

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

Relatório Analítico dos Investimentos

em maio de 2020

Carteira consolidada de investimentos - base (Maio / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
TÍTULOS PÚBLICOS			2.049.753,67	0,47%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	15.954.331,64	3,68%	1.372	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	14.598.583,49	3,37%	353	0,76%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	13.371.644,84	3,09%	613	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	35.155.116,75	8,11%	752	0,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	74.990.415,42	17,31%	912	0,84%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	15.803.851,18	3,65%	595	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	55.554,54	0,01%	1.269	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	25.091.160,49	5,79%	955	0,31%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	11.962.188,66	2,76%	882	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	80.942.082,71	18,68%	904	1,36%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	4.967.205,27	1,15%	669	0,11%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	12.760,41	0,00%	285	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	12.833.471,70	2,96%	123	0,69%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	15.392.566,14	3,55%	90	3,68%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	D+1009	Não há	734.113,89	0,17%	28	1,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	3.533.576,09	0,82%	33	2,07%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	808.681,48	0,19%		0,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL	D+1260	Não há	2.382.236,96	0,55%	19	4,20%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	D+4	Não há	16.386.368,30	3,78%	1.220	2,25%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'a'

Carteira consolidada de investimentos - base (Maio / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	10.543.014,79	2,43%	3.830	1,12%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	11.553.795,66	2,67%	163	0,72%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	16.515.532,95	3,81%	50.170	0,55%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	10.425.986,01	2,41%	53	1,49%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	13.939.845,09	3,22%	732	5,61%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	D+4	Não há	3.145.077,04	0,73%	15.786	0,32%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	9.560.828,42	2,21%	18.593	0,22%	Artigo 8º, Inciso III
ÁTICO FLORESTAL BRASIL FICFIP	Não se ...	Não se aplica	774.650,51	0,18%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRASIL FLORESTAL MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	777.639,12	0,18%	21	0,56%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	4.706.833,29	1,09%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	Não se ...	Não se aplica	2.441.607,67	0,56%		1,55%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
OSASCO PROPERTIES FII	Não se ...	Não se aplica	1.916.183,08	0,44%		0,46%	Desenquadrado - RV
Total para cálculo dos limites da Resolução			433.326.657,26				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (REDA FIXA) - base (Maio / 2020)

Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	2.049.753,67	0,47%	0,00%	0,50%	50,00%	214.613.574,96
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	287.924.929,72	66,45%	15,00%	50,50%	90,00%	102.069.061,81
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	21.666.332,86
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	40,00%	33.940.117,41	7,83%	2,00%	10,00%	40,00%	139.390.545,49
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'	5,00%	6.724.494,53	1,55%	0,00%	2,00%	5,00%	14.941.838,33
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	21.666.332,86
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	21.666.332,86
Total Renda Fixa	100,00%	330.639.295,33	76,30%	17,00%	63,00%	200,00%	

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Maio / 2020)

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'a'	30,00%	16.386.368,30	3,78%	0,00%	5,00%	10,00%	26.946.297,43
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'b'	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	21.666.332,86
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	66.123.251,54	15,26%	7,00%	19,00%	20,00%	20.542.079,91
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'b'	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	43.332.665,73
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	9.560.828,42	2,21%	0,00%	3,00%	10,00%	33.771.837,31
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	5,00%	6.259.122,92	1,44%	0,00%	2,00%	5,00%	15.407.209,94
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	5,00%	2.441.607,67	0,56%	0,00%	1,00%	5,00%	19.224.725,19
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	21.666.332,86
Desenquadrado - RV	0,00%	1.916.183,08	0,44%	0,00%	0,00%	0,00%	-1.916.183,08
Total Renda Variável	30,00%	102.687.361,93	23,70%	7,00%	30,00%	70,00%	

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%	5,00%	10,00%	43.332.665,73
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	21.666.332,86
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	7,00%	15,00%	

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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	261.259.724,19	60,29	0,05
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	57.579.607,52	13,29	0,00
ITAÚ UNIBANCO	43.474.655,16	10,03	0,00
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	13.939.845,09	3,22	1,16
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	12.833.471,70	2,96	0,00
NAVI CAPITAL	10.543.014,79	2,43	0,66
ITAÚ DTVM	10.425.986,01	2,41	0,00
A5 CAPITAL PARTNERS	4.706.833,29	1,09	-
GRAPHEN INVESTIMENTOS LTDA	3.984.403,04	0,92	2,83
AURORA CAPITAL	3.533.576,09	0,82	1,42
SUL AMERICA INVESTIMENTOS GEST...	3.145.077,04	0,73	0,01
RJI CORRETORA DE VALORES	2.382.236,96	0,55	-
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	2.049.753,67	0,47	-
CADENCE GESTORA	1.916.183,08	0,44	-
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	1.552.289,63	0,36	0,35

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

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2020		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	2.049.753,67	0,47	0,00	50,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	287.924.929,72	66,45	15,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	33.940.117,41	7,83	2,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	6.724.494,53	1,55	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 I, Alínea ' a '	16.386.368,30	3,78	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	66.123.251,54	15,26	7,00	20,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso III	9.560.828,42	2,21	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	6.259.122,92	1,44	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	2.441.607,67	0,56	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
Artigo 9º - A, Inciso III	0,00	0,00	0,00	5,00

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA Geral ex-C (Benchmark)	0,97%	0,80%	-0,15%	1,71%	7,42%	21,97%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,07%	0,79%	-0,15%	1,76%	7,59%	22,37%	0,02%	0,04%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	1,75%	2,33%	1,10%	3,57%	9,03%	22,17%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,00%	1,65%	0,63%	2,82%	8,06%	20,02%	0,01%	0,03%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,91%	1,92%	0,85%	3,04%	8,24%	20,20%	0,01%	0,03%
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	0,16%	2,61%	1,05%	4,38%	8,98%	22,01%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-0,43%	-2,75%	-1,97%	-3,17%	-3,52%	1.303,68%	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	0,30%	-15,80%	-3,18%	-15,41%	-18,49%	-19,94%	0,01%	0,07%
IMA-B 5+ (Benchmark)	1,02%	-7,88%	-8,21%	-5,48%	4,17%	38,08%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,00%	-8,04%	-8,27%	-5,69%	3,72%	36,70%	0,06%	0,15%
120% do CDI (Benchmark)	0,28%	1,85%	1,03%	2,31%	5,87%	14,02%	-	-
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL	-0,08%	-0,49%	-0,32%	-0,53%	-0,13%	-	-	-
IRF-M 1 (Benchmark)	0,42%	2,31%	1,47%	2,74%	6,33%	13,97%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,39%	2,19%	1,41%	2,60%	6,04%	13,42%	0,00%	0,00%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,39%	2,22%	1,42%	2,63%	6,11%	13,55%	0,00%	0,00%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA-B 5 (Benchmark)	2,12%	2,03%	0,82%	3,29%	9,46%	23,93%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,11%	1,92%	0,74%	3,15%	9,15%	23,37%	0,01%	0,04%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2,11%	1,99%	0,77%	3,20%	9,26%	23,45%	0,01%	0,04%
IMA-B (Benchmark)	1,52%	-3,64%	-4,32%	-1,70%	6,68%	31,99%	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	1,62%	-3,71%	-4,41%	-1,77%	6,53%	31,82%	0,04%	0,10%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,50%	-3,82%	-4,48%	-1,91%	6,23%	31,21%	0,04%	0,10%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	1,59%	-2,29%	-3,16%	-0,29%	9,09%	35,32%	0,04%	0,10%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	0,48%	-4,02%	-4,04%	-3,36%	0,63%	-	0,02%	0,06%
CDI (Benchmark)	0,24%	1,54%	0,86%	1,92%	4,87%	11,55%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,33%	1,12%	0,48%	1,48%	4,25%	10,73%	0,00%	0,01%
IPCA (Benchmark)	-0,38%	-0,16%	-0,62%	0,99%	1,88%	6,62%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,54%	1,82%	1,22%	2,17%	7,84%	19,42%	0,01%	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1,38%	3,85%	2,37%	4,46%	11,99%	27,82%	0,02%	0,03%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	0,41%	3,96%	1,85%	6,03%	12,53%	30,09%	-	-
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	-	-

IPCA + 9,00% ao ano (Benchmark)	0,30%	3,38%	1,51%	5,32%	11,01%	26,59%	-	-
BRASIL FLORESTAL MULTISTRATÉGIA FIP	-0,12%	-	-	-	32,77%	-19,74%	0,00%	-

IGC (Benchmark)	8,79%	-22,44%	-15,78%	-16,43%	-3,15%	25,21%	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	8,21%	-24,20%	-16,92%	-18,48%	-8,04%	19,04%	0,15%	0,38%

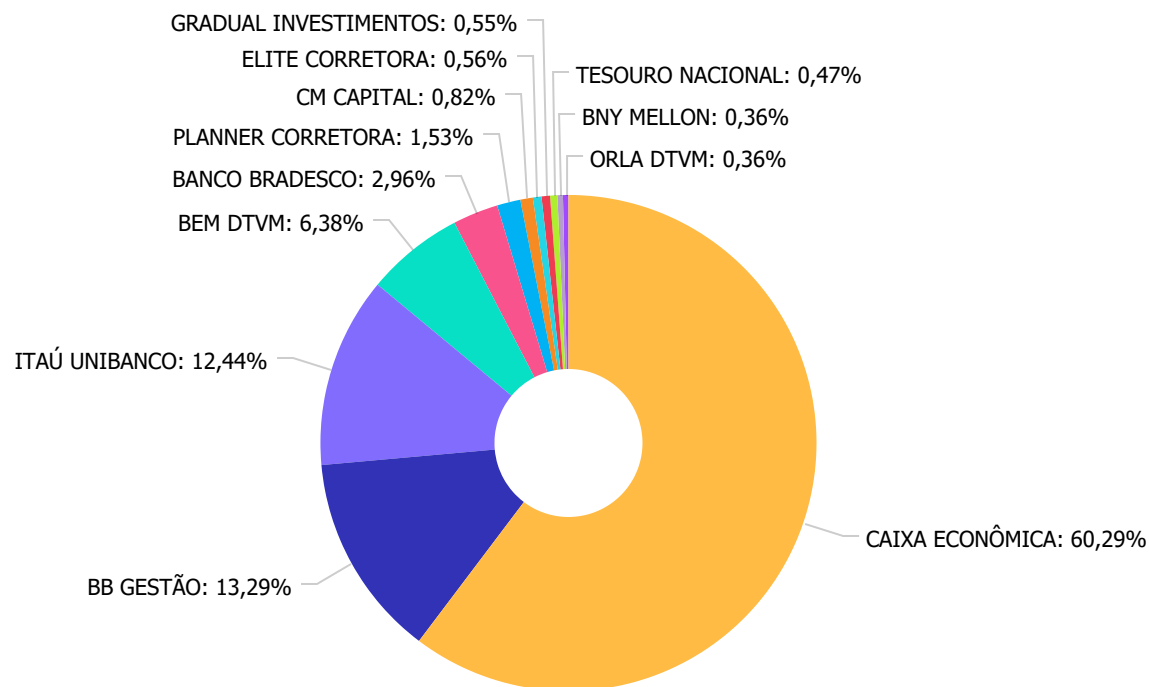
Ibovespa (Benchmark)	8,57%	-24,42%	-16,10%	-19,25%	-9,92%	13,87%	-	-
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	7,94%	-23,23%	-17,32%	-16,88%	-5,23%	19,25%	0,15%	0,38%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	10,49%	-30,82%	-25,66%	-24,20%	-11,82%	14,88%	0,16%	0,46%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	7,18%	-26,10%	-19,14%	-19,76%	-10,14%	15,39%	0,14%	0,37%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	9,18%	-36,23%	-30,73%	-29,72%	-18,72%	6,36%	0,21%	0,49%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	7,16%	-20,56%	-13,25%	-13,38%	0,13%	32,07%	0,16%	0,35%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	5,36%	-28,85%	-20,98%	-23,06%	-6,21%	20,72%	0,17%	0,40%

CDI (Benchmark)	0,24%	1,54%	0,86%	1,92%	4,87%	11,55%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,43%	-2,26%	-1,43%	-0,21%	7,39%	23,68%	0,02%	0,07%

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

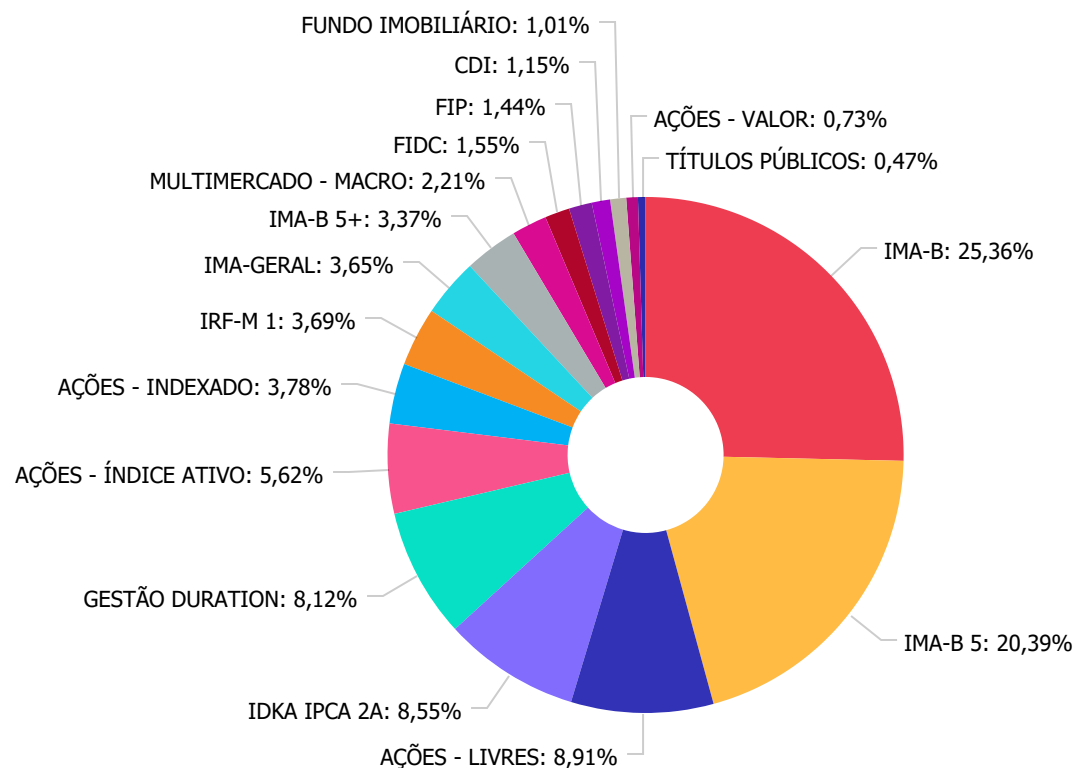
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	-0,11%	-0,69%	-0,36%	-0,80%	-	-	0,00%	0,00%
OSASCO PROPERTIES FII	-0,13%	-0,80%	-0,52%	-0,93%	440.744.831,13%	-	-	-
ÁTICO FLORESTAL BRASIL FICFIP	-	-	-	-	-	-	-	-

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



CAIXA ECONÔMICA	261.259.724,19
BB GESTÃO	57.579.607,52
ITAÚ UNIBANCO	53.900.641,17
BEM DTVM	27.627.936,92
BANCO BRADESCO	12.833.471,70
PLANNER CORRETORA	6.623.016,37
CM CAPITAL	3.533.576,09
ELITE CORRETORA	2.441.607,67
GRADUAL INVESTIMENTOS	2.382.236,96
TESOURO NACIONAL	2.049.753,67
BNY MELLON	1.552.289,63
ORLA DTVM	1.542.795,37

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



IMA-B	109.902.234,44
IMA-B 5	88.362.060,26
AÇÕES - LIVRES	38.612.343,40
IDKA IPCA 2A	37.053.349,15
GESTÃO DURATION	35.167.877,16
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	24.365.831,10
AÇÕES - INDEXADO	16.386.368,30
IRF-M 1	16.009.886,18
IMA-GERAL	15.803.851,18
IMA-B 5+	14.598.583,49
MULTIMERCADO - MACRO	9.560.828,42
FIDC	6.724.494,53
FIP	6.259.122,92
CDI	4.967.205,27
FUNDO IMOBILIÁRIO	4.357.790,75
AÇÕES - VALOR	3.145.077,04
TÍTULOS PÚBLICOS	2.049.753,67

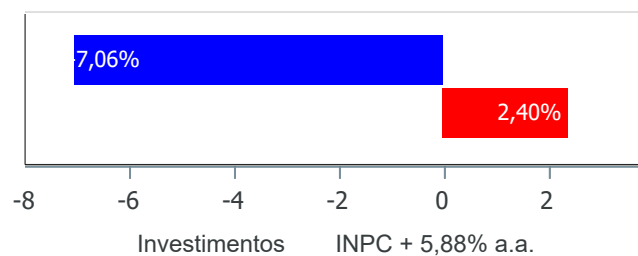
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Maio / 2020)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	31/07/2019	414	4.824,512202	4.865,387652	1.997.348,05	2.014.270,49	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	18/11/2019	7	4.995,267412	5.069,027963	34.966,87	35.483,20	Curva

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

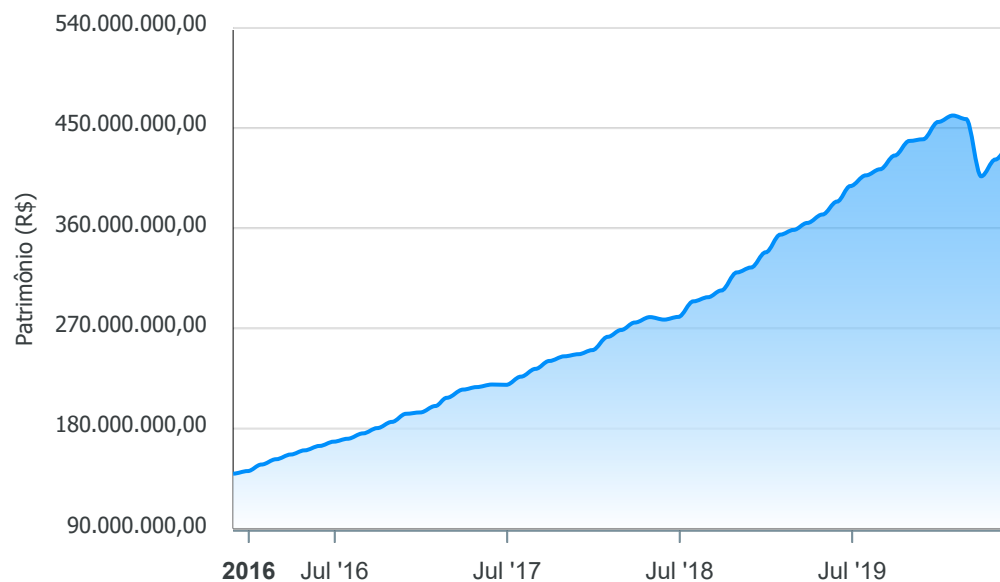
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	454.864.737,50	21.816.085,69	16.528.778,45	461.323.639,85	1.171.595,11	1.171.595,11	0,25%	0,25%	0,69%	0,69%	36,85%	3,25%
Fevereiro	461.323.639,85	10.707.825,40	6.130.332,45	457.995.410,88	-7.905.721,92	-6.734.126,81	-1,70%	-1,45%	0,58%	1,27%	-113,49%	4,88%
Março	457.995.410,88	28.820.410,36	32.625.991,25	406.736.215,22	-47.453.614,77	-54.187.741,58	-10,36%	-11,66%	0,68%	1,96%	-593,49%	19,18%
Abril	406.736.215,22	11.794.948,55	7.062.000,00	421.782.320,35	10.313.156,58	-43.874.585,00	2,51%	-9,44%	0,22%	2,19%	-430,80%	9,16%
Maio	421.782.320,35	645.611,92	226.784,81	433.326.657,26	11.125.509,80	-32.749.075,20	2,64%	-7,06%	0,20%	2,40%	-294,06%	4,98%

Investimentos x Meta Atuarial



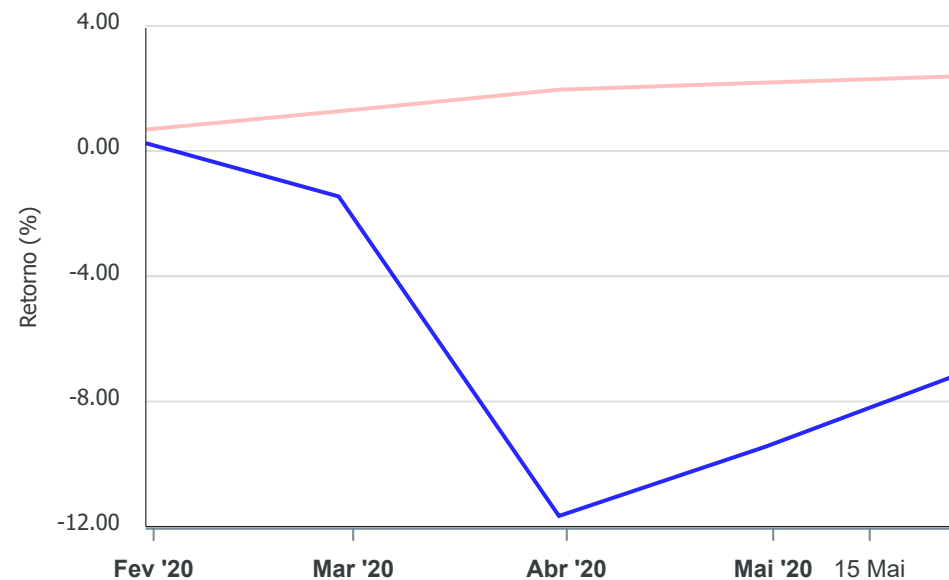
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Maio/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	13.095.600,50	0,00	0,00	13.371.644,84	276.044,34	2,11%	2,11%	1,24%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	73.444.224,59	0,00	0,00	74.990.415,42	1.546.190,83	2,11%	2,11%	1,25%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	11.727.566,72	0,00	0,00	11.962.188,66	234.621,94	2,00%	2,00%	1,00%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	24.622.009,51	0,00	0,00	25.091.160,49	469.150,98	1,91%	1,91%	1,06%
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	12.628.441,89	0,00	0,00	12.833.471,70	205.029,81	1,62%	1,62%	3,77%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	15.151.722,85	0,00	0,00	15.392.566,14	240.843,29	1,59%	1,59%	3,82%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	79.745.404,01	0,00	0,00	80.942.082,71	1.196.678,70	1,50%	1,50%	3,66%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	34.161.188,65	517.979,05	0,00	35.155.116,75	475.949,05	1,37%	1,38%	1,72%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.636.208,50	0,00	0,00	15.803.851,18	167.642,68	1,07%	1,07%	1,74%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	14.454.033,64	0,00	0,00	14.598.583,49	144.549,85	1,00%	1,00%	5,80%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	12.691,81	0,00	0,00	12.760,41	68,60	0,54%	0,54%	0,70%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	730.638,87	0,00	0,00	734.113,89	3.475,02	0,48%	0,48%	2,02%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	15.789.364,25	102.676,04	0,00	15.954.331,64	62.291,35	0,39%	0,39%	0,20%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	55.339,42	0,00	0,00	55.554,54	215,12	0,39%	0,39%	0,20%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	5.111.101,44	24.956,83	185.684,68	4.967.205,27	16.831,68	0,33%	0,33%	0,08%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	3.523.000,53	0,00	0,00	3.533.576,09	10.575,56	0,30%	0,14%	0,83%
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL	2.384.043,78	0,00	0,00	2.382.236,96	-1.806,82	-0,08%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	812.207,79	0,00	0,00	808.681,48	-3.526,31	-0,43%	-	-
TÍTULOS PÚBLICOS	2.156.525,57	0,00	41.100,13	2.049.753,67	-65.671,77	-3,05%	-	-
Total Renda Fixa	325.241.314,32	645.611,92	226.784,81	330.639.295,33	4.979.153,90	1,53%		2,25%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
ÁTICO FLORESTAL BRASIL FICFIP	641.686,36	0,00	0,00	774.650,51	132.964,15	20,72%	-	-
BRASIL FLORESTAL MULTIESTRATÉGIA FIP	645.249,29	0,00	0,00	777.639,12	132.389,83	20,52%	-0,12%	0,00%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	2.846.514,23	0,00	0,00	3.145.077,04	298.562,81	10,49%	10,49%	16,48%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	10.582.169,21	0,00	0,00	11.553.795,66	971.626,45	9,18%	9,18%	21,29%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	15.143.109,57	0,00	0,00	16.386.368,30	1.243.258,73	8,21%	8,21%	15,06%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	9.659.343,23	0,00	0,00	10.425.986,01	766.642,78	7,94%	7,94%	15,19%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	13.006.095,17	0,00	0,00	13.939.845,09	933.749,92	7,18%	7,18%	13,79%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	9.838.193,40	0,00	0,00	10.543.014,79	704.821,39	7,16%	7,16%	15,79%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	15.675.456,46	0,00	0,00	16.515.532,95	840.076,49	5,36%	5,36%	16,91%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	9.426.019,38	0,00	0,00	9.560.828,42	134.809,04	1,43%	1,43%	2,26%
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	2.444.258,94	0,00	0,00	2.441.607,67	-2.651,27	-0,11%	-0,11%	0,00%
OSASCO PROPERTIES FII	1.918.673,67	0,00	0,00	1.916.183,08	-2.490,59	-0,13%	-0,13%	-
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	4.714.237,12	0,00	0,00	4.706.833,29	-7.403,83	-0,16%	-	-
Total Renda Variável	96.541.006,03	0,00	0,00	102.687.361,93	6.146.355,90	6,37%		14,30%