

Relatório Analítico dos Investimentos em março e 1º trimestre de 2020

Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

Carteira consolidada de investimentos - base (Março / 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	7.737.068,95	3,01%	51	2,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	16/08/2020	2.495.446,00	0,97%	107	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	D+2	Não há	2.744.708,28	1,07%	27.054	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	2.195.514,16	0,85%	31	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	47.205.925,74	18,37%	596	0,45%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	113.381,20	0,04%	882	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVID...	D+0	15/08/2024	27.252.372,88	10,61%	31	9,83%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	27.288.195,09	10,62%	733	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	2.429.414,99	0,95%	1.227	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVI...	D+2	Não há	12.070.394,90	4,70%	324	0,62%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	15/08/2022	5.930.032,77	2,31%	165	0,89%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	7.614.508,90	2,96%	282	0,50%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	4.007.389,46	1,56%	117	0,22%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	D+0	Não há	20.394.485,42	7,94%	86	2,72%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.819,65	0,00%	319	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRDESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZ...	D+0	Não há	7.307.639,57	2,84%	1.537	0,96%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	2.022.149,80	0,79%	102	0,23%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRDESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	525,71	0,00%	401	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.077.831,89	0,81%	744	0,13%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.785.477,05	0,69%	50	0,64%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Março / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	2.866.710,08	1,12%	169	0,25%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO...	D+30 ou...	Não há	2.430.739,11	0,95%	74	0,42%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.200.150,62	0,47%	19.407	0,37%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ALASKA BLACK INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+32	Não há	2.012.200,53	0,78%	125.045	0,13%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAU DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	4.601.251,52	1,79%	55.486	0,17%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	D+4	Não há	4.879.170,88	1,90%	2.167	0,32%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BRADESCO VALUATION IBOVESPA FIC AÇÕES	D+4	Não há	2.346.761,33	0,91%	719	4,34%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
INDIE FIC AÇÕES	D+32	Não há	2.015.473,57	0,78%	18.968	0,90%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
MOAT CAPITAL FIC AÇÕES	D+17	Não há	2.617.366,71	1,02%	3.026	0,20%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
XP INVESTOR FI AÇÕES	D+4	Não há	1.285.029,06	0,50%	3.421	0,47%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	6.654.615,19	2,59%	4.099	0,84%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	1.069.404,84	0,42%	19.517	0,02%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MUL...	D+2	01/10/2020	7.016.729,99	2,73%	956	1,39%	Artigo 8º, Inciso III
ITAU PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	2.691.850,95	1,05%	875	0,33%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	22.983.084,43	8,95%	61	17,61%	Artigo 8º, Inciso III
FP2 MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não há	1.535.839,64	0,60%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO...	D+5	Não há	6.053.936,20	2,36%	171	4,86%	Artigo 9º - A, Inciso II
Total para cálculo dos limites da Resolução			256.935.597,06				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			1.218.508,81				Artigo 6º
PL Total			258.154.105,87				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Março / 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%	256.935.597,06
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	137.462.454,96	53,50%	40,00%	50,00%	100,00%	119.473.142,10
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	256.935.597,06
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	12.846.779,85
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	154.161.358,24
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	154.161.358,24
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	48.079.537,53	18,71%	0,00%	8,00%	40,00%	54.694.701,29
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	102.774.238,82
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	51.387.119,41
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	15,00%	38.540.339,56
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	38.540.339,56
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	12.846.779,85
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	2.430.739,11	0,95%	0,00%	2,00%	5,00%	10.416.040,74
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	12.846.779,85
Total Renda Fixa	100,00%	187.972.731,60	73,16%	40,00%	65,00%	570,00%	

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Março / 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%	77.080.679,12
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	77.080.679,12
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	27.612.019,41	10,75%	0,00%	15,00%	20,00%	23.775.100,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	51.387.119,41
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	33.761.070,21	13,14%	0,00%	5,00%	10,00%	-8.067.510,50
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	1.535.839,64	0,60%	0,00%	1,00%	5,00%	11.310.940,21
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	12.846.779,85
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	12.846.779,85
Total Renda Variável	30,00%	62.908.929,26	24,48%	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%	12.846.779,85
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	6.053.936,20	2,36%	0,00%	1,00%	5,00%	6.792.843,65
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	5,00%	12.846.779,85
Total Exterior	10,00%	6.053.936,20	2,36%	0,00%	5,00%	15,00%	

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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	136.456.307,37	53,11	0,01
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	60.855.680,00	23,69	0,01
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	23.193.674,08	9,03	0,00
ITAÚ UNIBANCO	7.293.102,47	2,84	0,00
NAVI CAPITAL	6.654.615,19	2,59	0,44
XP VISTA ASSET MANAGEMENT	6.053.936,20	2,36	0,00
SUL AMERICA INVESTIMENTOS GEST...	2.744.708,28	1,07	0,01
MOAT CAPITAL	2.617.366,71	1,02	0,04
SAFRA ASSET MANAGEMENT	2.195.514,16	0,85	0,00
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	2.022.149,80	0,79	0,00
INDIE CAPITAL	2.015.473,57	0,78	-
ALASKA ASSET MANAGEMENT	2.012.200,53	0,78	0,02
LAD CAPITAL	1.535.839,64	0,60	-
XP GESTÃO DE RECURSOS	1.285.029,06	0,50	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 '	137.462.454,96	53,50	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 '	48.079.537,53	18,71	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 '	2.430.739,11	0,95	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 '	27.612.019,41	10,75	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	33.761.070,21	13,14	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	1.535.839,64	0,60	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	6.053.936,20	2,36	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 Março/2020 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA Geral ex-C (Benchmark)	-1,93%	-1,00%	-1,00%	0,87%	8,34%	18,40%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-2,10%	-1,18%	-1,18%	0,61%	8,55%	18,63%	0,08%	0,04%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	-1,21%	0,00%	0,00%	2,46%	9,11%	19,14%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,66%	-0,66%	-0,66%	1,94%	7,78%	17,10%	0,06%	0,03%
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	0,58%	1,98%	1,98%	5,33%	9,55%	21,38%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,89%	-0,47%	-0,47%	2,19%	11,28%	22,26%	0,08%	0,04%
IMA-B 5+ (Benchmark)	-10,93%	-10,62%	-10,62%	-7,92%	8,24%	26,94%	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-10,89%	-10,58%	-10,58%	-7,80%	8,16%	26,53%	0,25%	0,16%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	-11,33%	-11,10%	-11,10%	-8,43%	7,39%	25,57%	0,26%	0,16%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA	-6,70%	-5,76%	-5,76%	-2,75%	10,06%	-	0,19%	0,10%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,60%	1,43%	1,43%	2,83%	6,66%	13,79%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,60%	1,38%	1,38%	2,70%	6,40%	13,27%	0,01%	0,00%
IMA-B (Benchmark)	-6,97%	-6,31%	-6,31%	-3,64%	9,14%	24,10%	-	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-7,12%	-6,50%	-6,50%	-3,88%	8,66%	23,30%	0,17%	0,11%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	-7,20%	-6,52%	-6,52%	-3,85%	8,81%	23,49%	0,17%	0,11%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	-6,92%	-7,37%	-7,37%	-4,35%	7,79%	23,52%	0,17%	0,10%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,34%	-0,74%	-0,74%	1,66%	6,93%	16,97%	0,03%	0,02%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,13%	-3,58%	-3,58%	-1,26%	-0,19%	1,90%	0,01%	0,04%
Selic (Benchmark)	0,34%	1,01%	1,01%	2,26%	5,44%	12,13%	-	-
BRDESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	0,32%	0,95%	0,95%	2,16%	5,24%	11,72%	0,00%	0,00%
CDI (Benchmark)	0,34%	1,01%	1,01%	2,26%	5,44%	12,12%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,25%	0,75%	0,75%	1,73%	4,31%	9,74%	0,00%	0,00%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	-0,25%	0,39%	0,39%	1,53%	4,65%	11,52%	0,00%	0,01%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,26%	0,80%	0,80%	1,83%	4,55%	10,26%	0,00%	0,00%
BRDESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,11%	0,38%	0,38%	0,96%	2,74%	6,50%	0,00%	0,00%
IPCA (Benchmark)	0,07%	0,53%	0,53%	2,31%	3,30%	8,03%	-	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	-2,03%	-0,90%	-0,90%	1,51%	8,06%	18,88%	0,06%	0,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-2,06%	-0,68%	-0,68%	1,89%	10,67%	21,36%	0,08%	0,04%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	-0,13%	1,31%	1,31%	3,13%	13,46%	23,65%	0,08%	0,04%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,09%	0,70%	0,70%	3,07%	10,94%	16,52%	0,01%	0,03%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-2,11%	-1,31%	-1,31%	0,48%	7,84%	17,51%	0,09%	0,04%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
S&P 500 (Benchmark)	1,10%	3,18%	3,18%	8,39%	21,65%	53,08%	-	-
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	-14,99%	-21,11%	-21,11%	-14,11%	-8,03%	2,45%	0,41%	0,22%
IBX (Benchmark)	-30,09%	-36,64%	-36,64%	-29,86%	-22,20%	-12,35%	-	-
INDIE FIC AÇÕES	-34,41%	-37,23%	-37,23%	-24,86%	-7,53%	3,72%	-	-
Ibovespa (Benchmark)	-29,90%	-36,86%	-36,86%	-30,29%	-23,47%	-14,46%	-	-
XP INVESTOR FI AÇÕES	-38,17%	-39,95%	-39,95%	-30,06%	-15,37%	-5,18%	0,64%	0,43%
BRDESCO VALUATION IBOVESPA FIC AÇÕES	-32,15%	-37,85%	-37,85%	-31,02%	-22,18%	-15,54%	0,53%	0,36%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-27,86%	-33,94%	-33,94%	-25,53%	-14,99%	5,24%	0,57%	0,32%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	0,57%	1,16%	1,16%	2,71%	7,54%	-	0,01%	0,01%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-32,44%	-39,18%	-39,18%	-31,38%	-17,47%	-4,42%	0,55%	0,38%
MOAT CAPITAL FIC AÇÕES	-36,50%	-42,44%	-42,44%	-34,83%	-22,82%	-5,18%	0,66%	0,41%
CDI (Benchmark)	0,34%	1,01%	1,01%	2,26%	5,44%	12,12%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	-5,31%	-6,10%	-6,10%	-2,57%	6,44%	17,36%	0,10%	0,07%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
FP2 MULTIESTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	-	-
ALASKA BLACK INSTITUCIONAL FI AÇÕES	-32,19%	-38,27%	-38,27%	-30,45%	-24,18%	-4,32%	0,67%	0,38%

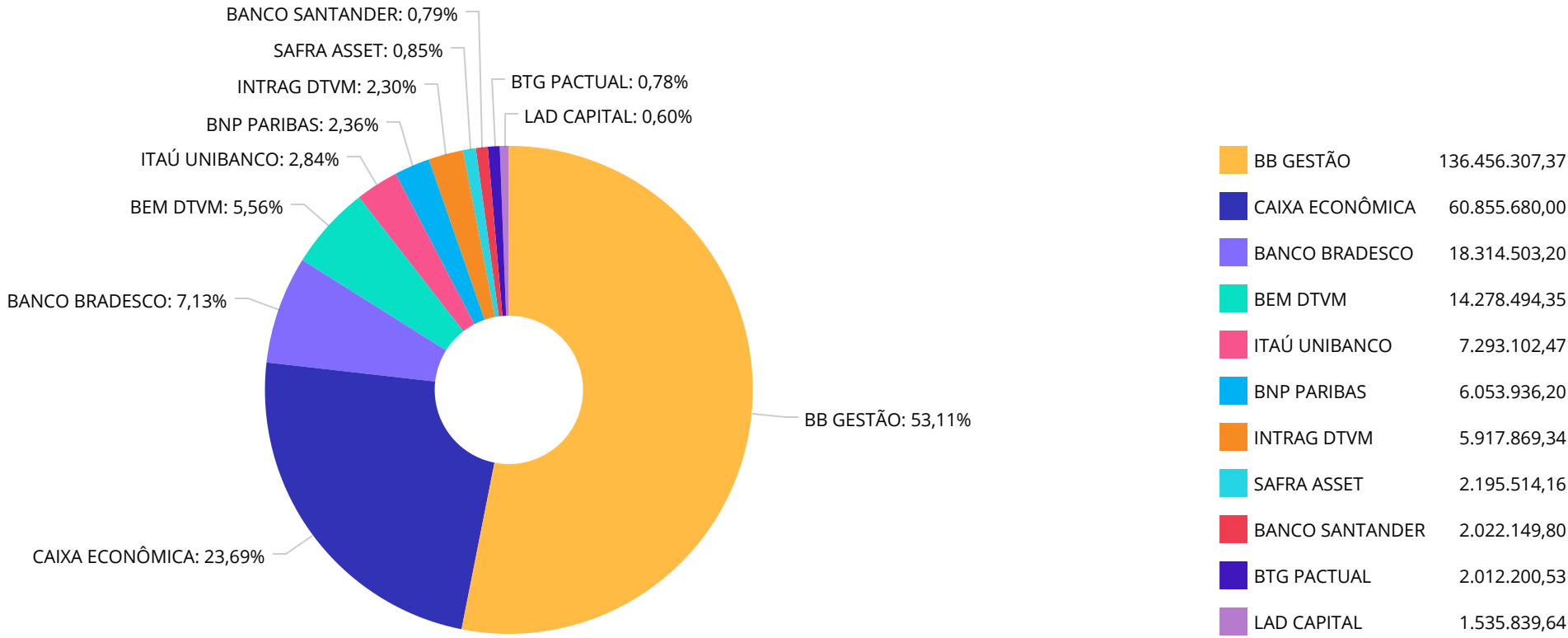
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Março/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	-7,92%	-9,77%	-9,77%	-	-	-	0,18%	-
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	-31,64%	-36,03%	-36,03%	-26,34%	-12,50%	5,75%	0,56%	0,37%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	-37,39%	-42,72%	-42,72%	-31,50%	-17,87%	-9,73%	0,59%	0,44%

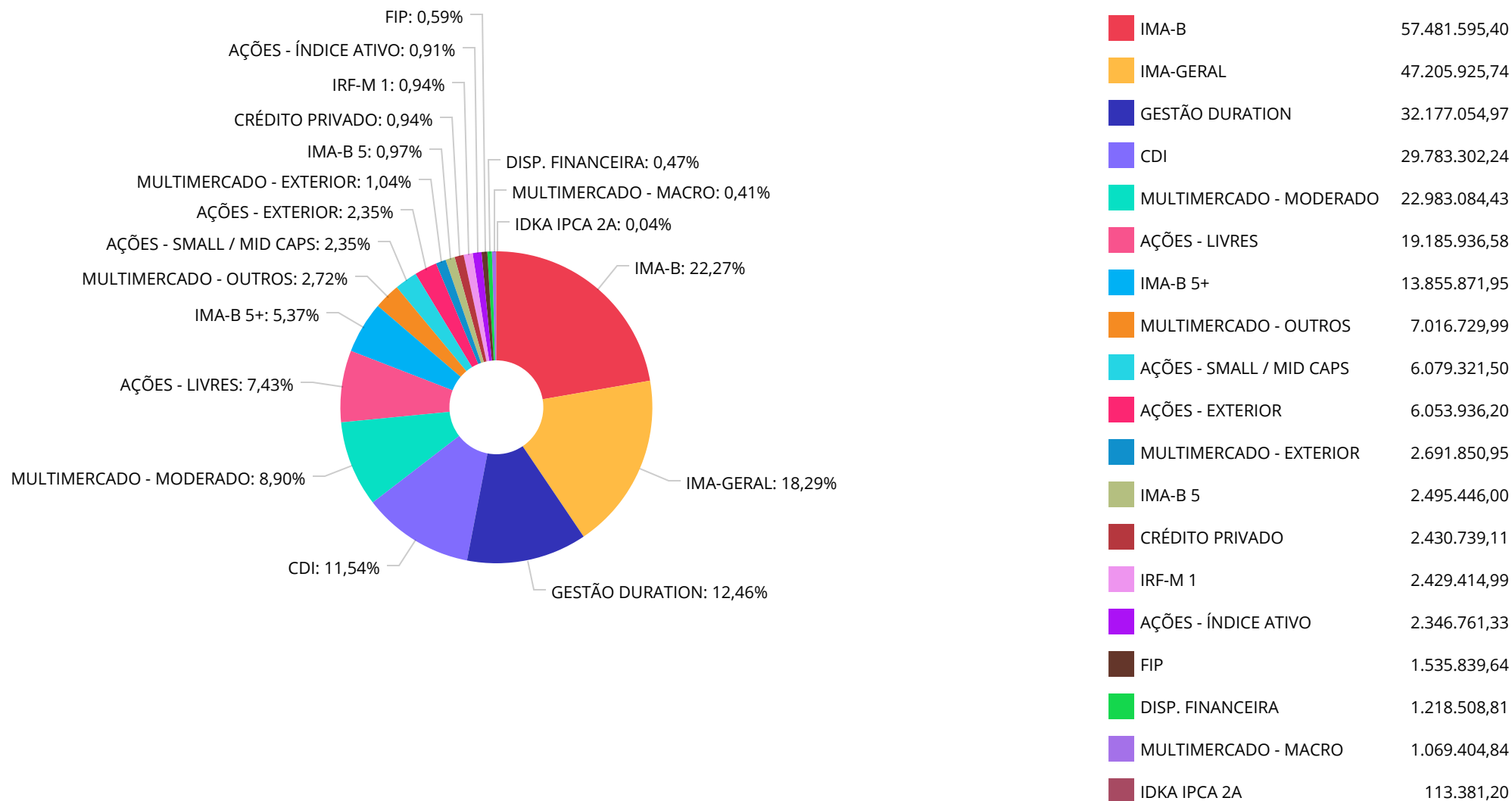
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Março/2020 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕ...	7,43%	13,43%	13,43%	-	-	-	0,20%	-

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



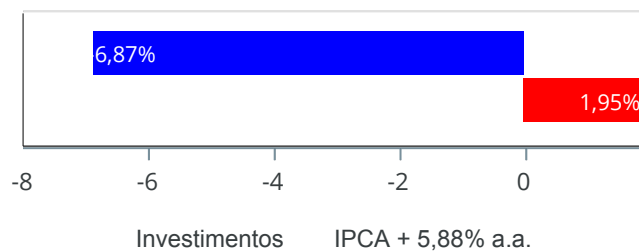
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Março / 2020)



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

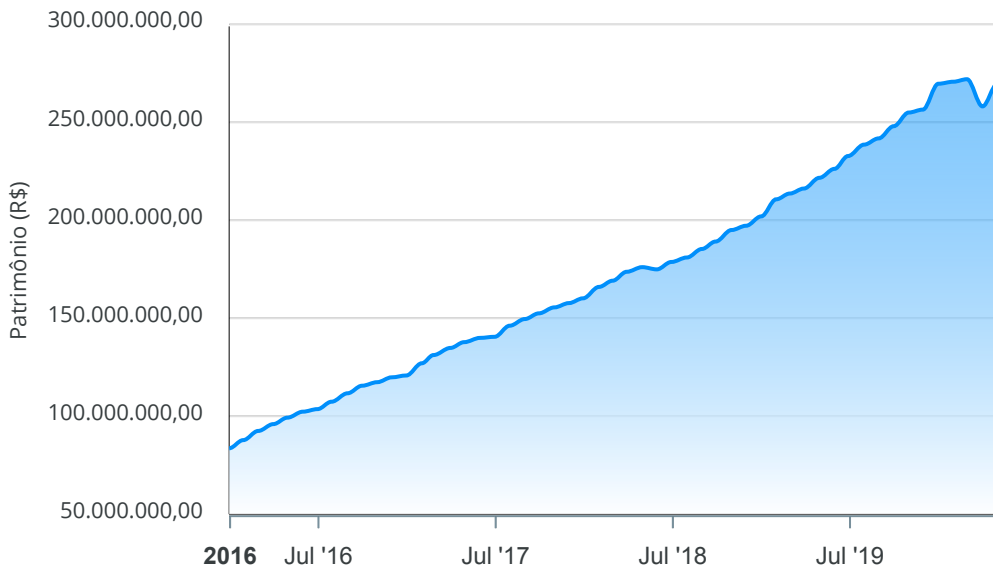
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	269.178.843,08	19.157.889,20	19.870.125,55	269.545.785,69	1.079.178,96	1.079.178,96	0,40%	0,40%	0,71%	0,71%	56,38%	2,13%
Fevereiro	269.545.785,69	21.259.186,81	17.391.810,86	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%

Investimentos x Meta Atuarial



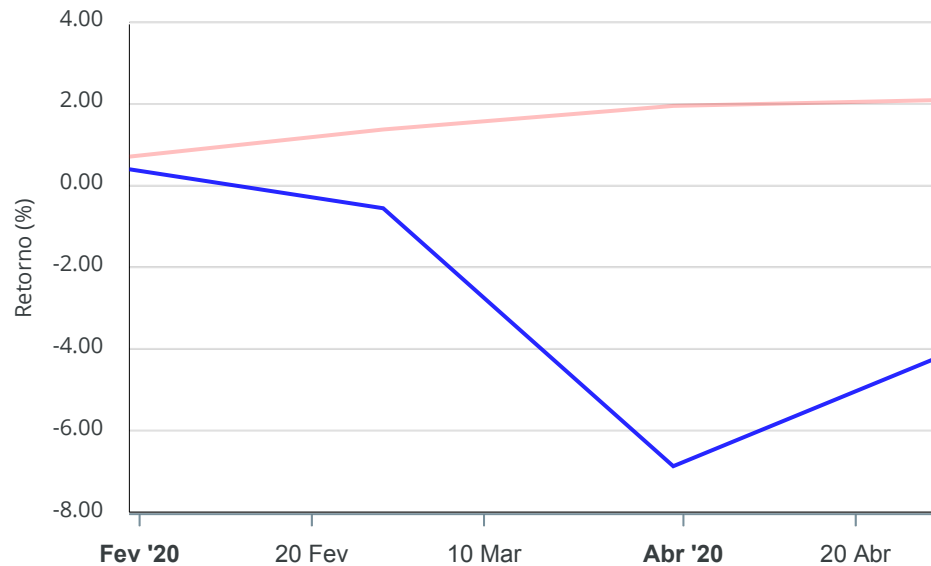
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Março/2020
FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	2.414.982,85	0,00	0,00	2.429.414,99	14.432,14	0,60%	0,60%	0,62%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	22.090.424,63	0,00	22.171.830,12	0,00	81.405,49	0,37%	0,59%	0,62%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	524,03	0,00	0,00	525,71	1,68	0,32%	0,32%	0,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.999.045,18	1.421.540,12	3.348.822,79	2.077.831,89	6.069,38	0,11%	0,25%	0,01%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	2.020.288,72	0,00	0,00	2.022.149,80	1.861,08	0,09%	0,09%	0,84%
BRADESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	9.700.383,39	11.962.527,29	14.366.040,77	7.307.639,57	10.769,66	0,05%	0,11%	0,01%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	508.790,15	0,00	508.941,83	0,00	151,68	0,03%	-0,03%	0,18%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	82.253,38	22.171.830,12	22.254.126,52	2.819,65	2.862,67	0,01%	0,26%	0,01%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	27.323.900,66	0,00	0,00	27.288.195,09	-35.705,57	-0,13%	-0,13%	7,65%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	20.445.111,46	0,00	0,00	20.394.485,42	-50.626,04	-0,25%	-0,25%	0,27%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.524.034,00	0,00	0,00	2.495.446,00	-28.588,00	-1,13%	-1,13%	1,28%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	6.010.652,61	0,00	0,00	5.930.032,77	-80.619,84	-1,34%	-1,34%	3,11%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	115.298,21	0,00	0,00	113.381,20	-1.917,01	-1,66%	-1,66%	5,67%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	7.885.978,46	0,00	0,00	7.737.068,95	-148.909,51	-1,89%	-1,89%	8,04%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	2.481.228,21	0,00	0,00	2.430.739,11	-50.489,10	-2,03%	-2,03%	6,06%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDEN...	27.825.476,00	0,00	0,00	27.252.372,88	-573.103,12	-2,06%	-2,06%	8,41%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	48.219.130,44	0,00	0,00	47.205.925,74	-1.013.204,70	-2,10%	-2,10%	8,04%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.928.569,10	0,00	0,00	2.866.710,08	-61.859,02	-2,11%	-2,11%	9,00%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA	2.353.096,85	0,00	0,00	2.195.514,16	-157.582,69	-6,70%	-6,70%	18,98%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	2.948.766,49	0,00	0,00	2.744.708,28	-204.058,21	-6,92%	-6,92%	16,70%

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.197.896,80	0,00	0,00	7.614.508,90	-583.387,90	-7,12%	-7,12%	16,53%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	4.318.332,46	0,00	0,00	4.007.389,46	-310.943,00	-7,20%	-7,20%	17,34%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	13.544.973,18	0,00	0,00	12.070.394,90	-1.474.578,28	-10,89%	-10,89%	25,25%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	2.013.512,88	0,00	0,00	1.785.477,05	-228.035,83	-11,33%	-11,33%	25,61%
Total Renda Fixa	219.952.650,14	35.555.897,53	62.649.762,03	187.972.731,60	-4.886.054,04	-1,91%		8,43%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	0,00	22.254.126,53	0,00	22.983.084,43	728.957,90	3,28%	-7,92%	17,69%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTI...	6.976.801,87	0,00	0,00	7.016.729,99	39.928,12	0,57%	0,57%	0,87%
FP2 MULTISTRATÉGIA FIP	1.535.944,08	0,00	0,00	1.535.839,64	-104,44	-0,01%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.129.396,44	0,00	0,00	1.069.404,84	-59.991,60	-5,31%	-5,31%	9,55%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	3.166.371,61	0,00	0,00	2.691.850,95	-474.520,66	-14,99%	-14,99%	40,91%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	9.224.674,42	0,00	0,00	6.654.615,19	-2.570.059,23	-27,86%	-27,86%	57,35%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	7.137.745,25	0,00	0,00	4.879.170,88	-2.258.574,37	-31,64%	-31,64%	56,38%
BRADESCO VALUATION IBOVESPA FIC AÇÕES	3.458.880,47	0,00	0,00	2.346.761,33	-1.112.119,14	-32,15%	-32,15%	52,86%
ALASKA BLACK INSTITUCIONAL FI AÇÕES	2.967.447,86	0,00	0,00	2.012.200,53	-955.247,33	-32,19%	-32,19%	67,21%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	6.811.083,03	0,00	0,00	4.601.251,52	-2.209.831,51	-32,44%	-32,44%	55,05%
INDIE FIC AÇÕES	0,00	3.000.000,00	0,00	2.015.473,57	-984.526,43	-32,82%	-34,41%	-
MOAT CAPITAL FIC AÇÕES	4.121.689,27	0,00	0,00	2.617.366,71	-1.504.322,56	-36,50%	-36,50%	65,57%
XP INVESTOR FI AÇÕES	2.078.278,42	0,00	0,00	1.285.029,06	-793.249,36	-38,17%	-38,17%	63,98%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	0,00	2.000.000,00	0,00	1.200.150,62	-799.849,38	-39,99%	-37,39%	58,85%
Total Renda Variável	48.608.312,72	27.254.126,53	0,00	62.908.929,26	-12.953.509,99	-17,07%		34,15%

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO E...	2.252.356,74	3.400.000,00	0,00	6.053.936,20	401.579,46	7,10%	7,43%	20,37%
Total Renda Variável	2.252.356,74	3.400.000,00	0,00	6.053.936,20	401.579,46	7,10%		20,37%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre/2020
FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	26.935.635,85	0,00	0,00	27.288.195,09	352.559,24	1,31%	1,31%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	21.917.851,95	0,00	22.171.830,12	0,00	253.978,17	1,16%	1,38%
BB INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	20.315.315,13	0,00	0,00	20.394.485,42	79.170,29	0,39%	0,39%
BRDESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	11.641.299,35	42.764.201,34	47.139.679,74	7.307.639,57	41.818,62	0,08%	0,38%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	2.396.440,01	0,00	0,00	2.429.414,99	32.974,98	1,38%	1,38%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.305.557,00	5.667.508,97	6.912.139,11	2.077.831,89	16.905,03	0,19%	0,75%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	2.008.066,83	0,00	0,00	2.022.149,80	14.082,97	0,70%	0,70%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	505.635,49	0,00	508.941,83	0,00	3.306,34	0,65%	0,59%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	12.700,08	22.241.263,23	22.254.126,52	2.819,65	2.982,86	0,01%	0,80%
BRDESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	520,75	0,00	0,00	525,71	4,96	0,95%	0,95%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	114.139,03	0,00	0,00	113.381,20	-757,83	-0,66%	-0,66%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	2.452.937,28	0,00	0,00	2.430.739,11	-22.198,17	-0,90%	-0,90%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.588.008,00	0,00	69.469,61	2.495.446,00	-23.092,39	-0,89%	-3,58%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	7.773.848,83	0,00	0,00	7.737.068,95	-36.779,88	-0,47%	-0,47%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.904.735,21	0,00	0,00	2.866.710,08	-38.025,13	-1,31%	-1,31%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	6.134.902,96	0,00	161.518,40	5.930.032,77	-43.351,79	-0,71%	-0,74%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA	2.329.755,32	0,00	0,00	2.195.514,16	-134.241,16	-5,76%	-5,76%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDEN...	28.123.302,25	0,00	693.993,11	27.252.372,88	-176.936,26	-0,63%	-0,68%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	2.008.308,28	0,00	0,00	1.785.477,05	-222.831,23	-11,10%	-11,10%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	0,00	3.000.000,00	0,00	2.744.708,28	-255.291,72	-8,51%	-7,37%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	4.286.911,01	0,00	0,00	4.007.389,46	-279.521,55	-6,52%	-6,52%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.143.575,27	0,00	0,00	7.614.508,90	-529.066,37	-6,50%	-6,50%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	47.768.176,02	0,00	0,00	47.205.925,74	-562.250,28	-1,18%	-1,18%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	13.498.192,77	0,00	0,00	12.070.394,90	-1.427.797,87	-10,58%	-10,58%
				Total Renda Fixa	-2.954.358,17	-1,02%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre/2020
FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	0,00	22.254.126,53	0,00	22.983.084,43	728.957,90	3,28%	-9,77%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTI...	6.936.270,99	0,00	0,00	7.016.729,99	80.459,00	1,16%	1,16%
FP2 MULTISTRATÉGIA FIP	1.535.984,39	0,00	0,00	1.535.839,64	-144,75	-0,01%	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.138.919,18	0,00	0,00	1.069.404,84	-69.514,34	-6,10%	-6,10%
ITAU PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	3.412.230,98	0,00	0,00	2.691.850,95	-720.380,03	-21,11%	-21,11%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	0,00	2.000.000,00	0,00	1.200.150,62	-799.849,38	-39,99%	-42,72%
XP INVESTOR FI AÇÕES	2.139.992,49	0,00	0,00	1.285.029,06	-854.963,43	-39,95%	-39,95%
INDIE FIC AÇÕES	0,00	3.000.000,00	0,00	2.015.473,57	-984.526,43	-32,82%	-37,23%
ALASKA BLACK INSTITUCIONAL FI AÇÕES	3.259.708,68	0,00	0,00	2.012.200,53	-1.247.508,15	-38,27%	-38,27%
BRADESCO VALUATION IBOVESPA FIC AÇÕES	3.776.125,64	0,00	0,00	2.346.761,33	-1.429.364,31	-37,85%	-37,85%
MOAT CAPITAL FIC AÇÕES	4.547.148,70	0,00	0,00	2.617.366,71	-1.929.781,99	-42,44%	-42,44%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	7.627.656,71	0,00	0,00	4.879.170,88	-2.748.485,83	-36,03%	-36,03%
ITAU DUNAMIS FIC AÇÕES	7.564.753,38	0,00	0,00	4.601.251,52	-2.963.501,86	-39,18%	-39,18%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	10.074.237,27	0,00	0,00	6.654.615,19	-3.419.622,08	-33,94%	-33,94%
				Total Renda Variável	-16.358.225,68	-20,64%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre/2020

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO E...	0,00	5.700.000,00	0,00	6.053.936,20	353.936,20	6,21%	13,43%
				Total Exterior	353.936,20	6,21%	