

# 2020

## Relatório Mensal

# Abril

## Análise dos Investimentos

De acordo com a Portaria MTP nº 1.467 de 2 de junho de 2022, Capítulo VI, Seção V, Artigo 136º e com o Manual do Pró-Gestão RPPS versão 3.3, ítem 3.2.6 Nível I, aprovado pela Portaria SPREV nº 918, de 2 de Março de 2022.

| Ativo   | Saldo Atual   | % Carteira | PL R\$            | % PL  | Lei      |
|---|---------------|------------|-------------------|-------|----------|
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO             | 28.785.546,64 | 12,58%     | 10.512.346.440,60 | 0,27% | 7º Ib    |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO     | 256.204,73    | 0,11%      | 6.681.370.754,17  | 0,00% | 7º Ib    |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO      | 634.535,67    | 0,28%      | 5.412.184.320,42  | 0,01% | 7º Ib    |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO   | 11.700.592,55 | 5,11%      | 7.168.032.689,23  | 0,16% | 7º Ib    |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO      | 2.658.877,66  | 1,16%      | 4.883.028.533,84  | 0,05% | 7º Ib    |
| BRADERCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA             | 8.871.576,82  | 3,88%      | 900.254.306,47    | 0,99% | 7º Ib    |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA              | 38.257.380,45 | 16,72%     | 11.368.843.034,79 | 0,34% | 7º Ib    |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 18.503.931,19 | 8,08%      | 8.182.089.077,85  | 0,23% | 7º Ib    |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP      | 13.014.815,46 | 5,69%      | 9.104.032.681,09  | 0,14% | 7º Ib    |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP     | 159.179,44    | 0,07%      | 1.937.305.372,80  | 0,01% | 7º Ib    |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP        | 384.620,10    | 0,17%      | 5.880.207.997,15  | 0,01% | 7º Ib    |
| CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP    | 7.174.000,78  | 3,13%      | 1.321.410.738,84  | 0,54% | 7º Ib    |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA         | 25.708.197,98 | 11,23%     | 10.765.141.210,50 | 0,24% | 7º Ib    |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP     | 25.779,80     | 0,01%      | 2.809.224.859,68  | 0,00% | 7º Ib    |
| ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA                    | 365.323,91    | 0,16%      | 219.155.027,19    | 0,17% | 7º Ib    |
| CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP      | 291.121,19    | 0,13%      | 2.806.802.535,15  | 0,01% | 7º III a |
| BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO                       | 576.186,40    | 0,25%      | 1.433.166.438,94  | 0,04% | 7º IV a  |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP  | 11.762.919,00 | 5,14%      | 2.594.654.169,89  | 0,45% | 7º IV a  |
| BRADERCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA                   | 18.300.707,46 | 8,00%      | 1.194.562.049,15  | 1,53% | 7º IV a  |
| BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA               | 358.596,07    | 0,16%      | 887.003.090,20    | 0,04% | 7º IV a  |
| BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI              | 2.108.575,03  | 0,92%      | 4.060.176.085,06  | 0,05% | 7º IV a  |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA         | 16.198.542,27 | 7,08%      | 5.079.848.328,78  | 0,32% | 7º IV a  |
| XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP              | 1.183.654,70  | 0,52%      | 538.945.990,03    | 0,22% | 7º IV a  |
| CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO         | 5.546.268,80  | 2,42%      | 178.208.284,23    | 3,11% | 7º VII b |
| BB INDEXADO IBRX FIC AÇÕES                                  | 380.622,91    | 0,17%      | 159.466.173,69    | 0,24% | 8º I a   |
| BRADERCO DIVIDENDOS FI AÇÕES                                | 156.065,16    | 0,07%      | 1.761.839.540,18  | 0,01% | 8º II a  |
| BRADERCO SELECTION FI AÇÕES                                 | 152.177,47    | 0,07%      | 593.878.228,05    | 0,03% | 8º II a  |

Investimentos

\$ 228.867.596,24

Disponibilidades Financeiras

\$ 0,00

Total Carteira

\$ 228.867.596,24

Governança (Pró Gestão)

🚫 Não possui

| Ativo   | Saldo Atual  | % Carteira | PL R\$           | % PL  | Lei      |
|---|--------------|------------|------------------|-------|----------|
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES                                    | 2.892.166,22 | 1,26%      | 3.439.376.385,25 | 0,08% | 8º II a  |
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES                      | 1.972.109,62 | 0,86%      | 3.143.288.746,73 | 0,06% | 8º II a  |
| XP INVESTOR 30 FIC AÇÕES                                  | 397.803,47   | 0,17%      | 607.807.879,74   | 0,07% | 8º II a  |
| XP INVESTOR DIVIDENDOS 30 FIC AÇÕES                       | 421.596,00   | 0,18%      | 90.224.906,78    | 0,47% | 8º II a  |
| CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO | 4.686.026,21 | 2,05%      | 505.965.301,46   | 0,93% | 8º III   |
| ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO        | 324.103,85   | 0,14%      | 81.132.519,11    | 0,40% | 8º III   |
| ITAÚ PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO                 | 2.718.449,09 | 1,19%      | 839.645.184,55   | 0,32% | 8º III   |
| XP MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO                   | 216.118,25   | 0,09%      | 439.656.192,56   | 0,05% | 8º III   |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I                  | 1.723.223,89 | 0,75%      | 1.075.121.854,10 | 0,16% | 9º A III |

Investimentos

\$ 228.867.596,24

Disponibilidades Financeiras

\$ 0,00

Total Carteira

\$ 228.867.596,24

Governança (Pró Gestão)

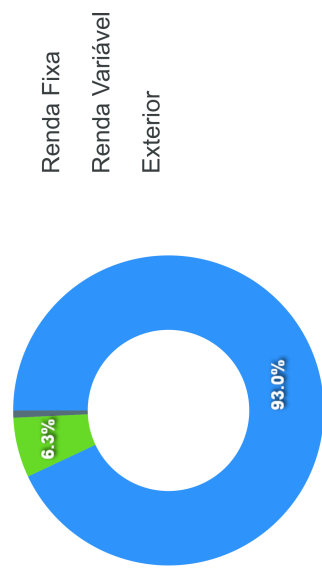
☑ Não possui

| Artigos                                     | Limite (%) | Utilizado             | Livre                 |
|---|------------|-----------------------|-----------------------|
| 7º I b - FI 100% Títulos TN                 | 100,00%    | 156.500.563,18 68,38% | 72.367.033,06 31,62%  |
| 7º III a - FI Referenciados RF              | 60,00%     | 291.121,19 0,13%      | 137.029.436,55 59,87% |
| 7º IV a - FI de Renda Fixa                  | 40,00%     | 50.489.180,93 22,06%  | 41.057.857,57 17,94%  |
| 7º VII b - FI Renda Fixa - Crédito Privado  | 5,00%      | 5.546.268,80 2,42%    | 5.897.111,01 2,58%    |
| 8º I a - FI Referenciados em Renda Variável | 30,00%     | 380.622,91 0,17%      | 68.279.655,96 29,83%  |
| 8º II a - FI em Ações                       | 20,00%     | 5.991.917,94 2,62%    | 39.781.601,31 17,38%  |
| 8º III - FI Multimercado                    | 10,00%     | 7.944.697,40 3,47%    | 14.942.062,22 6,53%   |
| 9º A III - Ações - BDR Nível I              | 10,00%     | 1.723.223,89 0,75%    | 21.163.535,73 9,25%   |

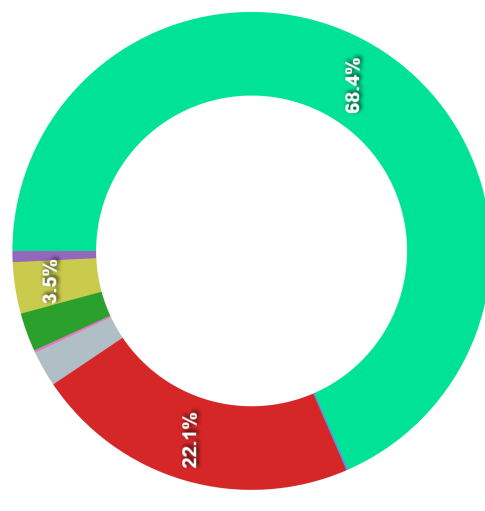
### Governança (Pró Gestão)

[🔗](#) Não possui

### Segmentos



### Artigos



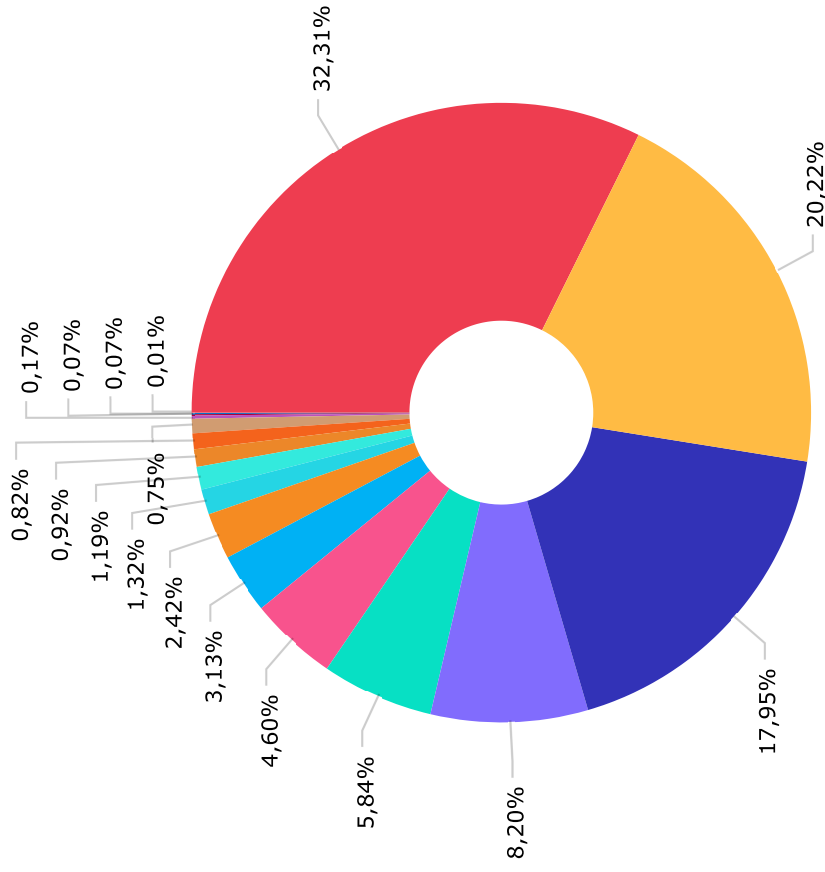
| Artigos                           | Atual  | Inferior | Alvo  | Superior | GAP Superior   | Artigos                           | Atual | Inferior | Alvo  | Superior | GAP Superior  |
|-----------------------------------|--------|----------|-------|----------|----------------|-----------------------------------|-------|----------|-------|----------|---------------|
| 7º I a - Títulos TN SELIC         | 0,00%  | 0,00%    | 0,00% | 100,00%  | 228.867.596,24 | 8º I a - FI Referenciados em R... | 0,17% | 0,00%    | 0,00% | 30,00%   | 68.279.655,96 |
| 7º I b - FI 100% Títulos TN       | 68,38% | 0,00%    | 0,00% | 100,00%  | 72.367.033,06  | 8º I b - FI de Índices Referen... | 0,00% | 0,00%    | 0,00% | 30,00%   | 68.660.278,87 |
| 7º I c - ETF 100% Títulos TN      | 0,00%  | 0,00%    | 0,00% | 100,00%  | 228.867.596,24 | 8º II a - FI em Ações             | 2,62% | 0,00%    | 0,00% | 20,00%   | 39.781.601,31 |
| 7º III a - FI Referenciados RF    | 0,13%  | 0,00%    | 0,00% | 60,00%   | 137.029.436,55 | 8º II b - FI em Índices de Açõ... | 0,00% | 0,00%    | 0,00% | 20,00%   | 45.773.519,25 |
| 7º III b - FI de Índices Refer... | 0,00%  | 0,00%    | 0,00% | 60,00%   | 137.320.557,74 | 8º III - FI Multimercado          | 3,47% | 0,00%    | 0,00% | 10,00%   | 14.942.062,22 |
| 7º IV a - FI de Renda Fixa        | 22,06% | 0,00%    | 0,00% | 40,00%   | 41.057.857,57  | 8º IV b - FI Imobiliário          | 0,00% | 0,00%    | 0,00% | 5,00%    | 11.443.379,81 |
| 7º IV b - FI de Índices Renda ... | 0,00%  | 0,00%    | 0,00% | 40,00%   | 91.547.038,50  | 9º A I - Renda Fixa - Dívida E... | 0,00% | 0,00%    | 0,00% | 10,00%   | 22.886.759,62 |
| 7º V b - Letras Imobiliárias G... | 0,00%  | 0,00%    | 0,00% | 5,00%    | 11.443.379,81  | 9º A II - Constituídos no Bras... | 0,00% | 0,00%    | 0,00% | 10,00%   | 22.886.759,62 |
| 7º VII b - FI Renda Fixa - Cré... | 2,42%  | 0,00%    | 0,00% | 5,00%    | 5.897.111,01   | 9º A III - Ações - BDR Nível I    | 0,75% | 0,00%    | 0,00% | 10,00%   | 21.163.535,73 |
| 7º VII c - FI de Debêntures In... | 0,00%  | 0,00%    | 0,00% | 5,00%    | 11.443.379,81  |                                   |       |          |       |          |               |

|   | Mês          | Ano           | 3M            | 6M            | 12M           | 24M          | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|---|--------------|---------------|---------------|---------------|---------------|--------------|-----------|--------------------|
| <b>CDI - BENCHMARK</b>                                      | <b>0,29</b>  | <b>1,30</b>   | <b>0,92</b>   | <b>2,07</b>   | <b>5,19</b>   | <b>11,87</b> |           |                    |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO             | 0,91         | -0,28         | -0,76         | -0,26         | 8,60          | 19,45        | 4,82      | 10,15              |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP  | 0,26         | 0,85          | 0,50          | 1,55          | 4,55          | 11,05        | 0,12      | 0,25               |
| ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO          | 0,24         | 1,54          | 1,05          | 2,04          | 6,43          | 13,59        | 0,43      | 0,90               |
| XP MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO                     | 0,59         | -3,61         | -3,60         | -2,46         | 2,56          | 8,33         |           |                    |
| <b>GLOBAL BDRX - BENCHMARK</b>                              | <b>16,32</b> | <b>23,16</b>  | <b>15,68</b>  | <b>32,24</b>  | <b>39,49</b>  | <b>79,09</b> |           |                    |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I                    | 15,96        | 23,85         | 16,27         | 32,52         | 39,65         | 76,46        | 16,55     | 34,85              |
| <b>IBOVESPA - BENCHMARK</b>                                 | <b>10,25</b> | <b>-30,39</b> | <b>-29,23</b> | <b>-24,92</b> | <b>-16,45</b> | <b>-6,51</b> |           |                    |
| XP INVESTOR 30 FIC AÇÕES                                    | 14,21        | -31,08        | -33,25        | -21,42        | -5,61         | 5,46         | 25,54     | 53,80              |
| XP INVESTOR DIVIDENDOS 30 FIC AÇÕES                         | 4,53         | -30,51        | -31,49        | -23,18        | -7,19         | 13,59        | 25,08     | 52,83              |
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES                                      | 11,03        | -32,47        | -32,34        | -25,59        | -9,53         | 3,07         | 25,89     | 54,53              |
| BRADESCO SELECTION FI AÇÕES                                 | 6,84         | -35,78        | -34,94        | -32,16        | -22,88        | -12,14       | 21,82     | 45,96              |
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES                        | 9,17         | -41,59        | -42,43        | -33,70        | -23,73        | -10,30       | 26,98     | 56,82              |
| CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO   | 0,25         | 1,41          | 1,09          | 2,61          | 7,30          |              |           |                    |
| <b>IBX - BENCHMARK</b>                                      | <b>10,27</b> | <b>-30,14</b> | <b>-29,25</b> | <b>-24,33</b> | <b>-15,12</b> | <b>-4,14</b> |           |                    |
| BB INDEXADO IBRX FIC AÇÕES                                  | 10,03        | -30,60        | -29,57        | -25,10        | -17,17        | -8,54        | 22,51     | 47,41              |
| <b>IDIV - BENCHMARK</b>                                     | <b>3,76</b>  | <b>-28,65</b> | <b>-27,50</b> | <b>-19,68</b> | <b>-7,18</b>  | <b>10,38</b> |           |                    |
| BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES                                | 7,25         | -30,67        | -28,73        | -25,69        | -20,22        | -10,14       | 19,56     | 41,20              |
| <b>IDKA IPCA 2 ANOS - BENCHMARK</b>                         | <b>0,57</b>  | <b>0,57</b>   | <b>0,03</b>   | <b>1,79</b>   | <b>8,62</b>   | <b>18,84</b> |           |                    |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0,43         | 0,02          | -0,44         | 1,13          | 7,34          | 17,02        | 2,75      | 5,79               |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO     | 0,32         | -0,34         | -0,72         | 1,02          | 6,95          | 16,67        | 2,68      | 5,64               |

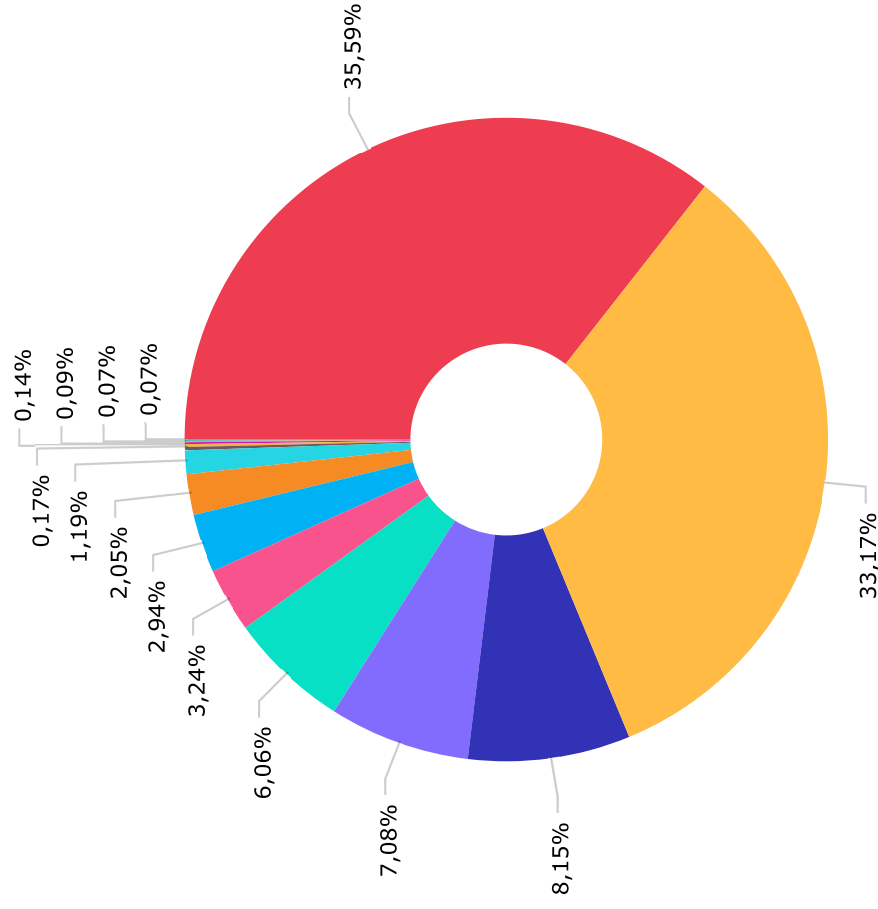
|  | Mês          | Ano          | 3M           | 6M            | 12M          | 24M          | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|--|--------------|--------------|--------------|---------------|--------------|--------------|-----------|--------------------|
| <b>IMA GERAL - BENCHMARK</b>                             | <b>0,86</b>  | <b>-0,14</b> | <b>-0,69</b> | <b>0,03</b>   | <b>8,47</b>  | <b>19,43</b> |           |                    |
| CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0,83         | -0,24        | -0,72        | -0,09         | 8,09         | 18,54        | 4,14      | 8,73               |
| <b>IMA-B - BENCHMARK</b>                                 | <b>1,31</b>  | <b>-5,08</b> | <b>-5,33</b> | <b>-5,55</b>  | <b>8,94</b>  | <b>25,92</b> |           |                    |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO   | 1,30         | -5,12        | -5,36        | -5,65         | 8,71         | 25,32        | 8,99      | 18,94              |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP     | 1,30         | -5,25        | -5,48        | -5,82         | 8,47         | 25,17        | 9,03      | 19,02              |
| CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP   | 1,25         | -5,21        | -5,43        | -5,77         | 8,45         | 25,19        | 9,01      | 18,98              |
| BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO                    | 1,22         | -5,36        | -5,60        | -5,85         | 8,39         | 25,02        | 9,05      | 19,06              |
| <b>IMA-B 5 - BENCHMARK</b>                               | <b>0,49</b>  | <b>-0,09</b> | <b>-0,64</b> | <b>0,86</b>   | <b>8,67</b>  | <b>19,47</b> |           |                    |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP   | 0,47         | -0,18        | -0,72        | 0,68          | 8,37         | 18,91        | 3,24      | 6,83               |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA            | 0,55         | -0,04        | -0,60        | 0,79          | 8,61         | 19,00        | 3,58      | 7,53               |
| <b>IMA-B 5+ - BENCHMARK</b>                              | <b>2,02</b>  | <b>-8,82</b> | <b>-8,85</b> | <b>-10,25</b> | <b>8,47</b>  | <b>30,32</b> |           |                    |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP  | 1,95         | -8,95        | -8,91        | -10,50        | 7,94         | 29,14        | 14,33     | 30,19              |
| <b>IPCA - BENCHMARK</b>                                  | <b>-0,31</b> | <b>0,22</b>  | <b>0,01</b>  | <b>1,89</b>   | <b>2,40</b>  | <b>7,46</b>  |           |                    |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA           | 1,11         | 2,43         | 1,60         | 2,52          | 13,47        | 24,61        | 4,96      | 10,45              |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA      | 0,14         | 1,28         | 0,93         | 1,98          | 9,19         | 18,37        | 2,58      | 5,44               |
| BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA                | 1,02         | -0,30        | -0,73        | -0,40         | 8,12         | 18,37        | 5,14      | 10,82              |
| XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP           | 0,39         | -1,51        | -2,18        | -0,84         | 7,22         | 18,30        | 4,37      | 9,20               |
| <b>IRF-M - BENCHMARK</b>                                 | <b>1,15</b>  | <b>2,59</b>  | <b>1,70</b>  | <b>2,75</b>   | <b>11,69</b> | <b>22,07</b> |           |                    |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO   | 1,07         | 2,47         | 1,60         | 2,60          | 11,40        | 21,53        | 4,99      | 10,51              |
| ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA                 | 0,43         | 1,77         | 1,33         | 2,44          | 6,32         | 13,16        | 0,49      | 1,03               |
| <b>IRF-M 1 - BENCHMARK</b>                               | <b>0,45</b>  | <b>1,88</b>  | <b>1,44</b>  | <b>2,65</b>   | <b>6,60</b>  | <b>13,72</b> |           |                    |

|   | Mês          | Ano          | 3M           | 6M           | 12M          | 24M          | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|---|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|--------------|-----------|--------------------|
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA       | 0,43         | 1,82         | 1,39         | 2,55         | 6,39         | 13,32        | 0,49      | 1,02               |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,41         | 1,79         | 1,37         | 2,51         | 6,31         | 13,19        | 0,49      | 1,03               |
| BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA           | 0,41         | 1,78         | 1,35         | 2,49         | 6,30         | 13,10        | 0,49      | 1,03               |
| <b>IRF-M 1+ - BENCHMARK</b>                               | <b>1,50</b>  | <b>2,96</b>  | <b>1,83</b>  | <b>2,84</b>  | <b>13,92</b> | <b>25,80</b> |           |                    |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP   | 1,44         | 2,87         | 1,77         | 2,71         | 13,65        | 25,31        | 7,27      | 15,31              |
| <b>S&amp;P 500 (MOEDA ORIGINAL) - BENCHMARK</b>           | <b>12,68</b> | <b>-9,85</b> | <b>-9,71</b> | <b>-4,12</b> | <b>-1,13</b> | <b>9,98</b>  |           |                    |
| ITAU PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO                 | 11,97        | -11,67       | -11,99       | -5,85        | -1,46        | 14,06        | 20,07     | 42,26              |
| <b>SELIC - BENCHMARK</b>                                  | <b>0,29</b>  | <b>1,30</b>  | <b>0,92</b>  | <b>2,07</b>  | <b>5,19</b>  | <b>11,87</b> |           |                    |
| BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI            | -0,05        | 0,57         | 0,20         | 1,28         | 4,34         | 10,84        | 0,26      | 0,55               |
| <b>IPCA + 6,00% AO ANO - BENCHMARK</b>                    | <b>0,15</b>  | <b>2,14</b>  | <b>1,41</b>  | <b>4,83</b>  | <b>8,57</b>  | <b>20,71</b> |           |                    |
| CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO       | 0,87         | -0,54        | -1,34        | -0,20        | 10,96        | 21,81        | 5,71      | 12,02              |

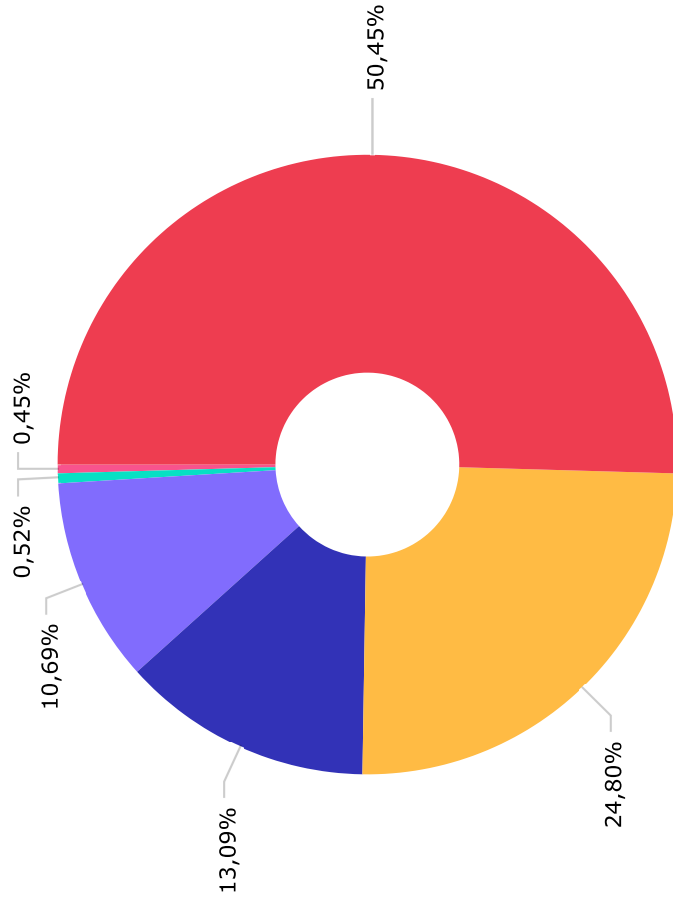




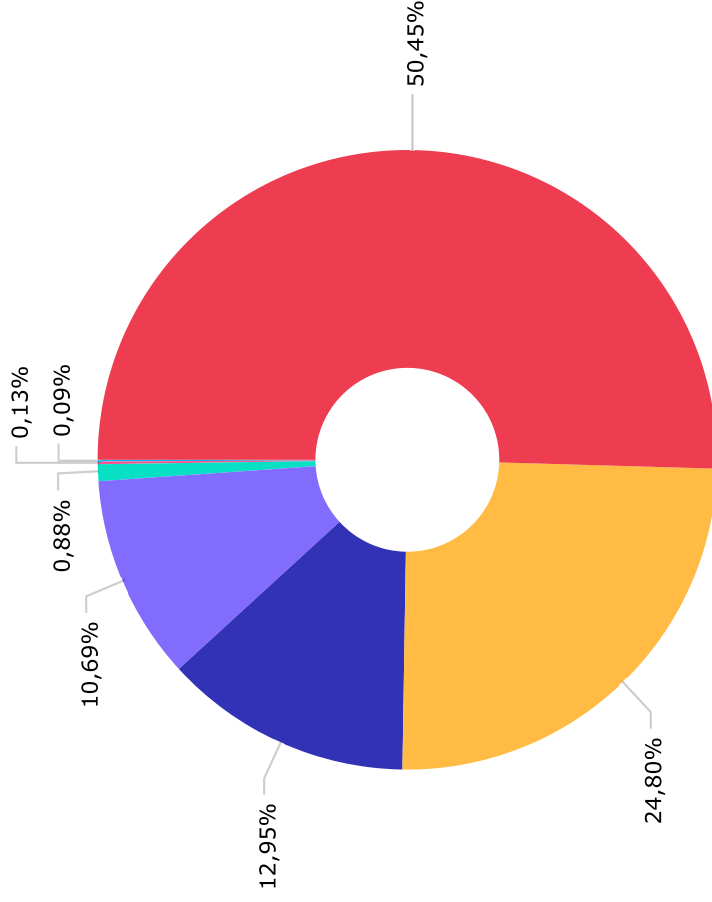
|                          |               |
|--------------------------|---------------|
| IPCA                     | 73.940.284,88 |
| IRF-M 1                  | 46.280.367,35 |
| CDI                      | 41.088.687,74 |
| IDKA IPCA 2 Anos         | 18.760.135,92 |
| IMA-B 5                  | 13.373.411,53 |
| Ibovespa                 | 10.521.878,99 |
| IMA Geral                | 7.174.000,78  |
| IPCA + 6,00% ao ano      | 5.546.268,80  |
| IRF-M                    | 3.024.201,57  |
| S&P 500 (Moeda Original) | 2.718.449,09  |
| Selic                    | 2.108.575,03  |
| IMA-B                    | 1.886.463,36  |
| Global BDRX              | 1.723.223,89  |
| IBX                      | 380.622,91    |
| IMA-B 5+                 | 159.179,44    |
| IDIV                     | 156.065,16    |
| IRF-M 1+                 | 25.779,80     |



| Classificação ANBIMA                          | Valor (R\$)   |
|---|---------------|
| Renda Fixa Indexados                          | 81.453.366,86 |
| Renda Fixa Duração Livre Soberano             | 75.914.503,91 |
| Renda Fixa Duração Alta Grau de Investimento  | 18.659.303,53 |
| Renda Fixa Duração Livre Crédito Livre        | 16.198.542,27 |
| Renda Fixa Duração Baixa Grau de Investimento | 13.871.494,03 |
| Ações Livre                                   | 7.406.899,20  |
| Renda Fixa Duração Livre Grau de Investimento | 6.729.923,50  |
| Multimercados Capital Protegido               | 4.686.026,21  |
| Multimercados Estratégia Específica           | 2.718.449,09  |
| Ações Indexados                               | 380.622,91    |
| Multimercados Juros e Moedas                  | 324.103,85    |
| Multimercados Macro                           | 216.118,25    |
| Ações Dividendos                              | 156.065,16    |
| Ações Índice Ativo                            | 152.177,47    |



| Management                         | Value          |
|------------------------------------|----------------|
| CAIXA ECONÔMICA FEDERAL            | 115.474.545,29 |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...  | 56.755.485,56  |
| BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMEM... | 29.947.698,01  |
| ITAU UNIBANCO S.A.                 | 24.470.694,96  |
| XP VISTA ASSET MANAGEMENT LTDA...  | 1.183.654,70   |
| XP GESTAO DE RECURSOS LTDA         | 1.035.517,72   |



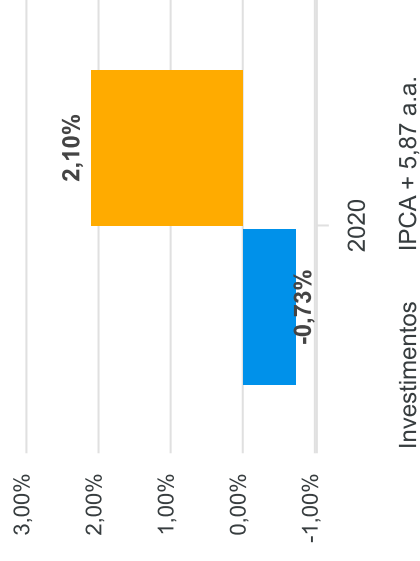
| Administrador                     | Valor          |
|-----------------------------------|----------------|
| CAIXA ECONÔMICA FEDERAL           | 115.474.545,29 |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A... | 56.755.485,56  |
| BANCO BRADESCO S.A.               | 29.639.455,38  |
| ITAU UNIBANCO S.A.                | 24.470.694,96  |
| INTRAG DTVM LTDA                  | 2.003.054,17   |
| BEM DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E... | 308.242,63     |
| BNY MELLON SERVICOS FINANCEIRO... | 216.118,25     |

| Mês       | Saldo Anterior | Aplicações    | Resgates      | Saldo Atual    | Retorno \$    | Retorno Acumulado \$ | Retorno % | Retorno Acumulado % | Meta % | Meta Acumulado % | Meta x Retorno Acumulado % | Risco - VaR |
|-----------|----------------|---------------|---------------|----------------|---------------|----------------------|-----------|---------------------|--------|------------------|----------------------------|-------------|
| Janeiro   | 224.454.039,47 | 1.806.166,41  | 464.263,84    | 227.072.452,80 | 1.276.510,76  | 1.276.510,76         | 0,57% ▲   | 0,57%               | 0,71%  | 0,71%            | 80,28%                     | 0,99%       |
| Fevereiro | 227.072.452,80 | 18.218.124,97 | 16.770.078,99 | 228.313.992,89 | -206.505,89   | 1.070.004,87         | -0,09% ▼  | 0,47%               | 0,66%  | 1,37%            | 34,31%                     | 1,47%       |
| Março     | 228.313.992,89 | 1.911.652,93  | 437.454,03    | 224.520.746,59 | -5.267.445,20 | -4.197.440,33        | -2,29% ▼  | -1,83%              | 0,57%  | 1,95%            | -93,85%                    | 6,99%       |
| Abril     | 224.520.746,59 | 2.226.174,73  | 418.311,87    | 228.867.596,24 | 2.538.986,79  | -1.658.453,54        | 1,12% ▲   | -0,73%              | 0,14%  | 2,10%            | -34,76%                    | 4,07%       |

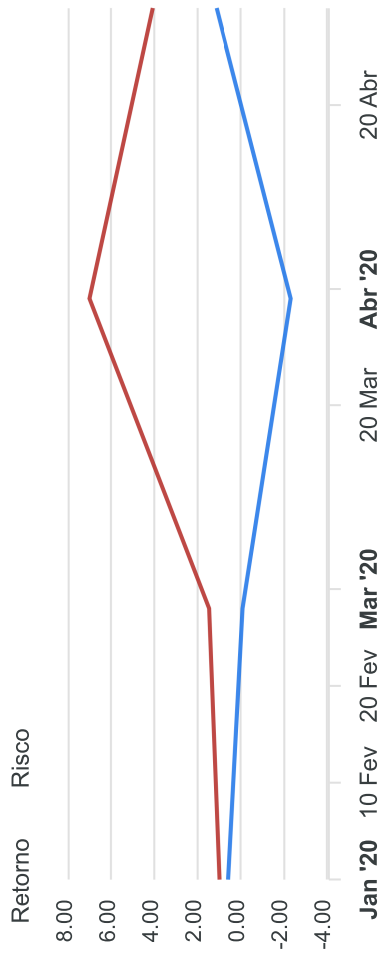
#### Retorno Acumulado (Períodos)

| Período | Retorno \$    | Retorno % | Meta % |
|---------|---------------|-----------|--------|
| 1º Trim | -4.197.440,33 | -1,83%    | 1,95%  |

#### Gráfico Retorno e Meta Acumulado



### Gráfico Risco x Retorno

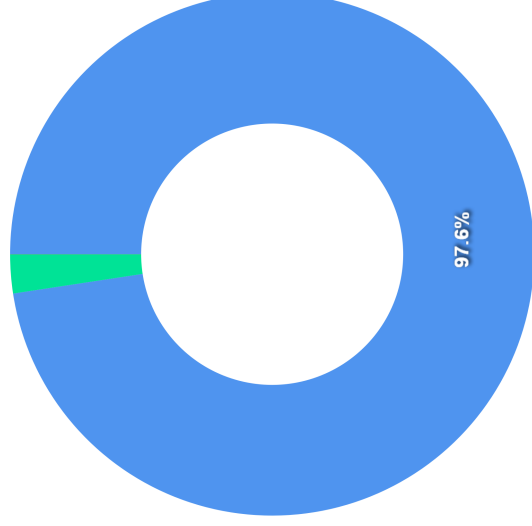


### Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade



### Liquidez - 30/04/2020

| Disponibilidade | Valor          | %     |
|-----------------|----------------|-------|
| Até D+30        | 223.362.170,56 | 97,59 |
| Até D+180       | 5.505.425,68   | 2,41  |
| Até D+360       | 0,00           | 0,00  |
| Até D+720       | 0,00           | 0,00  |
| Até D+1800      | 0,00           | 0,00  |
| Até D+3600      | 0,00           | 0,00  |
| Acima D+3600    | 0,00           | 0,00  |
| Indeterminado   | 0,00           | 0,00  |



| RENDIA FIXA   | Saldo Anterior | Aplicações   | Resgates   | Saldo Atual    | Retorno \$   | Retorno % | Risco - VaR |
|---|----------------|--------------|------------|----------------|--------------|-----------|-------------|
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO             | 28.525.226,10  | 0,00         | 0,00       | 28.785.546,64  | 260.320,54   | 0,91% ▲   | 4,82%       |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO     | 255.378,06     | 0,00         | 0,00       | 256.204,73     | 826,67       | 0,32% ▲   | 2,68%       |
| BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO                       | 569.239,14     | 0,00         | 0,00       | 576.186,40     | 6.947,26     | 1,22% ▲   | 9,05%       |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO      | 626.403,67     | 0,00         | 0,00       | 634.535,67     | 8.132,00     | 1,30% ▲   | 8,99%       |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO   | 11.652.548,04  | 0,00         | 0,00       | 11.700.592,55  | 48.044,51    | 0,41% ▲   | 0,49%       |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO      | 2.630.675,96   | 0,00         | 0,00       | 2.658.877,66   | 28.201,70    | 1,07% ▲   | 4,99%       |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP  | 11.732.624,52  | 0,00         | 0,00       | 11.762.919,00  | 30.294,48    | 0,26% ▲   | 0,12%       |
| BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA                   | 18.115.383,29  | 0,00         | 0,00       | 18.300.707,46  | 185.324,17   | 1,02% ▲   | 5,14%       |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA               | 356.642,75     | 0,00         | 0,00       | 358.596,07     | 1.953,32     | 0,55% ▲   | 3,58%       |
| BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA             | 8.834.917,41   | 0,00         | 0,00       | 8.871.576,82   | 36.659,41    | 0,41% ▲   | 0,49%       |
| BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI              | 2.109.714,24   | 0,00         | 0,00       | 2.108.575,03   | -1.139,21    | -0,05% ▼  | 0,26%       |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA              | 37.836.903,19  | 0,00         | 0,00       | 38.257.380,45  | 420.477,26   | 1,11% ▲   | 4,96%       |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 18.425.473,45  | 0,00         | 0,00       | 18.503.931,19  | 78.457,74    | 0,43% ▲   | 2,75%       |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP      | 12.954.543,00  | 0,00         | 0,00       | 13.014.815,46  | 60.272,46    | 0,47% ▲   | 3,24%       |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP     | 156.142,06     | 0,00         | 0,00       | 159.179,44     | 3.037,38     | 1,95% ▲   | 14,33%      |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP        | 379.672,48     | 0,00         | 0,00       | 384.620,10     | 4.947,62     | 1,30% ▲   | 9,03%       |
| CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP    | 7.114.840,00   | 0,00         | 0,00       | 7.174.000,78   | 59.160,78    | 0,83% ▲   | 4,14%       |
| CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO         | 5.498.368,00   | 0,00         | 0,00       | 5.546.268,80   | 47.900,80    | 0,87% ▲   | 5,71%       |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA         | 23.791.560,14  | 2.226.174,73 | 418.311,87 | 25.708.197,98  | 108.774,98   | 0,42% ▲   | 0,49%       |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP     | 25.413,52      | 0,00         | 0,00       | 25.779,80      | 366,28       | 1,44% ▲   | 7,27%       |
| CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP      | 287.533,19     | 0,00         | 0,00       | 291.121,19     | 3.588,00     | 1,25% ▲   | 9,01%       |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA         | 16.175.366,42  | 0,00         | 0,00       | 16.198.542,27  | 23.175,85    | 0,14% ▲   | 2,58%       |
| ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA                    | 363.759,43     | 0,00         | 0,00       | 365.323,91     | 1.564,48     | 0,43% ▲   | 0,49%       |
| XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP              | 1.179.012,38   | 0,00         | 0,00       | 1.183.654,70   | 4.642,32     | 0,39% ▲   | 4,37%       |
|   | 209.597.340,44 | 2.226.174,73 | 418.311,87 | 212.827.134,10 | 1.421.930,80 | 0,67%     | 3,21%       |

| RENDA VARIÁVEL  | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual   | Retorno \$ | Retorno % | Risco - VaR |
|---|----------------|------------|----------|---------------|------------|-----------|-------------|
| BB INDEXADO IBRX FIC AÇÕES                                | 345.929,79     | 0,00       | 0,00     | 380.622,91    | 34.693,12  | 10,03% ▲  | 22,51%      |
| BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES                              | 145.520,22     | 0,00       | 0,00     | 156.065,16    | 10.544,94  | 7,25% ▲   | 19,56%      |
| BRADESCO SELECTION FI AÇÕES                               | 142.430,79     | 0,00       | 0,00     | 152.177,47    | 9.746,68   | 6,84% ▲   | 21,82%      |
| CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO | 4.674.394,28   | 0,00       | 0,00     | 4.686.026,21  | 11.631,93  | 0,25% ▲   | -           |
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES                                    | 2.604.897,96   | 0,00       | 0,00     | 2.892.166,22  | 287.268,26 | 11,03% ▲  | 25,89%      |
| ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO        | 323.334,94     | 0,00       | 0,00     | 324.103,85    | 768,91     | 0,24% ▲   | 0,43%       |
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES                      | 1.806.490,86   | 0,00       | 0,00     | 1.972.109,62  | 165.618,76 | 9,17% ▲   | 26,98%      |
| ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO                 | 2.427.944,49   | 0,00       | 0,00     | 2.718.449,09  | 290.504,60 | 11,97% ▲  | 20,07%      |
| XP INVESTOR 30 FIC AÇÕES                                  | 348.298,18     | 0,00       | 0,00     | 397.803,47    | 49.505,29  | 14,21% ▲  | 25,54%      |
| XP INVESTOR DIVIDENDOS 30 FIC AÇÕES                       | 403.331,20     | 0,00       | 0,00     | 421.596,00    | 18.264,80  | 4,53% ▲   | 25,08%      |
| XP MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO                   | 214.844,70     | 0,00       | 0,00     | 216.118,25    | 1.273,55   | 0,59% ▲   | -           |
| -   | 13.437.417,41  | 0,00       | 0,00     | 14.317.238,25 | 879.820,84 | 6,55%     | 15,49%      |



| ESTRUTURADOS  | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual   | Retorno \$ | Retorno % | Risco - VaR |
|---|----------------|------------|----------|---------------|------------|-----------|-------------|
| BB INDEXADO IBRX FIC AÇÕES                                | 345.929,79     | 0,00       | 0,00     | 380.622,91    | 34.693,12  | 10,03% ▲  | 22,51%      |
| BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES                              | 145.520,22     | 0,00       | 0,00     | 156.065,16    | 10.544,94  | 7,25% ▲   | 19,56%      |
| BRADESCO SELECTION FI AÇÕES                               | 142.430,79     | 0,00       | 0,00     | 152.177,47    | 9.746,68   | 6,84% ▲   | 21,82%      |
| CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO | 4.674.394,28   | 0,00       | 0,00     | 4.686.026,21  | 11.631,93  | 0,25% ▲   | -           |
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES                                    | 2.604.897,96   | 0,00       | 0,00     | 2.892.166,22  | 287.268,26 | 11,03% ▲  | 25,89%      |
| ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO        | 323.334,94     | 0,00       | 0,00     | 324.103,85    | 768,91     | 0,24% ▲   | 0,43%       |
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES                      | 1.806.490,86   | 0,00       | 0,00     | 1.972.109,62  | 165.618,76 | 9,17% ▲   | 26,98%      |
| ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO                 | 2.427.944,49   | 0,00       | 0,00     | 2.718.449,09  | 290.504,60 | 11,97% ▲  | 20,07%      |
| XP INVESTOR 30 FIC AÇÕES                                  | 348.298,18     | 0,00       | 0,00     | 397.803,47    | 49.505,29  | 14,21% ▲  | 25,54%      |
| XP INVESTOR DIVIDENDOS 30 FIC AÇÕES                       | 403.331,20     | 0,00       | 0,00     | 421.596,00    | 18.264,80  | 4,53% ▲   | 25,08%      |
| XP MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO                   | 214.844,70     | 0,00       | 0,00     | 216.118,25    | 1.273,55   | 0,59% ▲   | -           |
| -   | 13.437.417,41  | 0,00       | 0,00     | 14.317.238,25 | 879.820,84 | 6,55%     | 15,49%      |

| FUNDOS IMOBILIÁRIOS                                       | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual   | Retorno \$ | Retorno % | Risco - VaR |
|---|----------------|------------|----------|---------------|------------|-----------|-------------|
| BB INDEXADO IBRX FIC AÇÕES                                | 345.929,79     | 0,00       | 0,00     | 380.622,91    | 34.693,12  | 10,03% ▲  | 22,51%      |
| BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES                              | 145.520,22     | 0,00       | 0,00     | 156.065,16    | 10.544,94  | 7,25% ▲   | 19,56%      |
| BRADESCO SELECTION FI AÇÕES                               | 142.430,79     | 0,00       | 0,00     | 152.177,47    | 9.746,68   | 6,84% ▲   | 21,82%      |
| CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO | 4.674.394,28   | 0,00       | 0,00     | 4.686.026,21  | 11.631,93  | 0,25% ▲   | -           |
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES                                    | 2.604.897,96   | 0,00       | 0,00     | 2.892.166,22  | 287.268,26 | 11,03% ▲  | 25,89%      |
| ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO        | 323.334,94     | 0,00       | 0,00     | 324.103,85    | 768,91     | 0,24% ▲   | 0,43%       |
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES                      | 1.806.490,86   | 0,00       | 0,00     | 1.972.109,62  | 165.618,76 | 9,17% ▲   | 26,98%      |
| ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO                 | 2.427.944,49   | 0,00       | 0,00     | 2.718.449,09  | 290.504,60 | 11,97% ▲  | 20,07%      |
| XP INVESTOR 30 FIC AÇÕES                                  | 348.298,18     | 0,00       | 0,00     | 397.803,47    | 49.505,29  | 14,21% ▲  | 25,54%      |
| XP INVESTOR DIVIDENDOS 30 FIC AÇÕES                       | 403.331,20     | 0,00       | 0,00     | 421.596,00    | 18.264,80  | 4,53% ▲   | 25,08%      |
| XP MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO                   | 214.844,70     | 0,00       | 0,00     | 216.118,25    | 1.273,55   | 0,59% ▲   | -           |
| -   | 13.437.417,41  | 0,00       | 0,00     | 14.317.238,25 | 879.820,84 | 6,55%     | 15,49%      |

|   | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual  | Retorno \$ | Retorno % | Risco - VaR |
|---|----------------|------------|----------|--------------|------------|-----------|-------------|
| INVESTIMENTOS NO EXTERIOR               |                |            |          |              |            |           |             |
| CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I | 1.485.988,74   | 0,00       | 0,00     | 1.723.223,89 | 237.235,15 | 15,96% ▲  | 16,55%      |
|   | 1.485.988,74   | 0,00       | 0,00     | 1.723.223,89 | 237.235,15 | 15,96%    | 0,00%       |

