

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
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2024	3.398.952,00	1,23%	104	0,75%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	42.304.064,23	15,35%	595	0,40%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	2.148.609,56	0,78%	6	4,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	D+2	Não há	20.049.177,68	7,28%	24.845	1,51%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	49.965.634,31	18,14%	752	0,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	2.194.896,99	0,80%	74	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	D+0	15/08/2024	2.770.083,18	1,01%	93	0,50%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	41.828.384,60	15,18%	1.372	0,39%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENC...	D+0	16/05/2023	2.134.248,42	0,77%	51	0,63%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	15/08/2030	3.211.597,58	1,17%	27	0,91%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	15/08/2022	565.662,30	0,21%	165	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	D+0	15/08/2022	1.547.416,67	0,56%	45	0,79%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+0	15/08/2022	1.319.795,84	0,48%	95	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	16/08/2020	1.178.025,27	0,43%	107	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	20.360.620,00	7,39%	123	1,09%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
SULAMÉRICA ATIVO FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	10.407.732,75	3,78%	2.437	1,32%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	891.280,47	0,32%	316	0,15%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	2.956.064,60	1,07%	669	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP	Não se ...	Não há	0,01	0,00%	23	100,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
AZ LEGAN VALORE FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	D+5	Não há	4.007.573,22	1,45%	3.721	1,84%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '

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%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	275.510.286,54
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	174.616.548,63	63,38%	40,00%	55,00%	100,00%	100.893.737,91
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	275.510.286,54
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	13.775.514,33
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	165.306.171,92
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	165.306.171,92
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	34.615.697,82	12,56%	0,00%	8,00%	40,00%	75.588.416,80
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	40,00%	110.204.114,62
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	55.102.057,31
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	41.326.542,98
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	41.326.542,98
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,01	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	13.775.514,32
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	4.007.573,22	1,45%	0,00%	3,00%	5,00%	9.767.941,11
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	13.775.514,33
Total Renda Fixa	100,00%	213.239.819,68	77,40%	40,00%	70,00%	570,00%	

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%	1,00%	30,00%	82.653.085,96
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	82.653.085,96
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	43.622.824,21	15,83%	0,00%	16,00%	20,00%	11.479.233,10
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	55.102.057,31
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	8.616.306,10	3,13%	0,00%	3,00%	10,00%	18.934.722,55
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	4.380.260,39	1,59%	0,00%	2,00%	5,00%	9.395.253,94
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	5.651.076,16	2,05%	0,00%	3,00%	5,00%	8.124.438,17
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	13.775.514,33
Total Renda Variável	30,00%	62.270.466,86	22,60%	0,00%	27,00%	125,00%	

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%	10,00%	27.551.028,65
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	27.551.028,65
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	27.551.028,65
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	30,00%	

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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	112.203.481,23	40,73	0,02
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	50.641.270,64	18,38	0,00
SUL AMERICA INVESTIMENTOS GEST...	46.425.622,47	16,85	0,14
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	29.698.873,07	10,78	0,00
VINCI PARTNERS	6.232.468,55	2,26	0,03
ITAÚ UNIBANCO	6.207.859,23	2,25	0,00
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	6.069.042,02	2,20	0,01
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	5.782.313,33	2,10	1,31
AZ QUEST INVESTIMENTOS	4.007.573,22	1,45	0,01
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	3.992.759,55	1,45	0,33
RIVIERA INVESTIMENTOS	2.612.147,08	0,95	0,07
LAD CAPITAL	1.418.389,71	0,51	-
BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUT...	218.486,43	0,08	0,00
SOCOPA	0,01	0,00	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 ' a '	0,00	0,00	0,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	174.616.548,63	63,38	40,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	100,00
Artigo 7º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	34.615.697,82	12,56	0,00	40,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	40,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	0,01	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	4.007.573,22	1,45	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	30,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	43.622.824,21	15,83	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	8.616.306,10	3,13	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	4.380.260,39	1,59	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5.651.076,16	2,05	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso I	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º - A, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º - A, Inciso III	0,00	0,00	0,00	10,00

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
IDKA IPCA 3 Anos (Benchmark)	2,93%	3,20%	1,71%	4,71%	11,50%	27,97%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,09%	2,16%	0,78%	3,36%	9,62%	26,68%	0,01%	0,04%
125% do CDI (Benchmark)	0,29%	1,93%	1,08%	2,40%	6,12%	14,64%	-	-
INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP	0,00%	0,00%	0,00%	-	-	-	0,00%	113,87%
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%
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	0,08%	2,22%	0,82%	3,90%	7,97%	19,75%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,50%	2,85%	1,39%	4,35%	11,52%	30,47%	0,02%	0,05%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,42%	2,31%	1,47%	2,74%	6,33%	13,97%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,39%	2,22%	1,42%	2,63%	6,11%	13,55%	0,00%	0,00%
IMA-B (Benchmark)	1,52%	-3,64%	-4,32%	-1,70%	6,68%	31,99%	-	-
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	1,62%	-3,71%	-4,41%	-1,77%	6,53%	31,82%	0,04%	0,10%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	1,45%	-4,97%	-4,50%	-2,76%	5,02%	30,87%	0,04%	0,10%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3,16%	0,19%	1,08%	1,68%	6,95%	19,35%	0,03%	0,07%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3,16%	0,19%	1,08%	1,68%	6,57%	19,48%	0,03%	0,07%

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
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,76%	-4,11%	-3,75%	-3,06%	3,01%	23,34%	0,06%	0,11%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,25%	0,64%	0,03%	1,57%	6,31%	18,52%	0,00%	0,02%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,80%	-2,83%	-0,36%	-2,07%	-0,89%	2,58%	0,01%	0,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,15%	1,75%	0,61%	2,96%	9,25%	25,27%	0,01%	0,04%

CDI (Benchmark)	0,24%	1,54%	0,86%	1,92%	4,87%	11,55%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,33%	1,12%	0,48%	1,48%	4,25%	10,73%	0,00%	0,01%
SULAMÉRICA ATIVO FI RENDA FIXA LP	0,59%	0,99%	0,11%	1,39%	4,63%	11,85%	0,02%	0,02%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,17%	1,19%	0,66%	1,50%	4,00%	9,71%	0,00%	0,00%
AZ LEGAN VALORE FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	0,46%	-4,95%	-5,42%	-4,48%	-2,42%	4,33%	0,01%	0,07%

IPCA (Benchmark)	-0,38%	-0,16%	-0,62%	0,99%	1,88%	6,62%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,10%	2,18%	0,80%	3,39%	9,70%	26,84%	0,01%	0,04%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1,38%	3,85%	2,37%	4,46%	11,99%	27,82%	0,02%	0,03%

Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,99%	-1,00%	0,48%	0,10%	3,60%	12,37%	0,01%	0,06%

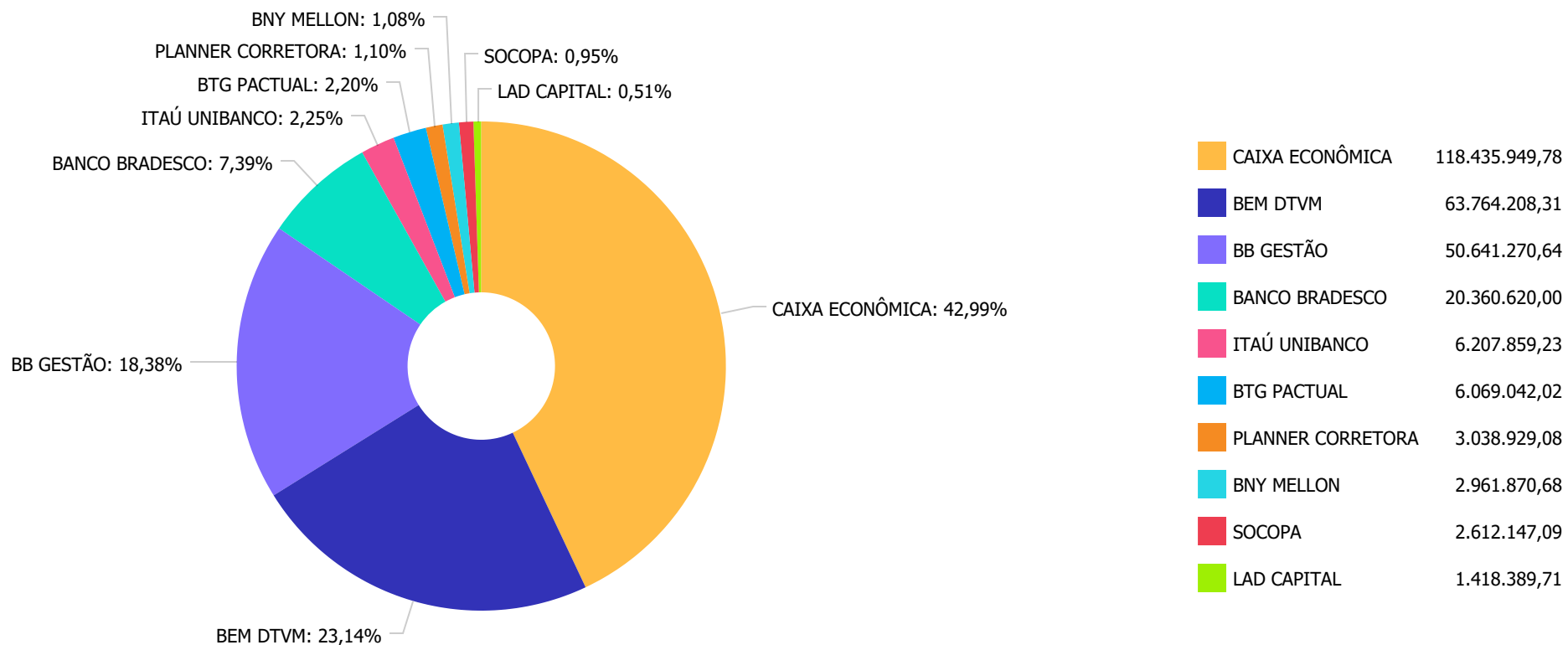
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Maio/2020 - RENDA VARIÁVEL

	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 MULTIESTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	-	-
IPCA + 9,00% ao ano (Benchmark)	0,30%	3,38%	1,51%	5,32%	11,01%	26,59%	-	-
BRASIL FLORESTAL MULTIESTRATÉGIA FIP	-0,12%	-	-	-	32,77%	-19,74%	0,00%	-
IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	0,23%	3,00%	1,28%	4,85%	9,99%	24,29%	-	-
CAIS MAUÁ DO BRASIL FIP	-	-	-	-	-	-	-	-
IDIV (Benchmark)	5,00%	-25,08%	-18,87%	-17,60%	-5,50%	29,54%	-	-
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	7,50%	-20,44%	-16,30%	-13,65%	-1,18%	31,96%	0,16%	0,33%
Ibovespa (Benchmark)	8,57%	-24,42%	-16,10%	-19,25%	-9,92%	13,87%	-	-
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	6,31%	-27,01%	-18,49%	-19,97%	-11,03%	20,50%	0,18%	0,34%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	10,28%	-16,87%	-12,27%	-10,89%	3,46%	41,18%	0,15%	0,41%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	10,49%	-30,82%	-25,66%	-24,20%	-11,82%	14,88%	0,16%	0,46%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	6,15%	-23,90%	-20,88%	-14,68%	2,09%	38,74%	0,14%	0,38%
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	7,86%	-30,73%	-21,10%	-25,75%	-17,66%	4,91%	0,11%	0,38%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	0,26%	1,68%	1,09%	2,01%	6,33%	-	0,00%	0,01%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	5,36%	-28,85%	-20,98%	-23,06%	-6,21%	20,72%	0,17%	0,40%

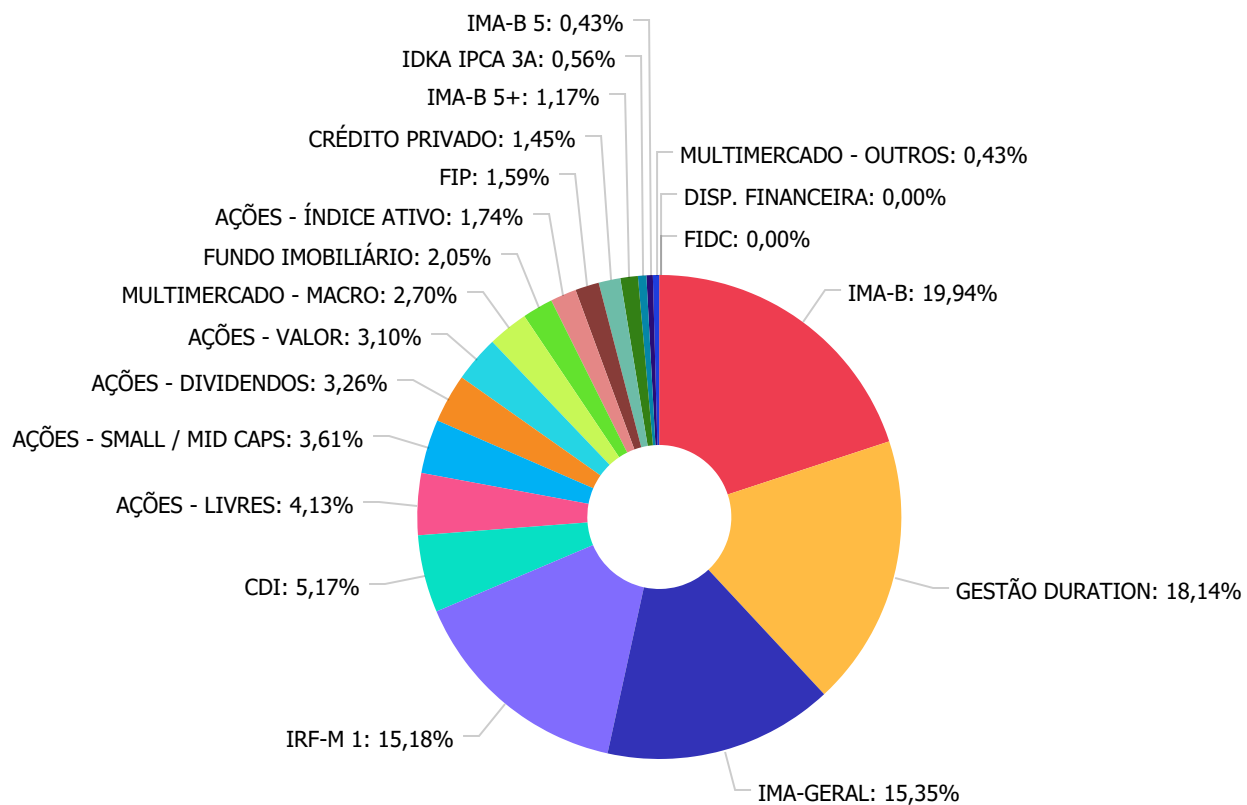
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Maio/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
SMLL (Benchmark)	5,07%	-30,73%	-24,82%	-21,96%	-1,69%	25,45%	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	4,76%	-30,42%	-24,26%	-21,69%	-2,38%	20,38%	0,18%	0,43%
CDI (Benchmark)	0,24%	1,54%	0,86%	1,92%	4,87%	11,55%	-	-
SULAMÉRICA EVOLUTION FI MULTIMERCADO	0,12%	-2,55%	-2,77%	-2,21%	0,47%	7,27%	0,01%	0,03%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	1,91%	-16,05%	-17,59%	-32,34%	72,96%	72,96%	-	-
SOCOPA FII - REIT11	0,00%	0,13%	-4,99%	0,13%	0,13%	0,13%	0,00%	0,31%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	6,18%	-22,20%	-16,86%	-14,08%	2,67%	36,66%	0,14%	0,40%

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



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

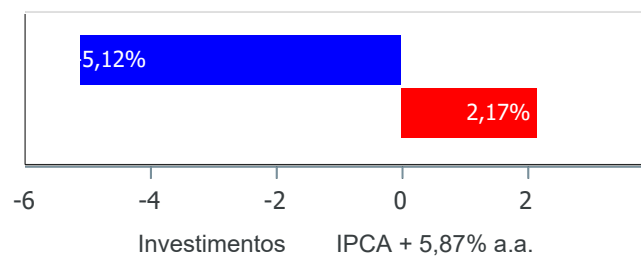


IMA-B	54.942.045,97
GESTÃO DURATION	49.965.634,31
IMA-GERAL	42.304.064,23
IRF-M 1	41.828.384,60
CDI	14.255.077,82
AÇÕES - LIVRES	11.370.261,26
AÇÕES - SMALL / MID CAPS	9.943.165,96
AÇÕES - DIVIDENDOS	8.983.258,53
AÇÕES - VALOR	8.527.221,18
MULTIMERCADO - MACRO	7.441.490,86
FUNDO IMOBILIÁRIO	5.651.076,16
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	4.798.917,28
FIP	4.380.260,39
CRÉDITO PRIVADO	4.007.573,22
IMA-B 5+	3.211.597,58
IDKA IPCA 3A	1.547.416,67
IMA-B 5	1.178.025,27
MULTIMERCADO - OUTROS	1.174.815,24
DISP. FINANCEIRA	642,20

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	279.633.064,13	12.032.253,03	8.125.053,34	284.927.693,58	1.387.429,76	1.387.429,76	0,49%	0,49%	0,71%	0,71%	68,89%	2,33%
Fevereiro	284.927.693,58	14.579.227,95	12.333.746,26	282.974.416,88	-4.198.758,39	-2.811.328,63	-1,46%	-0,98%	0,66%	1,37%	-71,31%	3,95%
Março	282.974.416,88	7.775.636,44	5.669.656,71	263.252.492,77	-21.827.903,84	-24.639.232,47	-7,66%	-8,56%	0,57%	1,95%	-438,69%	14,50%
Abril	263.252.492,77	17.245.251,00	14.782.278,71	270.149.837,87	4.434.372,81	-20.204.859,66	1,67%	-7,04%	0,14%	2,10%	-335,55%	7,72%
Maio	270.149.837,87	5.569.207,21	5.786.026,85	275.510.286,54	5.577.268,31	-14.627.591,35	2,06%	-5,12%	0,07%	2,17%	-235,75%	3,95%

Investimentos x Meta Atuarial



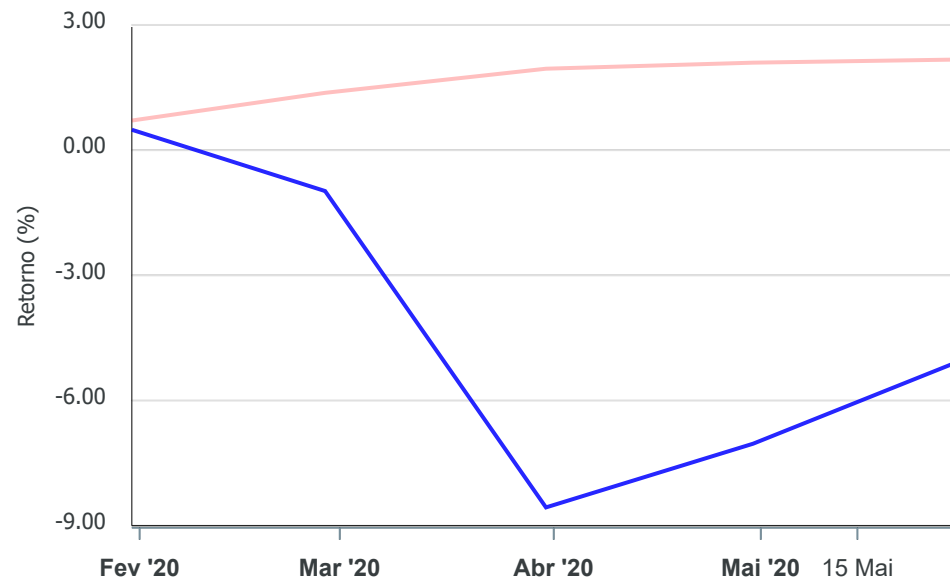
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.127.752,71	0,00	0,00	2.194.896,99	67.144,28	3,16%	3,16%	2,56%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.294.994,00	0,00	0,00	3.398.952,00	103.958,00	3,16%	3,16%	2,56%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	2.135.399,82	0,00	53.611,88	2.134.248,42	52.460,48	2,46%	2,50%	1,82%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.711.749,90	0,00	0,00	2.770.083,18	58.333,28	2,15%	2,15%	1,28%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.292.677,60	0,00	0,00	1.319.795,84	27.118,24	2,10%	2,10%	1,07%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRI...	1.515.727,43	0,00	0,00	1.547.416,67	31.689,24	2,09%	2,09%	1,07%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.106.768,86	0,00	0,00	2.148.609,56	41.840,70	1,99%	1,99%	1,24%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	3.155.932,43	0,00	0,00	3.211.597,58	55.665,15	1,76%	1,76%	5,61%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	20.035.335,14	0,00	0,00	20.360.620,00	325.284,86	1,62%	1,62%	3,77%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	19.763.175,47	0,00	0,00	20.049.177,68	286.002,21	1,45%	1,45%	3,51%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	49.286.114,03	0,00	0,00	49.965.634,31	679.520,28	1,38%	1,38%	1,72%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	558.689,78	0,00	0,00	565.662,30	6.972,52	1,25%	1,25%	0,48%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	41.801.798,34	53.611,88	0,00	42.304.064,23	448.654,01	1,07%	1,07%	1,74%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.168.664,20	0,00	0,00	1.178.025,27	9.361,07	0,80%	0,80%	0,54%
SULAMÉRICA ATIVO FI RENDA FIXA LP	10.347.121,27	0,00	0,00	10.407.732,75	60.611,48	0,59%	0,59%	1,85%
AZ LEGAN VALORE FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	3.989.396,61	0,00	0,00	4.007.573,22	18.176,61	0,46%	0,46%	0,62%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	41.664.635,96	0,00	0,00	41.828.384,60	163.748,64	0,39%	0,39%	0,20%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	2.946.390,75	0,00	0,00	2.956.064,60	9.673,85	0,33%	0,33%	0,08%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	1.103.724,13	5.515.595,33	5.732.414,97	891.280,47	4.375,98	0,07%	0,17%	0,01%
INVEST DUNAS FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR LP	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	0,00%	0,00%

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
Total Renda Fixa	211.006.048,44	5.569.207,21	5.786.026,85	213.239.819,68	2.450.590,88	1,13%		1,80%

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
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	7.717.730,38	0,00	0,00	8.527.221,18	809.490,80	10,49%	10,49%	16,48%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3.555.081,17	0,00	0,00	3.920.432,46	365.351,29	10,28%	10,28%	14,72%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	4.449.246,83	0,00	0,00	4.798.917,28	349.670,45	7,86%	7,86%	11,45%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	5.797.416,83	0,00	0,00	6.232.468,55	435.051,72	7,50%	7,50%	16,26%
ITAÚ DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.587.426,58	0,00	0,00	2.750.789,98	163.363,40	6,31%	6,31%	18,06%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	4.275.154,19	0,00	0,00	4.539.335,79	264.181,60	6,18%	6,18%	13,96%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	3.761.306,19	0,00	0,00	3.992.759,55	231.453,36	6,15%	6,15%	13,79%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	3.281.222,51	0,00	0,00	3.457.069,25	175.846,74	5,36%	5,36%	16,91%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	5.158.117,02	0,00	0,00	5.403.830,17	245.713,15	4,76%	4,76%	18,41%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	2.982.103,43	0,00	0,00	3.038.929,08	56.825,65	1,91%	1,91%	-
SOCOPA FII - REIT11	2.589.571,38	0,00	0,00	2.612.147,08	22.575,70	0,87%	0,00%	0,00%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTI...	1.171.721,21	0,00	0,00	1.174.815,24	3.094,03	0,26%	0,26%	0,17%
SULAMÉRICA EVOLUTION FI MULTIMERCADO	7.432.491,96	0,00	0,00	7.441.490,86	8.998,90	0,12%	0,12%	0,93%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	218.680,08	0,00	0,00	218.486,43	-193,65	-0,09%	-	-
CAIS MAUÁ DO BRASIL FIP	1.419.733,21	0,00	0,00	1.418.389,71	-1.343,50	-0,09%	-	-
BRASIL FLORESTAL MULTISTRATÉGIA FIP	2.746.786,46	0,00	0,00	2.743.384,25	-3.402,21	-0,12%	-0,12%	0,00%
Total Renda Variável	59.143.789,43	0,00	0,00	62.270.466,86	3.126.677,43	5,29%		11,94%