

# 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
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	1.332.287,67	9,37%	962	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	1.125.728,54	7,92%	913	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.035.728,54	7,29%	1.357	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.460.351,71	10,27%	917	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	157.038,21	1,10%	63	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	541.234,21	3,81%	882	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	44.578,55	0,31%	1.227	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	1.962.096,54	13,80%	733	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	1.006.523,29	7,08%	620	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	917.878,37	6,46%	169	0,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	141.964,17	1,00%	94	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	D+0	Não há	175.545,24	1,24%	187	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	564.641,13	3,97%	279	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	42.890,03	0,30%	319	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA...	D+3	Não há	695.575,99	4,89%	433	0,25%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIAÇÕES	D+4	Não há	360.499,68	2,54%	449	0,13%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BRADESCO SELECTION FIAÇÕES	D+4	Não há	257.231,55	1,81%	207	0,05%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIAÇÕES	D+24	Não há	317.045,61	2,23%	165	0,02%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ DUNA MIS FIAÇÕES	D+24	Não há	225.491,32	1,59%	55.486	0,01%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIAÇÕES	D+25	Não há	698.185,38	4,91%	2.903	0,12%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '

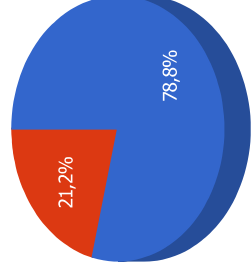
**Carteira consolidada de investimentos - base (Março / 2020)**

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	243.219,65	1,71%	19.517	0,01%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	907.316,32	6,38%	21.972	0,04%	Artigo 8º, Inciso III
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>14.213.051,70</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, Alinea 'b'	100,00%	8.665.567,26	60,97%	15,00%	25,00%	90,00%	4.126.179,27
Artigo 7º, Inciso III, Alinea 'a'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	8.527.831,02
Artigo 7º, Inciso IV, Alinea 'a'	40,00%	2.538.494,93	17,86%	10,00%	30,00%	40,00%	3.146.725,75
Artigo 7º, Inciso VI, Alinea 'a'	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	2.131.957,76
Artigo 7º, Inciso VII, Alinea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	710.652,59
Artigo 7º, Inciso VII, Alinea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	710.652,59
Artigo 7º, Inciso VII, Alinea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	710.652,59
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>11.204.062,19</b>	<b>78,83%</b>	<b>25,00%</b>	<b>70,00%</b>	<b>220,00%</b>	

**Distribuição por Segmento**

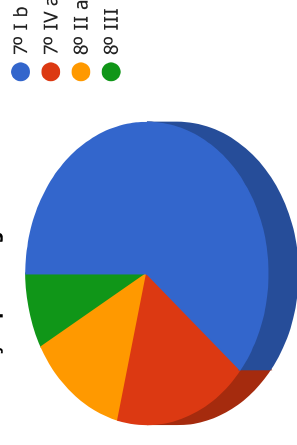


● RENDA FIXA ● RENDA VARIÁVEL

**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%	1.858.453,54	13,08%	7,00%	10,00%	20,00%	984.156,80
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	1.150.535,97	8,09%	7,00%	10,00%	10,00%	270.769,20
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	710.652,59
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	710.652,59
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	710.652,59
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>3.008.989,51</b>	<b>21,17%</b>	<b>14,00%</b>	<b>30,00%</b>	<b>45,00%</b>	

**Distribuição por Artigos**



Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2020			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	1.421.305,17
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>10,00%</b>	

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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	9.645.344,54	67,86	0,00
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	1.952.835,73	13,74	0,00
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	1.350.655,16	9,50	0,00
ITAU UNIBANCO	1.264.216,27	8,89	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, Alinea ' b '	8.665.567,26	60,97	15,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alinea ' a '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alinea ' a '	2.538.494,93	17,86	10,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alinea ' a '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alinea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alinea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alinea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso II, Alinea ' a '	1.858.453,54	13,08	7,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	1.150.535,97	8,09	7,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alinea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alinea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alinea ' 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
<b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>	-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%

<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	0,60%	1,43%	1,43%	2,83%	6,66%	13,79%	-	-
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,57%	1,33%	1,33%	2,68%	6,37%	13,23%	0,01%	0,01%
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%
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%

<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%
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%

<b>IMA-B (Benchmark)</b>	-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%

<b>CDI (Benchmark)</b>	0,34%	1,01%	1,01%	2,26%	5,44%	12,12%	-	-
BRADERCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	0,31%	0,93%	0,93%	2,11%	5,14%	11,51%	0,00%	0,00%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADE FI RENDA FIXA	0,26%	0,80%	0,80%	1,83%	4,55%	10,26%	0,00%	0,00%

**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
IPCA (Benchmark)	0,07%	0,53%	0,53%	2,31%	3,30%	8,03%	-	-
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%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-2,11%	-1,31%	-1,31%	0,48%	7,84%	17,51%	0,09%	0,04%
<b>Não Informado (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,39%	1,07%	1,07%	2,28%	5,51%	11,95%	0,00%	0,00%
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	-1,75%	-0,60%	-0,60%	1,82%	8,76%	16,85%	0,07%	0,03%

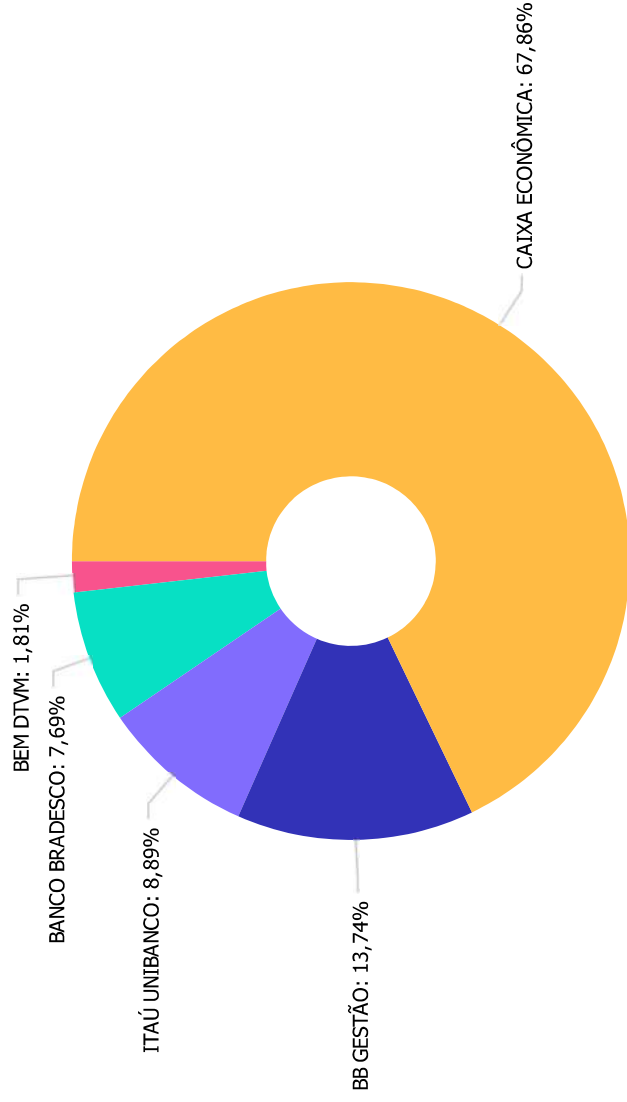


**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Março/2020 - RENDA VARIÁVEL**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Ibovespa (Benchmark)	-29,90%	-36,86%	-36,86%	-30,29%	-23,47%	-14,46%	-	-
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIAÇÕES	-31,67%	-38,33%	-38,33%	-30,98%	-24,65%	-14,59%	0,56%	0,35%
ITAU INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-41,88%	-46,49%	-46,49%	-38,72%	-29,21%	-15,65%	0,67%	0,46%
BRDESCO SELECTION FIAÇÕES	-31,54%	-39,89%	-39,89%	-34,30%	-26,99%	-17,46%	0,57%	0,36%
ITAU DUNAMIS FIC AÇÕES	-32,44%	-39,18%	-39,18%	-31,38%	-17,47%	-4,42%	0,55%	0,38%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-31,94%	-35,94%	-35,94%	-26,62%	-	-	0,51%	-

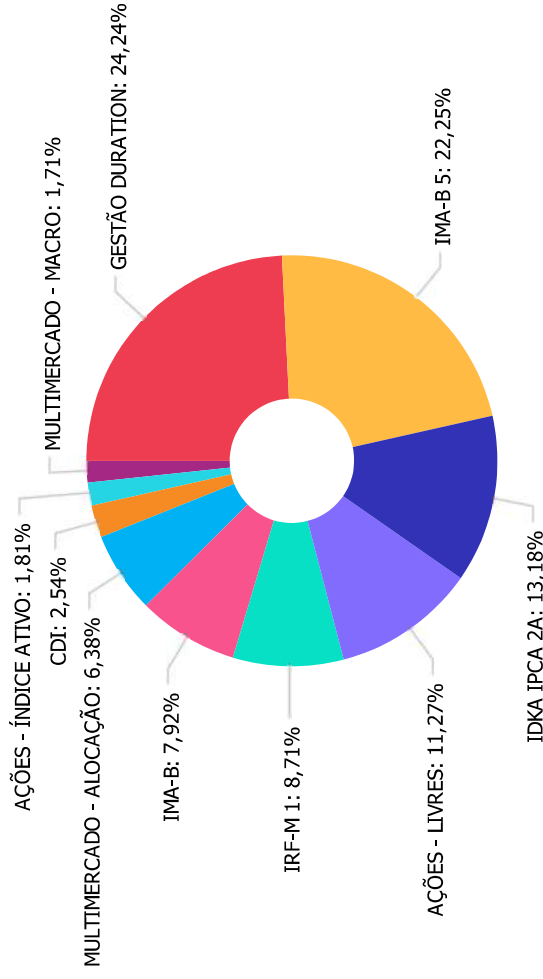
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,34%	1,01%	1,01%	2,26%	5,44%	12,12%	-	-
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	-8,45%	-10,88%	-10,88%	-6,80%	-1,89%	5,16%	0,17%	0,10%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	-5,31%	-6,10%	-6,10%	-2,57%	6,44%	17,36%	0,10%	0,07%

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



Administrador	Valor
CAIXA ECONÔMICA	9.645.344,54
BB GESTÃO	1.952.835,73
ITAÚ UNIBANCO	1.264.216,27
BANCO BRADESCO	1.093.423,61
BEM DTVM	257.231,55

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

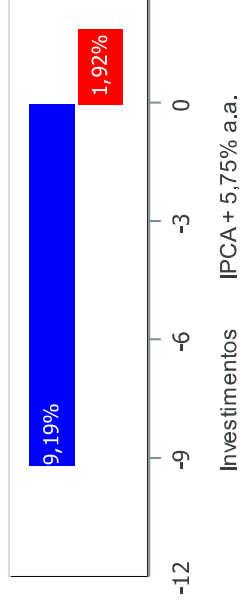


<span style="color: red;">■</span> GESTÃO DURATION	3.444.616,04
<span style="color: orange;">■</span> IMA-B 5	3.162.450,99
<span style="color: blue;">■</span> IDKA IPCA 2A	1.873.521,88
<span style="color: purple;">■</span> ACÇÕES - LIVRES	1.601.221,99
<span style="color: teal;">■</span> IRF-M 1	1.237.345,30
<span style="color: pink;">■</span> IMA-B	1.125.728,54
<span style="color: lightblue;">■</span> MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	907.316,32
<span style="color: brown;">■</span> CDI	360.399,44
<span style="color: cyan;">■</span> ACÇÕES - ÍNDICE ATIVO	257.231,55
<span style="color: magenta;">■</span> MULTIMERCADO - MACRO	243.219,65

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

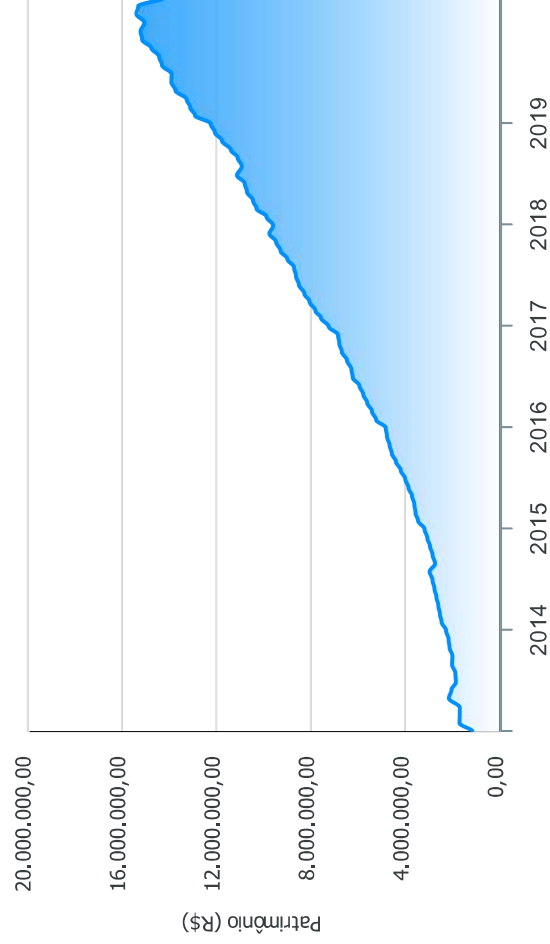
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	15.059.069,11	1.384.523,56	1.102.977,45	15.393.273,05	52.657,83	52.657,83	0,34%	0,34%	0,70%	0,70%	49,02%	2,67%
Fevereiro	15.393.273,05	591.180,86	415.821,46	15.308.565,69	-260.066,76	-207.408,93	-1,67%	-1,33%	0,65%	1,36%	-98,30%	3,76%
Março	15.308.565,69	306.222,91	172.307,47	14.213.051,70	-1.229.429,43	-1.436.838,36	-7,96%	-9,19%	0,56%	1,92%	-477,75%	13,88%

**Investimentos x Meta Atuarial**

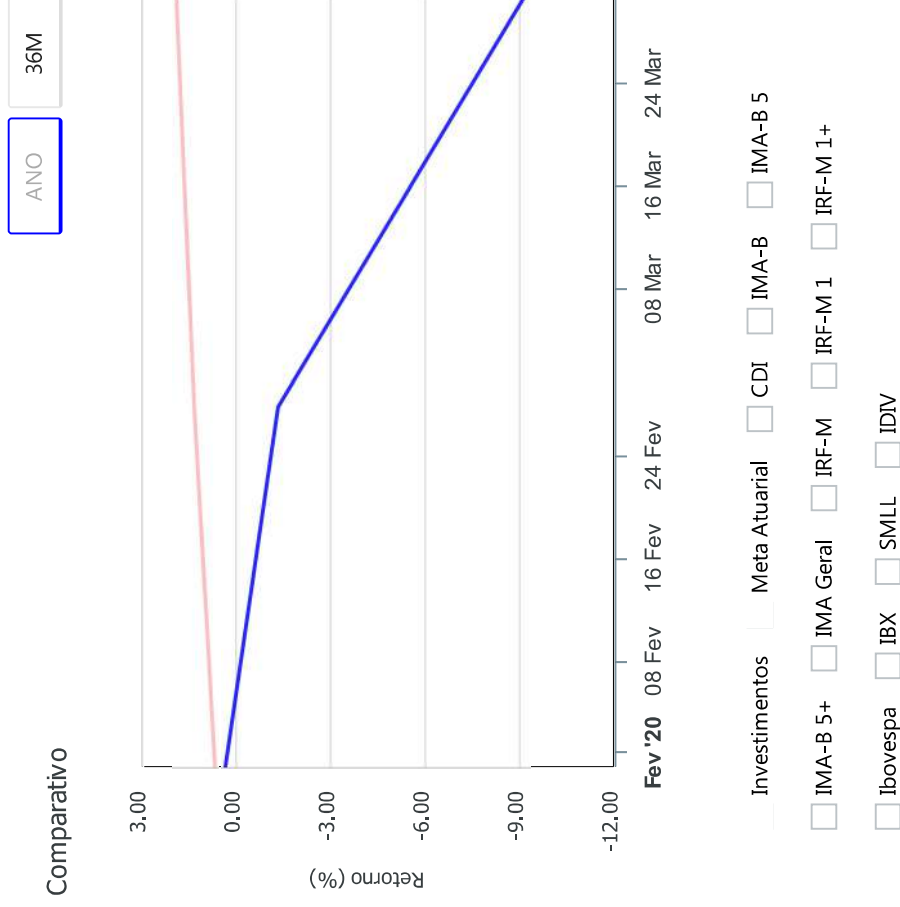


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



**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 PREVIDEN...	44.313,72	0,00	0,00	44.578,55	264,83	0,60%	0,60%	0,62%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.029.676,03	0,00	0,00	1.035.728,54	6.052,51	0,59%	0,59%	0,62%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	561.671,49	0,00	0,00	564.641,13	2.969,64	0,53%	0,53%	0,36%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	141.415,68	0,00	0,00	141.964,17	548,49	0,39%	0,39%	0,37%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	87.044,81	112.267,95	43.000,00	157.038,21	725,45	0,36%	0,57%	0,60%
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	174.997,90	0,00	0,00	175.545,24	547,34	0,31%	0,31%	0,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	72.889,47	4.740,09	77.721,46	0,00	91,90	0,12%	0,25%	0,01%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADE FI RENDA FIXA	19.364,98	75.020,55	51.586,01	42.890,03	90,51	0,10%	0,26%	0,01%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1.849.099,36	114.194,32	0,00	1.962.096,54	-1.197,14	-0,06%	-0,13%	7,65%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.351.940,72	0,00	0,00	1.332.287,67	-19.653,05	-1,45%	-1,45%	5,46%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	550.385,17	0,00	0,00	541.234,21	-9.150,96	-1,66%	-1,66%	5,67%
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA L...	707.977,79	0,00	0,00	695.575,99	-12.401,80	-1,75%	-1,75%	6,90%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.024.881,29	0,00	0,00	1.006.523,29	-18.358,00	-1,79%	-1,79%	6,78%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.487.076,34	0,00	0,00	1.460.351,71	-26.724,63	-1,80%	-1,80%	6,80%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	937.684,72	0,00	0,00	917.878,37	-19.806,35	-2,11%	-2,11%	9,00%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.211.791,59	0,00	0,00	1.125.728,54	-86.063,05	-7,10%	-7,10%	16,65%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>11.252.211,06</b>	<b>306.222,91</b>	<b>172.307,47</b>	<b>11.204.062,19</b>	<b>-182.064,31</b>	<b>-1,60%</b>		<b>6,69%</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
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	256.863,81	0,00	0,00	243.219,65	-13.644,16	-5,31%	-5,31%	9,55%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	991.019,55	0,00	0,00	907.316,32	-83.703,23	-8,45%	-8,45%	17,29%
BRADESCO SELECTION FIAÇÕES	375.728,14	0,00	0,00	257.231,55	-118.496,59	-31,54%	-31,54%	57,04%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIAÇÕES	527.604,76	0,00	0,00	360.499,68	-167.105,08	-31,67%	-31,67%	56,24%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	1.025.816,80	0,00	0,00	698.185,38	-327.631,42	-31,94%	-31,94%	51,35%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	333.787,49	0,00	0,00	225.491,32	-108.296,17	-32,44%	-32,44%	55,05%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	545.534,08	0,00	0,00	317.045,61	-228.488,47	-41,88%	-41,88%	66,66%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>4.056.354,63</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>3.008.989,51</b>	<b>-1.047.365,12</b>	<b>-25,82%</b>		<b>40,66%</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 (%)	(%) Insttit
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1.764.644,47	173.138,05	0,00	1.962.096,54	24.314,02	1,25%	1,31%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.021.632,06	0,00	0,00	1.035.728,54	14.096,48	1,38%	1,38%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	558.325,63	0,00	0,00	564.641,13	6.315,50	1,13%	1,13%
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	173.925,73	0,00	0,00	175.545,24	1.619,51	0,93%	0,93%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	140.460,79	0,00	0,00	141.964,17	1.503,38	1,07%	1,07%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	3.187,26	295.761,19	143.000,00	157.038,21	1.089,76	0,36%	1,33%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	43.973,47	0,00	0,00	44.578,55	605,08	1,38%	1,38%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADE FI RENDA FIXA	82.698,57	226.378,95	266.659,23	42.890,03	471,74	0,15%	0,80%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	131.146,76	131.447,15	0,00	300,39	0,23%	0,75%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.609.666,18	0,00	600.000,00	1.006.523,29	-3.142,89	-0,20%	-0,60%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	544.851,79	0,00	0,00	541.234,21	-3.617,58	-0,66%	-0,66%
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA L...	699.779,30	0,00	0,00	695.575,99	-4.203,31	-0,60%	-0,60%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.337.742,46	0,00	0,00	1.332.287,67	-5.454,79	-0,41%	-0,41%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.469.776,04	0,00	0,00	1.460.351,71	-9.424,33	-0,64%	-0,64%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	583.980,26	350.000,00	0,00	917.878,37	-16.101,89	-1,72%	-1,31%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.203.527,38	0,00	0,00	1.125.728,54	-77.798,84	-6,46%	-6,46%
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>-69.427,77</b>	<b>-0,62%</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
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	259.029,62	0,00	0,00	243.219,65	-15.809,97	-6,10%	-6,10%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	1.267.756,45	0,00	250.000,00	907.316,32	-110.440,13	-8,71%	-10,88%
ITAÚ DUNA MIS FIC AÇÕES	370.722,26	0,00	0,00	225.491,32	-145.230,94	-39,18%	-39,18%
BRADESCO SELECTION FIAÇÕES	733.431,13	0,00	300.000,00	257.231,55	-176.199,58	-24,02%	-39,89%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIAÇÕES	0,00	600.000,00	0,00	360.499,68	-239.500,32	-39,92%	-38,33%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	592.552,93	0,00	0,00	317.045,61	-275.507,32	-46,49%	-46,49%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	597.405,33	505.502,38	0,00	698.185,38	-404.722,33	-36,70%	-35,94%
			<b>Total Renda Variável</b>		<b>-1.367.410,59</b>	<b>-31,25%</b>	