

# Relatório Analítico dos Investimentos

em março e 1º trimestre de 2020

**Carteira consolidada de investimentos - base (Março / 2020)**

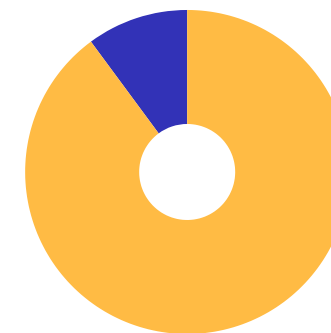
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	23.108.434,07	18,32%	733	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	1.102.513,96	0,87%	31	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.516.835,06	2,00%	105	0,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	3.350.154,32	2,66%	596	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	22.308.376,24	17,69%	962	0,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	2.674.226,82	2,12%	1.357	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	3.070.825,05	2,44%	428	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	16/08/2020	3.743.169,00	2,97%	107	0,38%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	42.759.093,46	33,91%	917	0,46%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	18/08/2020	2.805.596,00	2,22%	19	2,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	D+0	Não há	4.179.604,28	3,31%	307	0,15%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	312.535,97	0,25%	689	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	10.461,47	0,01%	319	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	300.037,49	0,24%	15.927	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	D+1	Não há	640.761,02	0,51%	15	0,21%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BTG PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO 30 FIC RENDA FIX...	D+61	Não há	414.829,24	0,33%	654	0,08%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	D+4	Não há	2.436.721,47	1,93%	1.146	0,41%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	4.435.905,58	3,52%	2.903	0,75%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	D+4	Não há	3.325.559,76	2,64%	2.167	0,22%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	697.583,54	0,55%	55.486	0,00%	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
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	795.758,91	0,63%	6.657	0,00%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' '
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	723.490,81	0,57%	417	0,19%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' '
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	D+4	Não há	352.122,34	0,28%	14.422	0,06%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' '
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	Término...	Não há	44.397,01	0,04%	749	0,16%	Desenquadrado - RF
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>126.108.992,87</b>				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			<b>3.828,31</b>				Artigo 6º
<b>PL Total</b>			<b>126.112.821,18</b>				

**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%	107.439.223,98	85,20%	15,00%	25,00%	70,00%	-19.162.928,97
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	4.179.604,28	3,31%	5,00%	10,00%	60,00%	71.485.791,44
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	1.263.795,95	1,00%	10,00%	30,00%	40,00%	49.179.801,20
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	18.916.348,93
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	6.305.449,64
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	414.829,24	0,33%	0,00%	0,00%	5,00%	5.890.620,40
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	6.305.449,64
Desenquadrado - RF	0,00%	44.397,01	0,04%	0,00%	0,00%	0,00%	-44.397,01
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>113.341.850,46</b>	<b>89,88%</b>	<b>30,00%</b>	<b>70,00%</b>	<b>200,00%</b>	

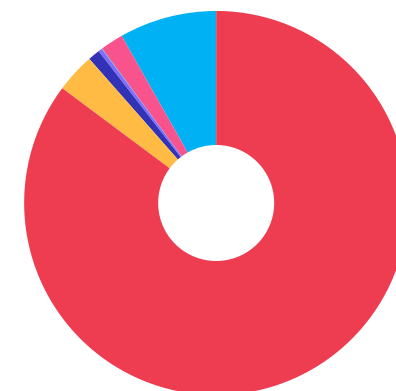


RENDA FIXA 113.341.850,46

RENDA VARIÁVEL 12.767.142,41

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%	2.436.721,47	1,93%	0,00%	0,00%	0,00%	-2.436.721,47
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	10.330.420,94	8,19%	7,00%	15,00%	20,00%	14.891.377,63
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	7,00%	10,00%	10,00%	12.610.899,29
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	6.305.449,64
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	6.305.449,64
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>12.767.142,41</b>	<b>10,12%</b>	<b>14,00%</b>	<b>30,00%</b>	<b>40,00%</b>	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	110.060.387,77	87,27	0,02
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	5.842.394,82	4,63	0,00
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	5.786.875,79	4,59	0,00
BANCO J. SAFRA S/A	1.743.274,98	1,38	0,00
ITAÚ UNIBANCO	1.421.074,35	1,13	0,00
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	1.210.588,15	0,96	0,00
MACROINVEST GESTÃO DE RECURSOS	44.397,01	0,04	0,10

**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 '	107.439.223,98	85,20	15,00	70,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	4.179.604,28	3,31	5,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	1.263.795,95	1,00	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 '	414.829,24	0,33	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	10.330.420,94	8,19	7,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00	7,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	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
<b>IDKA PRÉ 2 ANOS (Benchmark)</b>	1,18%	3,18%	3,18%	5,10%	12,99%	24,15%	-	-
BRDESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	1,21%	3,26%	3,26%	5,07%	12,88%	23,56%	0,08%	0,02%
<b>IMA Geral ex-C (Benchmark)</b>	-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%
<b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>	-1,21%	0,00%	0,00%	2,46%	9,11%	19,14%	-	-
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%
<b>IMA-B 5+ (Benchmark)</b>	-10,93%	-10,62%	-10,62%	-7,92%	8,24%	26,94%	-	-
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA	-6,70%	-5,76%	-5,76%	-2,75%	10,06%	-	0,19%	0,10%
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	0,60%	1,43%	1,43%	2,83%	6,66%	13,79%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,59%	1,38%	1,38%	2,73%	6,46%	13,39%	0,01%	0,00%
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	0,40%	1,18%	1,18%	2,42%	6,19%	13,21%	0,01%	0,01%
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	-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%
<b>IMA-B (Benchmark)</b>	-6,97%	-6,31%	-6,31%	-3,64%	9,14%	24,10%	-	-

**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
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-7,00%	-6,38%	-6,38%	-3,82%	8,70%	23,48%	0,17%	0,11%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,13%	-3,58%	-3,58%	-1,26%	-0,19%	1,91%	0,01%	0,04%
<b>IRF-M (Benchmark)</b>	-0,11%	1,42%	1,42%	3,31%	11,09%	21,25%	-	-
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%
<b>CDI (Benchmark)</b>	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%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,27%	0,80%	0,80%	1,83%	4,55%	10,26%	0,00%	0,00%
BTG PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO 30 FIC RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO...	-2,90%	-2,22%	-2,22%	-1,70%	1,59%	-	0,01%	0,03%
<b>IPCA (Benchmark)</b>	0,07%	0,53%	0,53%	2,31%	3,30%	8,03%	-	-
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,77%	-0,17%	-0,17%	2,45%	4,33%	8,76%	0,00%	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%
<b>Não Informado (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,01%	0,06%	0,06%	0,24%	0,75%	1,94%	0,00%	0,00%
<b>Não definido (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	-2,06%	-1,81%	-1,81%	-1,55%	45,22%	116,17%	0,04%	0,78%



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
-----	-----	----	----	-----	-----	---------	------------------

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

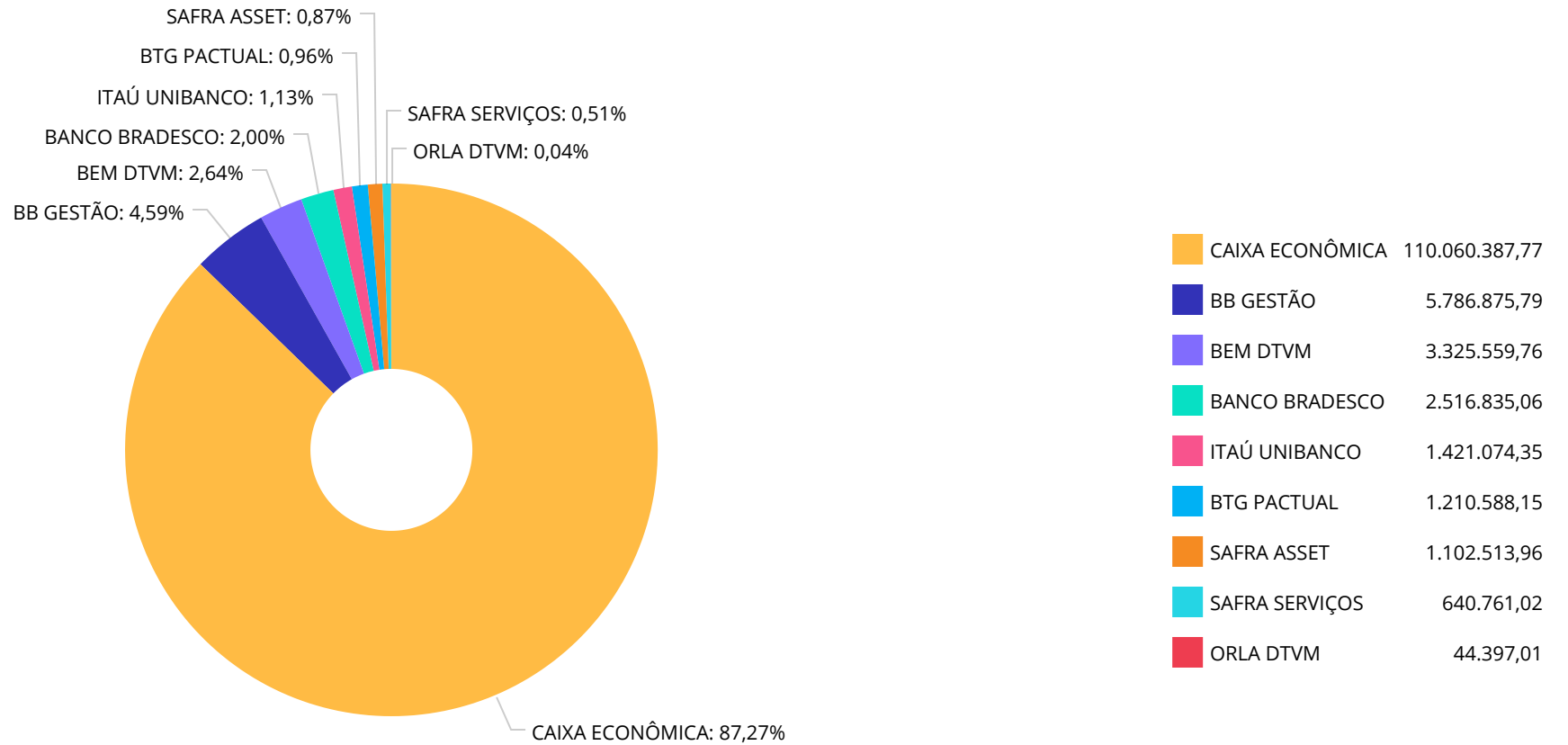
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IGC (Benchmark)</b>	-30,65%	-36,13%	-36,13%	-28,17%	-18,31%	-7,41%	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	-30,82%	-36,89%	-36,89%	-29,53%	-21,91%	-9,96%	0,58%	0,34%

<b>ICON (Benchmark)</b>	-31,51%	-36,10%	-36,10%	-30,32%	-6,98%	-7,63%	-	-
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	-31,23%	-36,04%	-36,04%	-29,74%	-6,29%	-10,28%	0,59%	0,39%

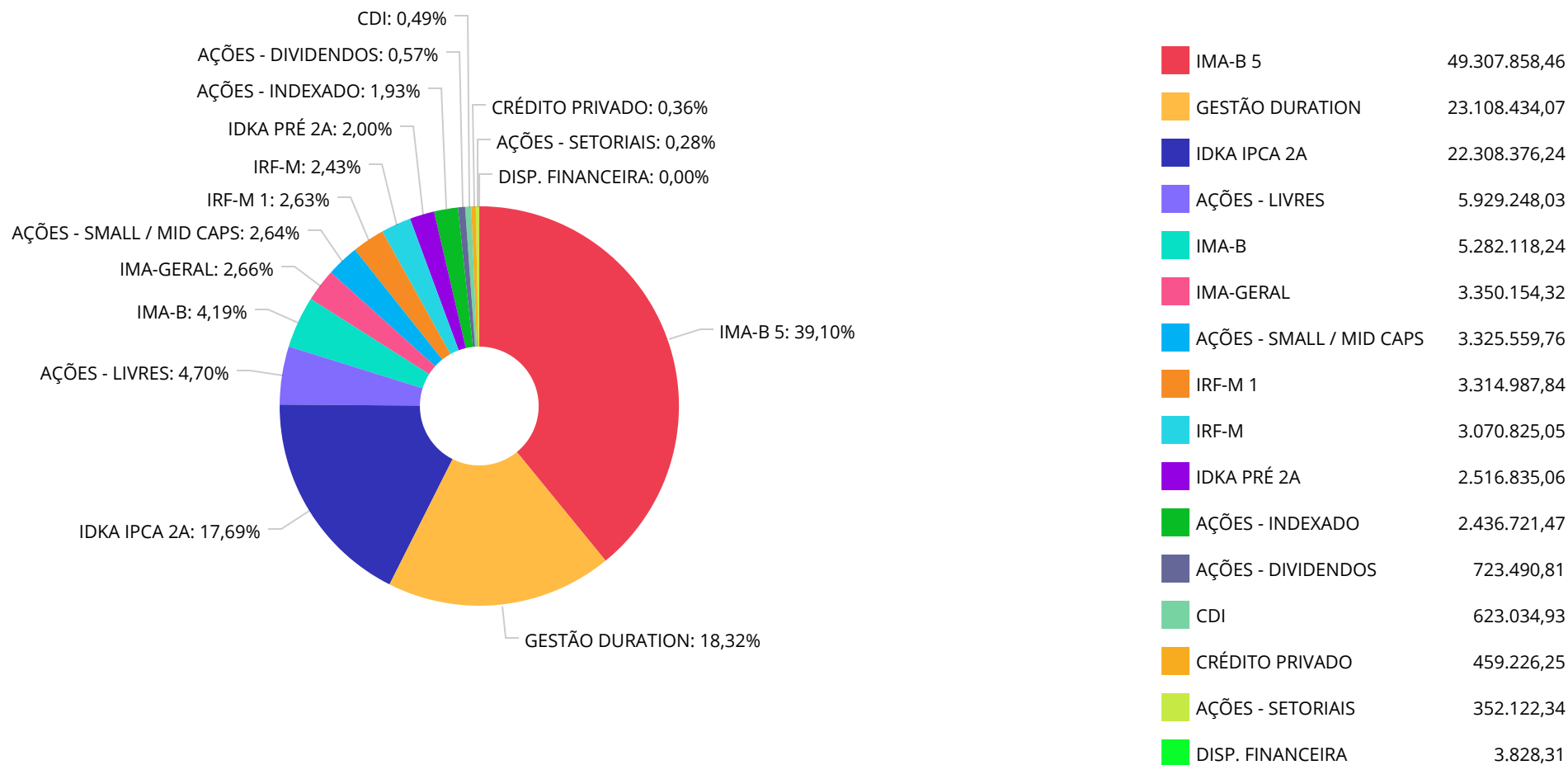
<b>Ibovespa (Benchmark)</b>	-29,90%	-36,86%	-36,86%	-30,29%	-23,47%	-14,46%	-	-
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	-27,67%	-35,22%	-35,22%	-28,22%	-16,95%	-5,73%	0,49%	0,32%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-31,71%	-35,29%	-35,29%	-28,84%	-13,47%	-1,02%	0,60%	0,36%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-32,45%	-39,18%	-39,18%	-31,38%	-17,47%	-4,42%	0,55%	0,38%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-31,94%	-35,95%	-35,95%	-26,62%	-	-	0,51%	-

<b>Não definido (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	-31,64%	-36,03%	-36,03%	-26,34%	-12,50%	5,75%	0,56%	0,37%

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



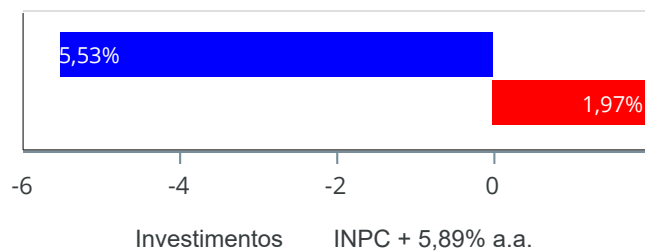
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Março / 2020)



**Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)**

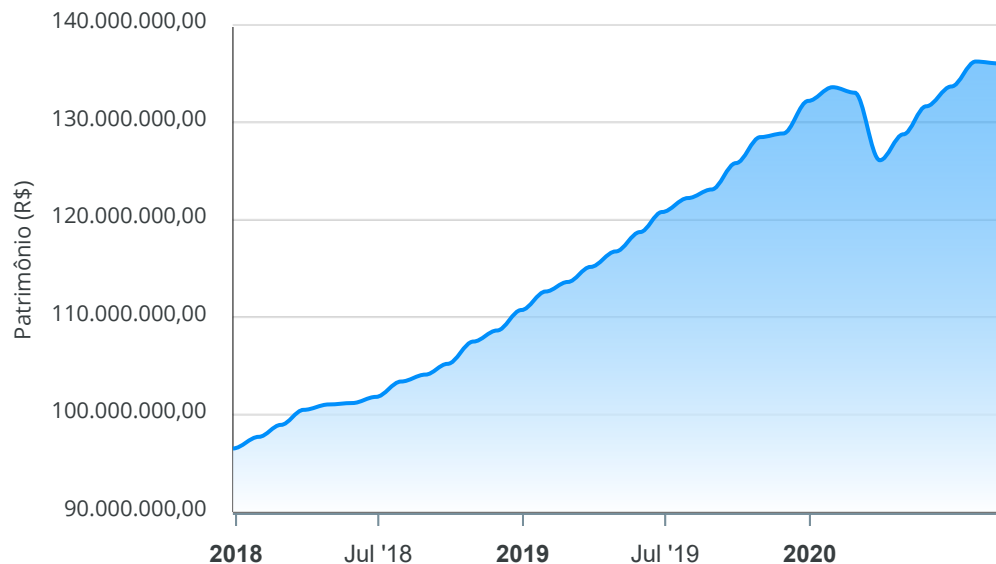
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	132.203.559,38	1.499.612,01	1.058.833,61	133.607.827,91	963.490,13	963.490,13	0,73%	0,73%	0,69%	0,69%	104,99%	1,60%
Fevereiro	133.607.827,91	6.326.140,90	5.953.330,85	133.044.983,84	-935.654,12	27.836,01	-0,70%	0,02%	0,58%	1,28%	1,80%	3,15%
Março	133.044.983,84	3.288.167,06	2.805.900,67	126.108.992,87	-7.418.257,36	-7.390.421,35	-5,56%	-5,53%	0,68%	1,97%	-281,39%	11,55%

Investimentos x Meta Atuarial



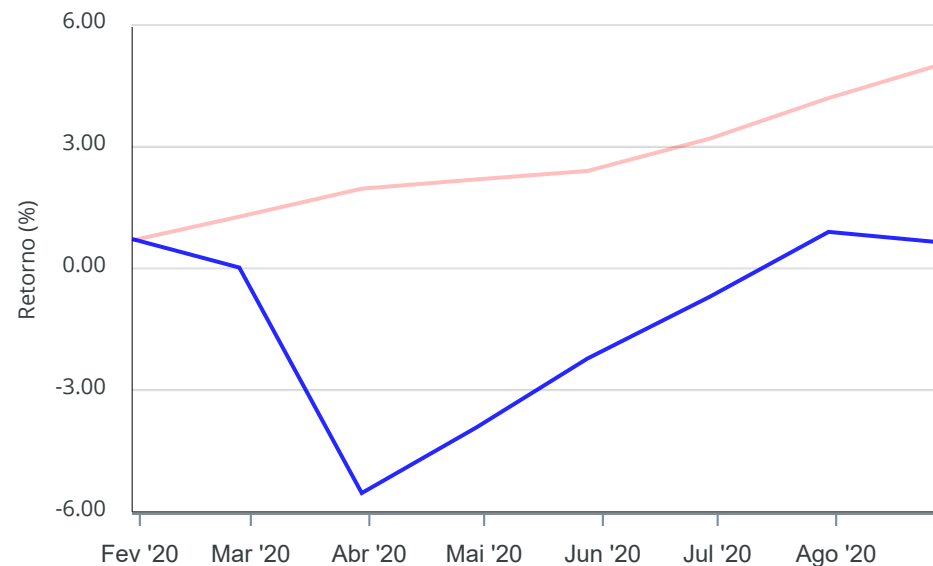
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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	2.486.780,72	0,00	0,00	2.516.835,06	30.054,34	1,21%	1,21%	7,65%
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.784.122,00	0,00	0,00	2.805.596,00	21.474,00	0,77%	0,77%	0,14%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.658.599,40	0,00	0,00	2.674.226,82	15.627,42	0,59%	0,59%	0,62%
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	638.184,74	0,00	0,00	640.761,02	2.576,28	0,40%	0,40%	0,86%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	312.092,05	0,00	0,00	312.535,97	443,92	0,14%	0,14%	0,11%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	39.680,22	37.542,21	66.823,51	10.461,47	62,55	0,08%	0,26%	0,01%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,00	2.048.077,16	1.748.077,16	300.037,49	37,49	0,00%	0,01%	0,01%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	22.900.610,41	1.202.547,69	991.000,00	23.108.434,07	-3.724,03	-0,02%	-0,13%	7,65%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	3.074.305,30	0,00	0,00	3.070.825,05	-3.480,25	-0,11%	-0,11%	7,66%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.786.051,00	0,00	0,00	3.743.169,00	-42.882,00	-1,13%	-1,13%	1,28%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	22.637.454,97	0,00	0,00	22.308.376,24	-329.078,73	-1,45%	-1,45%	5,46%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	43.541.590,22	0,00	0,00	42.759.093,46	-782.496,76	-1,80%	-1,80%	6,80%
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	45.330,80	0,00	0,00	44.397,01	-933,79	-2,06%	-2,06%	3,56%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.422.060,38	0,00	0,00	3.350.154,32	-71.906,06	-2,10%	-2,10%	8,04%
BTG PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO 30 FIC RENDA FIXA ...	427.213,65	0,00	0,00	414.829,24	-12.384,41	-2,90%	-2,90%	1,31%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA	1.181.646,73	0,00	0,00	1.102.513,96	-79.132,77	-6,70%	-6,70%	18,98%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	4.494.189,20	0,00	0,00	4.179.604,28	-314.584,92	-7,00%	-7,00%	16,53%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>114.429.911,79</b>	<b>3.288.167,06</b>	<b>2.805.900,67</b>	<b>113.341.850,46</b>	<b>-1.570.327,72</b>	<b>-1,37%</b>		<b>6,68%</b>

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
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.000.203,26	0,00	0,00	723.490,81	-276.712,45	-27,67%	-27,67%	48,81%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	3.522.468,54	0,00	0,00	2.436.721,47	-1.085.747,07	-30,82%	-30,82%	58,44%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	512.003,68	0,00	0,00	352.122,34	-159.881,34	-31,23%	-31,23%	59,10%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	4.864.965,58	0,00	0,00	3.325.559,76	-1.539.405,82	-31,64%	-31,64%	56,38%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.165.316,26	0,00	0,00	795.758,91	-369.557,35	-31,71%	-31,71%	59,74%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	6.517.504,49	0,00	0,00	4.435.905,58	-2.081.598,91	-31,94%	-31,94%	51,35%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1.032.610,24	0,00	0,00	697.583,54	-335.026,70	-32,44%	-32,44%	55,05%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>18.615.072,05</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>12.767.142,41</b>	<b>-5.847.929,64</b>	<b>-31,42%</b>		<b>54,81%</b>



**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	20.650.383,27	4.065.552,90	1.920.260,00	23.108.434,07	312.757,90	1,27%	1,31%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	2.437.386,08	0,00	0,00	2.516.835,06	79.448,98	3,26%	3,26%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	3.029.608,34	0,00	0,00	3.070.825,05	41.216,71	1,36%	1,36%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.637.830,14	0,00	0,00	2.674.226,82	36.396,68	1,38%	1,38%
SAFRA EXECUTIVE 2 FI RENDA FIXA	633.172,97	0,00	0,00	640.761,02	7.588,05	1,20%	1,18%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	310.089,79	0,00	0,00	312.535,97	2.446,18	0,79%	0,79%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	37.330,95	126.506,93	153.534,34	10.461,47	157,93	0,10%	0,80%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,00	2.904.213,41	2.604.218,28	300.037,49	42,36	0,00%	0,06%
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	45.214,61	0,00	0,00	44.397,01	-817,60	-1,81%	-1,81%
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.810.354,00	0,00	0,00	2.805.596,00	-4.758,00	-0,17%	-0,17%
BTG PACTUAL CRÉDITO CORPORATIVO 30 FIC RENDA FIXA ...	424.292,62	0,00	0,00	414.829,24	-9.463,38	-2,23%	-2,22%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.390.056,63	0,00	0,00	3.350.154,32	-39.902,31	-1,18%	-1,18%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA	1.169.255,68	0,00	0,00	1.102.513,96	-66.741,72	-5,71%	-5,76%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	22.399.713,53	0,00	0,00	22.308.376,24	-91.337,29	-0,41%	-0,41%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.882.012,00	0,00	0,00	3.743.169,00	-138.843,00	-3,58%	-3,58%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	5.966.038,38	0,00	1.510.000,00	4.179.604,28	-276.434,10	-4,63%	-6,38%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	42.948.000,48	144.536,32	57.000,00	42.759.093,46	-276.443,34	-0,64%	-0,64%
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>-424.685,95</b>	<b>-0,37%</b>	

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
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	3.554.902,25	0,00	3.573.052,51	0,00	18.150,26	0,51%	-0,80%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	550.572,30	0,00	0,00	352.122,34	-198.449,96	-36,04%	-36,04%
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	1.116.898,91	0,00	0,00	723.490,81	-393.408,10	-35,22%	-35,22%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.229.782,58	0,00	0,00	795.758,91	-434.023,67	-35,29%	-35,29%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	1.146.872,20	0,00	0,00	697.583,54	-449.288,66	-39,18%	-39,18%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	0,00	3.573.110,41	0,00	2.436.721,47	-1.136.388,94	-31,80%	-36,89%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	4.908.643,34	300.000,00	0,00	3.325.559,76	-1.883.083,58	-36,15%	-36,03%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	6.925.148,33	0,00	0,00	4.435.905,58	-2.489.242,75	-35,94%	-35,94%
<b>Total Renda Variável</b>					<b>-6.965.735,40</b>	<b>-35,30%</b>	