

Relatório Analítico dos Investimentos

em abril de 2020

Carteira consolidada de investimentos - base (Abril / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
TÍTULOS PÚBLICOS			1.981.789.822,57	75,34%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	54.006.030,13	2,05%	743	0,48%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	16.817.469,97	0,64%	1.251	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BANRISUL FOCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+1	Não há	17.952.182,58	0,68%	333	1,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	30.044.657,43	1,14%	958	0,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	24.816.222,77	0,94%	1.370	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	D+1	Não há	380.719,07	0,01%	789	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	34.889.488,01	1,33%	883	0,52%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
MIRAE ASSET PRÉ FUNDO DE ÍNDICE RENDA FIXA - FIX...	D+2	Não há	12.962.941,92	0,49%	522	8,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	455.983,92	0,02%	677	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	8.565.223,58	0,33%	317	1,48%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	6.862.578,67	0,26%	746	0,42%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVV11	D+3	Não há	52.708.500,00	2,00%	11.738	0,83%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVA11	D+3	Não há	81.763.500,00	3,11%	101.466	0,68%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '
ISHARES BM&FBOVESPA SMALL CAP FUNDO DE ÍNDICE - ...	D+3	Não há	39.425.850,80	1,50%	38.546	2,80%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	54.973.984,93	2,09%	2.563	8,77%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB VALE FI AÇÕES	D+4	Não há	16.712.375,17	0,64%	32.614	2,65%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	13.815.917,65	0,53%	33.869	1,64%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	20.917.023,87	0,80%	475	6,69%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES	D+3 du	Não há	16.347.982,14	0,62%	20.855	4,57%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '

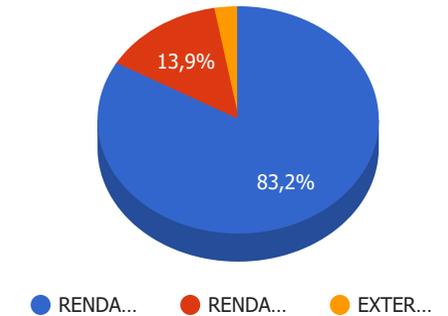
Carteira consolidada de investimentos - base (Abril / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	13.376.539,57	0,51%	9.427	3,62%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC ...	D+34	Não há	13.863.234,79	0,53%	277	10,93%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
IT NOW IDIV FUNDO DE ÍNDICE - DIVO11	D+3	Não há	25.247.903,00	0,96%	9.642	10,98%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MUL...	D+2	01/10/2020	11.710.777,10	0,45%	956	2,31%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	D+4	Não há	74.246.373,84	2,82%	94	6,91%	Artigo 9º - A, Inciso III
AUSTRO INSTITUCIONAL PIPE BANCOS FIC AÇÕES	D+31	0	5.721.045,77	0,22%	22	12,49%	Desenquadrado - RV
Total para cálculo dos limites da Resolução			2.630.374.329,25				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	1.981.789.822,57	75,34%	0,00%	70,00%	100,00%	648.584.506,68
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	178.906.769,96	6,80%	0,00%	2,00%	100,00%	2.451.467.559,29
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	12.962.941,92	0,49%	0,00%	0,00%	100,00%	2.617.411.387,33
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	0,00%	0,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	60,00%	1.578.224.597,55
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	1.578.224.597,55
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	15.883.786,17	0,60%	0,00%	1,00%	40,00%	1.036.265.945,53
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	1.052.149.731,70
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	526.074.865,85
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	394.556.149,39
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	394.556.149,39
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	131.518.716,46
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	131.518.716,46
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	131.518.716,46
Total Renda Fixa	100,00%	2.189.543.320,62	83,24%	0,00%	78,00%	565,00%	

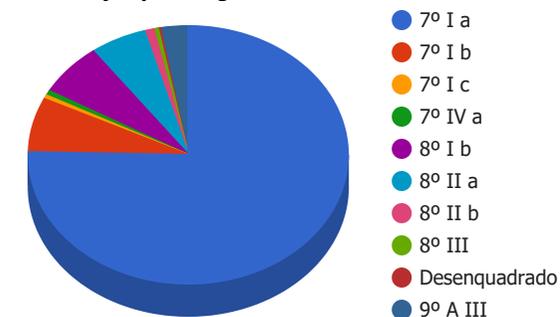
Distribuição por Segmento



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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	30,00%	789.112.298,78
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	173.897.850,80	6,61%	0,00%	6,00%	30,00%	615.214.447,98
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	150.007.058,12	5,70%	0,00%	6,00%	20,00%	376.067.807,73
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	25.247.903,00	0,96%	0,00%	2,00%	20,00%	500.826.962,85
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	11.710.777,10	0,45%	0,00%	2,00%	10,00%	251.326.655,83
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	131.518.716,46
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	131.518.716,46
Desenquadrado - RV	0,00%	5.721.045,77	0,22%	0,00%	0,00%	0,00%	-5.721.045,77
Total Renda Variável	30,00%	366.584.634,79	13,94%	0,00%	21,00%	120,00%	

Distribuição por Artigos



Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2020			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	74.246.373,84	2,82%	0,00%	1,00%	10,00%	188.791.059,09
Total Exterior	10,00%	74.246.373,84	2,82%	0,00%	1,00%	10,00%	

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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	1.981.789.822,57	75,34	-
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	272.195.793,27	10,35	0,05
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	126.362.835,48	4,80	0,01
BLACKROCK INVESTIMENTOS	121.189.350,80	4,61	0,77
ITAU UNIBANCO	77.956.403,00	2,96	0,01
BANRISUL CORRETORA	18.332.901,65	0,70	0,16
BANESTES DTVM	13.863.234,79	0,53	0,24
MIRAE ASSET	12.962.941,92	0,49	2,37
AUSTRO CAPITAL	5.721.045,77	0,22	1,20

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 '	1.981.789.822,57	75,34	0,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	178.906.769,96	6,80	0,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	12.962.941,92	0,49	0,00	100,00
Artigo 7º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	15.883.786,17	0,60	0,00	40,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	30,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	173.897.850,80	6,61	0,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	150.007.058,12	5,70	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	25.247.903,00	0,96	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	11.710.777,10	0,45	0,00	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
Artigo 9º - A, Inciso III	74.246.373,84	2,82	0,00	10,00

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
S&P/BM&F Índice de Futuros DI 3 anos ER (Benchmark)	-2,56%	-22,40%	-18,83%	-22,98%	-15,90%	-17,33%	-	-
MIRAE ASSET PRÉ FUNDO DE ÍNDICE RENDA FIXA - FIXA11	1,65%	4,27%	3,01%	4,11%	15,14%	-	0,07%	0,04%

IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,57%	0,57%	0,03%	1,79%	8,62%	18,84%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,32%	-0,34%	-0,72%	1,02%	6,95%	16,67%	0,03%	0,03%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,43%	0,02%	-0,44%	1,13%	7,34%	17,02%	0,03%	0,03%
BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	0,50%	0,19%	-0,34%	1,18%	7,58%	17,19%	0,03%	0,03%

IRF-M 1 (Benchmark)	0,45%	1,88%	1,44%	2,65%	6,60%	13,72%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,41%	1,79%	1,37%	2,51%	6,31%	13,19%	0,00%	0,00%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,43%	1,82%	1,39%	2,55%	6,39%	13,32%	0,00%	0,00%
BANRISUL FOCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,42%	1,81%	1,38%	2,54%	6,37%	13,24%	0,01%	0,00%

CDI (Benchmark)	0,28%	1,30%	0,92%	2,07%	5,19%	11,87%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00%	0,79%	0,42%	1,46%	4,46%	10,92%	0,00%	0,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,20%	0,95%	0,67%	1,54%	4,07%	9,49%	0,00%	0,00%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,22%	1,02%	0,72%	1,65%	4,31%	10,01%	0,00%	0,00%

IPCA (Benchmark)	-0,31%	0,22%	0,01%	1,89%	2,40%	7,46%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1,11%	2,43%	1,60%	2,52%	13,47%	24,61%	0,05%	0,04%

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

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

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDIV (Benchmark)	3,76%	-28,65%	-27,50%	-19,68%	-7,18%	10,38%	-	-
IT NOW IDIV FUNDO DE ÍNDICE - DIVO11	3,86%	-28,67%	-27,53%	-19,71%	-7,42%	10,13%	0,20%	0,31%
Ibovespa (Benchmark)	10,25%	-30,39%	-29,23%	-24,92%	-16,45%	-6,51%	-	-
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVA11	10,23%	-30,39%	-29,22%	-24,88%	-16,50%	-6,75%	0,23%	0,35%
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES	16,56%	-13,98%	-17,97%	3,05%	23,66%	38,05%	0,20%	0,37%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	10,49%	-29,74%	-30,52%	-20,71%	-4,10%	12,34%	0,24%	0,38%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	9,48%	-32,48%	-31,54%	-26,34%	-18,11%	-8,19%	0,21%	0,37%
BB VALE FI AÇÕES	3,56%	-17,44%	-12,42%	-4,67%	-11,18%	-8,07%	0,21%	0,23%
AUSTRO INSTITUCIONAL PIPE BANCOS FIC AÇÕES	-8,17%	-37,16%	-34,96%	-36,97%	-37,62%	-20,80%	0,17%	0,28%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	0,25%	1,41%	1,09%	2,61%	7,30%	-	0,00%	0,01%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	12,64%	-27,85%	-30,07%	-19,61%	-	-	0,24%	-
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVV11	10,25%	-30,38%	-29,22%	-24,85%	-16,42%	-6,29%	0,23%	0,35%
SMLL (Benchmark)	10,19%	-34,07%	-34,37%	-21,91%	-4,59%	5,90%	-	-
ISHARES BM&FBOVESPA SMALL CAP FUNDO DE ÍNDICE - SMAL11	10,09%	-34,04%	-34,30%	-21,98%	-5,03%	5,11%	0,24%	0,43%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	16,41%	-24,59%	-26,09%	-18,98%	-3,08%	16,50%	0,25%	0,40%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	8,83%	-28,58%	-29,34%	-18,63%	-4,61%	11,58%	0,18%	0,36%

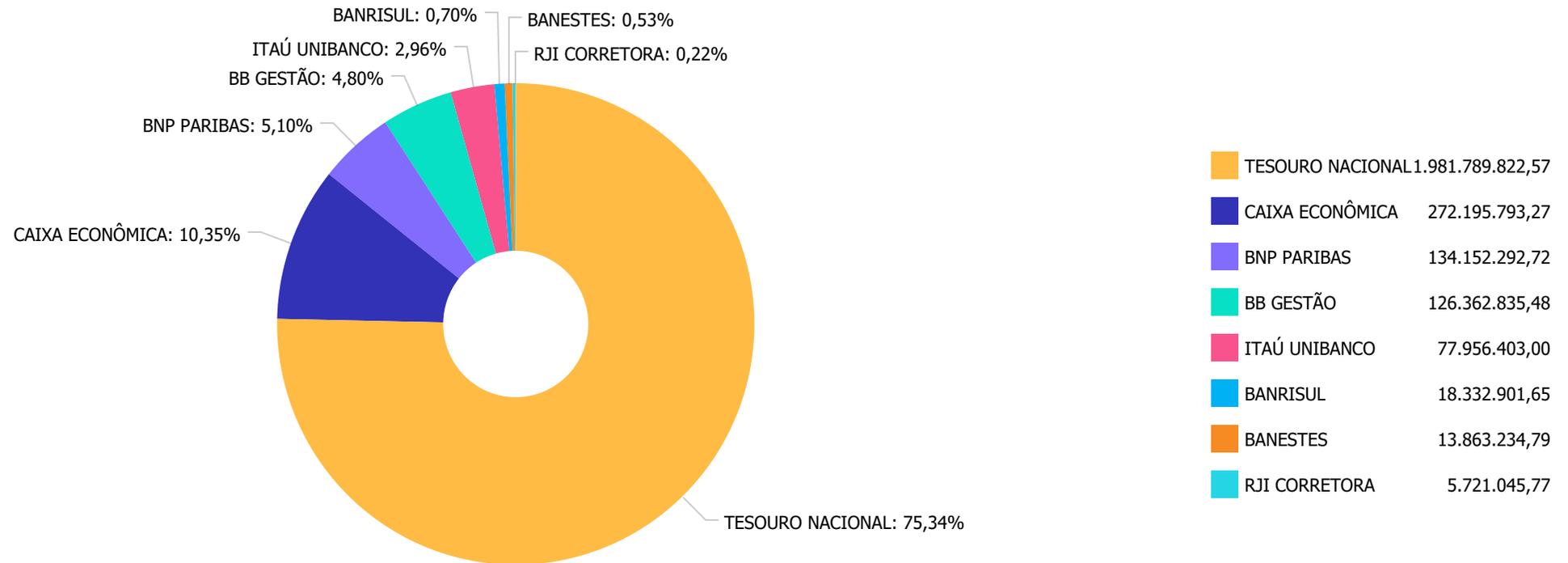
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Abril/2020 - RENDA VARIÁVEL

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

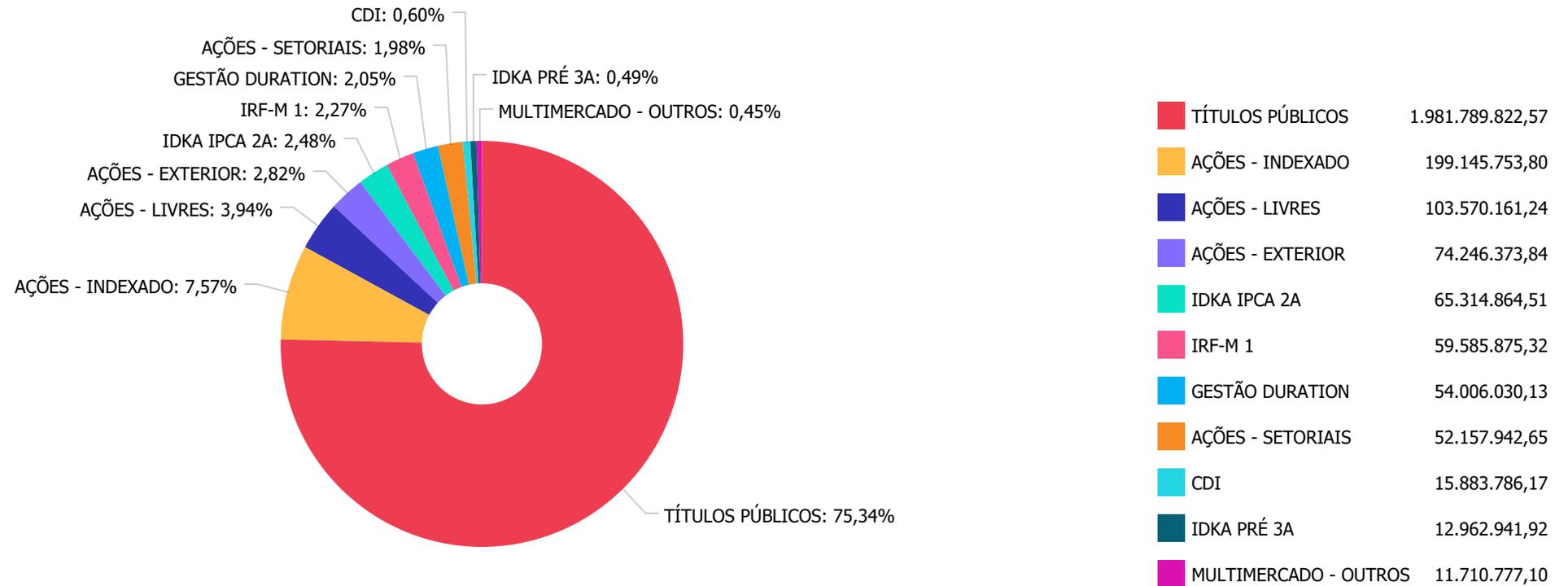
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Abril/2020 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	16,32%	23,16%	15,68%	32,24%	39,49%	79,08%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	15,96%	23,85%	16,27%	32,52%	39,65%	76,46%	0,17%	0,22%

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



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



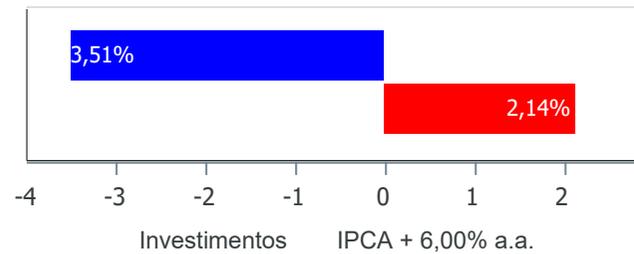
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Abril / 2020)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
LTN - Letra do Tesouro Nacional	01/01/2022	21/03/2018	80.000	727,418914	941,714758	58.193.513,12	75.337.180,64	Mercado
LTN - Letra do Tesouro Nacional	01/01/2022	09/04/2018	200.000	732,978346	941,714758	146.595.669,20	188.342.951,60	Mercado
LTN - Letra do Tesouro Nacional	01/04/2022	07/02/2020	160.000	898,51867100	928,181583	143.762.987,36	148.509.053,28	Mercado
LTN - Letra do Tesouro Nacional	01/07/2022	26/06/2019	120.000	825,383252	914,012162	99.045.990,24	109.681.459,44	Mercado
LTN - Letra do Tesouro Nacional	01/07/2023	14/06/2019	190.000	753,636224	846,250038	143.190.882,56	160.787.507,22	Mercado
LTN - Letra do Tesouro Nacional	01/01/2024	03/01/2020	200.000	787,45838900	811,682048	157.491.677,80	162.336.409,60	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2028	06/06/2019	20.000	3.820,891426	3.904,711533	76.417.828,52	78.094.230,66	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2028	06/06/2019	30.000	3.820,891426	3.904,711533	114.626.742,78	117.141.345,99	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2028	06/06/2019	20.000	3.820,891426	3.904,711533	76.417.828,52	78.094.230,66	Mercado
NTN-F - Nota do Tesouro Nacional - Série F	01/01/2023	17/10/2017	50.000	1.051,661907	1.155,548839	52.583.095,35	57.777.441,95	Mercado
NTN-F - Nota do Tesouro Nacional - Série F	01/01/2023	13/10/2017	50.000	1.052,640809	1.155,548839	52.632.040,45	57.777.441,95	Mercado
NTN-F - Nota do Tesouro Nacional - Série F	01/01/2023	10/10/2017	25.000	1.050,747229	1.155,548839	26.268.680,73	28.888.720,98	Mercado
NTN-F - Nota do Tesouro Nacional - Série F	01/01/2025	14/11/2018	50.000	1.037,699013	1.174,224265	51.884.950,65	58.711.213,25	Mercado
NTN-F - Nota do Tesouro Nacional - Série F	01/01/2025	14/11/2018	140.000	1.038,996258	1.174,224265	145.459.476,12	164.391.397,10	Mercado
NTN-F - Nota do Tesouro Nacional - Série F	01/01/2025	13/10/2017	60.000	1.049,132984	1.174,224265	62.947.979,04	70.453.455,90	Mercado
NTN-F - Nota do Tesouro Nacional - Série F	01/01/2027	20/05/2019	100.000	1.092,532528	1.177,697376	109.253.252,80	117.769.737,60	Mercado
NTN-F - Nota do Tesouro Nacional - Série F	01/01/2029	25/05/2019	50.000	1.094,981011	1.183,446326	54.749.050,55	59.172.316,30	Mercado
NTN-F - Nota do Tesouro Nacional - Série F	01/01/2029	01/08/2019	60.000	1.192,017651	1.183,446326	71.521.059,06	71.006.779,56	Mercado
NTN-F - Nota do Tesouro Nacional - Série F	01/01/2029	12/11/2019	10.000	1.254,155389	1.183,446326	12.541.553,89	11.834.463,26	Mercado
NTN-F - Nota do Tesouro Nacional - Série F	01/01/2029	08/11/2019	140.000	1.257,994167	1.183,446326	176.119.183,38	165.682.485,64	Mercado

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	2.632.923.382,27	697.509.577,57	691.667.390,65	2.658.338.535,94	19.572.966,75	19.572.966,75	0,74%	0,74%	0,72%	0,72%	102,87%	5,63%
Fevereiro	2.658.338.535,94	439.877.375,00	413.872.045,09	2.655.747.844,38	-28.596.021,47	-9.023.054,72	-1,07%	-0,33%	0,67%	1,39%	-23,78%	10,80%
Março	2.655.747.844,38	119.956.504,87	102.310.509,49	2.518.534.593,44	-154.859.246,32	-163.882.301,04	-5,79%	-6,10%	0,58%	1,98%	-307,95%	36,14%
Abril	2.518.534.593,44	48.557.850,91	21.394.435,51	2.616.000.808,08	70.302.799,24	-93.579.501,80	2,76%	-3,51%	0,15%	2,14%	-164,29%	15,06%

Investimentos x Meta Atuarial



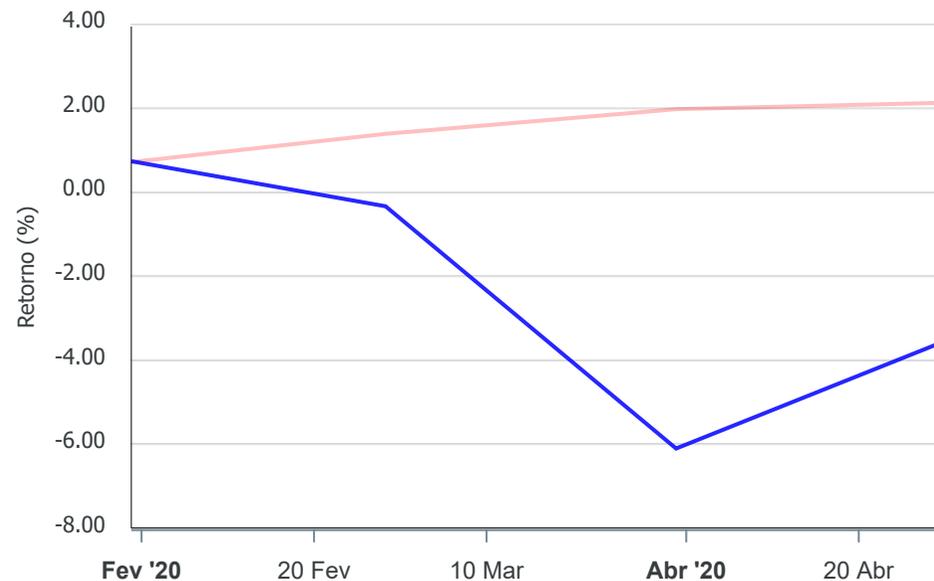
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Abril/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
MIRAE ASSET PRÉ FUNDO DE ÍNDICE RENDA FIXA - FIXA1...	12.752.894,25	0,00	0,00	12.962.941,92	210.047,67	1,65%	1,65%	6,53%
TÍTULOS PÚBLICOS	1.953.808.470,55	0,00	0,00	1.981.789.822,57	27.981.352,02	1,43%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	53.412.463,42	0,00	0,00	54.006.030,13	593.566,71	1,11%	1,11%	4,96%
BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	378.843,03	0,00	0,00	380.719,07	1.876,04	0,50%	0,50%	2,88%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	29.917.266,32	0,00	0,00	30.044.657,43	127.391,11	0,43%	0,43%	2,75%
BANRISUL FOCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	17.877.446,16	0,00	0,00	17.952.182,58	74.736,42	0,42%	0,42%	0,51%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	34.776.913,89	0,00	0,00	34.889.488,01	112.574,12	0,32%	0,32%	2,68%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	0,00	16.766.212,00	0,00	16.817.469,97	51.257,97	0,31%	0,41%	0,49%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	0,00	24.743.356,93	0,00	24.816.222,77	72.865,84	0,29%	0,43%	0,49%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	7.077.895,77	5.518.437,75	4.047.294,53	8.565.223,58	16.184,59	0,13%	0,22%	0,00%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.790.753,95	11.833.259,16	18.779.005,83	6.862.578,67	17.571,39	0,07%	0,20%	0,01%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	455.968,06	0,00	0,00	455.983,92	15,86	0,00%	0,00%	0,45%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	7.792.293,70	0,00	7.791.352,33	0,00	-941,37	-0,01%	0,26%	0,12%
Total Renda Fixa	2.132.041.209,10	58.861.265,84	30.617.652,69	2.189.543.320,62	29.258.498,37	1,35%		2,69%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES	14.024.939,25	0,00	0,00	16.347.982,14	2.323.042,89	16,56%	16,56%	20,20%
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇ...	11.909.160,30	0,00	0,00	13.863.234,79	1.954.074,49	16,41%	16,41%	25,34%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	48.805.587,90	0,00	0,00	54.973.984,93	6.168.397,03	12,64%	12,64%	24,36%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	12.106.124,72	0,00	0,00	13.376.539,57	1.270.414,85	10,49%	10,49%	23,51%
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVV11	47.833.500,00	0,00	0,00	52.708.500,00	4.875.000,00	10,19%	10,25%	22,79%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	19.105.338,09	0,00	0,00	20.917.023,87	1.811.685,78	9,48%	9,48%	21,11%
ISHARES BM&FBOVESPA SMALL CAP FUNDO DE ÍNDICE - SM...	36.022.117,60	0,00	0,00	39.425.850,80	3.403.733,20	9,45%	10,09%	23,67%
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVA11	74.823.000,00	0,00	0,00	81.763.500,00	6.940.500,00	9,28%	10,23%	22,79%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	12.695.103,16	0,00	0,00	13.815.917,65	1.120.814,49	8,83%	8,83%	18,12%
IT NOW IDIV FUNDO DE ÍNDICE - DIVO11	24.347.276,40	0,00	0,00	25.247.903,00	900.626,60	3,70%	3,86%	19,77%
BB VALE FI AÇÕES	16.137.130,45	0,00	0,00	16.712.375,17	575.244,72	3,56%	3,56%	21,14%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTI...	11.681.707,92	0,00	0,00	11.710.777,10	29.069,18	0,25%	0,25%	0,38%
AUSTRO INSTITUCIONAL PIPE BANCOS FIC AÇÕES	6.229.917,77	0,00	0,00	5.721.045,77	-508.872,00	-8,17%	-8,17%	17,18%
Total Renda Variável	335.720.903,56	0,00	0,00	366.584.634,79	30.863.731,23	9,19%		21,77%

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

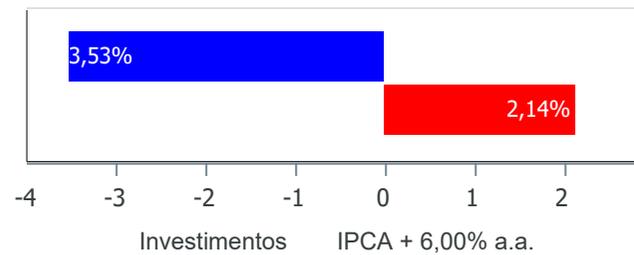
FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	64.024.921,97	0,00	0,00	74.246.373,84	10.221.451,87	15,96%	15,96%	16,55%
Total Renda Variável	64.024.921,97	0,00	0,00	74.246.373,84	10.221.451,87	15,96%		16,55%

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	2.613.148.416,16	693.886.550,38	678.067.286,86	2.648.507.119,14	19.539.439,46	19.539.439,46	0,74%	0,74%	0,72%	0,72%	103,07%	5,79%
Fevereiro	2.648.507.119,14	433.429.794,92	410.102.357,43	2.643.210.831,75	-28.623.724,88	-9.084.285,42	-1,07%	-0,34%	0,67%	1,39%	-24,11%	11,21%
Março	2.643.210.831,75	113.058.545,97	97.319.261,32	2.504.079.437,53	-154.870.678,87	-163.954.964,29	-5,82%	-6,14%	0,58%	1,98%	-309,77%	37,95%
Abril	2.504.079.437,53	25.931.227,92	1.360.955,34	2.598.911.970,47	70.262.260,36	-93.692.703,93	2,78%	-3,53%	0,15%	2,14%	-165,28%	15,82%

Investimentos x Meta Atuarial



Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



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

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 Abril/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
MIRAE ASSET PRÉ FUNDO DE ÍNDICE RENDA FIXA - FIXA1...	12.752.894,25	0,00	0,00	12.962.941,92	210.047,67	1,65%	1,65%	6,53%
TÍTULOS PÚBLICOS	1.953.808.470,55	0,00	0,00	1.981.789.822,57	27.981.352,02	1,43%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	53.412.463,42	0,00	0,00	54.006.030,13	593.566,71	1,11%	1,11%	4,96%
BANRISUL FOCO IDKA IPCA 2A FI RENDA FIXA	378.843,03	0,00	0,00	380.719,07	1.876,04	0,50%	0,50%	2,88%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	29.917.266,32	0,00	0,00	30.044.657,43	127.391,11	0,43%	0,43%	2,75%
BANRISUL FOCO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	17.877.446,16	0,00	0,00	17.952.182,58	74.736,42	0,42%	0,42%	0,51%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	34.776.913,89	0,00	0,00	34.889.488,01	112.574,12	0,32%	0,32%	2,68%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	0,00	24.743.356,93	0,00	24.816.222,77	72.865,84	0,29%	0,43%	0,49%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	519.204,99	428.443,41	436.453,25	512.408,62	1.213,47	0,13%	0,22%	0,00%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	434.141,33	759.427,58	924.502,09	270.504,82	1.438,00	0,12%	0,20%	0,01%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	455.968,06	0,00	0,00	455.983,92	15,86	0,00%	0,00%	0,45%
Total Renda Fixa	2.104.333.612,00	25.931.227,92	1.360.955,34	2.158.080.961,84	29.177.077,26	1,37%		3,13%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES	14.024.939,25	0,00	0,00	16.347.982,14	2.323.042,89	16,56%	16,56%	20,20%
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇ...	11.909.160,30	0,00	0,00	13.863.234,79	1.954.074,49	16,41%	16,41%	25,34%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	48.805.587,90	0,00	0,00	54.973.984,93	6.168.397,03	12,64%	12,64%	24,36%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	12.106.124,72	0,00	0,00	13.376.539,57	1.270.414,85	10,49%	10,49%	23,51%
IT NOW IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVV11	47.833.500,00	0,00	0,00	52.708.500,00	4.875.000,00	10,19%	10,25%	22,79%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	19.105.338,09	0,00	0,00	20.917.023,87	1.811.685,78	9,48%	9,48%	21,11%
ISHARES BM&FBOVESPA SMALL CAP FUNDO DE ÍNDICE - SM...	36.022.117,60	0,00	0,00	39.425.850,80	3.403.733,20	9,45%	10,09%	23,67%
ISHARES IBOVESPA FUNDO DE ÍNDICE - BOVA11	74.823.000,00	0,00	0,00	81.763.500,00	6.940.500,00	9,28%	10,23%	22,79%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	12.695.103,16	0,00	0,00	13.815.917,65	1.120.814,49	8,83%	8,83%	18,12%
IT NOW IDIV FUNDO DE ÍNDICE - DIVO11	24.347.276,40	0,00	0,00	25.247.903,00	900.626,60	3,70%	3,86%	19,77%
BB VALE FI AÇÕES	16.137.130,45	0,00	0,00	16.712.375,17	575.244,72	3,56%	3,56%	21,14%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTI...	11.681.707,92	0,00	0,00	11.710.777,10	29.069,18	0,25%	0,25%	0,38%
AUSTRO INSTITUCIONAL PIPE BANCOS FIC AÇÕES	6.229.917,77	0,00	0,00	5.721.045,77	-508.872,00	-8,17%	-8,17%	17,18%
Total Renda Variável	335.720.903,56	0,00	0,00	366.584.634,79	30.863.731,23	9,19%		21,77%

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	64.024.921,97	0,00	0,00	74.246.373,84	10.221.451,87	15,96%	15,96%	16,55%
Total Renda Variável	64.024.921,97	0,00	0,00	74.246.373,84	10.221.451,87	15,96%		16,55%