

CRÉDITO E MERCADO

Engenharia Financeira
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			86.376.046,61	15,45%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	46.493.901,61	8,31%	595	0,44%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	60.472.013,03	10,81%	441	0,36%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	59.017.909,42	10,55%	955	0,74%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	65.707.047,05	11,75%	669	1,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	55.041.136,33	9,84%	1.269	0,73%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	49.839.937,87	8,91%	752	0,41%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	D+1009	Não há	3.678.520,19	0,66%	28	5,28%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	46.681.991,87	8,35%	285	0,90%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRA1 FI RENDA FIXA	D+1445	Não há	728.433,24	0,13%	16	4,17%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1800	Não há	1.287.784,17	0,23%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, 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 4	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	1.873.756,88	0,34%		0,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se ...	Não se aplica	1.835.742,60	0,33%	98	2,17%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	16.374.375,48	2,93%	12.825	2,17%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	13.838.081,26	2,47%	1.777	5,59%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	21.154.301,98	3,78%	50.170	0,70%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	17.731.733,83	3,17%	6.827	1,66%	Artigo 8º, Inciso II, 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
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+1	Não há	236.737,73	0,04%	12	14,12%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	1.376.986,85	0,25%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRASIL ÓLEO & GÁS MULTISTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	503,29	0,00%	15	0,40%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
ÁTICO FLORESTAL BRASIL FICFIP	Não se ...	Não se aplica	1.549.301,01	0,28%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRCR11	S/Info	Não se aplica	294.087,60	0,05%		0,02%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se ...	Não se aplica	2.029.077,60	0,36%		5,72%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
RIO BRAVO RENDA VAREJO FII - RBVA11	Não se ...	Não se aplica	2.582.000,00	0,46%		0,49%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	S/Info	Não se aplica	3.011.892,70	0,54%		6,38%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
Total para cálculo dos limites da Resolução			559.213.300,23				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			508.239,52				Artigo 6º
PL Total			559.721.539,75				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA 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%	86.376.046,61	15,45%	5,00%	15,00%	100,00%	472.837.253,62
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	336.571.945,31	60,19%	10,00%	52,50%	100,00%	222.641.354,92
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	27.960.665,01
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	27.960.665,01
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	111.842.660,05
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	111.842.660,05
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	52.376.729,47	9,37%	0,00%	10,00%	40,00%	171.308.590,62
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	27.960.665,01
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	3.709.499,51	0,66%	0,00%	0,50%	3,00%	13.066.899,50
Total Renda Fixa	100,00%	479.034.220,90	85,66%	15,00%	78,00%	298,00%	

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%	0,00	0,00%	0,00%	0,50%	10,00%	55.921.330,02
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	25,00%	139.803.325,06
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	69.098.492,55	12,36%	0,00%	14,00%	20,00%	42.744.167,50
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	27.960.665,01
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	236.737,73	0,04%	0,00%	0,50%	3,00%	16.539.661,28
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	2.926.791,15	0,52%	0,00%	1,00%	5,00%	25.033.873,86
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	7.917.057,90	1,42%	0,00%	1,00%	5,00%	20.043.607,11
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	27.960.665,01
Total Renda Variável	30,00%	80.179.079,33	14,34%	0,00%	22,00%	78,00%	

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%	27.960.665,01
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	27.960.665,01
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	27.960.665,01
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	

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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	169.329.860,32	30,28	0,03
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	167.242.084,99	29,91	0,01
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	86.376.046,61	15,45	-
ITAÚ UNIBANCO	67.836.293,85	12,13	0,00
AZ QUEST INVESTIMENTOS	34.106.109,31	6,10	0,13
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	13.838.081,26	2,47	0,03
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	6.666.613,80	1,19	1,51
GRAPHEN INVESTIMENTOS LTDA	5.789.014,80	1,04	4,11
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	2.582.000,00	0,46	1,37
REDITUS INVESTIMENTOS	2.029.077,60	0,36	-
PETRA CAPITAL	1.835.742,60	0,33	0,03
VERITAS CAPITAL MANAGEMENT	1.287.784,17	0,23	0,08
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	294.087,60	0,05	0,00
VALORA INVESTIMENTOS	503,29	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 '	86.376.046,61	15,45	50,00	90,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	336.571.945,31	60,19	20,00	50,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	52.376.729,47	9,37	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	5,00	10,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	69.098.492,55	12,36	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 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%	-	-
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	-	-	-	-	-	-	-	-
120% do CDI (Benchmark)	0,28%	1,85%	1,03%	2,31%	5,87%	14,02%	-	-
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)	0,42%	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%
IMA-B 5 (Benchmark)	2,12%	2,03%	0,82%	3,29%	9,46%	23,93%	-	-
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,30%	2,12%	1,79%	1,75%	-22,25%	-16,50%	-	-

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 (Benchmark)	1,52%	-3,64%	-4,32%	-1,70%	6,68%	31,99%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,50%	-3,69%	-4,36%	-1,79%	6,48%	31,36%	0,04%	0,10%
BRA1 FI RENDA FIXA	0,74%	-25,06%	-24,80%	-47,43%	-70,24%	-69,52%	0,01%	0,53%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	0,48%	-4,02%	-4,04%	-3,36%	0,63%	-	0,02%	0,06%

IRF-M (Benchmark)	1,42%	4,05%	2,47%	4,69%	11,31%	26,14%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,40%	3,94%	2,42%	4,57%	11,04%	25,67%	0,02%	0,03%

IPCA (Benchmark)	-0,38%	-0,16%	-0,62%	0,99%	1,88%	6,62%	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,20%	-1,34%	-0,63%	-1,51%	-8,38%	-12,84%	0,00%	0,06%
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%

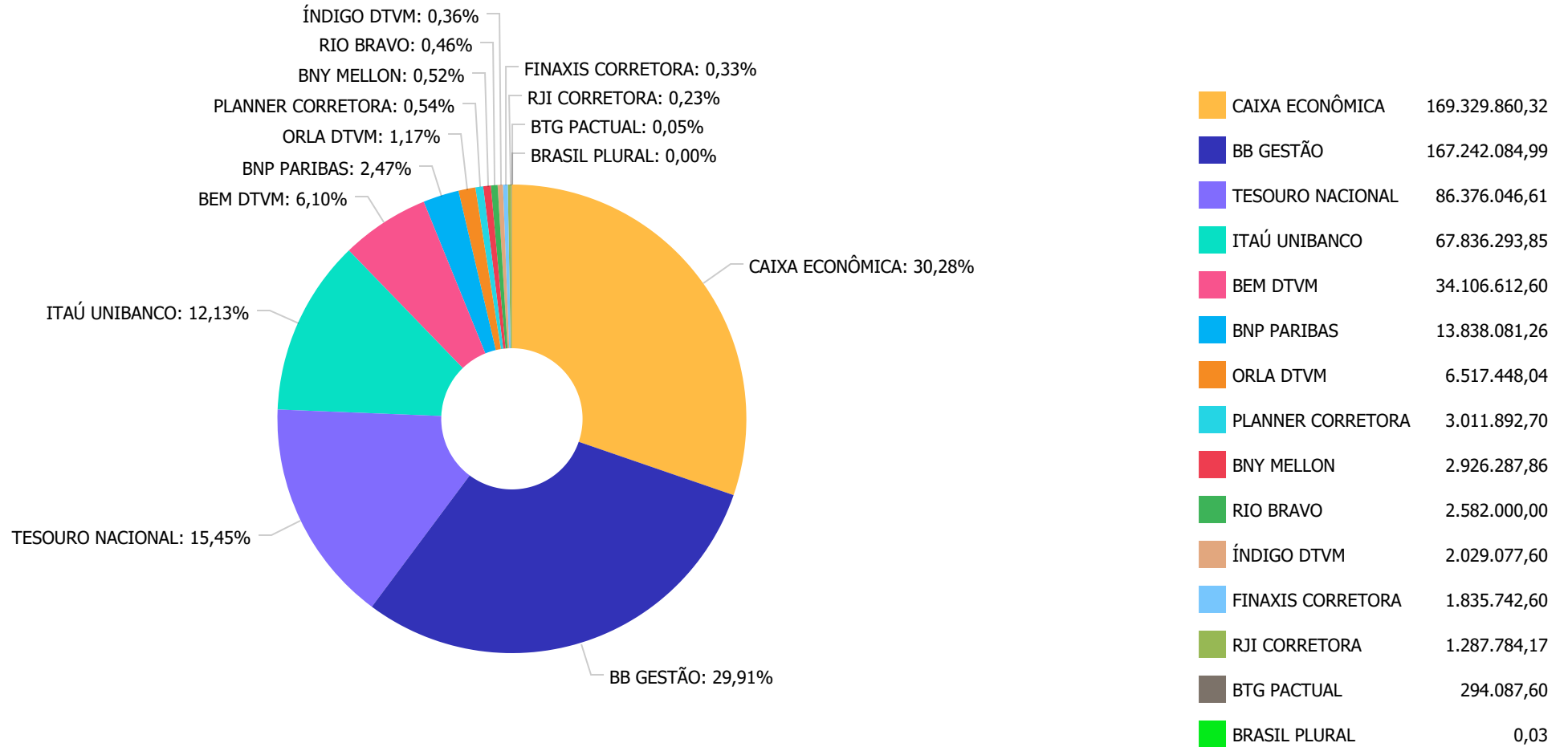
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Maio/2020 - RENDA VARIÁVEL

	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%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	-	-
IPCA + 11,00% ao ano (Benchmark)	0,45%	4,15%	1,97%	6,26%	13,04%	31,26%	-	-
BRASIL ÓLEO & GÁS MULTISTRATÉGIA FIP	27,67%	-	-	-	-92,76%	-99,72%	0,58%	0,94%
Ibovespa (Benchmark)	8,57%	-24,42%	-16,10%	-19,25%	-9,92%	13,87%	-	-
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	9,33%	-25,16%	-21,40%	-19,52%	-9,51%	10,88%	0,13%	0,42%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	8,59%	-21,88%	-15,44%	-16,65%	-6,18%	21,52%	0,14%	0,37%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	5,36%	-28,85%	-20,98%	-23,06%	-6,21%	20,72%	0,17%	0,40%
SMLL (Benchmark)	5,07%	-30,73%	-24,82%	-21,96%	-1,69%	25,45%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	5,79%	-26,59%	-26,64%	-18,65%	4,15%	30,60%	0,10%	0,46%
CDI (Benchmark)	0,24%	1,54%	0,86%	1,92%	4,87%	11,55%	-	-
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-0,33%	6,72%	-0,56%	5,80%	1,75%	-94,63%	0,00%	0,08%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRCR11	-1,47%	-22,69%	-16,51%	-8,53%	0,63%	0,14%	0,06%	0,30%
ÁQUILLA FII - AQLL11	0,00%	0,28%	0,00%	0,28%	-24,79%	-31,88%	0,00%	0,18%

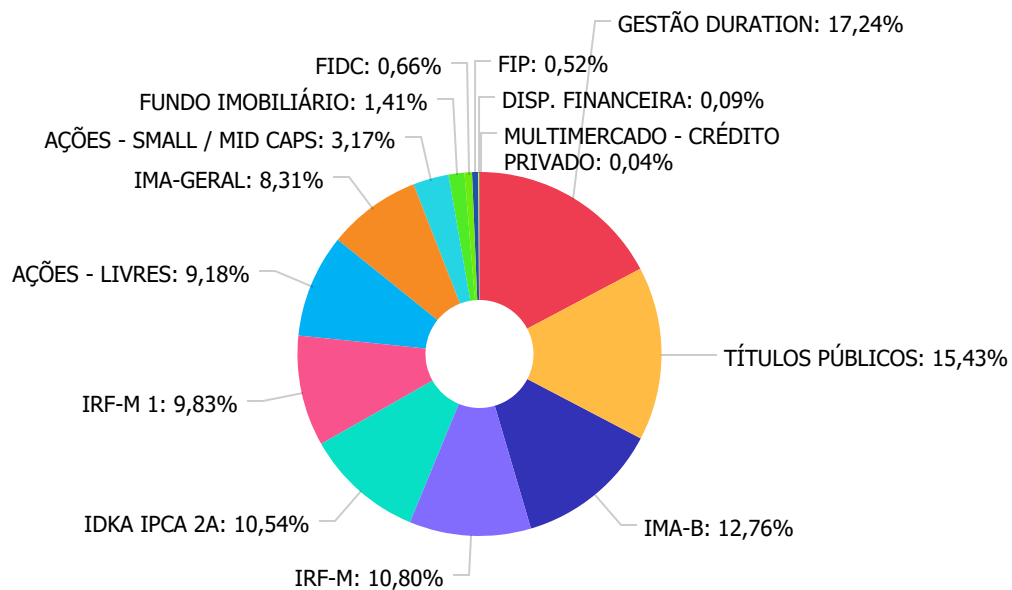
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Maio/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	-0,42%	-17,96%	-19,47%	-33,89%	69,02%	69,02%	-	-
ÁTICO FLORESTAL BRASIL FICFIP	-	-	-	-	-	-	-	-
RIO BRAVO RENDA VAREJO FII - RBVA11	6,34%	-23,61%	-11,12%	-10,93%	-89,84%	-88,83%	0,08%	0,30%

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



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



GESTÃO DURATION	96.521.929,74
TÍTULOS PÚBLICOS	86.376.046,61
IMA-B	71.401.784,65
IRF-M	60.472.013,03
IDKA IPCA 2A	59.017.909,42
IRF-M 1	55.041.136,33
AÇÕES - LIVRES	51.366.758,72
IMA-GERAL	46.493.901,61
AÇÕES - SMALL / MID CAPS	17.731.733,83
FUNDO IMOBILIÁRIO	7.917.057,90
FIDC	3.709.499,51
FIP	2.926.791,15
DISP. FINANCEIRA	508.239,52
MULTIMERCADO - CRÉDITO PRIVADO	236.737,73

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	15/08/2024	20/01/2004	1.100	1.345,077073	3.880,378221	1.479.584,78	4.268.416,04	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	18/11/2003	880	1.247,941000	3.880,378221	1.098.188,08	3.414.732,83	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	08/10/2004	750	1.322,840000	3.880,378221	992.130,00	2.910.283,67	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	22/09/2004	760	1.314,210000	3.880,378221	998.799,60	2.949.087,45	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	02/09/2004	770	1.299,461390	3.880,378221	1.000.585,27	2.987.891,23	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	22/07/2004	850	1.322,487235	3.880,378221	1.124.114,15	3.298.321,49	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	06/04/2004	750	1.342,192893	3.880,378221	1.006.644,67	2.910.283,67	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	17/03/2004	750	1.333,000000	3.880,378221	999.750,00	2.910.283,67	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	14/12/2004	1.100	1.352,073136	3.880,378221	1.487.280,45	4.268.416,04	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	04/01/2005	630	1.364,164873	3.880,378221	859.423,87	2.444.638,28	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	04/01/2005	100	1.364,164800	3.880,378221	136.416,48	388.037,82	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	07/01/2005	730	1.366,595342	3.880,378221	997.614,60	2.832.676,10	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	17/11/2004	610	1.468,534148	4.106,034592	895.805,83	2.504.681,10	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	18/11/2004	1.010	1.468,534139	4.106,034592	1.483.219,48	4.147.094,94	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	19/11/2004	1.180	1.468,534144	4.106,034592	1.732.870,29	4.845.120,82	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	29/04/2005	916	1.363,723504	4.106,034592	1.249.170,73	3.761.127,69	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	29/05/2003	885	1.595,100000	4.482,209121	1.411.663,50	3.966.755,07	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	15/04/2003	742	1.578,791792	4.482,209121	1.171.463,51	3.325.799,17	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	29/05/2003	500	1.596,101000	4.482,209121	798.050,50	2.241.104,56	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	15/04/2003	662	1.580,468218	4.482,209121	1.046.269,96	2.967.222,44	Mercado

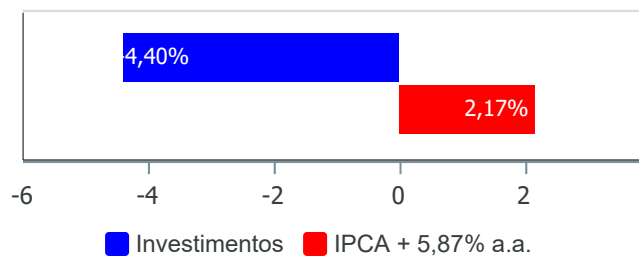
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Maio / 2020)

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	20/03/2003	600	1.601,028617	4.482,209121	960.617,17	2.689.325,47	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	15/04/2003	938	1.577,117868	4.482,209121	1.479.336,56	4.204.312,16	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	29/05/2003	500	1.596,101000	4.482,209121	798.050,50	2.241.104,56	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	09/09/2003	690	1.452,455942	4.482,209121	1.002.194,60	3.092.724,29	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	03/07/2003	180	1.433,575000	4.482,209121	258.043,50	806.797,64	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	18/06/2003	631	1.441,834834	4.482,209121	909.797,78	2.828.273,96	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	08/10/2003	300	1.432,180667	4.482,209121	429.654,20	1.344.662,74	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	21/03/2003	1.300	1.602,545169	4.482,209121	2.083.308,72	5.826.871,86	Mercado

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

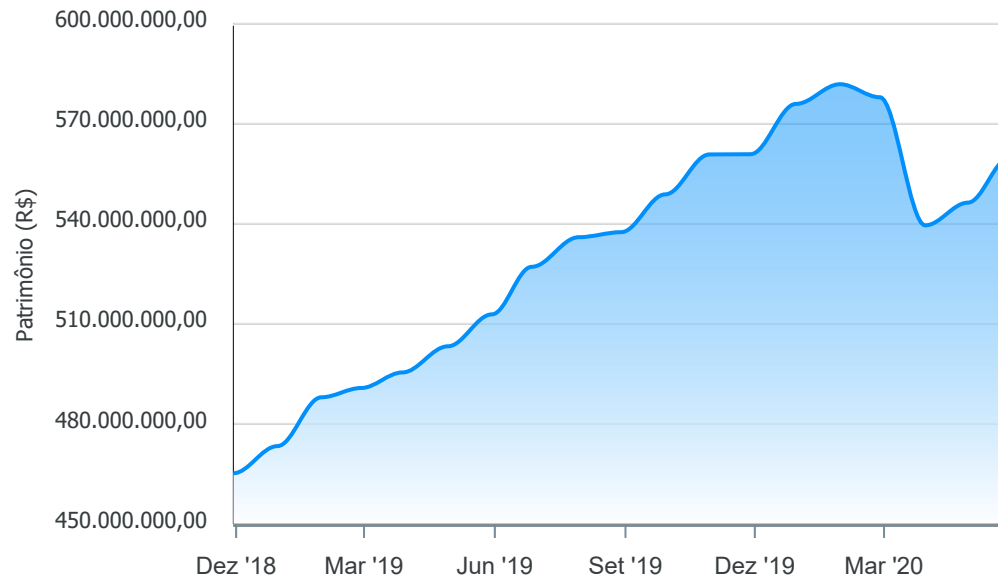
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	567.916.838,93	5.240.000,00	3.230.017,76	574.187.723,07	4.260.901,90	4.260.901,90	0,75%	0,75%	0,71%	0,71%	105,26%	2,48%
Fevereiro	574.187.723,07	5.920.000,00	4.345.165,69	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	539.069.244,48	4.572.430,55	-36.070.397,10	0,86%	-6,32%	0,14%	2,10%	-301,18%	7,06%
Maio	539.069.244,48	5.820.000,00	3.207.049,14	552.741.587,69	11.059.392,35	-25.011.004,75	2,04%	-4,40%	0,07%	2,17%	-202,84%	3,40%

Investimentos x Meta Atuarial



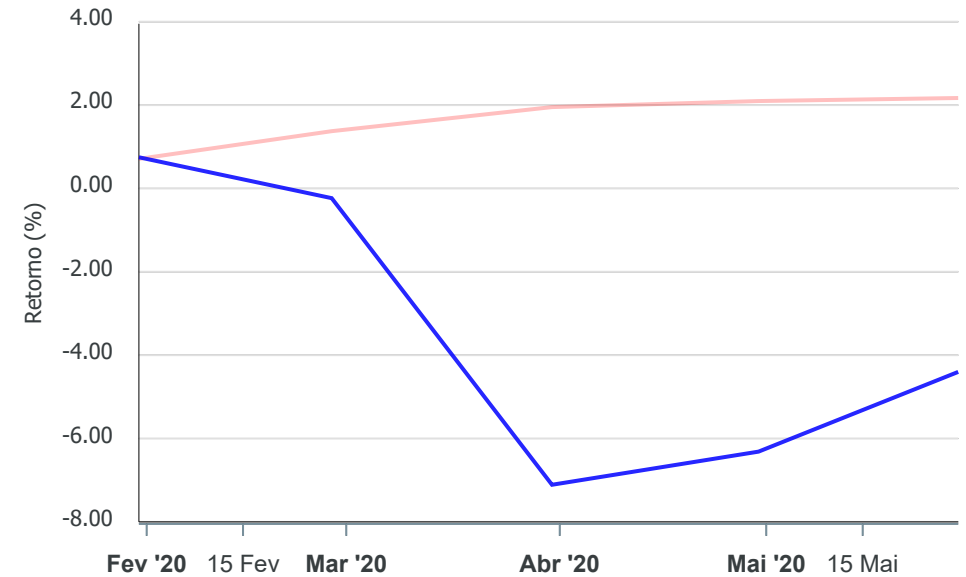
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
BRA1 FI RENDA FIXA	723.116,57	0,00	45.878,81	728.433,24	51.195,48	7,08%	0,74%	0,69%
TÍTULOS PÚBLICOS	85.026.799,40	0,00	362.774,55	86.376.046,61	1.712.021,76	2,01%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	57.529.382,08	390.000,00	0,00	59.017.909,42	1.098.527,34	1,90%	1,91%	1,06%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	59.286.557,87	5.430.000,00	0,00	65.707.047,05	990.489,18	1,53%	1,50%	3,64%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	59.639.756,28	0,00	0,00	60.472.013,03	832.256,75	1,40%	1,40%	1,72%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	49.162.127,02	0,00	0,00	49.839.937,87	677.810,85	1,38%	1,38%	1,72%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	46.000.707,75	0,00	0,00	46.493.901,61	493.193,86	1,07%	1,07%	1,74%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	46.431.045,21	0,00	0,00	46.681.991,87	250.946,66	0,54%	0,54%	0,70%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	3.661.107,48	0,00	0,00	3.678.520,19	17.412,71	0,48%	0,48%	2,02%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	57.837.428,61	0,00	3.020.000,00	55.041.136,33	223.707,72	0,39%	0,39%	0,20%
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%	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.839.413,92	0,00	0,00	1.835.742,60	-3.671,32	-0,20%	-0,20%	0,04%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.291.680,07	0,00	0,00	1.287.784,17	-3.895,90	-0,30%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1.881.927,53	0,00	0,00	1.873.756,88	-8.170,65	-0,43%	-	-
Total Renda Fixa	470.311.049,82	5.820.000,00	3.428.653,36	479.034.220,90	6.331.824,44	1,34%		1,60%

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
BRASIL ÓLEO & GÁS MULTISTRATÉGIA FIP	394,23	0,00	0,00	503,29	109,06	27,66%	27,67%	58,02%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	14.976.942,01	0,00	0,00	16.374.375,48	1.397.433,47	9,33%	9,33%	12,80%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	12.744.055,96	0,00	0,00	13.838.081,26	1.094.025,30	8,58%	8,58%	13,82%
RIO BRAVO RENDA VAREJO FII - RBVA11	2.428.000,00	0,00	17.000,00	2.582.000,00	171.000,00	7,04%	6,34%	7,54%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	16.761.423,37	0,00	0,00	17.731.733,83	970.310,46	5,79%	5,79%	9,75%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	20.078.270,60	0,00	0,00	21.154.301,98	1.076.031,38	5,36%	5,36%	16,91%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	2.955.572,62	0,00	0,00	3.011.892,70	56.320,08	1,91%	-0,42%	-
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	1.378.207,35	0,00	0,00	1.376.986,85	-1.220,50	-0,09%	-	-
ÁTICO FLORESTAL BRASIL FICFIP	1.551.612,03	0,00	0,00	1.549.301,01	-2.311,02	-0,15%	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	2.032.336,32	0,00	0,00	2.029.077,60	-3.258,72	-0,16%	0,00%	0,00%
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	237.516,43	0,00	0,00	236.737,73	-778,70	-0,33%	-0,33%	0,01%
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRCR11	299.800,56	0,00	1.395,78	294.087,60	-4.317,18	-1,44%	-1,47%	5,91%
Total Renda Variável	75.444.131,48	0,00	18.395,78	80.179.079,33	4.753.343,63	6,30%		12,83%