



Relatório Analítico dos Investimentos

em abril de 2020

Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

CRÉDITO E MERCADO
Engenharia Financeira

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			85.026.799,54	15,58%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	46.000.707,75	8,43%	595	0,44%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	59.639.756,28	10,93%	427	0,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	49.162.127,02	9,01%	743	0,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	59.286.557,87	10,86%	670	1,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	57.529.382,08	10,54%	958	0,70%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	57.837.428,61	10,60%	1.251	0,81%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRA1 FI RENDA FIXA	D+1445	Não há	723.116,57	0,13%	16	4,17%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	D+1009	Não há	3.661.107,48	0,67%	28	5,28%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1800	Não há	1.291.680,07	0,24%	11	0,95%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	46.431.045,21	8,51%	284	0,91%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se ...	Não se aplica	1.839.413,92	0,34%	98	2,17%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 4	Não se ...	Não se aplica	0,01	0,00%		0,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	Não se ...	Não se aplica	0,01	0,00%		0,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 3	Não se ...	Não se aplica	0,01	0,00%		0,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	1.881.927,53	0,34%	70	2,53%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	14.976.942,01	2,74%	12.868	2,14%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	20.078.270,60	3,68%	51.174	0,70%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	12.744.055,96	2,34%	1.799	5,42%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	16.761.423,37	3,07%	6.889	1,65%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '

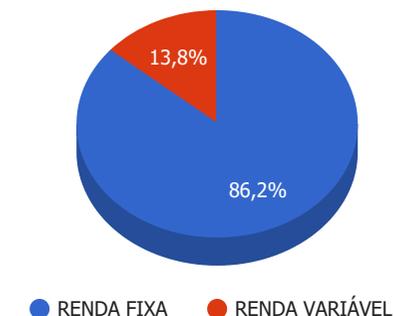
Carteira consolidada de investimentos - base (Abril / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+1	Não há	237.516,43	0,04%	12	14,12%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	1.378.207,35	0,25%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRASIL ÓLEO & GÁS MULTISTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	394,23	0,00%	15	0,40%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
ÁTICO FLORESTAL BRASIL FICFIP	Não se ...	Não se aplica	1.551.612,03	0,28%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRCR11	S/Info	Não se aplica	299.800,56	0,05%		0,02%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se ...	Não se aplica	2.032.336,32	0,37%		5,73%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
RIO BRAVO RENDA VAREJO FII - RBVA11	Não se ...	Não se aplica	2.428.000,00	0,44%		0,49%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	S/Info	Não se aplica	2.955.572,62	0,54%		6,26%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
Total para cálculo dos limites da Resolução			545.755.181,44				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			586.279,83				Artigo 6º
PL Total			546.341.461,27				

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%	85.026.799,54	15,58%	5,00%	15,00%	100,00%	460.728.381,90
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	329.455.959,61	60,37%	10,00%	52,50%	100,00%	216.299.221,83
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	27.287.759,07
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	27.287.759,07
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	109.151.036,29
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	109.151.036,29
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	52.106.949,33	9,55%	0,00%	10,00%	40,00%	166.195.123,25
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	27.287.759,07
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	3.721.341,48	0,68%	0,00%	0,50%	3,00%	12.651.313,96
Total Renda Fixa	100,00%	470.311.049,96	86,18%	15,00%	78,00%	298,00%	

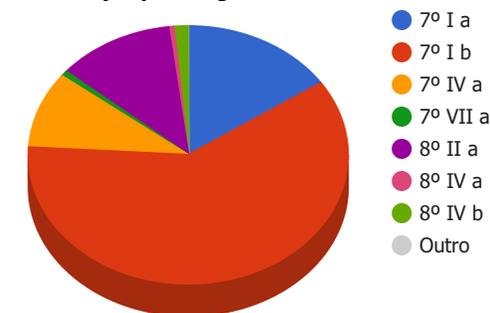
Distribuição por Segmento



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%	0,50%	10,00%	54.575.518,14
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	25,00%	136.438.795,36
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	64.560.691,94	11,83%	0,00%	14,00%	20,00%	44.590.344,35
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	27.287.759,07
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	237.516,43	0,04%	0,00%	0,50%	3,00%	16.135.139,01
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	2.930.213,61	0,54%	0,00%	1,00%	5,00%	24.357.545,46
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	7.715.709,50	1,41%	0,00%	1,00%	5,00%	19.572.049,57
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	27.287.759,07
Total Renda Variável	30,00%	75.444.131,48	13,82%	0,00%	22,00%	78,00%	

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%	5,00%	27.287.759,07
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	27.287.759,07
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	27.287.759,07
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	

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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	166.331.265,38	30,48	0,03
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	163.124.694,23	29,89	0,01
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	85.026.799,54	15,58	-
ITAÚ UNIBANCO	66.509.315,81	12,19	0,00
AZ QUEST INVESTIMENTOS	31.738.365,38	5,82	0,12
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	12.744.055,96	2,34	0,03
GRAPHEN INVESTIMENTOS LTDA	5.780.551,44	1,06	2,50
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	3.678.689,19	0,67	-
ÁTICO ASSET MANAGEMENT	2.929.819,38	0,54	7,03
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	2.428.000,00	0,44	0,46
REDITUS INVESTIMENTOS	2.032.336,32	0,37	-
PETRA CAPITAL	1.839.413,92	0,34	0,03
VERITAS CAPITAL MANAGEMENT	1.291.680,07	0,24	0,07
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	299.800,56	0,05	0,00
VALORA INVESTIMENTOS	394,23	0,00	0,00
BRASIL PLURAL	0,03	0,00	0,00

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 '	85.026.799,54	15,58	50,00	90,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	329.455.959,61	60,37	20,00	50,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	52.106.949,33	9,55	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	5,00	10,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	64.560.691,94	11,83	10,00	20,00

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)

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
IMA Geral ex-C (Benchmark)	0,84%	-0,17%	-0,67%	0,03%	8,34%	19,04%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,91%	-0,28%	-0,76%	-0,26%	8,60%	19,45%	0,05%	0,04%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,57%	0,57%	0,03%	1,79%	8,62%	18,84%	-	-
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%
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	0,23%	2,45%	1,63%	5,31%	9,60%	23,00%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-0,26%	-2,32%	-2,22%	-2,92%	-2,84%	1.177,36%	0,01%	0,02%
120% do CDI (Benchmark)	0,34%	1,56%	1,10%	2,48%	6,26%	14,40%	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	-	-	-	-	-	-	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 3	-	-	-	-	-	-	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 4	-	-	-	-	-	-	-	-
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%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,49%	-0,09%	-0,64%	0,86%	8,67%	19,47%	-	-
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,11%	2,43%	2,38%	1,74%	-21,80%	-16,95%	0,05%	0,18%

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
IMA-B (Benchmark)	1,31%	-5,08%	-5,33%	-5,55%	8,94%	25,91%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,30%	-5,12%	-5,36%	-5,65%	8,71%	25,32%	0,09%	0,11%
BRA1 FI RENDA FIXA	-5,88%	-25,60%	-25,25%	-47,98%	-70,38%	-69,69%	0,10%	0,53%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	0,34%	-4,47%	-4,70%	-4,98%	2,31%	-17,09%	0,05%	0,06%
IRF-M (Benchmark)	1,15%	2,59%	1,70%	2,75%	11,69%	22,07%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,13%	2,50%	1,65%	2,62%	11,40%	21,56%	0,05%	0,03%
IPCA (Benchmark)	-0,31%	0,22%	0,01%	1,89%	2,40%	7,46%	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,18%	-1,15%	-0,61%	-1,51%	-8,43%	-13,35%	0,00%	0,06%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,14%	1,28%	0,93%	1,98%	9,19%	18,37%	0,03%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1,11%	2,43%	1,60%	2,52%	13,47%	24,61%	0,05%	0,04%

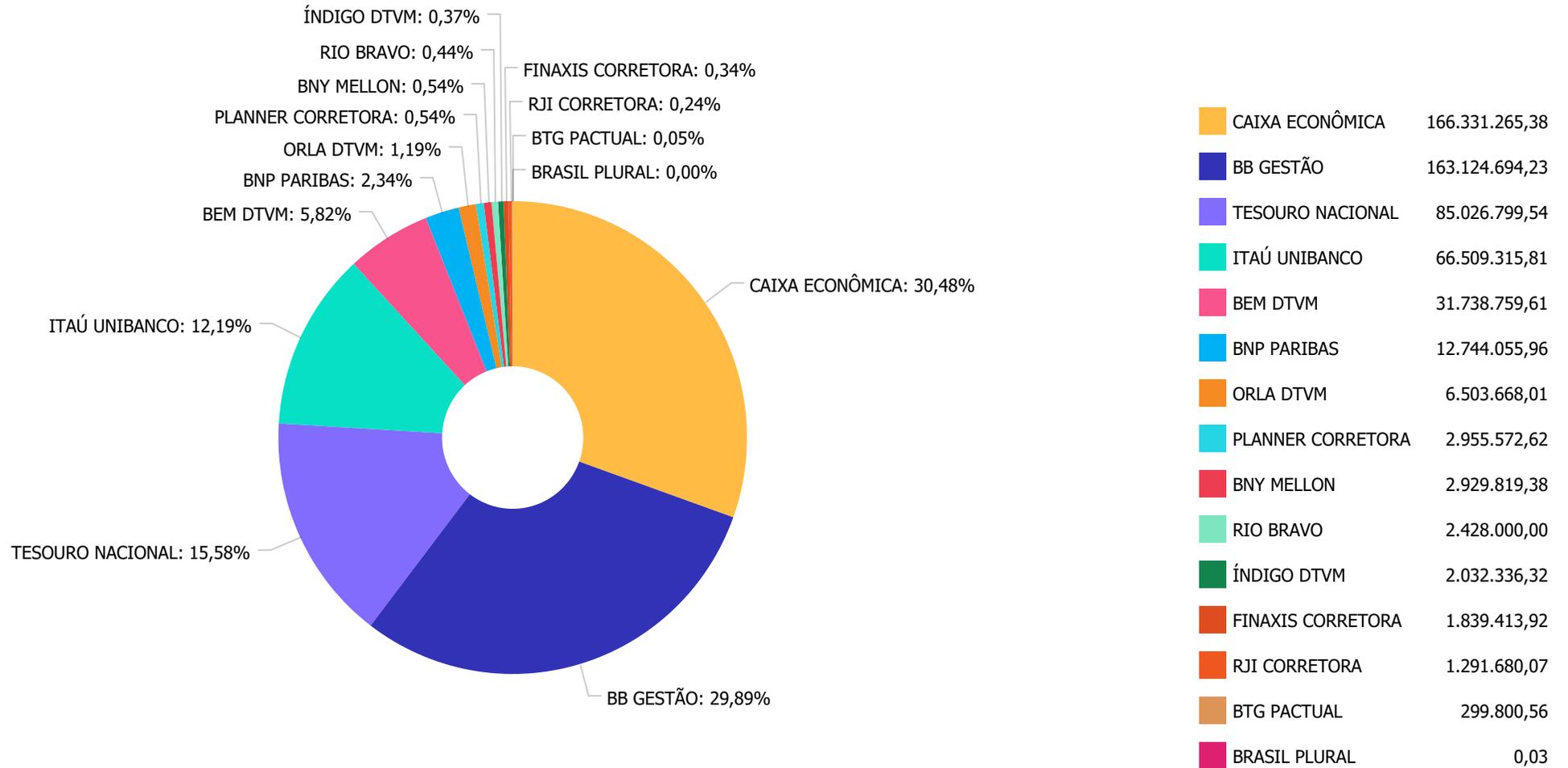
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Abril/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	0,48%	3,53%	2,42%	6,98%	13,20%	31,16%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	-	-
IPCA + 11,00% ao ano (Benchmark)	0,52%	3,68%	2,53%	7,21%	13,71%	32,34%	-	-
BRASIL ÓLEO & GÁS MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-59,22%	-94,46%	11.768.261,06%	0,43%	0,84%
Ibovespa (Benchmark)	10,25%	-30,39%	-29,23%	-24,92%	-16,45%	-6,51%	-	-
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	11,36%	-31,54%	-34,06%	-26,84%	-16,84%	-7,32%	0,23%	0,41%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	10,92%	-28,05%	-27,50%	-22,83%	-12,03%	2,31%	0,22%	0,36%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	11,03%	-32,47%	-32,34%	-25,59%	-9,53%	3,07%	0,26%	0,39%
SMLL (Benchmark)	10,19%	-34,07%	-34,37%	-21,91%	-4,59%	5,90%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	11,39%	-30,61%	-34,95%	-19,91%	-0,36%	13,81%	0,25%	0,46%
CDI (Benchmark)	0,28%	1,30%	0,92%	2,07%	5,19%	11,87%	-	-
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-0,33%	7,08%	-0,69%	5,23%	3,34%	-94,58%	0,00%	0,09%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRGR11	3,99%	-21,53%	-19,66%	-0,13%	-0,47%	-11,02%	0,08%	0,30%
ÁQUILLA FII - AQLL11	0,00%	0,28%	0,00%	-7,43%	-13,01%	-31,88%	0,00%	0,25%

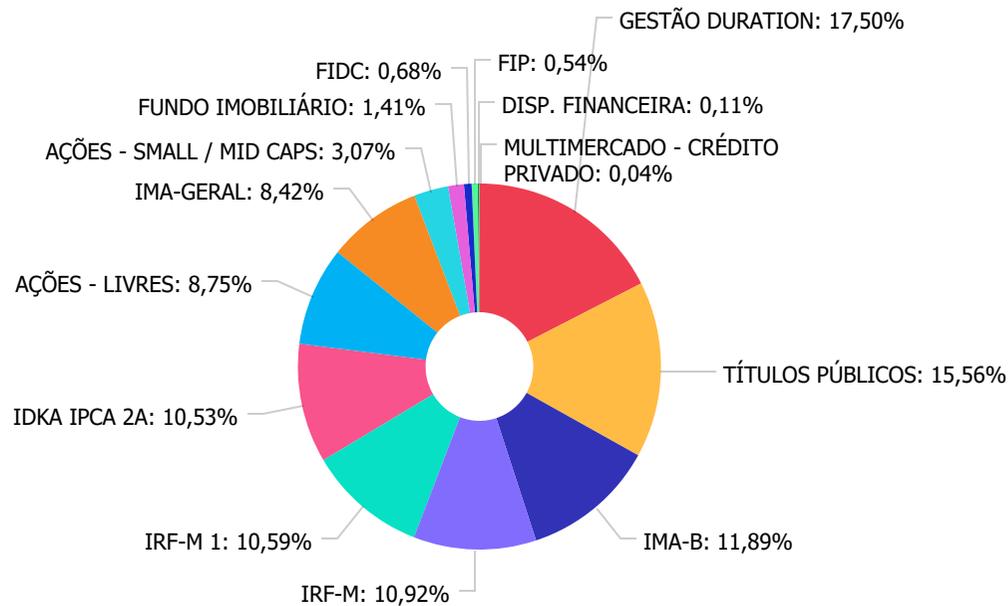
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Abril/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	0,00%	-17,96%	-19,02%	-33,88%	69,02%	69,02%	-	-
ÁTICO FLORESTAL BRASIL FICFIP	-	-	-	-	-	-	-	-
RIO BRAVO RENDA VAREJO FII - RBVA11	-3,02%	-28,17%	-19,61%	-13,72%	-90,17%	-90,21%	0,08%	0,30%

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



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



GESTÃO DURATION	95.593.172,23
TÍTULOS PÚBLICOS	85.026.799,54
IMA-B	64.962.461,99
IRF-M	59.639.756,28
IRF-M 1	57.837.428,61
IDKA IPCA 2A	57.529.382,08
AÇÕES - LIVRES	47.799.268,57
IMA-GERAL	46.000.707,75
AÇÕES - SMALL / MID CAPS	16.761.423,37
FUNDO IMOBILIÁRIO	7.715.709,50
FIDC	3.721.341,48
FIP	2.930.213,61
DISP. FINANCEIRA	586.279,83
MULTIMERCADO - CRÉDITO PRIVADO	237.516,43

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

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	08/10/2004	750	1.322,840000	3.760,880021	992.130,00	2.820.660,02	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	22/09/2004	760	1.314,210000	3.760,880021	998.799,60	2.858.268,82	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	02/09/2004	770	1.299,461390	3.760,880021	1.000.585,27	2.895.877,62	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	22/07/2004	850	1.322,487235	3.760,880021	1.124.114,15	3.196.748,02	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	06/04/2004	750	1.342,192893	3.760,880021	1.006.644,67	2.820.660,02	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	17/03/2004	750	1.333,000000	3.760,880021	999.750,00	2.820.660,02	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	14/12/2004	1.100	1.352,073136	3.760,880021	1.487.280,45	4.136.968,02	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	04/01/2005	630	1.364,164873	3.760,880021	859.423,87	2.369.354,41	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	04/01/2005	100	1.364,164800	3.760,880021	136.416,48	376.088,00	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	07/01/2005	730	1.366,595342	3.760,880021	997.614,60	2.745.442,42	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	20/01/2004	1.100	1.345,077073	3.760,880021	1.479.584,78	4.136.968,02	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	18/11/2003	880	1.247,941000	3.760,880021	1.098.188,08	3.309.574,42	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	17/11/2004	610	1.468,534148	4.181,252814	895.805,83	2.550.564,22	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	18/11/2004	1.010	1.468,534139	4.181,252814	1.483.219,48	4.223.065,34	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	19/11/2004	1.180	1.468,534144	4.181,252814	1.732.870,29	4.933.878,32	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	29/04/2005	916	1.363,723504	4.181,252814	1.249.170,73	3.830.027,58	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	29/05/2003	500	1.596,101000	4.414,984144	798.050,50	2.207.492,07	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	15/04/2003	662	1.580,468218	4.414,984144	1.046.269,96	2.922.719,50	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	20/03/2003	600	1.601,028617	4.414,984144	960.617,17	2.648.990,49	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	15/04/2003	938	1.577,117868	4.414,984144	1.479.336,56	4.141.255,13	Mercado

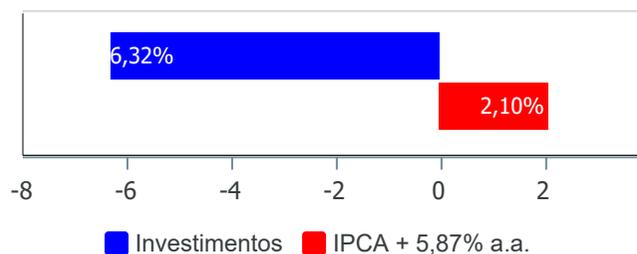
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Abril / 2020)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	29/05/2003	500	1.596,101000	4.414,984144	798.050,50	2.207.492,07	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	09/09/2003	690	1.452,455942	4.414,984144	1.002.194,60	3.046.339,06	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	03/07/2003	180	1.433,575000	4.414,984144	258.043,50	794.697,15	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	18/06/2003	631	1.441,834834	4.414,984144	909.797,78	2.785.854,99	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	08/10/2003	300	1.432,180667	4.414,984144	429.654,20	1.324.495,24	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	21/03/2003	1.300	1.602,545169	4.414,984144	2.083.308,72	5.739.479,39	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	29/05/2003	885	1.595,100000	4.414,984144	1.411.663,50	3.907.260,97	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	15/04/2003	742	1.578,791792	4.414,984144	1.171.463,51	3.275.918,23	Mercado

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

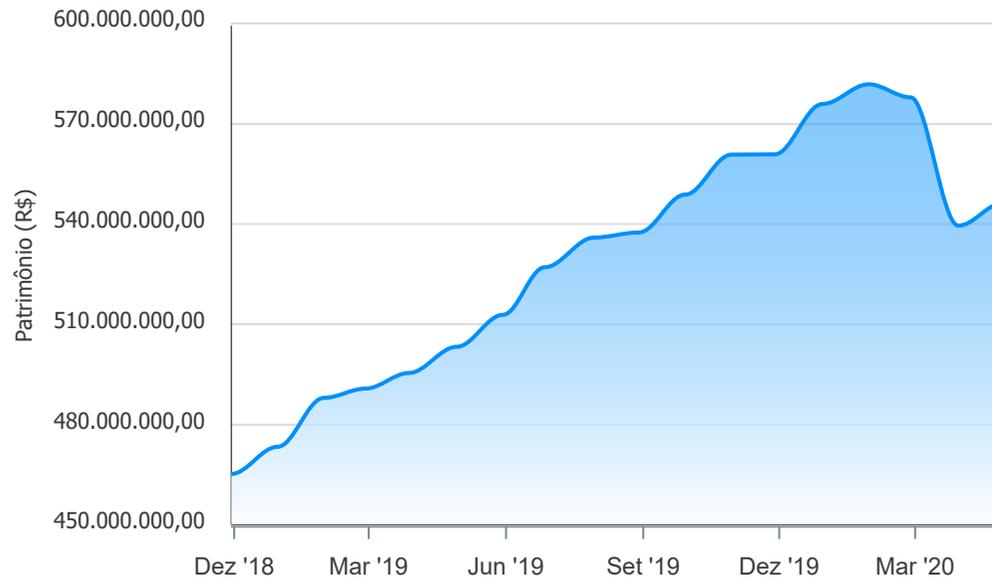
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	567.916.838,93	5.240.000,00	3.230.017,76	574.187.723,07	4.260.901,90	4.260.901,90	0,75%	0,75%	0,71%	0,71%	105,26%	2,48%
Fevereiro	574.187.723,07	5.920.000,00	4.345.165,69	570.157.905,78	-5.604.651,60	-1.343.749,70	-0,97%	-0,23%	0,66%	1,37%	-16,96%	3,66%
Março	570.157.905,78	5.020.000,00	5.551.658,99	530.327.168,84	-39.299.077,95	-40.642.827,65	-6,89%	-7,11%	0,57%	1,95%	-364,29%	13,31%
Abril	530.327.168,84	7.911.841,23	3.742.196,14	539.069.244,62	4.572.430,69	-36.070.396,96	0,86%	-6,32%	0,14%	2,10%	-301,18%	7,06%

Investimentos x Meta Atuarial



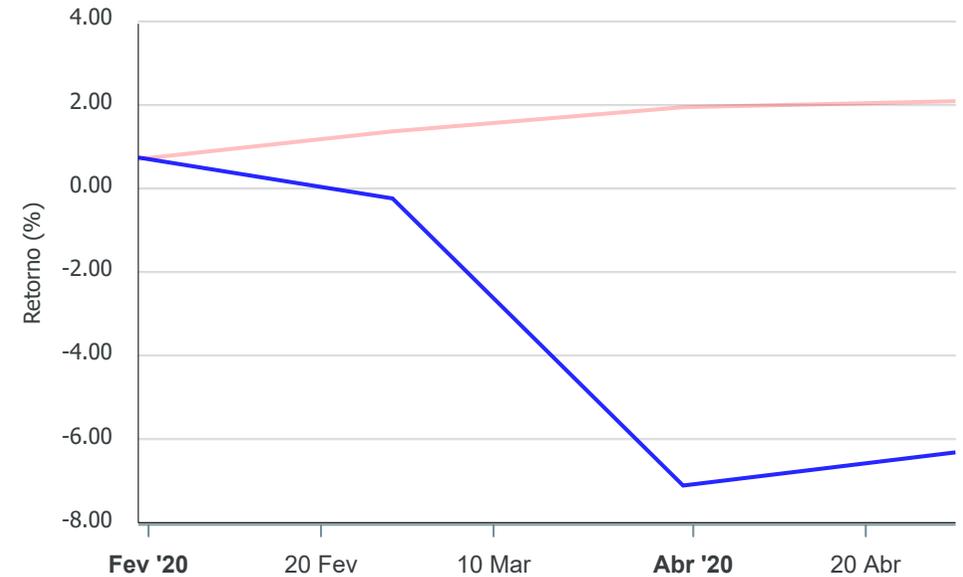
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	51.612.044,88	6.911.841,23	0,00	59.286.557,87	762.671,76	1,30%	1,30%	8,99%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	58.974.303,20	0,00	0,00	59.639.756,28	665.453,08	1,13%	1,13%	4,97%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	48.621.798,43	0,00	0,00	49.162.127,02	540.328,59	1,11%	1,11%	4,96%
TÍTULOS PÚBLICOS	85.110.385,68	0,00	984.605,60	85.026.799,54	901.019,46	1,06%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	45.584.702,83	0,00	0,00	46.000.707,75	416.004,92	0,91%	0,91%	4,82%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	56.293.876,63	1.000.000,00	0,00	57.529.382,08	235.505,45	0,41%	0,43%	2,75%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	60.589.175,23	0,00	3.000.000,00	57.837.428,61	248.253,38	0,41%	0,41%	0,49%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	3.648.676,91	0,00	0,00	3.661.107,48	12.430,57	0,34%	0,34%	5,25%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	46.364.614,62	0,00	0,00	46.431.045,21	66.430,59	0,14%	0,14%	2,58%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 3	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 4	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.293.098,24	0,00	0,00	1.291.680,07	-1.418,17	-0,11%	-0,11%	4,88%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.842.659,46	0,00	0,00	1.839.413,92	-3.245,54	-0,18%	-0,18%	0,08%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1.886.829,56	0,00	0,00	1.881.927,53	-4.902,03	-0,26%	-0,26%	0,67%
BRA1 FI RENDA FIXA	768.310,02	0,00	0,00	723.116,57	-45.193,45	-5,88%	-5,88%	10,09%
Total Renda Fixa	462.590.475,72	7.911.841,23	3.984.605,60	470.311.049,96	3.793.338,61	0,81%		4,25%

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
ÁTICO FLORESTAL BRASIL FICFIP	1.283.372,71	0,00	0,00	1.551.612,03	268.239,32	20,90%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	15.048.053,89	0,00	0,00	16.761.423,37	1.713.369,48	11,39%	11,39%	24,54%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	13.448.649,47	0,00	0,00	14.976.942,01	1.528.292,54	11,36%	11,36%	22,71%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	18.083.969,71	0,00	0,00	20.078.270,60	1.994.300,89	11,03%	11,03%	25,89%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	11.489.893,59	0,00	0,00	12.744.055,96	1.254.162,37	10,92%	10,92%	22,08%
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRCR11	289.900,26	0,00	1.590,54	299.800,56	11.490,84	3,96%	3,42%	7,60%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	2.943.761,75	0,00	0,00	2.955.572,62	11.810,87	0,40%	0,00%	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	2.035.097,57	0,00	0,00	2.032.336,32	-2.761,25	-0,14%	0,00%	0,00%
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	238.295,46	0,00	0,00	237.516,43	-779,03	-0,33%	-0,33%	0,01%
RIO BRAVO RENDA VAREJO FII - RBVA11	2.519.600,00	0,00	16.000,00	2.428.000,00	-75.600,00	-3,00%	-3,64%	8,45%
BRASIL ÓLEO & GÁS MULTISTRATÉGIA FIP	556,44	0,00	0,00	394,23	-162,21	-29,15%	-29,15%	43,13%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	7.273.216,45	0,00	0,00	1.378.207,35	-5.895.009,10	-81,05%	-	-
Total Renda Variável	74.654.367,30	0,00	17.590,54	75.444.131,48	807.354,72	1,08%		22,65%