

Relatório Analítico dos Investimentos em março e 1º trimestre de 2020

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

Carteira consolidada de investimentos - base (Março / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI...	D+1	Não há	16.244.073,74	17,12%	116	2,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	287.211,31	0,30%	352	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	2.578.792,56	2,72%	882	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	12.974.611,95	13,67%	913	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	2.800.592,94	2,95%	962	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVI...	D+2	Não há	736.764,72	0,78%	324	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	10.861.820,04	11,44%	673	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	2.770.036,29	2,92%	1.357	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.477.875,62	1,56%	263	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	3.374.263,26	3,56%	917	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	7.868.614,26	8,29%	733	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	408.344,98	0,43%	276	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	D+1471	Não há	230.928,91	0,24%	26	0,33%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	9.145.191,51	9,64%	282	0,60%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	6.150,14	0,01%	117	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	4.075.921,96	4,29%	169	0,35%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	7.798.648,63	8,22%	118	0,90%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	646.711,62	0,68%	31	0,23%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se ...	Não se aplica	1.817.042,11	1,91%	98	2,14%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se ...	Não se aplica	5.768,22	0,01%		1,10%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Março / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO P...	D+90 ou...	18 meses	789.938,67	0,83%		0,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	795.685,70	0,84%	207	0,14%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	D+4382	Não há	0,01	0,00%		0,00%	Artigo 8º, Inciso III
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	Não se ...	Não se aplica	3.048.054,97	3,21%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se ...	Não se aplica	2.707.941,60	2,85%		7,64%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	D+4	Não há	1.454.730,66	1,53%	93	0,17%	Artigo 9º - A, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			94.905.716,38				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	61.974.656,69	65,30%	20,00%	30,00%	90,00%	23.440.488,05
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	56.943.429,83
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	22.311.897,75	23,51%	10,00%	30,00%	40,00%	15.650.388,80
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	14.235.857,46
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	1.822.810,33	1,92%	0,00%	0,00%	5,00%	2.922.475,49
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	789.938,67	0,83%	0,00%	0,00%	5,00%	3.955.347,15
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.745.285,82
Total Renda Fixa	100,00%	86.899.303,44	91,56%	30,00%	70,00%	220,00%	

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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	795.685,70	0,84%	0,00%	15,00%	20,00%	18.185.457,58
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,01	0,00%	0,00%	10,00%	10,00%	9.490.571,63
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	3.048.054,97	3,21%	0,00%	0,00%	5,00%	1.697.230,85
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	2.707.941,60	2,85%	0,00%	5,00%	5,00%	2.037.344,22
Total Renda Variável	30,00%	6.551.682,28	6,90%	0,00%	30,00%	40,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2020			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	1.454.730,66	1,53%	0,00%	0,00%	5,00%	3.290.555,16
Total Exterior	10,00%	1.454.730,66	1,53%	0,00%	0,00%	5,00%	

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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	31.530.060,67	33,22	0,01
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	30.806.700,77	32,46	0,00
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	23.322.568,83	24,57	0,00
ÍNDIGO DTVM	3.048.054,97	3,21	-
REDITUS INVESTIMENTOS	2.707.941,60	2,85	-
PETRA CAPITAL	1.817.042,11	1,91	0,03
SECURITY ADMINISTRADORA DE REC...	789.938,67	0,83	8,35
BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUT...	646.711,62	0,68	0,01
RJI CORRETORA DE VALORES	230.928,91	0,24	0,04
BRASIL PLURAL	5.768,23	0,01	0,00

Artigo 14º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR)

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2020		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	61.974.656,69	65,30	20,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	22.311.897,75	23,51	10,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	1.822.810,33	1,92	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	789.938,67	0,83	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	795.685,70	0,84	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	0,01	0,00	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	3.048.054,97	3,21	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	2.707.941,60	2,85	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso III	1.454.730,66	1,53	0,00	5,00

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI + 3,50% ao ano (Benchmark)	0,64%	1,87%	1,87%	4,04%	9,16%	20,11%	-	-
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-20,15%	-15,53%	-15,53%	-1,22%	-11,05%	-42,88%	-	0,55%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	-1,21%	0,00%	0,00%	2,46%	9,11%	19,14%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,66%	-0,66%	-0,66%	1,94%	7,78%	17,10%	0,06%	0,03%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,45%	-0,41%	-0,41%	1,98%	8,03%	17,44%	0,05%	0,03%
IRF-M 1+ (Benchmark)	-0,47%	1,44%	1,44%	3,57%	12,96%	24,50%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,45%	1,41%	1,41%	3,50%	12,70%	23,91%	0,11%	0,04%
IMA-B 5+ (Benchmark)	-10,93%	-10,62%	-10,62%	-7,92%	8,24%	26,94%	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-10,89%	-10,58%	-10,58%	-7,80%	8,16%	26,53%	0,25%	0,16%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,60%	1,43%	1,43%	2,83%	6,66%	13,79%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,59%	1,38%	1,38%	2,73%	6,46%	13,39%	0,01%	0,00%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,58%	1,35%	1,35%	2,68%	6,36%	13,19%	0,01%	0,00%
IMA-B 5 (Benchmark)	-1,75%	-0,57%	-0,57%	2,03%	9,34%	19,39%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,80%	-0,64%	-0,64%	1,86%	9,03%	18,84%	0,07%	0,04%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-26,51%	-29,15%	-29,15%	-27,63%	-23,66%	-41,11%	0,42%	0,28%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	-1,78%	-0,59%	-0,59%	1,93%	9,18%	18,81%	0,07%	0,04%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	-16,59%	-16,49%	-16,49%	-15,90%	-12,02%	-25,11%	0,23%	0,17%
IMA-B (Benchmark)	-6,97%	-6,31%	-6,31%	-3,64%	9,14%	24,10%	-	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-7,12%	-6,50%	-6,50%	-3,88%	8,66%	23,30%	0,17%	0,11%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-6,98%	-6,33%	-6,33%	-3,73%	8,93%	23,52%	0,17%	0,11%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	-7,20%	-6,52%	-6,52%	-3,85%	8,81%	23,49%	0,17%	0,11%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	-7,01%	-6,39%	-6,39%	-3,80%	8,76%	23,20%	0,17%	0,11%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-7,10%	-6,46%	-6,46%	-3,94%	8,66%	23,36%	0,17%	0,11%
Selic (Benchmark)	0,34%	1,01%	1,01%	2,26%	5,44%	12,13%	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,01%	0,63%	0,63%	1,80%	4,93%	11,46%	0,00%	0,01%
CDI (Benchmark)	0,34%	1,01%	1,01%	2,26%	5,44%	12,12%	-	-
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	-0,08%	0,33%	0,33%	1,10%	3,09%	-16,11%	-	-
IPCA (Benchmark)	0,07%	0,53%	0,53%	2,31%	3,30%	8,03%	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,25%	-0,97%	-0,97%	-1,49%	-9,59%	-13,76%	0,00%	0,06%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	-0,13%	1,31%	1,31%	3,13%	13,46%	23,65%	0,08%	0,04%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-2,11%	-1,31%	-1,31%	0,48%	7,84%	17,51%	0,09%	0,04%

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

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

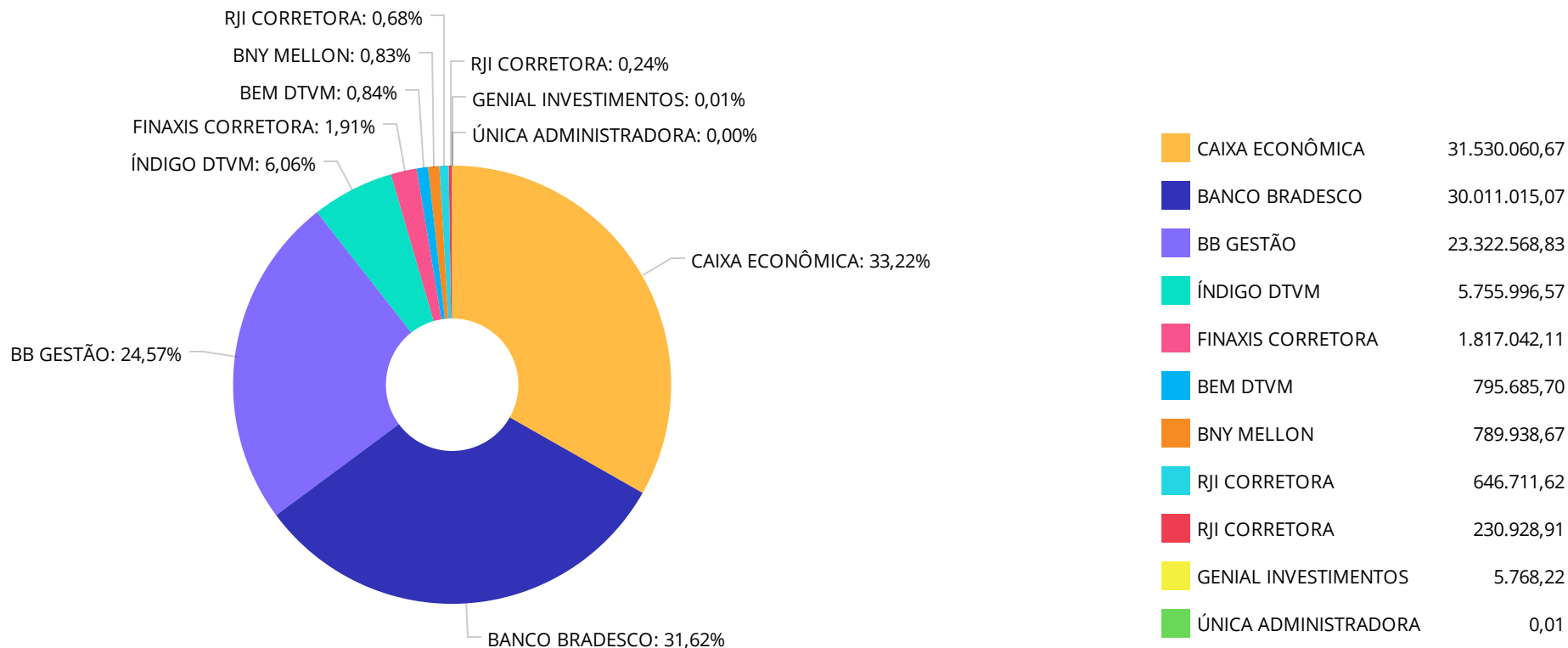
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Março/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 8,50% ao ano (Benchmark)	0,79%	2,57%	2,57%	6,57%	12,16%	27,18%	-	-
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	-	-	-	-	-	-	-	-
IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	0,74%	2,45%	2,45%	6,32%	11,64%	26,01%	-	-
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	-	-	-	-	-	-	-	-
Ibovespa (Benchmark)	-29,90%	-36,86%	-36,86%	-30,29%	-23,47%	-14,46%	-	-
BRADESCO SELECTION FIAÇÕES	-31,54%	-39,89%	-39,89%	-34,30%	-26,99%	-17,46%	0,57%	0,36%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	0,00%	0,28%	0,28%	-23,19%	-13,01%	-31,88%	0,00%	0,25%

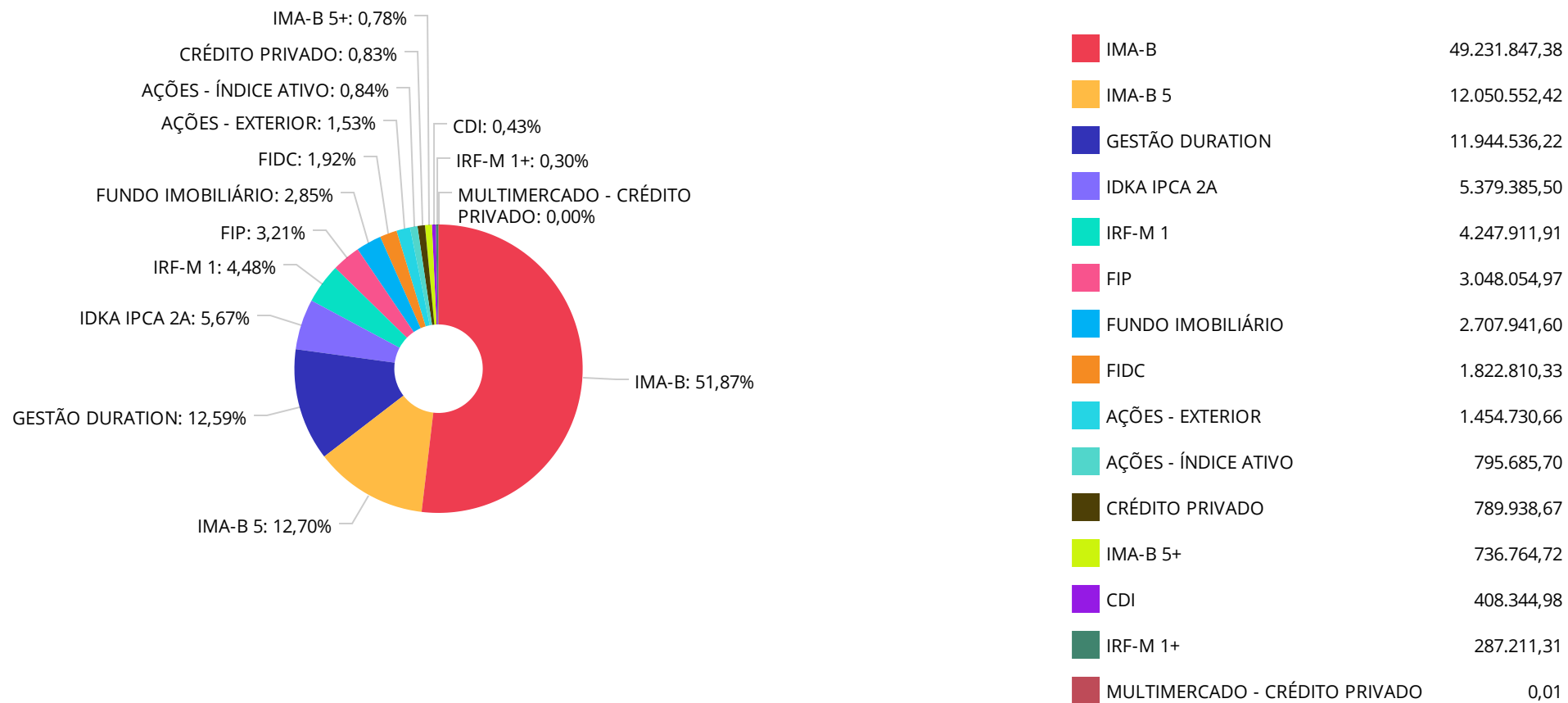
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Março/2020 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	5,47%	5,88%	5,88%	12,08%	26,75%	64,72%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIAÇÕES	6,30%	6,80%	6,80%	12,71%	27,06%	62,46%	0,30%	0,17%

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



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

⚠ ATENÇÃO! Meta Atuarial de **2020** não está cadastrada !!!

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.465.863,24	1.288.711,51	0,00	2.770.036,29	15.461,54	0,56%	0,59%	0,62%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	891.085,52	1.588.702,16	1.014.815,69	1.477.875,62	12.903,63	0,52%	0,58%	0,61%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	408.317,64	0,00	0,00	408.344,98	27,34	0,01%	0,01%	0,18%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRI...	790.582,18	0,00	0,00	789.938,67	-643,51	-0,08%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	7.878.910,04	0,00	0,00	7.868.614,26	-10.295,78	-0,13%	-0,13%	7,65%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.821.650,58	0,00	0,00	1.817.042,11	-4.608,47	-0,25%	-0,25%	0,13%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	288.497,92	0,00	0,00	287.211,31	-1.286,61	-0,45%	-0,45%	11,47%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	2.841.905,47	0,00	0,00	2.800.592,94	-41.312,53	-1,45%	-1,45%	5,46%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	2.622.393,70	0,00	0,00	2.578.792,56	-43.601,14	-1,66%	-1,66%	5,67%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	7.940.225,33	0,00	0,00	7.798.648,63	-141.576,70	-1,78%	-1,78%	7,31%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.436.012,69	0,00	0,00	3.374.263,26	-61.749,43	-1,80%	-1,80%	6,80%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	4.163.873,84	0,00	0,00	4.075.921,96	-87.951,88	-2,11%	-2,11%	9,00%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	14.738.933,51	299.990,63	1.014.815,69	12.974.611,95	-1.049.496,50	-6,98%	-7,10%	16,65%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	11.677.239,70	0,00	0,00	10.861.820,04	-815.419,66	-6,98%	-6,98%	16,57%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC ...	17.468.277,84	0,00	0,00	16.244.073,74	-1.224.204,10	-7,01%	-7,01%	16,55%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.845.853,13	0,00	0,00	9.145.191,51	-700.661,62	-7,12%	-7,12%	16,53%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	6.627,34	0,00	0,00	6.150,14	-477,20	-7,20%	-7,20%	17,34%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	826.771,49	0,00	0,00	736.764,72	-90.006,77	-10,89%	-10,89%	25,25%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	276.845,27	0,00	0,00	230.928,91	-45.916,36	-16,59%	-16,59%	23,39%
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	7.223,72	0,00	0,00	5.768,22	-1.455,50	-20,15%	-	-

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	879.959,91	0,00	0,00	646.711,62	-233.248,29	-26,51%	-26,51%	42,17%
Total Renda Fixa	90.277.050,06	3.177.404,30	2.029.631,38	86.899.303,44	-4.525.519,54	-4,95%		12,55%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	3.048.930,49	0,00	0,00	3.048.054,97	-875,52	-0,03%	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	2.711.935,54	0,00	0,00	2.707.941,60	-3.993,94	-0,15%	0,00%	0,00%
BRADESCO SELECTION FIAÇÕES	1.162.227,24	0,00	0,00	795.685,70	-366.541,54	-31,54%	-31,54%	57,04%
Total Renda Variável	6.923.093,28	0,00	0,00	6.551.682,28	-371.411,00	-5,36%		12,95%

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIAÇÕES	1.368.464,43	0,00	0,00	1.454.730,66	86.266,23	6,30%	6,30%	29,56%
Total Renda Variável	1.368.464,43	0,00	0,00	1.454.730,66	86.266,23	6,30%		29,56%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	7.766.952,99	0,00	0,00	7.868.614,26	101.661,27	1,31%	1,31%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.978.103,67	1.588.702,16	2.116.101,34	1.477.875,62	27.171,13	0,76%	1,35%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.459.208,77	1.288.711,51	4.803,39	2.770.036,29	26.919,40	0,98%	1,38%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	283.223,86	0,00	0,00	287.211,31	3.987,45	1,41%	1,41%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRI...	787.331,49	0,00	0,00	789.938,67	2.607,18	0,33%	0,33%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	405.802,10	0,00	0,00	408.344,98	2.542,88	0,63%	0,63%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	6.579,12	0,00	0,00	6.150,14	-428,98	-6,52%	-6,52%
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	6.828,31	0,00	0,00	5.768,22	-1.060,09	-15,52%	-15,53%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	2.812.059,41	0,00	0,00	2.800.592,94	-11.466,47	-0,41%	-0,41%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	2.596.029,07	0,00	0,00	2.578.792,56	-17.236,51	-0,66%	-0,66%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.834.890,49	0,00	0,00	1.817.042,11	-17.848,38	-0,97%	-0,97%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.396.038,97	0,00	0,00	3.374.263,26	-21.775,71	-0,64%	-0,64%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	276.529,10	0,00	0,00	230.928,91	-45.600,19	-16,49%	-16,49%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	7.844.814,45	0,00	0,00	7.798.648,63	-46.165,82	-0,59%	-0,59%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	4.129.986,54	0,00	0,00	4.075.921,96	-54.064,58	-1,31%	-1,31%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	823.916,06	0,00	0,00	736.764,72	-87.151,34	-10,58%	-10,58%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	912.730,27	0,00	0,00	646.711,62	-266.018,65	-29,15%	-29,15%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.780.611,79	0,00	0,00	9.145.191,51	-635.420,28	-6,50%	-6,50%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	11.596.299,37	0,00	0,00	10.861.820,04	-734.479,33	-6,33%	-6,33%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	12.832.250,37	4.206.933,60	3.097.553,07	12.974.611,95	-967.018,95	-5,68%	-6,46%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC ...	14.462.948,53	3.906.942,99	986.255,13	16.244.073,74	-1.139.562,65	-6,20%	-6,39%
				Total Renda Fixa	-3.880.408,62	-4,27%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre/2020

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	3.039.409,90	0,00	0,00	3.048.054,97	8.645,07	0,28%	-
ECO HEDGE FI MULTIMERCA DO CRÉDITO PRIVADO LP	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	2.720.394,63	0,00	0,00	2.707.941,60	-12.453,03	-0,46%	0,28%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	1.323.782,56	0,00	0,00	795.685,70	-528.096,86	-39,89%	-39,89%
				Total Renda Variável	-531.904,82	-7,51%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre/2020

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FIAÇÕES	1.362.156,91	0,00	0,00	1.454.730,66	92.573,75	6,80%	6,80%
				Total Exterior	92.573,75	6,80%	