

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 IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	9.911.388,24	4,74%	1.227	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2024	7.788.863,63	3,73%	104	1,78%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	7.618.320,72	3,64%	913	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	12.884.038,22	6,16%	596	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	16.381.709,99	7,84%	962	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	15.792.082,96	7,56%	917	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+0	15/08/2022	4.232.423,35	2,02%	95	0,87%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	5.676.083,09	2,72%	620	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	15/08/2022	384.105,10	0,18%	165	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	8.391.605,31	4,01%	882	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	41.537.374,11	19,87%	733	0,38%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	2.658.408,19	1,27%	703	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	2.194.619,55	1,05%	428	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	4.585.781,53	2,19%	744	0,29%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRANCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	258.827,66	0,12%	276	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.464.222,18	1,66%	102	0,39%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	1.889.740,28	0,90%	279	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	19.816.988,92	9,48%	63	1,49%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	5.169.396,60	2,47%	169	0,44%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	1.615.289,76	0,77%	1.899	0,72%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '

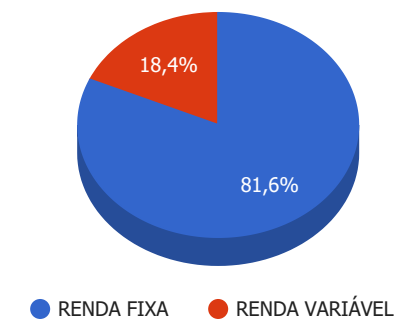
Carteira consolidada de investimentos - base (Março / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	2.291.597,52	1,10%	1.477	0,38%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	4.838.280,23	2,31%	207	0,87%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	9.208.753,68	4,41%	16.314	1,03%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	1.615.289,76	0,77%	1.899	0,72%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	1.561.955,14	0,75%	6.657	0,11%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	3.333.843,16	1,59%	55.486	0,12%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	3.421.566,89	1,64%	7.869	0,52%	Artigo 8º, Inciso III
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	D+2	Não há	915.676,42	0,44%	42	0,28%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	7.876.481,39	3,77%	19.517	0,18%	Artigo 8º, Inciso III
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII ...	Não se ...	Não se aplica	1.834.284,95	0,88%		0,98%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
Total para cálculo dos limites da Resolução			209.024.961,44				

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%	135.451.022,46	64,80%	15,00%	30,00%	90,00%	52.671.442,84
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	125.414.976,86
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	35.184.957,17	16,83%	10,00%	30,00%	40,00%	48.425.027,41
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	31.353.744,22
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	10.451.248,07
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	10.451.248,07
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	10.451.248,07
Total Renda Fixa	100,00%	170.635.979,63	81,63%	25,00%	70,00%	220,00%	

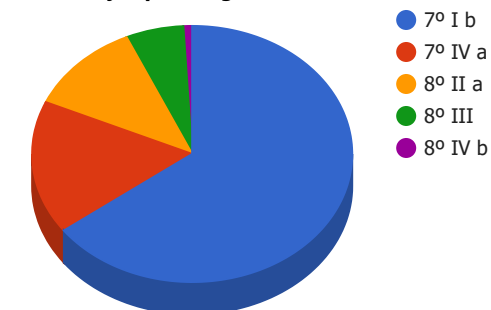
Distribuição por Segmento



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 II, Alínea ' a '	20,00%	24.340.972,16	11,65%	7,00%	10,00%	20,00%	17.464.020,13
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	12.213.724,70	5,84%	7,00%	10,00%	10,00%	8.688.771,44
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	10.451.248,07
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	1.834.284,95	0,88%	0,00%	5,00%	5,00%	8.616.963,12
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	10.451.248,07
Total Renda Variável	30,00%	38.388.981,81	18,37%	14,00%	30,00%	45,00%	

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%	0,00%	10,00%	20.902.496,14
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	

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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	128.215.194,95	61,34	0,03
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	51.015.430,55	24,41	0,00
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	10.266.504,49	4,91	0,00
ITAÚ UNIBANCO	5.223.583,44	2,50	0,00
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	3.464.222,18	1,66	0,00
WESTERN ASSET	3.421.566,89	1,64	0,01
ZION INVEST	1.834.284,95	0,88	0,37
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	1.615.289,76	0,77	0,00
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	1.561.955,14	0,75	0,00
AZ QUEST INVESTIMENTOS	1.491.252,67	0,71	0,01
SAFRA ASSET MANAGEMENT	915.676,42	0,44	0,00

Artigo 14º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR)

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2020		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	135.451.022,46	64,80	15,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	35.184.957,17	16,83	10,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	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 II, Alínea ' a '	24.340.972,16	11,65	7,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	12.213.724,70	5,84	7,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	1.834.284,95	0,88	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de 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%
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%
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 5 (Benchmark)	-1,75%	-0,57%	-0,57%	2,03%	9,34%	19,39%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,80%	-0,64%	-0,64%	1,86%	9,03%	18,84%	0,07%	0,04%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	-1,79%	-0,60%	-0,60%	1,92%	9,12%	18,91%	0,07%	0,04%
IMA-B (Benchmark)	-6,97%	-6,31%	-6,31%	-3,64%	9,14%	24,10%	-	-
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%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-2,69%	-3,54%	-3,54%	-0,76%	6,67%	10,76%	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%
IRF-M (Benchmark)	-0,11%	1,42%	1,42%	3,31%	11,09%	21,25%	-	-

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
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,11%	1,38%	1,38%	3,22%	10,87%	20,76%	0,08%	0,03%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,11%	1,36%	1,36%	3,20%	10,78%	20,64%	0,08%	0,03%
Selic (Benchmark)	0,34%	1,01%	1,01%	2,26%	5,44%	12,13%	-	-
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,01%	0,63%	0,63%	1,80%	4,93%	11,46%	0,00%	0,01%
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%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,16%	0,88%	0,88%	2,04%	5,22%	11,76%	0,00%	0,00%
IPCA (Benchmark)	0,07%	0,53%	0,53%	2,31%	3,30%	8,03%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,73%	-0,38%	-0,38%	2,06%	10,13%	20,34%	0,07%	0,04%
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%
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%

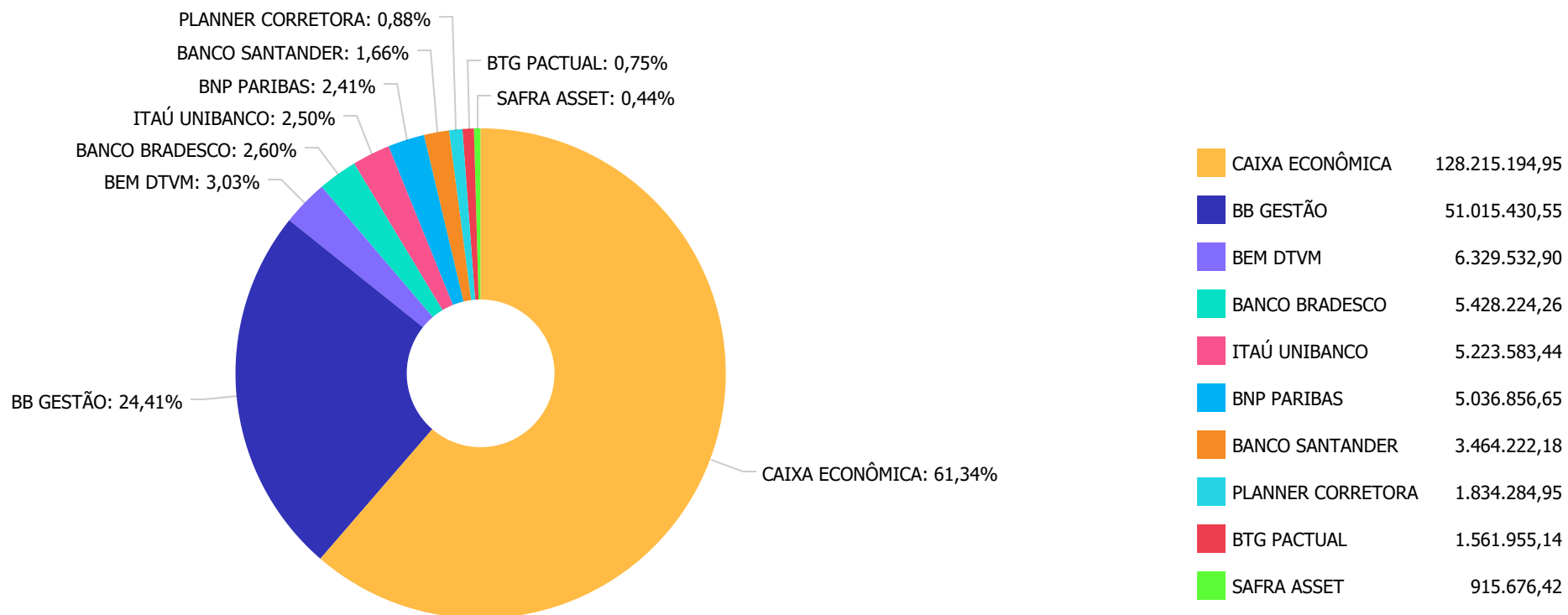
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Março/2020 - RENDA VARIÁVEL

	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%	-	-
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%
Ibovespa (Benchmark)	-29,90%	-36,86%	-36,86%	-30,29%	-23,47%	-14,46%	-	-
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-31,71%	-35,29%	-35,29%	-28,84%	-13,47%	-1,01%	0,60%	0,36%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	-35,44%	-38,53%	-38,53%	-32,81%	-24,02%	-15,18%	0,59%	0,39%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	-29,79%	-35,13%	-35,13%	-28,59%	-18,70%	-6,64%	0,53%	0,34%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-27,05%	-34,54%	-34,54%	-25,80%	-18,01%	-0,68%	0,53%	0,32%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	-31,54%	-39,89%	-39,89%	-34,30%	-26,99%	-17,46%	0,57%	0,36%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-32,44%	-39,18%	-39,18%	-31,38%	-17,47%	-4,42%	0,55%	0,38%
SMLL (Benchmark)	-35,07%	-40,17%	-40,17%	-27,52%	-11,98%	-1,62%	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	-35,06%	-40,34%	-40,34%	-28,21%	-13,79%	-6,52%	0,61%	0,42%
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)	-	-	-	-	-	-	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	-10,08%	-17,05%	-17,05%	-30,07%	-27,70%	-54,47%	0,54%	0,46%

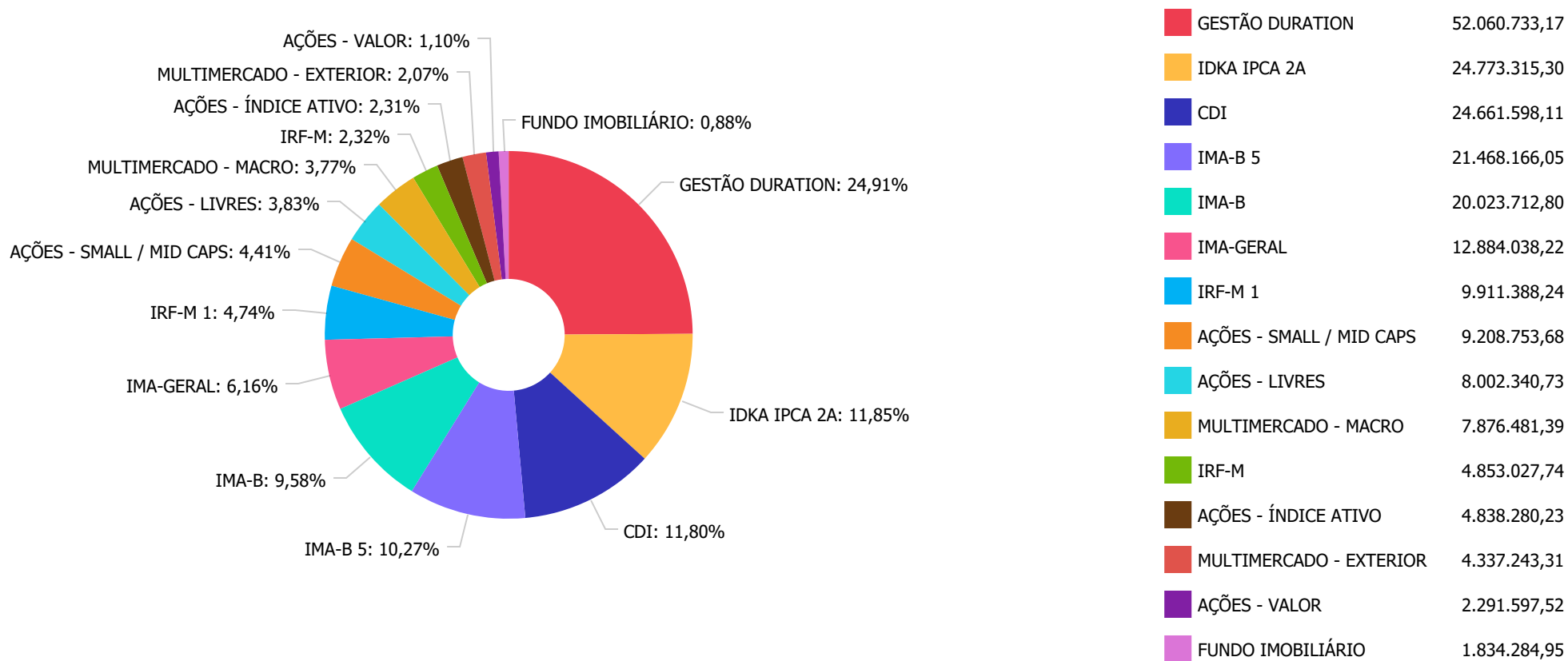
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Março/2020 - RENDA VARIÁVEL

Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
-----	-----	----	----	-----	-----	---------	------------------

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



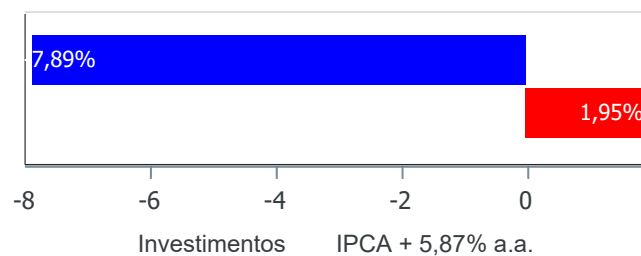
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Março / 2020)



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

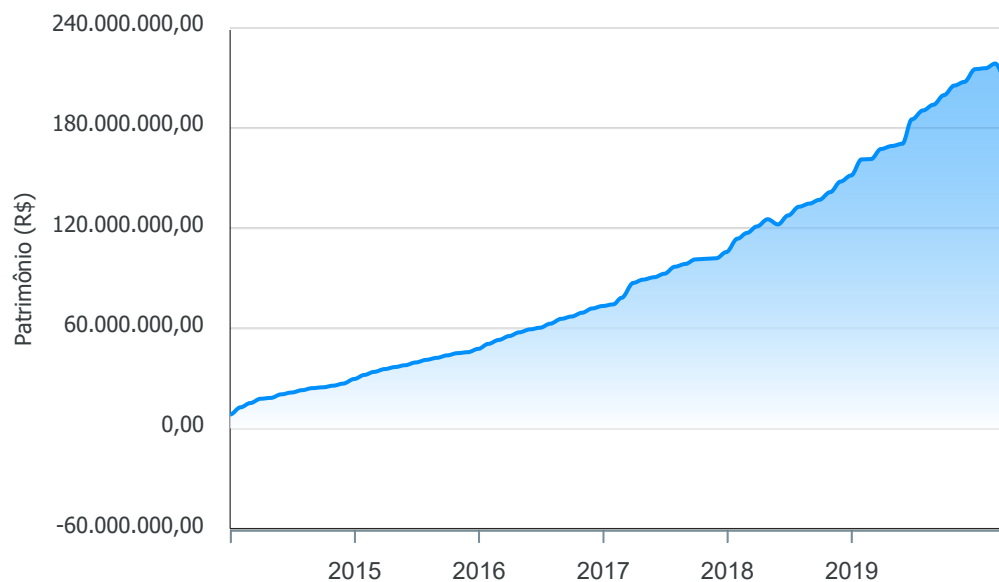
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	215.323.630,36	11.203.932,19	11.215.351,57	215.920.428,04	608.217,06	608.217,06	0,28%	0,28%	0,71%	0,71%	39,77%	2,41%
Fevereiro	215.920.428,04	9.956.730,84	4.002.545,34	218.699.683,91	-3.174.929,63	-2.566.712,57	-1,43%	-1,15%	0,66%	1,37%	-83,87%	4,08%
Março	218.699.683,91	10.741.685,93	5.120.191,38	209.024.961,44	-15.296.217,02	-17.862.929,59	-6,82%	-7,89%	0,57%	1,95%	-404,42%	13,44%

Investimentos x Meta Atuarial



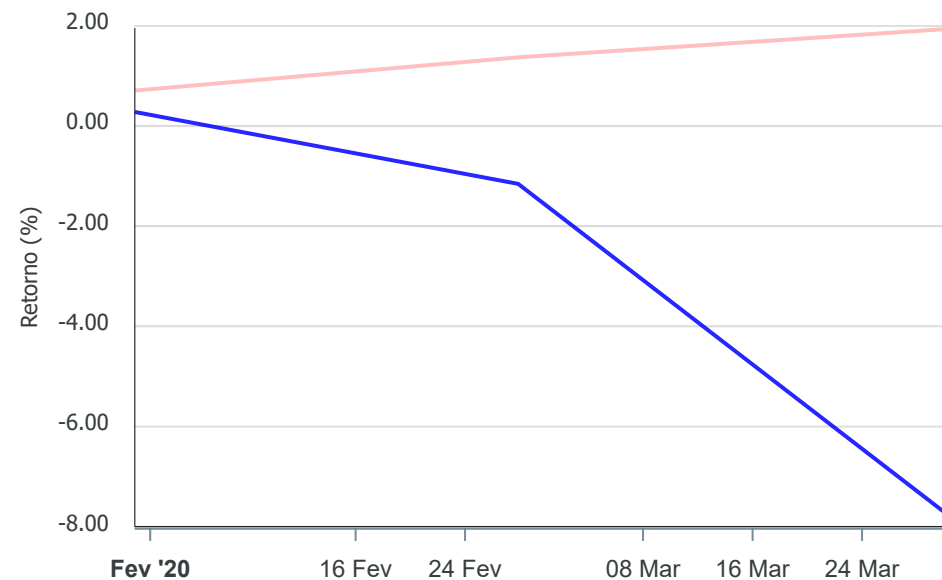
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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...	8.605.032,71	1.251.000,00	0,00	9.911.388,24	55.355,53	0,56%	0,60%	0,62%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	1.879.801,52	0,00	0,00	1.889.740,28	9.938,76	0,53%	0,53%	0,36%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	17.577.812,17	3.164.872,96	958.000,00	19.816.988,92	32.303,79	0,16%	0,16%	0,30%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	3.461.033,90	0,00	0,00	3.464.222,18	3.188,28	0,09%	0,09%	0,84%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.417.810,59	3.825.812,97	1.662.191,38	4.585.781,53	4.349,35	0,07%	0,25%	0,01%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	258.810,33	0,00	0,00	258.827,66	17,33	0,01%	0,01%	0,18%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.661.356,48	0,00	0,00	2.658.408,19	-2.948,29	-0,11%	-0,11%	7,68%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	2.197.106,77	0,00	0,00	2.194.619,55	-2.487,22	-0,11%	-0,11%	7,66%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	44.097.017,57	0,00	2.500.000,00	41.537.374,11	-59.643,46	-0,14%	-0,13%	7,65%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	389.327,08	0,00	0,00	384.105,10	-5.221,98	-1,34%	-1,34%	3,11%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	14.124.938,86	2.500.000,00	0,00	16.381.709,99	-243.228,87	-1,46%	-1,45%	5,46%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	8.533.487,03	0,00	0,00	8.391.605,31	-141.881,72	-1,66%	-1,66%	5,67%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENC...	4.306.881,02	0,00	0,00	4.232.423,35	-74.457,67	-1,73%	-1,73%	6,87%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	5.779.609,32	0,00	0,00	5.676.083,09	-103.526,23	-1,79%	-1,79%	6,78%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	16.081.080,05	0,00	0,00	15.792.082,96	-288.997,09	-1,80%	-1,80%	6,80%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.160.574,86	0,00	0,00	12.884.038,22	-276.536,64	-2,10%	-2,10%	8,04%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	5.280.943,92	0,00	0,00	5.169.396,60	-111.547,32	-2,11%	-2,11%	9,00%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.004.433,07	0,00	0,00	7.788.863,63	-215.569,44	-2,69%	-2,69%	11,73%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	8.200.748,77	0,00	0,00	7.618.320,72	-582.428,05	-7,10%	-7,10%	16,65%
Total Renda Fixa	167.017.806,02	10.741.685,93	5.120.191,38	170.635.979,63	-2.003.320,94	-1,16%		6,17%

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 ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	8.318.337,18	0,00	0,00	7.876.481,39	-441.855,79	-5,31%	-5,31%	9,55%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	2.039.999,15	0,00	0,00	1.834.284,95	-205.714,20	-10,08%	-10,08%	54,05%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	1.071.669,53	0,00	0,00	915.676,42	-155.993,11	-14,56%	-14,56%	40,14%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	4.030.934,28	0,00	0,00	3.421.566,89	-609.367,39	-15,12%	-15,12%	41,01%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	3.141.174,03	0,00	0,00	2.291.597,52	-849.576,51	-27,05%	-27,05%	52,81%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	2.300.526,98	0,00	0,00	1.615.289,76	-685.237,22	-29,79%	-29,79%	52,96%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	7.067.088,23	0,00	0,00	4.838.280,23	-2.228.808,00	-31,54%	-31,54%	57,04%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.287.340,66	0,00	0,00	1.561.955,14	-725.385,52	-31,71%	-31,71%	59,74%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	4.934.979,64	0,00	0,00	3.333.843,16	-1.601.136,48	-32,44%	-32,44%	55,05%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	14.179.970,90	0,00	0,00	9.208.753,68	-4.971.217,22	-35,06%	-35,06%	60,61%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	2.309.857,31	0,00	0,00	1.491.252,67	-818.604,64	-35,44%	-35,44%	58,53%
Total Renda Variável	51.681.877,89	0,00	0,00	38.388.981,81	-13.292.896,08	-25,72%		45,75%

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	38.511.116,49	5.000.000,00	2.500.000,00	41.537.374,11	526.257,62	1,21%	1,31%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	24.268.998,63	9.841.014,44	14.477.657,72	19.816.988,92	184.633,57	0,54%	0,88%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	8.538.961,14	1.251.000,00	0,00	9.911.388,24	121.427,10	1,24%	1,38%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.622.220,68	0,00	0,00	2.658.408,19	36.187,51	1,38%	1,38%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	2.165.163,30	0,00	0,00	2.194.619,55	29.456,25	1,36%	1,36%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	3.440.096,11	0,00	0,00	3.464.222,18	24.126,07	0,70%	0,70%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	1.868.603,60	0,00	0,00	1.889.740,28	21.136,68	1,13%	1,13%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.808.623,60	5.810.334,52	3.047.243,91	4.585.781,53	14.067,32	0,18%	0,75%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	257.215,87	0,00	0,00	258.827,66	1.611,79	0,63%	0,63%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	397.375,14	0,00	10.462,01	384.105,10	-2.808,03	-0,71%	-0,74%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENC...	4.357.790,85	0,00	110.537,30	4.232.423,35	-14.830,20	-0,34%	-0,38%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	5.710.505,77	0,00	0,00	5.676.083,09	-34.422,68	-0,60%	-0,60%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	8.447.694,34	0,00	0,00	8.391.605,31	-56.089,03	-0,66%	-0,66%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	5.237.965,45	0,00	0,00	5.169.396,60	-68.568,85	-1,31%	-1,31%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.075.023,23	0,00	192.187,35	7.788.863,63	-93.972,25	-1,16%	-3,54%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	13.976.596,95	2.500.000,00	0,00	16.381.709,99	-94.886,96	-0,58%	-0,41%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	15.893.996,76	0,00	0,00	15.792.082,96	-101.913,80	-0,64%	-0,64%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.037.494,67	0,00	0,00	12.884.038,22	-153.456,45	-1,18%	-1,18%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	8.144.821,08	0,00	0,00	7.618.320,72	-526.500,36	-6,46%	-6,46%
				Total Renda Fixa	-188.544,70	-0,11%	

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 S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	1.153.567,81	0,00	0,00	915.676,42	-237.891,39	-20,62%	-20,62%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	2.211.427,65	0,00	0,00	1.834.284,95	-377.142,70	-17,05%	-17,05%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	8.388.474,97	0,00	0,00	7.876.481,39	-511.993,58	-6,10%	-6,10%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	0,00	2.500.000,00	0,00	1.615.289,76	-884.710,24	-35,39%	-35,13%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	4.341.977,80	0,00	0,00	3.421.566,89	-920.410,91	-21,20%	-21,20%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,00	2.500.000,00	0,00	1.561.955,14	-938.044,86	-37,52%	-35,29%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	0,00	2.500.000,00	0,00	1.491.252,67	-1.008.747,33	-40,35%	-38,53%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	3.500.810,97	0,00	0,00	2.291.597,52	-1.209.213,45	-34,54%	-34,54%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	5.481.052,54	0,00	0,00	3.333.843,16	-2.147.209,38	-39,18%	-39,18%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	8.049.448,35	0,00	0,00	4.838.280,23	-3.211.168,12	-39,89%	-39,89%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	15.436.606,61	0,00	0,00	9.208.753,68	-6.227.852,93	-40,34%	-40,34%
Total Renda Variável					-17.674.384,89	-31,53%	