

# CRÉDITO E MERCADO

*Engenharia Financeira*

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                 |
|-----------------------------------------------------|------------|-----------------|---------------|--------------------|----------|------------------|-----------------------------------|
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE... | D+1        | Não há          | 11.332.892,07 | 17,90%             | 883      | 0,17%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'   |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO     | D+3        | Não há          | 1.013.805,64  | 1,60%              | 595      | 0,01%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'   |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI... | D+0        | Não há          | 1.609.389,47  | 2,54%              | 1.251    | 0,02%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'   |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE... | D+0        | Não há          | 10.619.654,64 | 16,78%             | 958      | 0,13%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'   |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F... | D+0        | Não há          | 12.880.761,84 | 20,35%             | 1.370    | 0,12%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'   |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA       | D+0        | Não possui      | 2.081.878,61  | 3,29%              | 743      | 0,02%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'   |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA         | D+0        | Não há          | 4.442.821,15  | 7,02%              | 317      | 0,77%            | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'  |
| TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5               | D+1471     | Não há          | 240.584,75    | 0,38%              | 26       | 0,34%            | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'  |
| BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA           | D+4        | Não há          | 2.053.752,62  | 3,24%              | 172      | 0,17%            | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'  |
| TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA                         | D+1471     | Não há          | 672.613,86    | 1,06%              | 31       | 0,24%            | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'  |
| CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP      | D+0        | Não há          | 5.170.152,66  | 8,17%              | 421      | 0,14%            | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'  |
| LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR             | D+1260     | 90 dias         | 750.456,49    | 1,19%              | 70       | 1,01%            | Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a' |
| AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR                  | Não pos... | 1008 dias úteis | 2.402.672,99  | 3,80%              | 8        | 5,77%            | Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a' |
| GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1                           | D+1601     | 29 dias         | 1.268.044,25  | 2,00%              | 33       | 0,74%            | Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a' |
| BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES                          | D+4        | Não há          | 258.087,38    | 0,41%              | 475      | 0,08%            | Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'  |
| CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES                  | D+15       | Não há          | 432.296,81    | 0,68%              | 53       | 0,28%            | Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'  |
| SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO            | D+91 ou... | Não há          | 1.122.766,86  | 1,77%              | 14       | 0,62%            | Artigo 8º, Inciso III             |
| CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP            | D+4        | Não há          | 1.001.189,67  | 1,58%              | 18.875   | 0,02%            | Artigo 8º, Inciso III             |
| LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO               | D+1        | Não há          | 19.474,03     | 0,03%              | 12       | 1,16%            | Artigo 8º, Inciso III             |
| W7 MULTISTRATÉGIA FIP                               | Não se ... | Não se aplica   | 2.455.211,17  | 3,88%              |          | 0,00%            | Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'  |

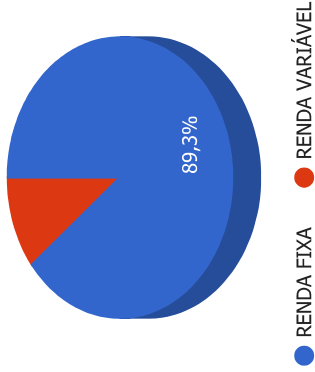
Carteira consolidada de investimentos - base (Abril / 2020)

| Produto / Fundo                                     | Resgate    | Carência      | Saldo         | Particip. S/ Total | Cotistas | % S/ PL do Fundo | RESOLUÇÃO - 3.922                  |
|-----------------------------------------------------|------------|---------------|---------------|--------------------|----------|------------------|------------------------------------|
| HAZ FIL - ATCR11                                    | Não se ... | Não se aplica | 1.044.187,97  | 1,65%              |          | 1,48%            | Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b ' |
| BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FIL ... | Não se ... | Não se aplica | 428.387,07    | 0,68%              |          | 0,30%            | Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b ' |
| Total para cálculo dos limites da Resolução         |            |               | 63.301.082,00 |                    |          |                  |                                    |

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, Alinea ' a '   | 100,00%     | 0,00          | 0,00%    | 0,00%                         | 0,00%  | 10,00%  | 6.330.108,20  |
| Artigo 7º, Inciso I, Alinea ' b '   | 100,00%     | 39.538.382,27 | 62,46%   | 20,00%                        | 50,00% | 90,00%  | 17.432.591,53 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alinea ' a ' | 60,00%      | 0,00          | 0,00%    | 0,00%                         | 5,00%  | 60,00%  | 37.980.649,20 |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alinea ' a '  | 40,00%      | 12.579.925,04 | 19,87%   | 10,00%                        | 15,00% | 40,00%  | 12.740.507,76 |
| Artigo 7º, Inciso V, Alinea ' b '   | 20,00%      | 0,00          | 0,00%    | 0,00%                         | 0,00%  | 5,00%   | 3.165.054,10  |
| Artigo 7º, Inciso VI, Alinea ' a '  | 15,00%      | 0,00          | 0,00%    | 0,00%                         | 0,00%  | 5,00%   | 3.165.054,10  |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alinea ' a ' | 5,00%       | 4.421.173,73  | 6,98%    | 0,00%                         | 0,00%  | 5,00%   | -1.256.119,63 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alinea ' b ' | 5,00%       | 0,00          | 0,00%    | 0,00%                         | 0,00%  | 5,00%   | 3.165.054,10  |
| Total Renda Fixa                    | 100,00%     | 56.539.481,04 | 89,32%   | 30,00%                        | 70,00% | 220,00% |               |

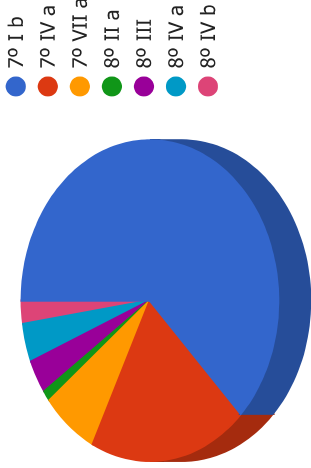
Distribuição por Segmento



Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENTA 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%  | 10,00% | 6.330.108,20  |
| Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a' | 20,00%    | 690.384,19   | 1,09%    | 5,00%                         | 15,00% | 20,00% | 11.969.832,21 |
| Artigo 8º, Inciso III            | 10,00%    | 2.143.430,56 | 3,39%    | 3,00%                         | 10,00% | 10,00% | 4.186.677,64  |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a' | 5,00%     | 2.455.211,17 | 3,88%    | 0,00%                         | 0,00%  | 5,00%  | 709.842,93    |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b' | 5,00%     | 1.472.575,04 | 2,33%    | 0,00%                         | 2,00%  | 5,00%  | 1.692.479,06  |
| Total Renda Variável             | 30,00%    | 6.761.600,96 | 10,68%   | 8,00%                         | 30,00% | 50,00% |               |

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%    | 0,00        | 0,00%    | 0,00%                                  | 0,00% | 1,00%    | 633.010,82   |
| Total Exterior            | 10,00%    | 0,00        | 0,00%    | 0,00%                                  | 0,00% | 1,00%    |              |

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

| Gestão                            | Valor         | % S/ Carteira | % S/ PL Gestão |
|-----------------------------------|---------------|---------------|----------------|
| CAIXA ECONÔMICA FEDERAL           | 36.628.755,38 | 57,86         | 0,01           |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM        | 14.214.174,56 | 22,45         | 0,00           |
| GRAPHEN INVESTIMENTOS LTDA        | 4.216.791,48  | 6,66          | 1,82           |
| A5 CAPITAL PARTNERS               | 2.455.211,17  | 3,88          | -              |
| BRADESCO ASSET MANAGEMENT         | 2.053.752,62  | 3,24          | 0,00           |
| AURORA CAPITAL                    | 1.268.044,25  | 2,00          | 11,12          |
| RJI GESTÃO & INVESTIMENTOS        | 1.122.766,86  | 1,77          | 0,17           |
| BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUT... | 672.613,86    | 1,06          | 0,01           |
| ZION INVEST                       | 428.387,07    | 0,68          | 0,09           |
| RJI CORRETORA DE VALORES          | 240.584,75    | 0,38          | 0,05           |

**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 'a'   | 0,00                          | 0,00       | 0,00                | 10,00               |
| Artigo 7º, Inciso I, Alinea 'b'   | 39.538.382,27                 | 62,46      | 20,00               | 90,00               |
| Artigo 7º, Inciso III, Alinea 'a' | 0,00                          | 0,00       | 0,00                | 60,00               |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alinea 'a'  | 12.579.925,04                 | 19,87      | 10,00               | 40,00               |
| Artigo 7º, Inciso V, Alinea 'b'   | 0,00                          | 0,00       | 0,00                | 5,00                |
| Artigo 7º, Inciso VI, Alinea 'a'  | 0,00                          | 0,00       | 0,00                | 5,00                |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alinea 'a' | 4.421.173,73                  | 6,98       | 0,00                | 5,00                |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alinea 'b' | 0,00                          | 0,00       | 0,00                | 5,00                |
| Artigo 8º, Inciso I, Alinea 'a'   | 0,00                          | 0,00       | 0,00                | 10,00               |
| Artigo 8º, Inciso II, Alinea 'a'  | 690.384,19                    | 1,09       | 5,00                | 20,00               |
| Artigo 8º, Inciso III             | 2.143.430,56                  | 3,39       | 3,00                | 10,00               |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alinea 'a'  | 2.455.211,17                  | 3,88       | 0,00                | 5,00                |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alinea 'b'  | 1.472.575,04                  | 2,33       | 0,00                | 5,00                |
| Artigo 9º - A, Inciso III         | 0,00                          | 0,00       | 0,00                | 1,00                |

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 |
|-------------------------------------------------------------|--------|---------|---------|---------|---------|-----------|---------|------------------|
| 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%            |
|                                                             |        |         |         |         |         |           |         |                  |
| IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)                             | 0,30%  | 2,76%   | 1,86%   | 5,79%   | 10,62%  | 25,30%    | -       | -                |
| AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR                          | 1,34%  | 7,20%   | 4,36%   | 8,47%   | 13,79%  | 28,33%    | 0,00%   | 0,02%            |
|                                                             |        |         |         |         |         |           |         |                  |
| 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%            |
|                                                             |        |         |         |         |         |           |         |                  |
| 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%            |
| GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1                                   | -3,17% | -16,05% | -11,54% | -15,94% | -17,98% | -23,61%   | -       | 0,07%            |
|                                                             |        |         |         |         |         |           |         |                  |
| 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%            |
|                                                             |        |         |         |         |         |           |         |                  |
| IMA-B 5 (Benchmark)                                         | 0,49%  | -0,09%  | -0,64%  | 0,86%   | 8,67%   | 19,47%    | -       | -                |
| TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA                                 | 0,23%  | -28,98% | -29,22% | -27,99% | -23,81% | -36,75%   | 0,05%   | 0,27%            |

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 |
|------------------------------------------------|--------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|------------------|
| TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5          | 0,40%  | -16,16% | -16,18% | -16,63% | -12,25% | -24,08% | 0,04%   | 0,17%            |
| <b>CDI (Benchmark)</b>                         |        |         |         |         |         |         |         |                  |
|                                                | 0,28%  | 1,30%   | 0,92%   | 2,07%   | 5,19%   | 11,87%  | -       | -                |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA    | 0,22%  | 1,02%   | 0,72%   | 1,65%   | 4,31%   | 10,01%  | 0,00%   | 0,00%            |
| <b>IPCA (Benchmark)</b>                        |        |         |         |         |         |         |         |                  |
|                                                | -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%            |
| BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA      | 1,02%  | -0,30%  | -0,73%  | -0,40%  | 8,12%   | 18,37%  | 0,05%   | 0,04%            |
| <b>Não Informado (Benchmark)</b>               |        |         |         |         |         |         |         |                  |
|                                                | -      | -       | -       | -       | -       | -       | -       | -                |
| CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0,31%  | 1,35%   | 0,96%   | 2,07%   | 5,25%   | 11,69%  | 0,00%   | 0,00%            |

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% | -       | -                |
| W7 MULTISTRATÉGIA FIP            | -     | -     | -     | -     | -      | -      | -       | -                |

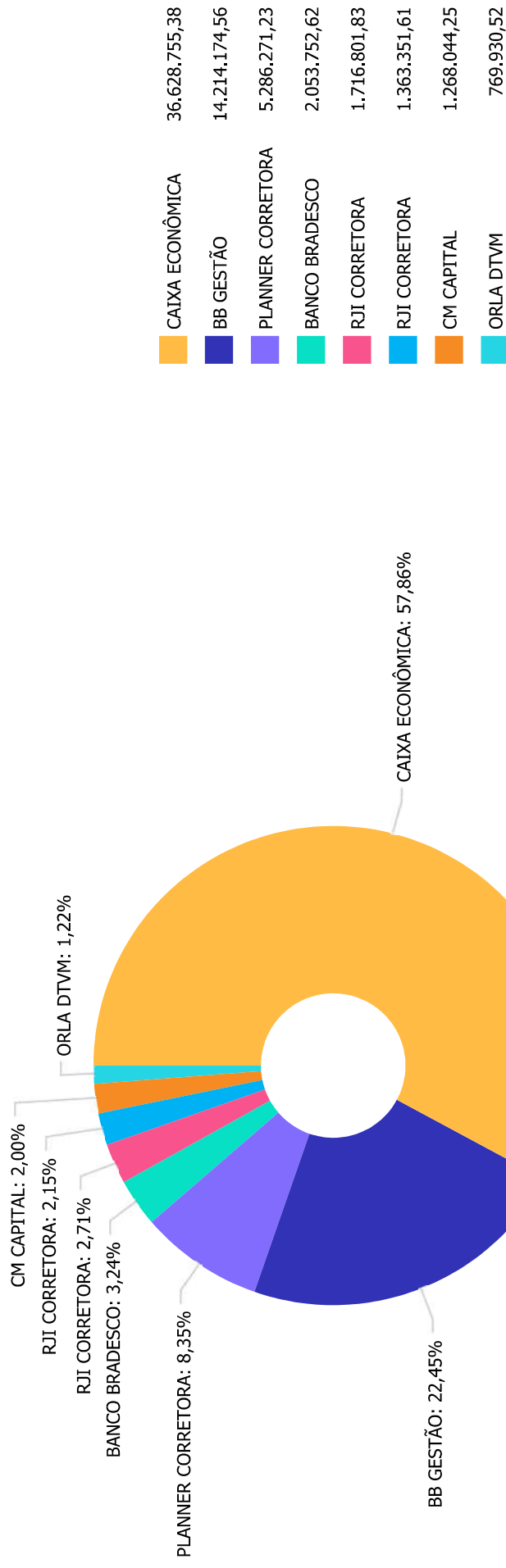
|                                          |       |        |        |         |         |         |       |       |
|------------------------------------------|-------|--------|--------|---------|---------|---------|-------|-------|
| IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)          | 0,15% | 2,14%  | 1,41%  | 4,83%   | 8,57%   | 20,71%  | -     | -     |
| SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO | 0,27% | -9,90% | -9,94% | -10,05% | -16,07% | -23,26% | 0,01% | 0,11% |

|                            |        |         |         |         |         |        |       |       |
|----------------------------|--------|---------|---------|---------|---------|--------|-------|-------|
| Ibovespa (Benchmark)       | 10,25% | -30,39% | -29,23% | -24,92% | -16,45% | -6,51% | -     | -     |
| BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES | 9,48%  | -32,48% | -31,54% | -26,34% | -18,11% | -8,19% | 0,21% | 0,37% |

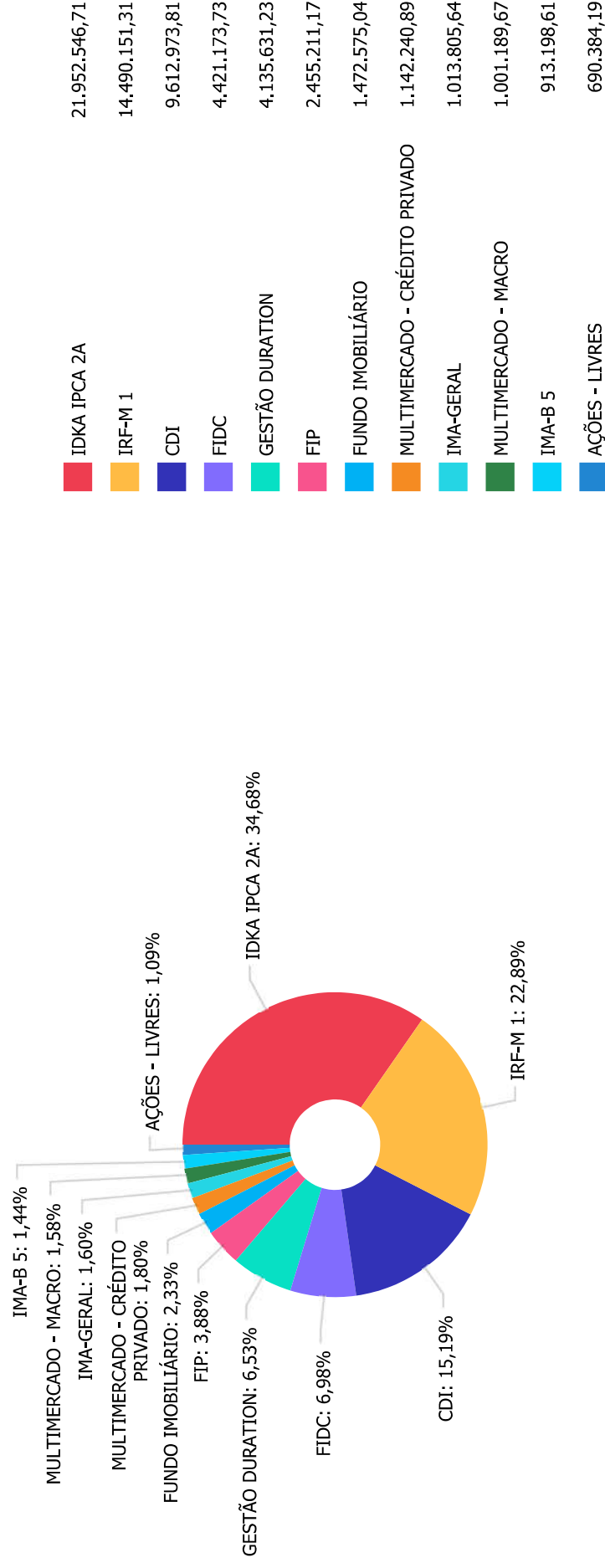
|                                          |        |        |        |        |       |         |       |       |
|------------------------------------------|--------|--------|--------|--------|-------|---------|-------|-------|
| CDI (Benchmark)                          | 0,28%  | 1,30%  | 0,92%  | 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% |
| CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP | 2,63%  | -3,63% | -4,29% | -0,87% | 7,95% | 19,59%  | 0,05% | 0,08% |

|                                                          |         |         |         |         |         |         |       |       |
|----------------------------------------------------------|---------|---------|---------|---------|---------|---------|-------|-------|
| Não Informado (Benchmark)                                | -       | -       | -       | -       | -       | -       | -     | -     |
| HAZ FI - ATCR11                                          | -0,09%  | 0,05%   | 0,13%   | 374,34% | 374,34% | 374,34% | -     | -     |
| BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11 | -22,43% | -35,66% | -27,83% | -38,06% | -46,10% | -62,78% | 0,21% | 0,49% |
| CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES                       | 9,16%   | -27,61% | -28,50% | -16,77% | -       | -       | 0,25% | -     |

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



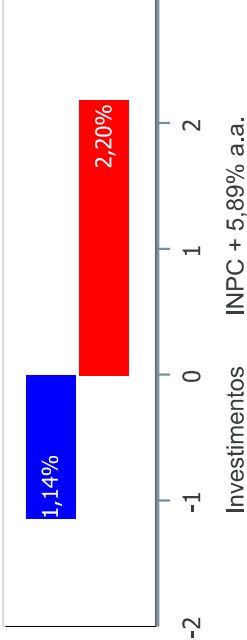
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Abril / 2020)



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

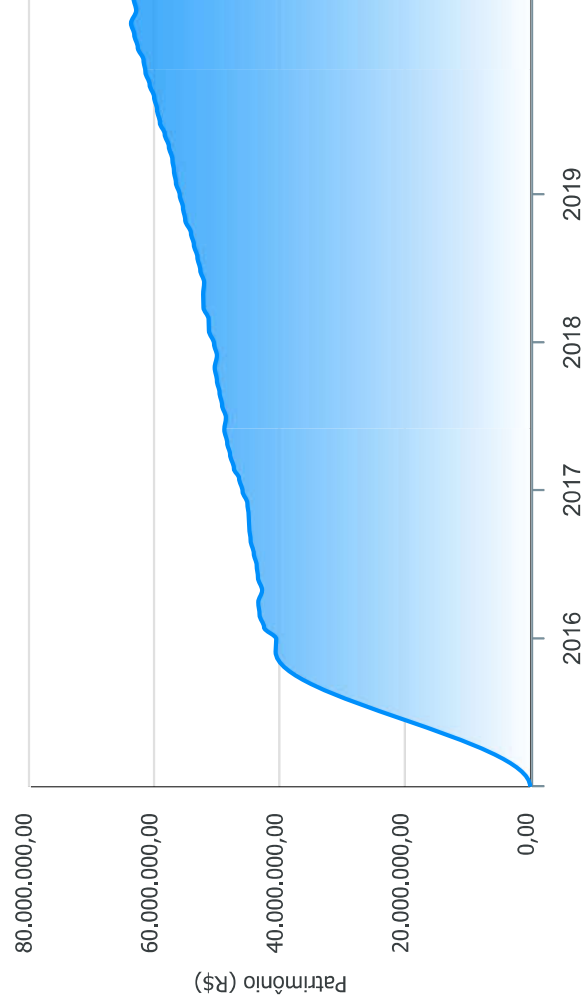
| Mês       | Saldo Anterior | Aplicações   | Resgates   | Saldo no Mês  | Retorno       | Retorno Acum | Retorno Mês | Retorno Acum | Meta Mês | Meta Acum | Gap Acum | VaR   |
|-----------|----------------|--------------|------------|---------------|---------------|--------------|-------------|--------------|----------|-----------|----------|-------|
| Janeiro   | 62.655.472,33  | 1.234.574,35 | 812.767,13 | 63.187.113,79 | 109.834,24    | 109.834,24   | 0,17%       | 0,17%        | 0,69%    | 0,69%     | 25,17%   | 0,92% |
| Fevereiro | 63.187.113,79  | 759.621,99   | 378.131,56 | 63.724.290,23 | 155.686,01    | 265.520,25   | 0,24%       | 0,42%        | 0,58%    | 1,28%     | 32,87%   | 1,19% |
| Março     | 63.724.290,23  | 588.321,14   | 320.079,51 | 62.895.088,70 | -1.097.443,16 | -831.922,91  | -1,71%      | -1,30%       | 0,68%    | 1,97%     | -66,24%  | 5,25% |
| Abril     | 62.895.088,70  | 594.837,77   | 294.670,44 | 63.301.082,00 | 105.825,97    | -726.096,94  | 0,17%       | -1,14%       | 0,22%    | 2,20%     | -51,81%  | 2,23% |

Investimentos x Meta Atuarial



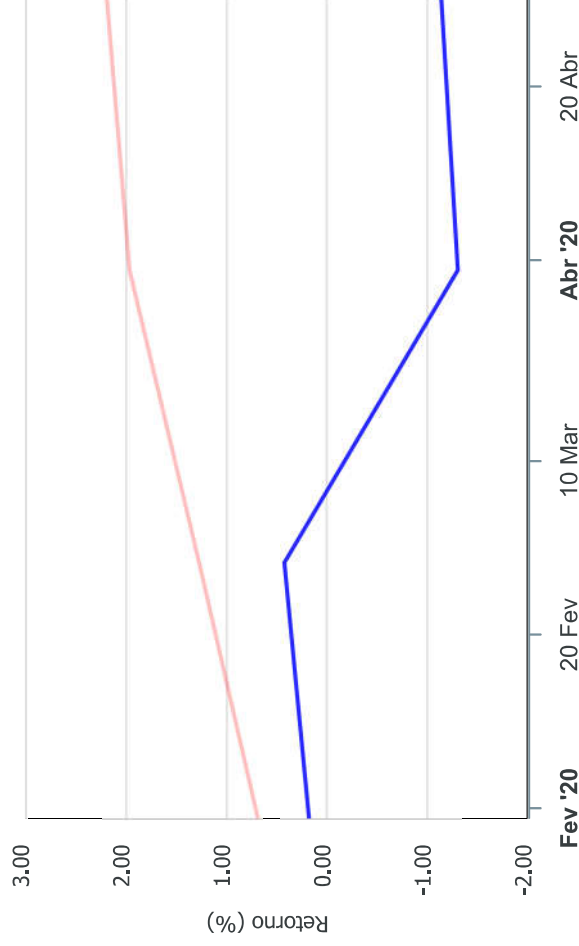
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 |
|-------------------------------------------------------|----------------|------------|------------|---------------|---------------|-------------|------------|-----------|
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA         | 2.058.997,21   | 0,00       | 0,00       | 2.081.378,61  | 22.881,40     | 1,11%       | 1,11%      | 4,96%     |
| BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA             | 2.032.955,06   | 0,00       | 0,00       | 2.053.752,62  | 20.797,56     | 1,02%       | 1,02%      | 5,14%     |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO       | 1.004.637,35   | 0,00       | 0,00       | 1.013.805,64  | 9.168,29      | 0,91%       | 0,91%      | 4,82%     |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 12.825.196,47  | 0,00       | 0,00       | 12.880.761,84 | 55.565,37     | 0,43%       | 0,43%      | 0,49%     |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND... | 10.574.626,69  | 0,00       | 0,00       | 10.619.654,64 | 45.027,95     | 0,43%       | 0,43%      | 2,75%     |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE... | 1.602.781,06   | 0,00       | 0,00       | 1.609.389,47  | 6.608,41      | 0,41%       | 0,41%      | 0,49%     |
| TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5                 | 239.629,38     | 0,00       | 0,00       | 240.584,75    | 955,37        | 0,40%       | 0,40%      | 3,60%     |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC... | 11.296.325,45  | 0,00       | 0,00       | 11.332.892,07 | 36.566,62     | 0,32%       | 0,32%      | 2,68%     |
| CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP        | 5.154.091,08   | 0,00       | 0,00       | 5.170.152,66  | 16.061,58     | 0,31%       | 0,31%      | 0,12%     |
| TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA                           | 671.077,09     | 0,00       | 0,00       | 672.613,86    | 1.536,77      | 0,23%       | 0,23%      | 5,21%     |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA           | 4.133.193,63   | 594.837,77 | 294.670,44 | 4.442.821,15  | 9.460,19      | 0,20%       | 0,22%      | 0,00%     |
| LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR               | 752.411,28     | 0,00       | 0,00       | 750.456,49    | -1.954,79     | -0,26%      | -0,26%     | 0,67%     |
| AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR                    | 2.436.578,20   | 0,00       | 0,00       | 2.402.672,99  | -33.905,21    | -1,39%      | 1,34%      | 0,47%     |
| GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1                             | 1.309.540,22   | 0,00       | 0,00       | 1.268.044,25  | -41.495,97    | -3,17%      | -          | -         |
| Total Renda Fixa                                      | 56.092.040,17  | 594.837,77 | 294.670,44 | 56.539.481,04 | 147.273,54    | 0,26%       |            | 1,79%     |

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 AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES                            | 235.733,66     | 0,00       | 0,00     | 258.087,38   | 22.353,72     | 9,48%       | 9,48%      | 21,11%    |
| CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES                    | 396.029,76     | 0,00       | 0,00     | 432.296,81   | 36.267,05     | 9,16%       | 9,16%      | 25,07%    |
| CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP              | 975.539,39     | 0,00       | 0,00     | 1.001.189,67 | 25.650,28     | 2,63%       | 2,63%      | 4,66%     |
| SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO              | 1.119.700,86   | 0,00       | 0,00     | 1.122.766,86 | 3.066,00      | 0,27%       | 0,27%      | 1,12%     |
| HAZ FII - ATCR11                                      | 1.045.175,70   | 0,00       | 0,00     | 1.044.187,97 | -987,73       | -0,09%      | -0,09%     | -         |
| W7 MULTISTRATÉGIA FIP                                 | 2.459.073,23   | 0,00       | 0,00     | 2.455.211,17 | -3.862,06     | -0,16%      | -          | -         |
| LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO                 | 19.537,90      | 0,00       | 0,00     | 19.474,03    | -63,87        | -0,33%      | -0,33%     | 0,01%     |
| BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ... | 552.258,03     | 0,00       | 0,00     | 428.387,07   | -123.870,96   | -22,43%     | -22,43%    | 21,45%    |
| Total Renda Variável                                  | 6.803.048,53   | 0,00       | 0,00     | 6.761.600,96 | -41.447,57    | -0,61%      |            | 9,62%     |