

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 IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	34.667.600,91	6,38%	673	0,60%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	15/08/2022	23.851.596,98	4,39%	165	3,57%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	17.113.644,85	3,15%	882	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	40.887.011,44	7,53%	733	0,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	12.552.116,40	2,31%	6	24,52%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS F...	D+1	Não há	16.924.964,98	3,12%	210	1,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	79.599.649,59	14,65%	913	1,35%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	29.993.654,27	5,52%	105	3,38%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	17.413.375,64	3,21%	74	1,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	D+2	Não há	41.567.426,31	7,65%	27.054	3,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	19.883.374,51	3,66%	962	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	3.851.509,95	0,71%	689	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	91.801.526,31	16,90%	279	1,83%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se ...	Não se aplica	1.301.924,19	0,24%	98	1,53%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	D+4	Não há	5.397.949,60	0,99%	1.146	0,90%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	D+4	Não há	4.155.147,17	0,76%	2.167	0,27%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAU FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	7.998.672,16	1,47%	53	1,39%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
VINCI MOSAICO FI AÇÕES	D+4 du ...	Não há	4.221.080,32	0,78%	1.871	0,36%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	D+4	Não há	6.075.030,42	1,12%	16.160	0,78%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	5.727.499,35	1,05%	1.899	2,56%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '

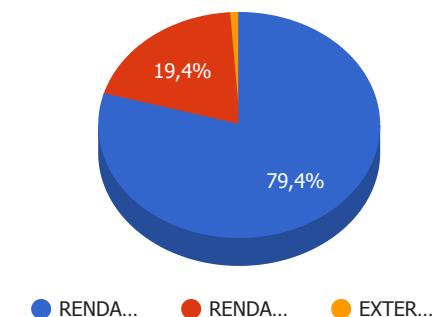
Carteira consolidada de investimentos - base (Março / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	9.478.650,90	1,75%	7.180	1,03%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	6.154.472,10	1,13%	6.657	0,45%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	9.132.535,81	1,68%	207	1,64%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	D+2	Não há	14.503.804,72	2,67%	42	4,39%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	6.391.441,71	1,18%	21.972	0,27%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	5.108.223,95	0,94%	7.869	0,77%	Artigo 8º, Inciso III
VINCI VALOREM FI MULTIMERCADO	D+2	Não há	9.365.228,37	1,72%	2.958	1,13%	Artigo 8º, Inciso III
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	11.171.931,27	2,06%	1.172	0,84%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTIESTRATÉGIA F...	Não se ...	Não se aplica	712.816,61	0,13%	19	3,21%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	6.157.508,54	1,13%	307	0,76%	Artigo 9º - A, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			543.161.369,33				

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 ' b '	100,00%	334.454.415,88	61,58%	35,00%	55,50%	65,00%	18.600.474,18
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	81.474.205,40
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	95.653.036,26	17,61%	15,00%	20,00%	30,00%	67.295.374,54
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	81.474.205,40
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	1.301.924,19	0,24%	0,00%	0,50%	0,50%	1.413.882,66
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	27.158.068,47
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	27.158.068,47
Total Renda Fixa	100,00%	431.409.376,33	79,43%	50,00%	76,00%	135,50%	

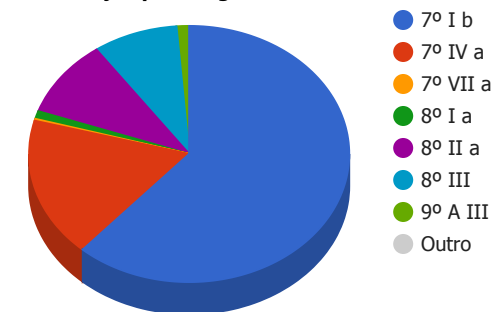
Distribuição por Segmento



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%	5.397.949,60	0,99%	0,00%	1,50%	2,50%	8.181.084,63
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	52.943.088,23	9,75%	6,00%	11,50%	15,00%	28.531.117,17
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	46.540.630,02	8,57%	6,00%	9,50%	10,00%	7.775.506,91
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	712.816,61	0,13%	0,00%	0,50%	1,00%	4.718.797,08
Total Renda Variável	30,00%	105.594.484,46	19,44%	12,00%	23,00%	28,50%	

Distribuição por Artigos



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%	1,00%	1,00%	5.431.613,69
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	6.157.508,54	1,13%	0,00%	0,00%	0,00%	-6.157.508,54
Total Exterior	10,00%	6.157.508,54	1,13%	0,00%	1,00%	1,00%	

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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	168.739.179,45	31,07	0,03
ITAÚ UNIBANCO	91.801.526,31	16,90	0,01
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	81.030.792,34	14,92	0,01
SUL AMERICA INVESTIMENTOS GEST...	47.642.456,73	8,77	0,15
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	43.281.337,25	7,97	0,00
SAFRA ASSET MANAGEMENT	31.833.244,53	5,86	0,02
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	18.706.588,50	3,44	0,02
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	16.924.964,98	3,12	0,00
AZ QUEST INVESTIMENTOS	9.478.650,90	1,75	0,03
VINCI GESTÃO DE PATRIMÔNIO LTD...	9.365.228,37	1,72	0,04
ITAÚ DTVM	7.998.672,16	1,47	0,00
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	5.727.499,35	1,05	0,01
WESTERN ASSET	5.108.223,95	0,94	0,01
VINCI PARTNERS	4.221.080,32	0,78	0,02
PETRA CAPITAL	1.301.924,19	0,24	0,02

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 '	334.454.415,88	61,58	35,00	65,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	95.653.036,26	17,61	15,00	30,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	1.301.924,19	0,24	0,00	0,50
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	5.397.949,60	0,99	0,00	2,50
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	52.943.088,23	9,75	6,00	15,00
Artigo 8º, Inciso III	46.540.630,02	8,57	6,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	712.816,61	0,13	0,00	1,00
Artigo 9º - A, Inciso II	0,00	0,00	0,00	1,00

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)

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
IDKA PRÉ 2 ANOS (Benchmark)	1,18%	3,18%	3,18%	5,10%	12,99%	24,15%	-	-
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	1,21%	3,26%	3,26%	5,07%	12,88%	23,56%	0,08%	0,02%
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%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,45%	-0,41%	-0,41%	1,98%	8,03%	17,44%	0,05%	0,03%
IMA-B (Benchmark)	-6,97%	-6,31%	-6,31%	-3,64%	9,14%	24,10%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-6,98%	-6,33%	-6,33%	-3,73%	8,93%	23,52%	0,17%	0,11%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-7,10%	-6,46%	-6,46%	-3,94%	8,66%	23,36%	0,17%	0,11%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	-6,92%	-7,37%	-7,37%	-4,35%	7,79%	23,52%	0,17%	0,10%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP	-7,17%	-6,54%	-6,54%	-3,95%	8,62%	23,20%	0,17%	0,11%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-2,69%	-3,55%	-3,55%	-0,76%	6,28%	10,89%	0,12%	0,07%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,34%	-0,74%	-0,74%	1,66%	6,93%	16,97%	0,03%	0,02%
CDI (Benchmark)	0,34%	1,01%	1,01%	2,26%	5,44%	12,12%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,14%	0,79%	0,79%	1,91%	4,99%	11,48%	0,00%	0,00%
IPCA (Benchmark)	0,07%	0,53%	0,53%	2,31%	3,30%	8,03%	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,25%	-0,97%	-0,97%	-1,49%	-9,59%	-13,76%	0,00%	0,06%

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
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,53%	1,13%	1,13%	2,34%	9,75%	18,58%	0,00%	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	-0,13%	1,31%	1,31%	3,13%	13,46%	23,65%	0,08%	0,04%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-2,11%	-3,56%	-3,56%	-1,06%	3,59%	7,22%	0,07%	0,06%

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%	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	-15,12%	-21,20%	-21,20%	-14,24%	-8,19%	2,65%	0,41%	0,22%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	-14,56%	-20,62%	-20,62%	-13,66%	-7,63%	2,85%	0,40%	0,21%
IPCA + 10,00% ao ano (Benchmark)	0,91%	2,92%	2,92%	7,30%	13,72%	30,72%	-	-
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	0,00%	0,88%
IMA-B 5 (Benchmark)	-1,75%	-0,57%	-0,57%	2,03%	9,34%	19,39%	-	-
VINCI VALOREM FI MULTIMERCADO	-0,92%	0,48%	0,48%	2,57%	10,04%	17,37%	0,04%	0,03%
IGC (Benchmark)	-30,65%	-36,13%	-36,13%	-28,17%	-18,31%	-7,41%	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	-30,82%	-36,89%	-36,89%	-29,53%	-21,90%	-9,95%	0,58%	0,34%
Ibovespa (Benchmark)	-29,90%	-36,86%	-36,86%	-30,29%	-23,47%	-14,46%	-	-
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	-31,34%	-36,25%	-36,25%	-28,08%	-19,74%	-9,77%	0,58%	0,35%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-31,71%	-35,29%	-35,29%	-28,84%	-13,47%	-1,01%	0,60%	0,36%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	-38,66%	-42,92%	-42,92%	-35,29%	-24,09%	-9,17%	0,62%	0,43%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	-29,79%	-35,13%	-35,13%	-28,59%	-18,70%	-6,64%	0,53%	0,34%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	-31,54%	-39,89%	-39,89%	-34,30%	-26,99%	-17,46%	0,57%	0,36%
VINCI MOSAICO FI AÇÕES	-31,73%	-34,30%	-34,30%	-22,13%	-9,71%	2,06%	0,53%	0,37%

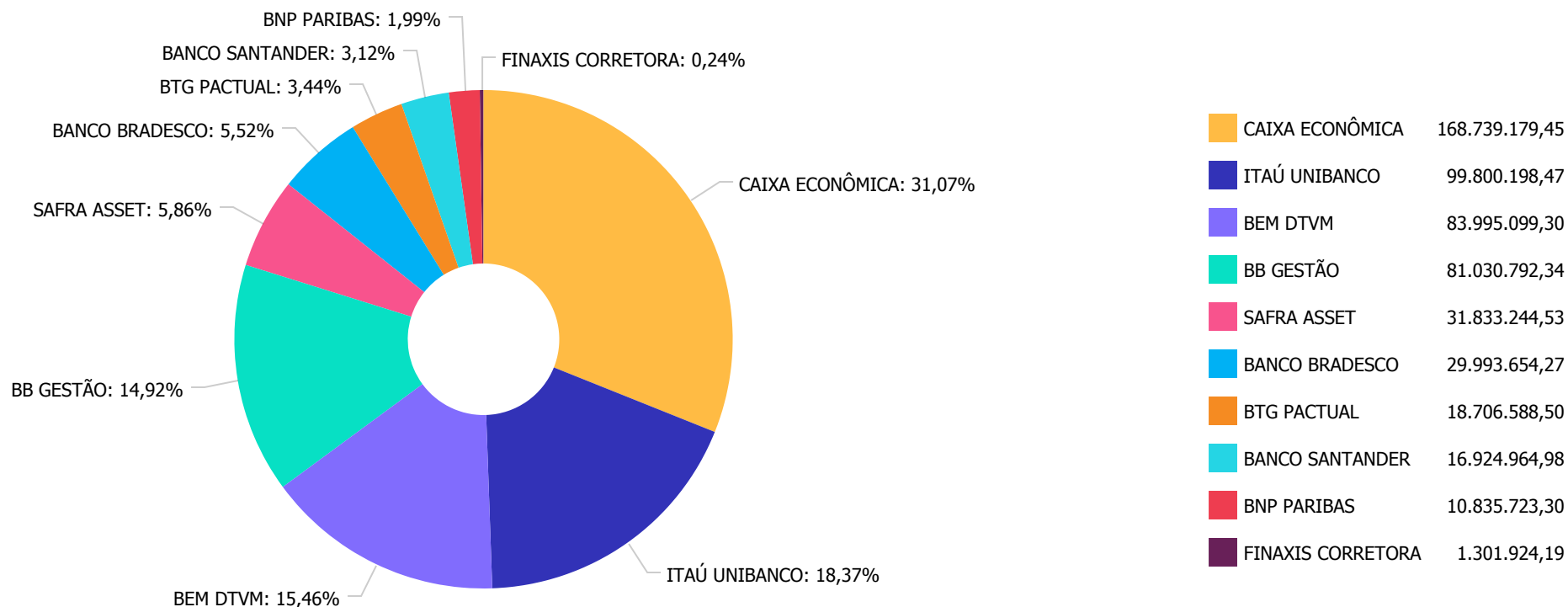
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Março/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
SMLL (Benchmark)	-35,07%	-40,17%	-40,17%	-27,52%	-11,98%	-1,62%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	-37,75%	-37,70%	-37,70%	-25,49%	-8,27%	3,26%	0,59%	0,44%
CDI (Benchmark)	0,34%	1,01%	1,01%	2,26%	5,44%	12,12%	-	-
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	0,15%	0,62%	0,62%	2,06%	5,62%	11,14%	0,01%	0,01%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	-8,45%	-10,88%	-10,88%	-6,80%	-1,89%	5,16%	0,17%	0,10%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BRDESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	-31,64%	-36,03%	-36,03%	-26,34%	-12,50%	5,75%	0,56%	0,37%

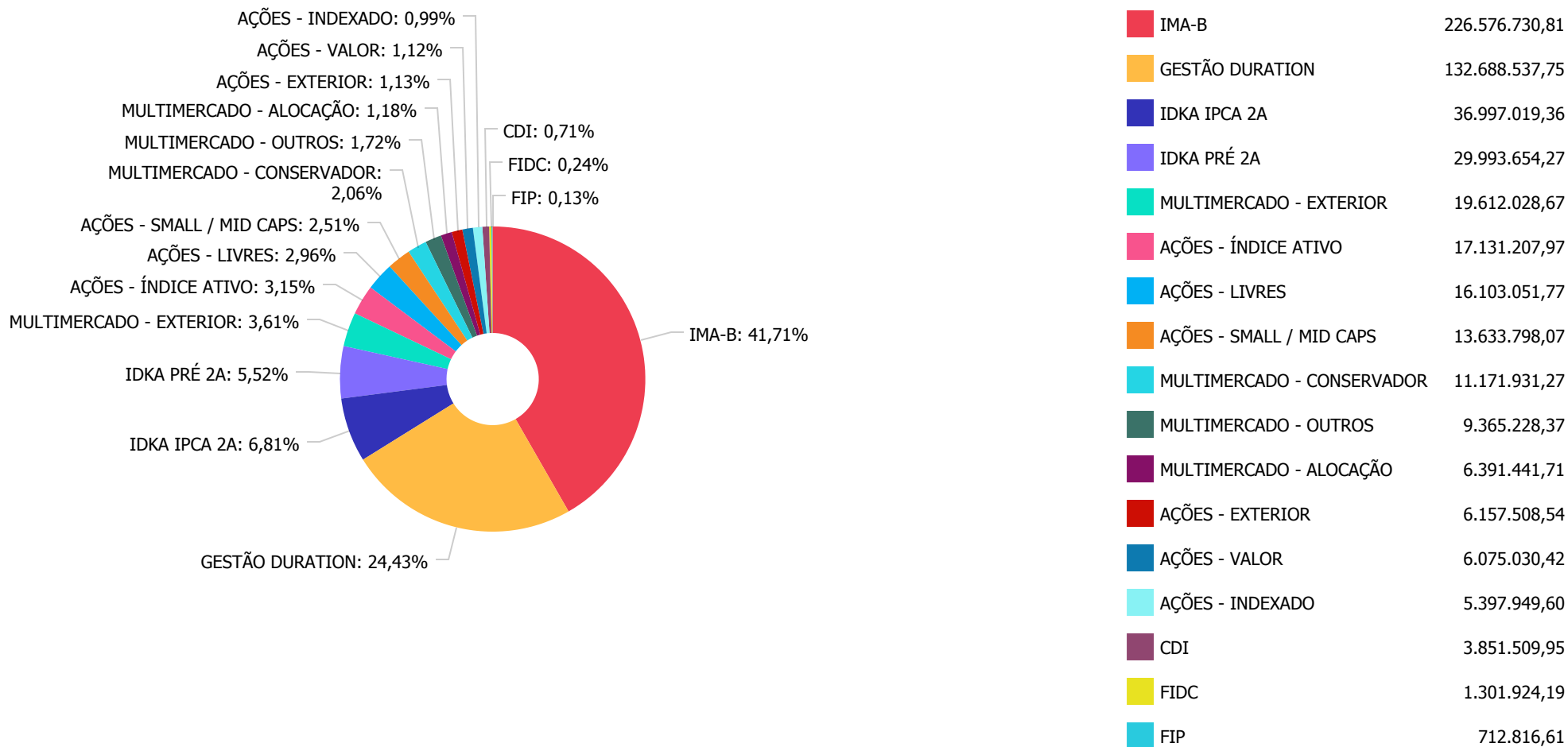
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Março/2020 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	5,47%	5,88%	5,88%	12,08%	26,75%	64,72%	-	-
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,01%	1,37%	1,37%	5,85%	21,73%	61,92%	0,38%	0,15%

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



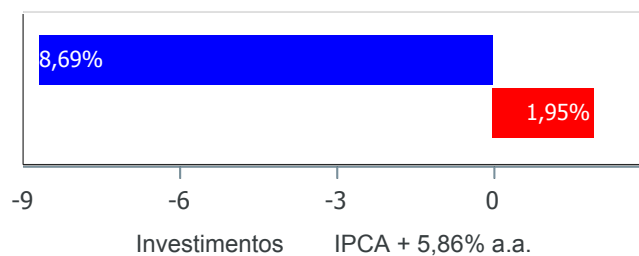
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Março / 2020)



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

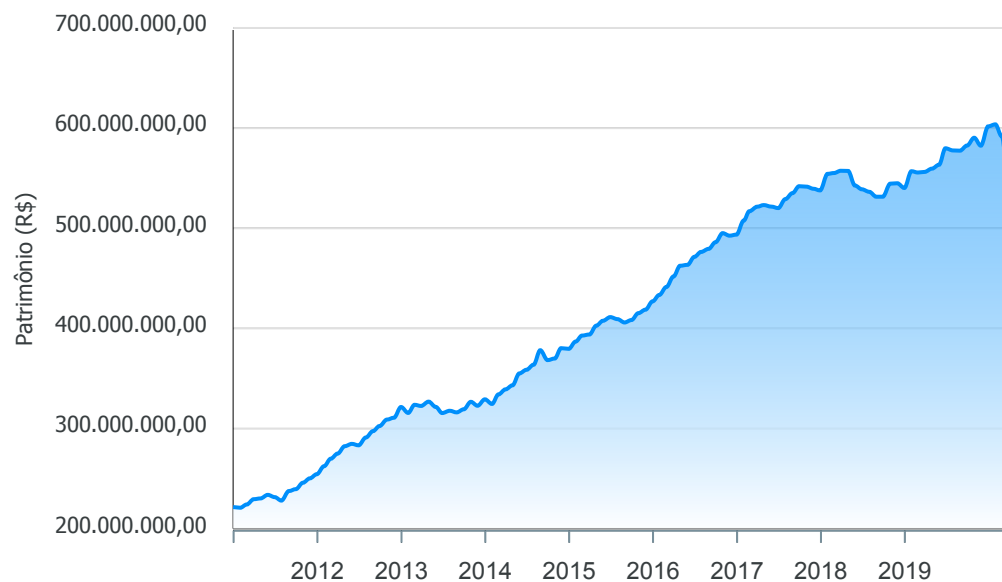
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	601.757.165,89	33.792.081,99	34.429.117,89	603.762.413,32	2.642.283,33	2.642.283,33	0,44%	0,44%	0,71%	0,71%	61,89%	2,07%
Fevereiro	603.762.413,32	118.776.753,06	122.569.044,97	591.890.201,50	-8.079.919,91	-5.437.636,58	-1,34%	-0,91%	0,66%	1,37%	-65,93%	4,18%
Março	591.890.201,50	19.290.056,34	21.502.334,97	543.161.369,33	-46.516.553,54	-51.954.190,12	-7,86%	-8,69%	0,57%	1,95%	-445,95%	15,79%

Investimentos x Meta Atuarial



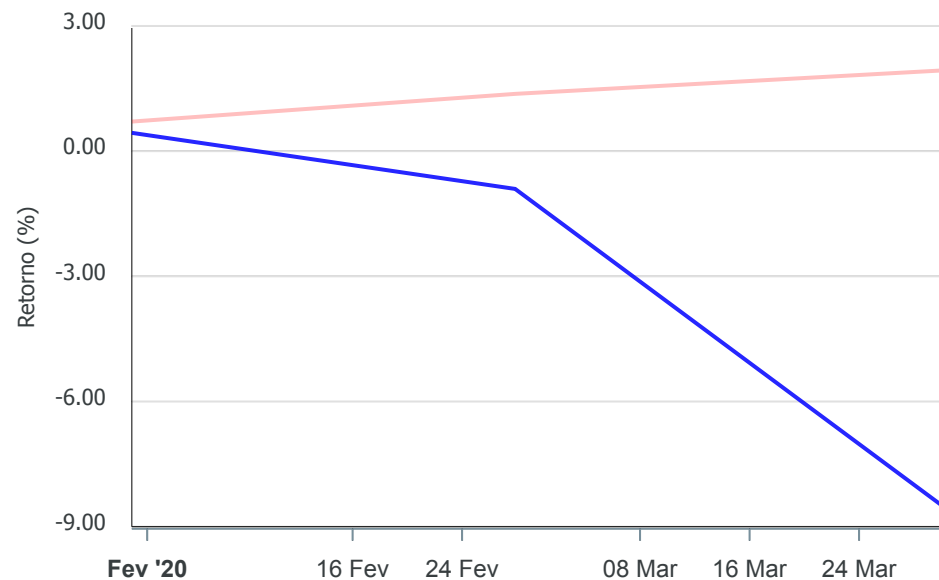
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	34.639.889,48	0,00	5.053.165,22	29.993.654,27	406.930,01	1,17%	1,21%	7,65%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	91.318.712,29	0,00	0,00	91.801.526,31	482.814,02	0,53%	0,53%	0,36%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	3.905.937,16	0,00	60.000,00	3.851.509,95	5.572,79	0,14%	0,14%	0,11%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	40.940.510,54	0,00	0,00	40.887.011,44	-53.499,10	-0,13%	-0,13%	7,65%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.305.226,20	0,00	0,00	1.301.924,19	-3.302,01	-0,25%	-0,25%	0,13%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	22.485.796,24	10.652.741,85	12.889.169,75	19.883.374,51	-365.993,83	-1,10%	-1,45%	5,46%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	24.175.863,62	0,00	0,00	23.851.596,98	-324.266,64	-1,34%	-1,34%	3,11%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	17.402.995,13	0,00	0,00	17.113.644,85	-289.350,28	-1,66%	-1,66%	5,67%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.823.224,23	0,00	0,00	12.552.116,40	-271.107,83	-2,11%	-2,11%	6,72%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	17.895.228,60	0,00	0,00	17.413.375,64	-481.852,96	-2,69%	-2,69%	11,73%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	48.133.044,60	0,00	3.500.000,00	41.567.426,31	-3.065.618,29	-6,37%	-6,92%	16,70%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	80.705.733,91	4.802.745,40	0,00	79.599.649,59	-5.908.829,72	-6,91%	-7,10%	16,65%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	36.928.946,89	334.569,09	0,00	34.667.600,91	-2.595.915,07	-6,97%	-6,98%	16,57%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC...	18.231.468,05	0,00	0,00	16.924.964,98	-1.306.503,07	-7,17%	-7,17%	16,61%
Total Renda Fixa	450.892.576,94	15.790.056,34	21.502.334,97	431.409.376,33	-13.770.921,98	-2,95%		9,32%

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
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	11.155.075,84	0,00	0,00	11.171.931,27	16.855,43	0,15%	0,15%	1,38%
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTISTRATÉGIA FIP	715.942,81	0,00	0,00	712.816,61	-3.126,20	-0,44%	-0,44%	0,29%
VINCI VALOREM FI MULTIMERCADO	9.451.844,81	0,00	0,00	9.365.228,37	-86.616,44	-0,92%	-0,92%	4,41%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	6.981.075,66	0,00	0,00	6.391.441,71	-589.633,95	-8,45%	-8,45%	17,29%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	16.974.648,73	0,00	0,00	14.503.804,72	-2.470.844,01	-14,56%	-14,56%	40,14%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	6.017.978,23	0,00	0,00	5.108.223,95	-909.754,28	-15,12%	-15,12%	41,01%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	8.157.215,59	0,00	0,00	5.727.499,35	-2.429.716,24	-29,79%	-29,79%	52,96%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	7.803.151,86	0,00	0,00	5.397.949,60	-2.405.202,26	-30,82%	-30,82%	58,44%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	11.649.957,29	0,00	0,00	7.998.672,16	-3.651.285,13	-31,34%	-31,34%	57,80%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	13.339.540,76	0,00	0,00	9.132.535,81	-4.207.004,95	-31,54%	-31,54%	57,04%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	6.078.570,06	0,00	0,00	4.155.147,17	-1.923.422,89	-31,64%	-31,64%	56,38%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	9.012.662,37	0,00	0,00	6.154.472,10	-2.858.190,27	-31,71%	-31,71%	59,74%
VINCI MOSAICO FI AÇÕES	6.183.041,84	0,00	0,00	4.221.080,32	-1.961.961,52	-31,73%	-31,73%	53,19%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	6.093.990,57	3.500.000,00	0,00	6.075.030,42	-3.518.960,15	-36,68%	-38,66%	62,30%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	15.225.731,11	0,00	0,00	9.478.650,90	-5.747.080,21	-37,75%	-37,75%	58,98%
Total Renda Variável	134.840.427,53	3.500.000,00	0,00	105.594.484,46	-32.745.943,07	-23,67%		40,96%

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
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	6.157.197,03	0,00	0,00	6.157.508,54	311,51	0,01%	0,01%	37,63%
Total Renda Variável	6.157.197,03	0,00	0,00	6.157.508,54	311,51	0,01%		37,63%

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
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	90.774.729,40	0,00	0,00	91.801.526,31	1.026.796,91	1,13%	1,13%
BRDESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	0,00	40.244.133,91	10.926.817,90	29.993.654,27	676.338,26	1,68%	3,26%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	40.358.757,61	0,00	0,00	40.887.011,44	528.253,83	1,31%	1,31%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	37.912.957,19	16.000.000,00	54.098.722,30	0,00	185.765,11	0,34%	0,63%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	50.646.691,03	28.387,71	33.612.923,58	17.113.644,85	51.489,69	0,10%	-0,66%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.095.136,69	0,00	275.000,00	3.851.509,95	31.373,26	0,77%	0,79%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	0,00	6.745.465,36	6.748.408,61	0,00	2.943,25	0,04%	0,59%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.314.712,69	0,00	0,00	1.301.924,19	-12.788,50	-0,97%	-0,97%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	13.015.690,20	0,00	329.016,67	12.552.116,40	-134.557,13	-1,03%	-3,56%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	24.675.619,60	0,00	649.654,40	23.851.596,98	-174.368,22	-0,71%	-0,74%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	18.054.416,06	0,00	431.266,98	17.413.375,64	-209.773,44	-1,16%	-3,55%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	9.721.124,12	54.947.519,71	44.520.768,36	19.883.374,51	-264.500,96	-0,41%	-0,41%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC...	18.110.044,05	0,00	0,00	16.924.964,98	-1.185.079,07	-6,54%	-6,54%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	35.413.921,86	1.607.573,14	0,00	34.667.600,91	-2.353.894,09	-6,36%	-6,33%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	48.367.093,72	0,00	3.500.000,00	41.567.426,31	-3.299.667,41	-6,82%	-7,37%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	100.026.864,49	7.985.811,56	23.407.919,03	79.599.649,59	-5.005.107,43	-4,63%	-6,46%
				Total Renda Fixa	-10.136.775,94	-1,63%	

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
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	11.103.594,04	0,00	0,00	11.171.931,27	68.337,23	0,62%	0,62%
VINCI VALOREM FI MULTIMERCADO	9.320.948,17	0,00	0,00	9.365.228,37	44.280,20	0,48%	0,48%
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTISTRATÉGIA FIP	722.229,59	0,00	0,00	712.816,61	-9.412,98	-1,30%	-
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	0,00	7.200.000,00	0,00	6.391.441,71	-808.558,29	-11,23%	-10,88%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	0,00	6.720.000,00	0,00	5.108.223,95	-1.611.776,05	-23,98%	-21,20%
VINCI MOSAICO FI AÇÕES	0,00	6.720.000,00	0,00	4.221.080,32	-2.498.919,68	-37,19%	-34,30%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	0,00	6.720.000,00	0,00	4.155.147,17	-2.564.852,83	-38,17%	-36,03%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	8.829.781,08	0,00	0,00	5.727.499,35	-3.102.281,73	-35,13%	-35,13%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	8.553.052,64	0,00	0,00	5.397.949,60	-3.155.103,04	-36,89%	-36,89%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	9.511.250,72	0,00	0,00	6.154.472,10	-3.356.778,62	-35,29%	-35,29%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	18.271.871,93	0,00	0,00	14.503.804,72	-3.768.067,21	-20,62%	-20,62%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	0,00	10.220.000,00	0,00	6.075.030,42	-4.144.969,58	-40,56%	-42,92%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	12.547.420,56	0,00	0,00	7.998.672,16	-4.548.748,40	-36,25%	-36,25%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	15.215.455,71	0,00	0,00	9.478.650,90	-5.736.804,81	-37,70%	-37,70%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	15.193.802,74	0,00	0,00	9.132.535,81	-6.061.266,93	-39,89%	-39,89%
Total Renda Variável					-41.254.922,72	-28,09%	

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
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,00	6.720.000,00	0,00	6.157.508,54	-562.491,46	-8,37%	1,37%
				Total Exterior	-562.491,46	-8,37%	