0,00%	1,00%	5,00%	6.277.761,62
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	5,00%	13.408.061,09
Total Exterior	10,00%	7.130.299,47	2,66%	0,00%	5,00%	15,00%	

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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	137.581.380,49	51,31	0,01
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	62.160.318,53	23,18	0,01
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	25.846.610,15	9,64	0,00
ITAÚ UNIBANCO	8.122.609,79	3,03	0,00
NAVI CAPITAL	7.467.749,36	2,78	0,47
XP VISTA ASSET MANAGEMENT	7.130.299,47	2,66	0,00
XP GESTÃO DE RECURSOS	3.478.321,59	1,30	0,00
MOAT CAPITAL	3.180.627,66	1,19	0,04
SUL AMERICA INVESTIMENTOS GEST...	2.775.799,55	1,04	-
INDIE CAPITAL	2.319.295,59	0,86	0,12
ALASKA ASSET MANAGEMENT	2.297.062,37	0,86	0,02
SAFRA ASSET MANAGEMENT	2.234.271,20	0,83	0,00
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	2.031.140,86	0,76	0,00
LAD CAPITAL	1.535.735,20	0,57	-

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 '	138.726.555,53	51,73	40,00	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 '	49.929.989,77	18,62	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 '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	2.441.197,30	0,91	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	30,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	33.312.327,48	12,42	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	35.085.117,06	13,08	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	1.535.735,20	0,57	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	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	5,00
Artigo 9º - A, Inciso II	7.130.299,47	2,66	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso III	0,00	0,00	0,00	5,00

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%	-0,72%	1,02%	6,95%	16,67%	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%
IMA-B 5+ (Benchmark)	2,01%	-8,82%	-8,85%	-10,25%	8,47%	30,32%	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,92%	-8,86%	-8,90%	-10,22%	8,35%	29,79%	0,14%	0,16%
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	1,97%	-9,34%	-9,31%	-10,81%	7,64%	28,89%	0,14%	0,16%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA	1,77%	-4,10%	-4,43%	-4,40%	10,14%	-	0,10%	0,10%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,45%	1,88%	1,44%	2,65%	6,60%	13,72%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,41%	1,79%	1,37%	2,51%	6,31%	13,19%	0,00%	0,00%
IMA-B (Benchmark)	1,31%	-5,08%	-5,33%	-5,55%	8,94%	25,91%	-	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,22%	-5,36%	-5,60%	-5,85%	8,39%	25,02%	0,09%	0,11%
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	1,36%	-5,25%	-5,51%	-5,82%	8,68%	25,40%	0,09%	0,11%

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
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	1,13%	-6,32%	-5,99%	-6,10%	7,35%	25,01%	0,08%	0,10%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,14%	-0,60%	-0,79%	0,75%	5,98%	16,46%	0,01%	0,02%
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%
Selic (Benchmark)	0,28%	1,30%	0,92%	2,07%	5,19%	11,87%	-	-
BRABESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	0,26%	1,22%	0,86%	1,96%	4,99%	11,45%	0,00%	0,00%
CDI (Benchmark)	0,28%	1,30%	0,92%	2,07%	5,19%	11,87%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,20%	0,95%	0,67%	1,54%	4,07%	9,49%	0,00%	0,00%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	0,24%	0,63%	0,27%	1,33%	4,37%	11,22%	0,00%	0,01%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,22%	1,02%	0,72%	1,65%	4,31%	10,01%	0,00%	0,00%
BRABESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,08%	0,46%	0,30%	0,79%	2,51%	6,26%	0,00%	0,00%
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 VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,54%	-0,14%	-0,83%	0,54%	9,92%	21,85%	0,04%	0,04%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1,11%	2,43%	1,60%	2,52%	13,47%	24,61%	0,05%	0,04%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,44%	1,15%	0,80%	1,75%	10,41%	16,70%	0,01%	0,03%
BRABESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,02%	-0,30%	-0,73%	-0,40%	8,12%	18,37%	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
S&P 500 (Benchmark)	12,68%	-9,85%	-9,71%	-4,12%	-1,13%	9,98%	-	-
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	11,97%	-11,67%	-11,99%	-5,85%	-1,46%	14,06%	0,20%	0,25%
IBX (Benchmark)	10,27%	-30,14%	-29,25%	-24,33%	-15,12%	-4,14%	-	-
INDIE FIC AÇÕES	15,07%	-27,77%	-29,26%	-16,83%	2,86%	20,73%	0,24%	0,43%
Ibovespa (Benchmark)	10,25%	-30,39%	-29,23%	-24,92%	-16,45%	-6,51%	-	-
XP INVESTOR FI AÇÕES	14,71%	-31,12%	-33,24%	-21,42%	-4,80%	5,90%	0,27%	0,46%
BRADESCO VALUATION IBOVESPA FIC AÇÕES	8,76%	-32,41%	-33,22%	-26,55%	-15,63%	-8,66%	0,21%	0,38%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	12,22%	-25,87%	-24,13%	-19,05%	-5,04%	15,46%	0,25%	0,35%
XP INVESTOR 30 FIC AÇÕES	14,21%	-31,08%	-33,25%	-21,42%	-5,61%	5,46%	0,26%	0,45%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	0,25%	1,41%	1,09%	2,61%	7,30%	-	0,00%	0,01%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	11,03%	-32,47%	-32,34%	-25,59%	-9,53%	3,07%	0,26%	0,39%
MOAT CAPITAL FIC AÇÕES	21,52%	-30,05%	-29,58%	-20,54%	-7,76%	12,32%	0,29%	0,47%
CDI (Benchmark)	0,28%	1,30%	0,92%	2,07%	5,19%	11,87%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	2,63%	-3,63%	-4,29%	-0,87%	7,95%	19,59%	0,05%	0,08%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
FP2 MULTIESTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	-	-

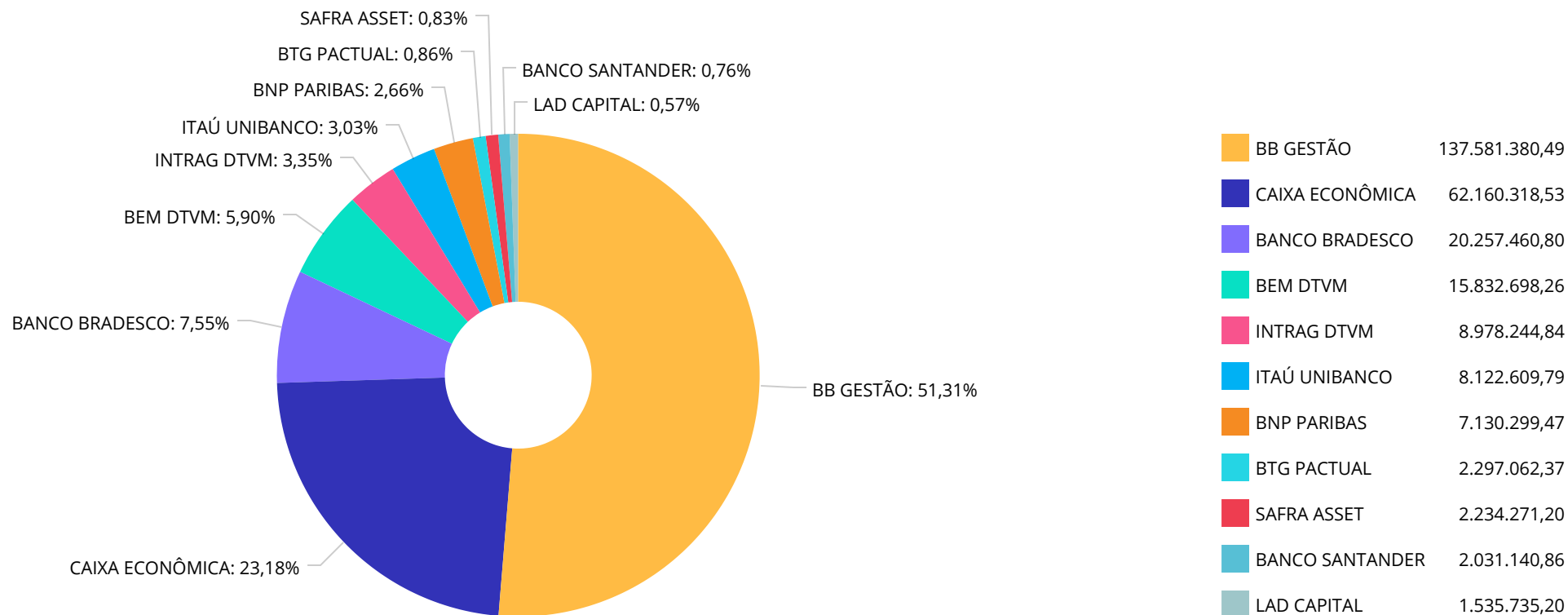
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Abril/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
ALASKA BLACK INSTITUCIONAL FI AÇÕES	14,16%	-29,53%	-30,64%	-21,18%	-10,92%	3,62%	0,17%	0,41%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	4,16%	-6,02%	-6,27%	-3,53%	-	-	0,06%	-
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	14,55%	-26,73%	-27,89%	-16,66%	-2,86%	17,53%	0,23%	0,40%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	9,92%	-37,04%	-37,27%	-26,20%	-11,06%	-2,86%	0,23%	0,45%

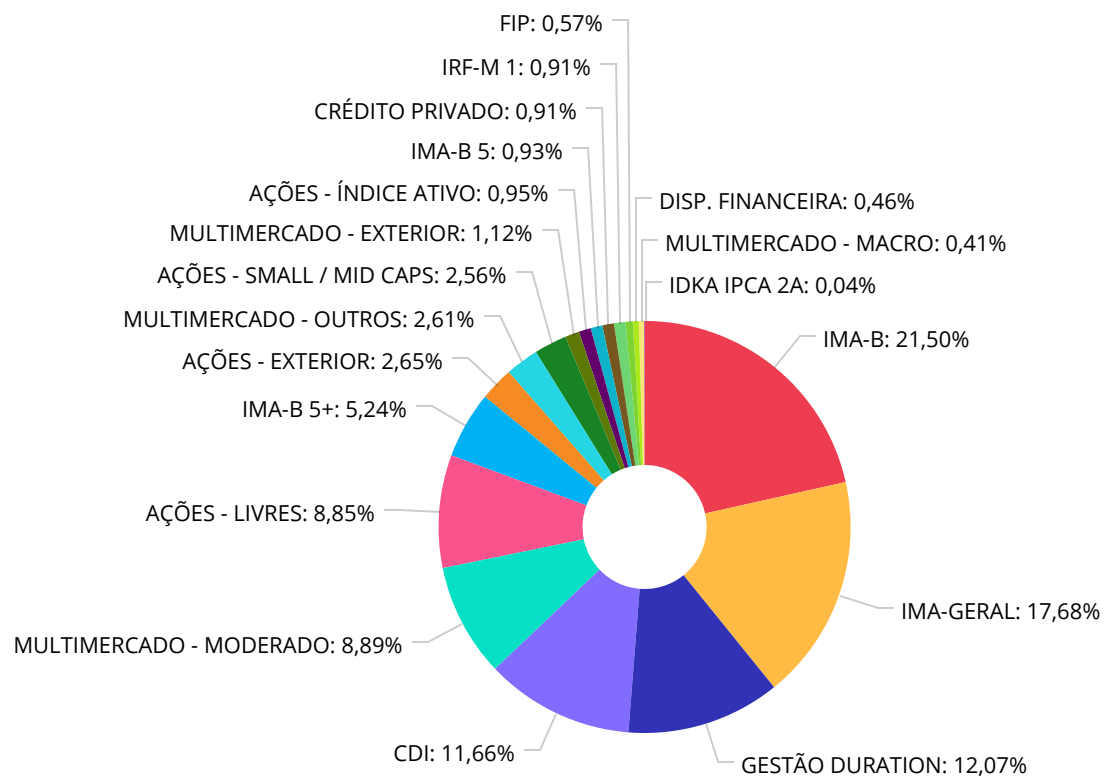
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Abril/2020 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕ...	17,78%	33,59%	22,77%	-	-	-	0,16%	-

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



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

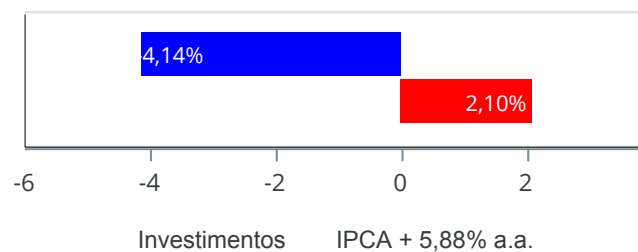


IMA-B	57.917.695,39
IMA-GERAL	47.636.725,90
GESTÃO DURATION	32.518.623,72
CDI	31.412.707,80
MULTIMERCADO - MODERADO	23.939.471,15
AÇÕES - LIVRES	23.851.734,29
IMA-B 5+	14.122.750,58
AÇÕES - EXTERIOR	7.130.299,47
MULTIMERCADO - OUTROS	7.034.190,68
AÇÕES - SMALL / MID CAPS	6.908.335,14
MULTIMERCADO - EXTERIOR	3.013.932,07
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	2.552.258,05
IMA-B 5	2.494.862,00
CRÉDITO PRIVADO	2.441.197,30
IRF-M 1	2.439.431,69
FIP	1.535.735,20
DISP. FINANCEIRA	1.238.245,42
MULTIMERCADO - MACRO	1.097.523,16
IDKA IPCA 2A	113.748,22

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

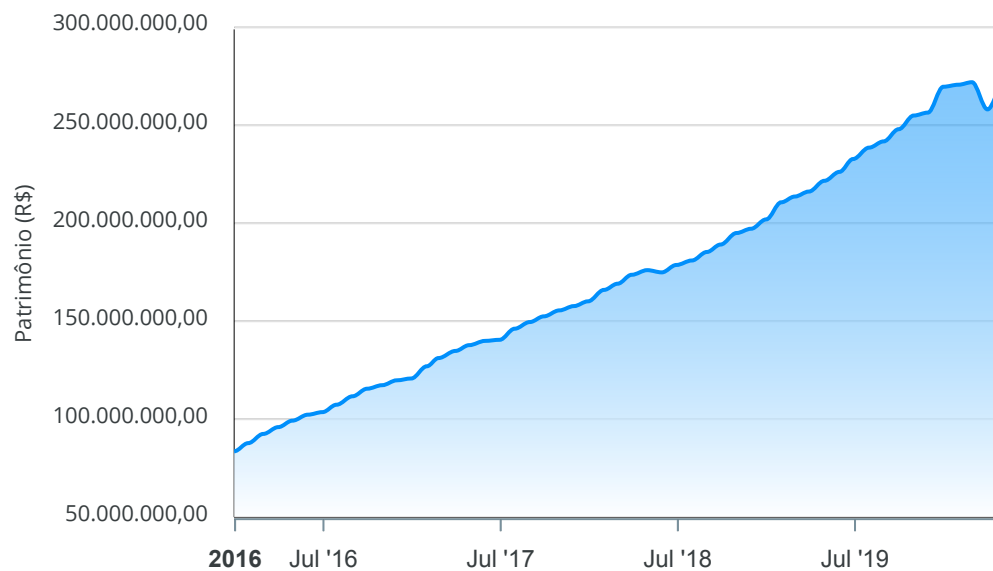
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	269.178.843,08	19.157.889,20	19.870.125,55	269.545.785,69	1.079.178,96	1.079.178,96	0,40%	0,40%	0,71%	0,71%	56,38%	2,13%
Fevereiro	269.545.785,69	21.259.186,81	17.391.810,86	270.813.319,60	-2.599.842,04	-1.520.663,08	-0,95%	-0,55%	0,66%	1,38%	-40,25%	3,31%
Março	270.813.319,60	66.210.024,06	62.649.762,03	256.935.597,06	-17.437.984,57	-18.958.647,65	-6,36%	-6,87%	0,57%	1,95%	-351,80%	14,74%
Abril	256.935.597,06	16.853.037,58	13.284.185,53	268.161.221,81	7.656.772,70	-11.301.874,95	2,94%	-4,14%	0,14%	2,10%	-197,01%	7,68%

Investimentos x Meta Atuarial



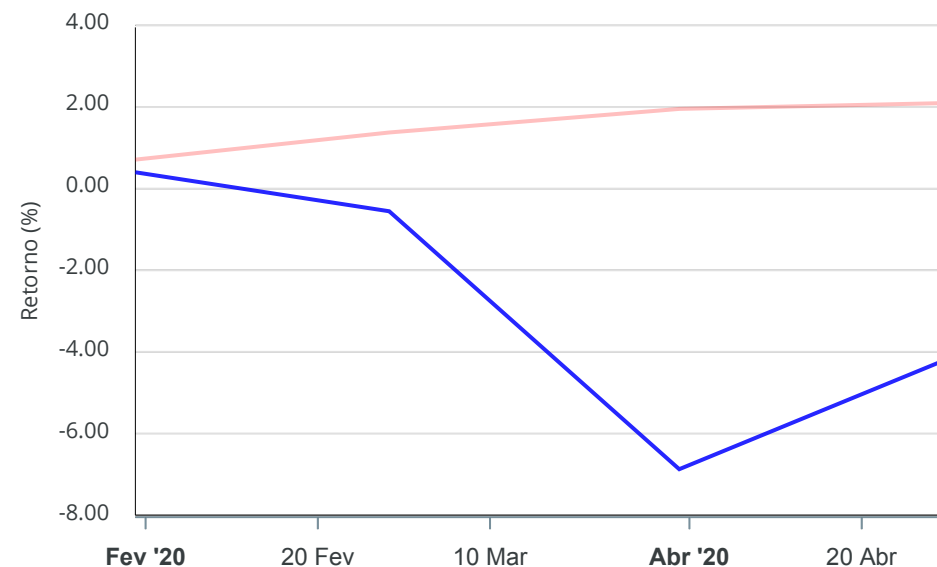
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	1.785.477,05	0,00	0,00	1.820.727,38	35.250,33	1,97%	1,97%	14,28%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	12.070.394,90	0,00	0,00	12.302.023,20	231.628,30	1,92%	1,92%	14,30%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA	2.195.514,16	0,00	0,00	2.234.271,20	38.757,04	1,77%	1,77%	10,41%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	4.007.389,46	0,00	0,00	4.061.936,77	54.547,31	1,36%	1,36%	9,48%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.614.508,90	0,00	0,00	7.707.439,84	92.930,94	1,22%	1,22%	9,05%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	2.744.708,28	0,00	0,00	2.775.799,55	31.091,27	1,13%	1,13%	8,45%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	27.288.195,09	0,00	0,00	27.591.445,74	303.250,65	1,11%	1,11%	4,96%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.866.710,08	0,00	0,00	2.896.037,12	29.327,04	1,02%	1,02%	5,14%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	47.205.925,74	0,00	0,00	47.636.725,90	430.800,16	0,91%	0,91%	4,82%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	7.737.068,95	0,00	0,00	7.800.533,48	63.464,53	0,82%	0,82%	4,29%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDEN...	27.252.372,88	0,00	0,00	27.399.197,84	146.824,96	0,54%	0,54%	3,99%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	2.022.149,80	0,00	0,00	2.031.140,86	8.991,06	0,44%	0,44%	0,89%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	2.430.739,11	0,00	0,00	2.441.197,30	10.458,19	0,43%	0,43%	2,86%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	2.429.414,99	0,00	0,00	2.439.431,69	10.016,70	0,41%	0,41%	0,49%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	113.381,20	0,00	0,00	113.748,22	367,02	0,32%	0,32%	2,68%
BRDESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	525,71	0,00	0,00	527,09	1,38	0,26%	0,26%	0,00%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	20.394.485,42	0,00	0,00	20.442.894,35	48.408,93	0,24%	0,24%	0,21%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	2.819,65	0,00	0,00	2.825,80	6,15	0,22%	0,22%	0,00%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.077.831,89	1.017.483,94	1.059.360,79	2.040.486,17	4.531,13	0,15%	0,20%	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	5.930.032,77	0,00	0,00	5.938.516,71	8.483,94	0,14%	0,14%	1,33%

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
BRADESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	7.307.639,57	13.835.553,64	12.224.824,74	8.925.974,39	7.605,92	0,04%	0,08%	0,00%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.495.446,00	0,00	0,00	2.494.862,00	-584,00	-0,02%	-0,02%	0,72%
Total Renda Fixa	187.972.731,60	14.853.037,58	13.284.185,53	191.097.742,60	1.556.158,95	0,82%		4,74%

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
MOAT CAPITAL FIC AÇÕES	2.617.366,71	0,00	0,00	3.180.627,66	563.260,95	21,52%	21,52%	29,50%
INDIE FIC AÇÕES	2.015.473,57	0,00	0,00	2.319.295,59	303.822,02	15,07%	15,07%	24,39%
XP INVESTOR FI AÇÕES	1.285.029,06	0,00	0,00	1.474.066,02	189.036,96	14,71%	14,71%	26,55%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	4.879.170,88	0,00	0,00	5.589.149,35	709.978,47	14,55%	14,55%	22,88%
ALASKA BLACK INSTITUCIONAL FI AÇÕES	2.012.200,53	0,00	0,00	2.297.062,37	284.861,84	14,16%	14,16%	17,37%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	6.654.615,19	0,00	0,00	7.467.749,36	813.134,17	12,22%	12,22%	24,84%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	2.691.850,95	0,00	0,00	3.013.932,07	322.081,12	11,97%	11,97%	20,07%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	4.601.251,52	0,00	0,00	5.108.677,72	507.426,20	11,03%	11,03%	25,89%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	1.200.150,62	0,00	0,00	1.319.185,79	119.035,17	9,92%	9,92%	23,19%
BRADESCO VALUATION IBOVESPA FIC AÇÕES	2.346.761,33	0,00	0,00	2.552.258,05	205.496,72	8,76%	8,76%	21,45%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	22.983.084,43	0,00	0,00	23.939.471,15	956.386,72	4,16%	4,16%	6,29%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.069.404,84	0,00	0,00	1.097.523,16	28.118,32	2,63%	2,63%	4,66%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTI...	7.016.729,99	0,00	0,00	7.034.190,68	17.460,69	0,25%	0,25%	0,38%
XP INVESTOR 30 FIC AÇÕES	0,00	2.000.000,00	0,00	2.004.255,57	4.255,57	0,21%	14,21%	25,54%
FP2 MULTIESTRATÉGIA FIP	1.535.839,64	0,00	0,00	1.535.735,20	-104,44	-0,01%	-	-
Total Renda Variável	62.908.929,26	2.000.000,00	0,00	69.933.179,74	5.024.250,48	7,74%		15,07%

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
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO E...	6.053.936,20	0,00	0,00	7.130.299,47	1.076.363,27	17,78%	17,78%	15,66%
Total Renda Variável	6.053.936,20	0,00	0,00	7.130.299,47	1.076.363,27	17,78%		15,66%