

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

Relatório Analítico dos Investimentos

em junho, 2º trimestre e 1º semestre de 2020

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2020)

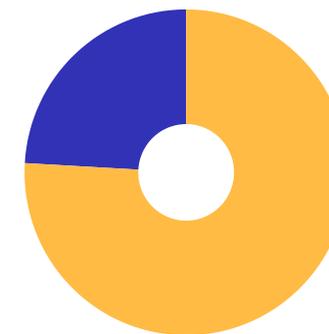
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	32.849.187,22	14,58%	763	0,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	10.016.587,77	4,44%	1.262	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	7.992.051,23	3,55%	901	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2024	8.190.591,54	3,63%	104	1,78%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	13.265.681,45	5,89%	600	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	16.961.967,78	7,53%	956	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	16.377.539,69	7,27%	912	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	15/08/2022	393.319,74	0,17%	165	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	8.691.359,08	3,86%	884	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	2.744.958,86	1,22%	714	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	2.267.625,65	1,01%	453	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	5.886.579,42	2,61%	622	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+0	15/08/2022	4.392.789,05	1,95%	95	0,87%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1 du	Não há	20.094.580,83	8,92%	56	7,91%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	5.331.111,85	2,37%	174	0,45%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.669.283,51	1,63%	742	0,21%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRANCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	260.186,16	0,12%	222	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.508.223,82	1,56%	105	0,36%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	1.910.968,54	0,85%	287	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	6.271.476,60	2,78%	56	0,57%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	4.261.779,27	1,89%	49.451	0,11%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' '
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	12.124.996,51	5,38%	16.254	1,11%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' '
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	6.074.832,43	2,70%	204	0,90%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' '
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	4.841.630,31	2,15%	1.560	0,57%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' '
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	3.984.937,57	1,77%	12.843	0,48%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' '
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	4.129.430,94	1,83%	1.743	1,54%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' '
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	4.211.252,82	1,87%	6.411	0,20%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' '
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	8.301.929,21	3,68%	18.591	0,18%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	4.063.975,08	1,80%	9.851	0,45%	Artigo 8º, Inciso III
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	D+2	Não há	1.085.719,68	0,48%	55	0,24%	Artigo 8º, Inciso III
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII ...	Não se ...	Não se aplica	1.217.142,35	0,54%		0,98%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b ' '
Total para cálculo dos limites da Resolução			225.373.695,96				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	130.030.238,48	57,70%	15,00%	30,00%	90,00%	72.806.087,88
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	135.224.217,58
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	41.045.831,31	18,21%	10,00%	30,00%	40,00%	49.103.647,07
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	33.806.054,39
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	11.268.684,80
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	11.268.684,80
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	11.268.684,80
Total Renda Fixa	100,00%	171.076.069,79	75,91%	25,00%	70,00%	220,00%	



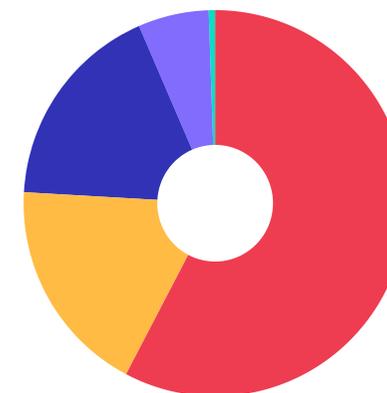
RENDA FIXA 171.076.069,79

RENDA VARIÁVEL 54.297.626,17

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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	39.628.859,85	17,58%	7,00%	10,00%	20,00%	5.445.879,34
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	13.451.623,97	5,97%	7,00%	10,00%	10,00%	9.085.745,63
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	11.268.684,80
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	1.217.142,35	0,54%	0,00%	5,00%	5,00%	10.051.542,45
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	11.268.684,80
Total Renda Variável	30,00%	54.297.626,17	24,09%	14,00%	30,00%	45,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2020			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	22.537.369,60
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA Geral ex-C (Benchmark)	0,90%	1,71%	2,74%	1,71%	6,19%	22,95%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,95%	1,75%	2,96%	1,75%	6,31%	23,30%	0,01%	0,04%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,99%	3,35%	3,35%	3,35%	8,68%	23,17%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,21%	2,88%	3,57%	2,88%	8,18%	21,13%	0,01%	0,03%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,18%	3,12%	3,54%	3,12%	8,19%	21,36%	0,01%	0,03%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,28%	2,60%	1,15%	2,60%	5,98%	13,67%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,26%	2,45%	1,06%	2,45%	5,71%	13,15%	0,00%	0,00%
IMA-B 5 (Benchmark)	1,12%	3,17%	3,77%	3,17%	8,73%	24,75%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,10%	3,04%	3,71%	3,04%	8,51%	24,21%	0,01%	0,04%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,08%	3,08%	3,71%	3,08%	8,59%	24,25%	0,01%	0,04%
IMA-B (Benchmark)	2,05%	-1,66%	4,96%	-1,66%	4,73%	35,13%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,03%	-1,88%	4,91%	-1,88%	4,52%	34,35%	0,03%	0,10%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,24%	1,43%	5,16%	1,43%	5,13%	20,83%	0,02%	0,07%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,99%	1,64%	2,40%	1,64%	6,28%	19,00%	0,00%	0,02%
IRF-M (Benchmark)	0,79%	4,86%	3,39%	4,86%	9,64%	27,08%	-	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,77%	4,68%	3,26%	4,68%	9,51%	26,49%	0,01%	0,02%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,77%	4,73%	3,33%	4,73%	9,54%	26,59%	0,01%	0,02%
Selic (Benchmark)	0,21%	1,75%	0,73%	1,75%	4,58%	11,21%	-	-
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,26%	1,16%	0,53%	1,16%	3,89%	10,37%	0,00%	0,01%
CDI (Benchmark)	0,21%	1,75%	0,73%	1,75%	4,58%	11,21%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,13%	1,24%	0,49%	1,24%	3,50%	8,88%	0,00%	0,00%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,28%	1,52%	0,63%	1,52%	4,27%	10,79%	0,00%	0,01%
IPCA (Benchmark)	0,26%	0,10%	-0,43%	0,10%	2,12%	5,57%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,19%	3,40%	3,79%	3,40%	9,01%	27,95%	0,01%	0,04%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,44%	2,27%	1,12%	2,27%	5,62%	19,25%	0,00%	0,01%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,75%	4,63%	3,27%	4,63%	9,82%	28,20%	0,01%	0,03%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,34%	1,98%	1,27%	1,98%	6,89%	20,42%	0,00%	0,02%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,95%	1,78%	3,13%	1,78%	6,24%	22,63%	0,01%	0,04%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,66%	-	-	-	-	-	0,01%	-

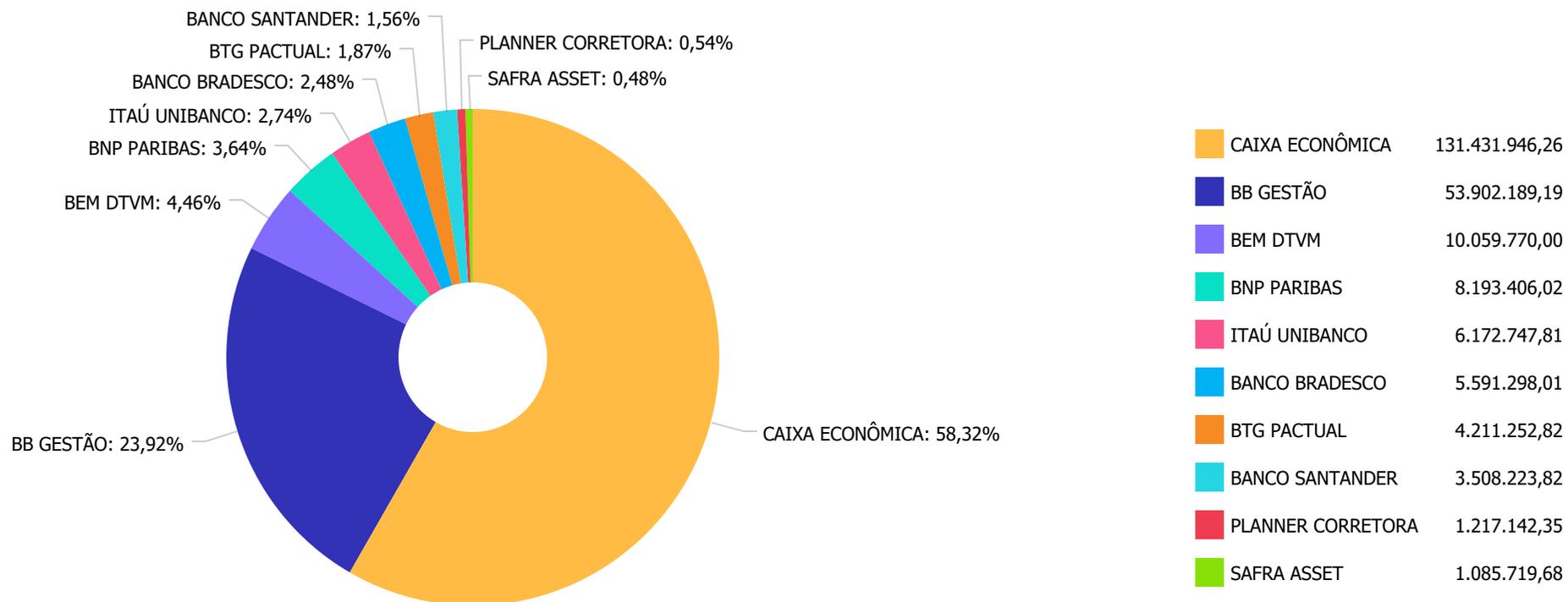
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
S&P 500 (Benchmark)	1,84%	-4,04%	19,95%	-4,04%	4,59%	14,05%	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	0,85%	-6,40%	18,78%	-6,40%	4,13%	17,08%	0,13%	0,23%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	0,91%	-5,88%	18,57%	-5,88%	4,57%	17,16%	0,13%	0,22%
Ibovespa (Benchmark)	8,76%	-17,80%	30,18%	-17,80%	-6,20%	30,64%	-	-
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	10,27%	-8,33%	41,67%	-8,33%	8,82%	58,71%	0,10%	0,42%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	9,88%	-17,76%	33,78%	-17,76%	-3,83%	27,38%	0,12%	0,43%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	7,79%	-15,79%	29,82%	-15,79%	-3,40%	35,64%	0,12%	0,37%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	7,44%	-18,07%	25,17%	-18,07%	-4,94%	52,01%	0,13%	0,34%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	8,95%	-24,53%	25,56%	-24,53%	-13,48%	19,34%	0,12%	0,39%
ITAU DUNAMIS FIC AÇÕES	9,28%	-22,25%	27,83%	-22,25%	-4,41%	36,54%	0,13%	0,40%
SMLL (Benchmark)	14,43%	-20,73%	32,49%	-20,73%	5,76%	49,01%	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	12,89%	-21,45%	31,67%	-21,45%	3,57%	42,14%	0,16%	0,45%
CDI (Benchmark)	0,21%	1,75%	0,73%	1,75%	4,58%	11,21%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,25%	-1,03%	5,40%	-1,03%	6,27%	25,21%	0,01%	0,07%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	2,90%	-44,96%	-33,65%	-44,96%	-60,34%	-71,02%	0,16%	0,44%

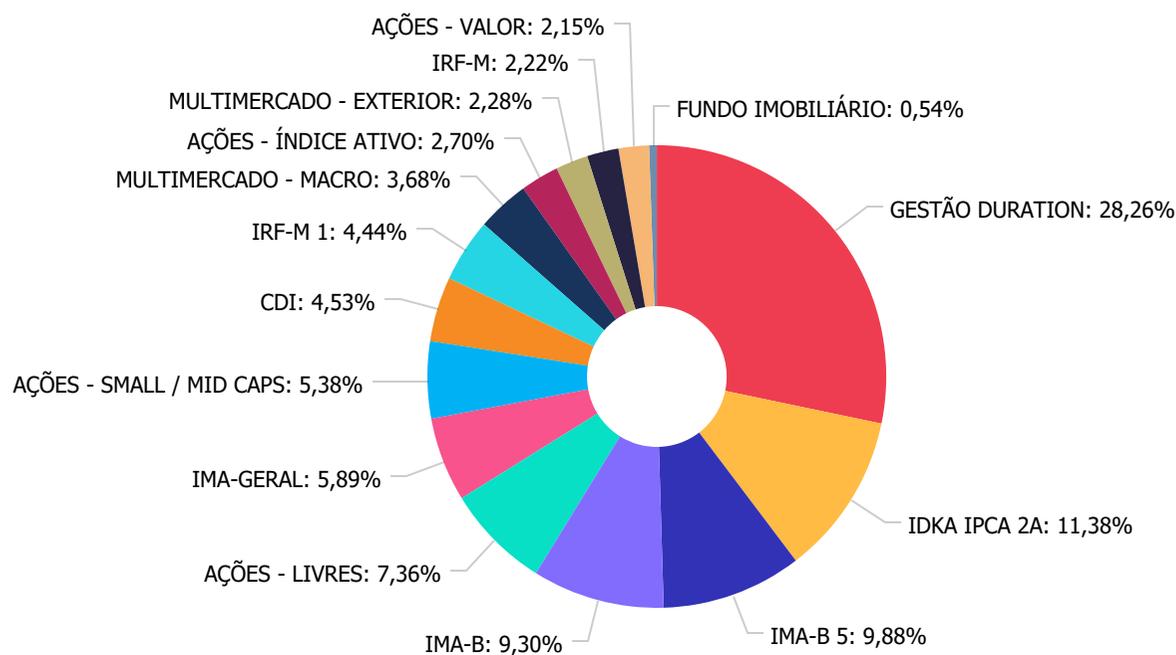
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2020 - RENDA VARIÁVEL

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

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



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

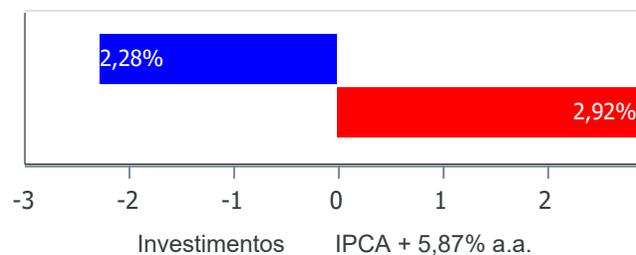


GESTÃO DURATION	63.694.072,26
IDKA IPCA 2A	25.653.326,86
IMA-B 5	22.264.119,11
IMA-B	20.968.751,56
AÇÕES - LIVRES	16.587.400,60
IMA-GERAL	13.265.681,45
AÇÕES - SMALL / MID CAPS	12.124.996,51
CDI	10.200.946,27
IRF-M 1	10.016.587,77
MULTIMERCADO - MACRO	8.301.929,21
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	6.074.832,43
MULTIMERCADO - EXTERIOR	5.149.694,76
IRF-M	5.012.584,51
AÇÕES - VALOR	4.841.630,31
FUNDO IMOBILIÁRIO	1.217.142,35

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

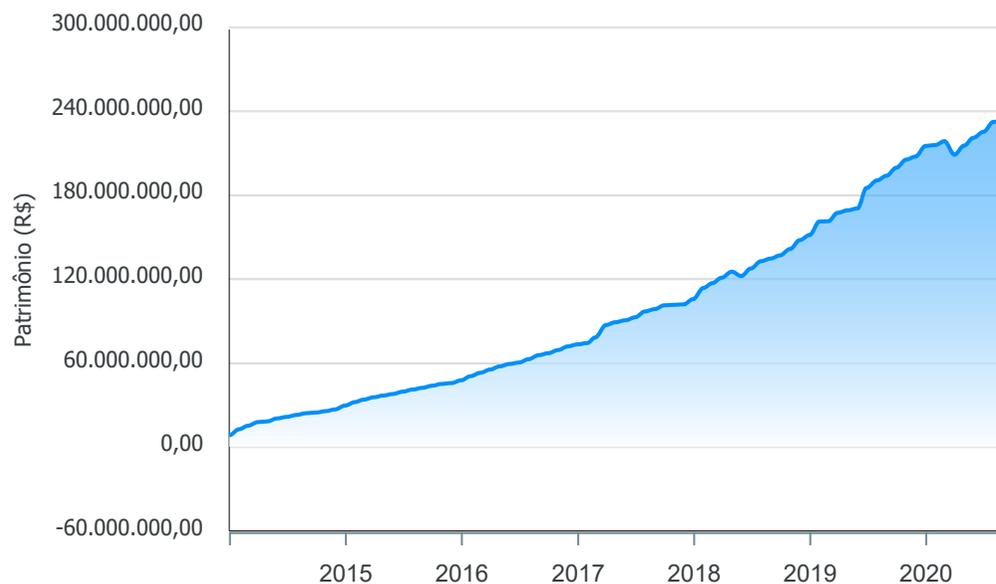
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	215.323.630,36	11.203.932,19	11.215.351,57	215.920.428,04	608.217,06	608.217,06	0,28%	0,28%	0,71%	0,71%	39,77%	2,41%
Fevereiro	215.920.428,04	9.956.730,84	4.002.545,34	218.699.683,91	-3.174.929,63	-2.566.712,57	-1,43%	-1,15%	0,66%	1,37%	-83,87%	4,08%
Março	218.699.683,91	10.741.685,93	5.120.191,38	209.024.961,44	-15.296.217,02	-17.862.929,59	-6,82%	-7,89%	0,57%	1,95%	-404,42%	13,44%
Abril	209.024.961,44	6.785.760,10	4.256.778,82	215.497.107,49	3.943.164,77	-13.919.764,82	1,86%	-6,18%	0,14%	2,10%	-294,55%	6,58%
Mai	215.497.107,49	2.489.423,92	1.212.156,52	221.092.522,53	4.318.147,64	-9.601.617,18	1,99%	-4,31%	0,07%	2,17%	-198,46%	3,53%
Junho	221.092.522,53	29.157.019,70	29.561.002,50	225.373.695,96	4.685.156,23	-4.916.460,95	2,12%	-2,28%	0,74%	2,92%	-77,95%	3,54%

Investimentos x Meta Atuarial



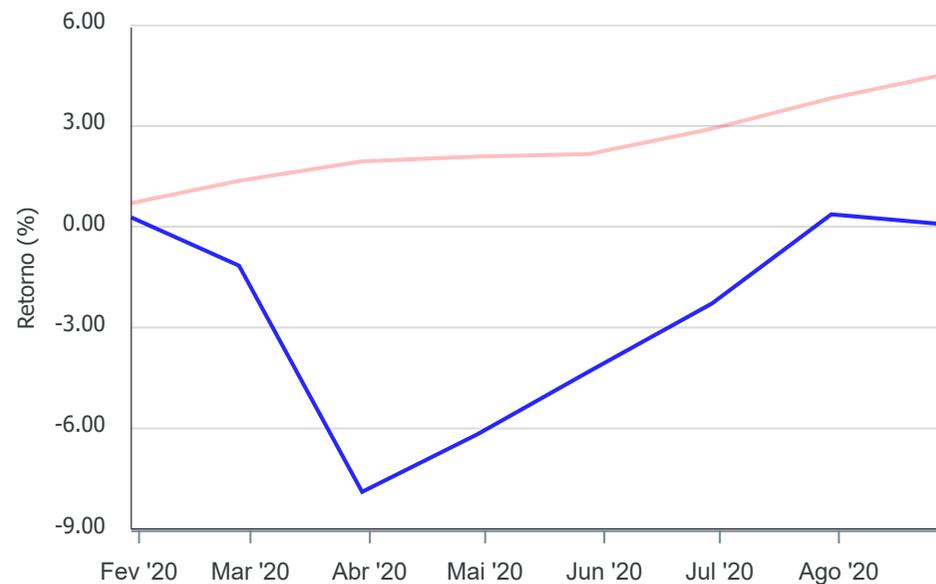
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Junho/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	7.833.409,39	0,00	0,00	7.992.051,23	158.641,84	2,03%	2,03%	2,99%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.090.523,75	0,00	0,00	8.190.591,54	100.067,79	1,24%	1,24%	1,72%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	8.587.195,31	0,00	0,00	8.691.359,08	104.163,77	1,21%	1,21%	0,81%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENC...	4.341.244,98	0,00	0,00	4.392.789,05	51.544,07	1,19%	1,19%	0,85%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	16.764.933,50	0,00	0,00	16.961.967,78	197.034,28	1,18%	1,18%	0,86%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	16.199.568,44	0,00	0,00	16.377.539,69	177.971,25	1,10%	1,10%	0,91%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	5.823.927,19	0,00	0,00	5.886.579,42	62.652,23	1,08%	1,08%	0,89%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	389.455,17	0,00	0,00	393.319,74	3.864,57	0,99%	0,99%	0,45%
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	5.280.938,82	0,00	0,00	5.331.111,85	50.173,03	0,95%	0,95%	1,28%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.141.013,72	0,00	0,00	13.265.681,45	124.667,73	0,95%	0,95%	1,27%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.723.930,80	0,00	0,00	2.744.958,86	21.028,06	0,77%	0,77%	1,17%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	2.250.354,04	0,00	0,00	2.267.625,65	17.271,61	0,77%	0,77%	1,18%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	42.578.024,92	0,00	10.000.000,00	32.849.187,22	271.162,30	0,64%	0,75%	1,17%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,00	20.000.000,00	0,00	20.094.580,83	94.580,83	0,47%	0,66%	1,04%
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	1.902.676,01	0,00	0,00	1.910.968,54	8.292,53	0,44%	0,44%	0,38%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	3.496.440,97	0,00	0,00	3.508.223,82	11.782,85	0,34%	0,34%	0,31%
BRANCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	259.513,71	0,00	0,00	260.186,16	672,45	0,26%	0,26%	0,04%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	9.990.940,28	0,00	0,00	10.016.587,77	25.647,49	0,26%	0,26%	0,05%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	22.322.109,19	0,00	16.090.521,72	6.271.476,60	39.889,13	0,18%	0,28%	0,06%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.975.312,23	1.157.019,70	3.470.480,78	3.669.283,51	7.432,36	0,10%	0,13%	0,01%

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
Total Renda Fixa	177.951.512,42	21.157.019,70	29.561.002,50	171.076.069,79	1.528.540,17	0,77%		1,02%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Junho/2020**FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL**

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	10.740.227,81	0,00	0,00	12.124.996,51	1.384.768,70	12,89%	12,89%	16,18%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	3.899.869,68	0,00	0,00	4.261.779,27	361.909,59	9,28%	9,28%	13,00%
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	5.575.633,88	0,00	0,00	6.074.832,43	499.198,55	8,95%	8,95%	12,00%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.006.662,27	2.000.000,00	0,00	4.211.252,82	204.590,55	5,11%	10,27%	10,27%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	1.945.406,27	2.000.000,00	0,00	4.129.430,94	184.024,67	4,66%	7,79%	11,90%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	1.815.671,62	2.000.000,00	0,00	3.984.937,57	169.265,95	4,44%	9,88%	11,74%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	2.669.690,30	2.000.000,00	0,00	4.841.630,31	171.940,01	3,68%	7,44%	13,19%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	1.182.856,65	0,00	0,00	1.217.142,35	34.285,70	2,90%	2,90%	16,11%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	8.199.190,86	0,00	0,00	8.301.929,21	102.738,35	1,25%	1,25%	1,24%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	1.075.955,94	0,00	0,00	1.085.719,68	9.763,74	0,91%	0,91%	12,57%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	4.029.844,83	0,00	0,00	4.063.975,08	34.130,25	0,85%	0,85%	12,81%
Total Renda Variável	43.141.010,11	8.000.000,00	0,00	54.297.626,17	3.156.616,06	6,17%		11,48%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º 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	41.537.374,11	0,00	10.000.000,00	32.849.187,22	1.311.813,11	3,16%	3,27%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	15.792.082,96	0,00	0,00	16.377.539,69	585.456,73	3,71%	3,71%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	16.381.709,99	0,00	0,00	16.961.967,78	580.257,79	3,54%	3,54%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.788.863,63	0,00	0,00	8.190.591,54	401.727,91	5,16%	5,16%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12.884.038,22	0,00	0,00	13.265.681,45	381.643,23	2,96%	2,96%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	7.618.320,72	0,00	0,00	7.992.051,23	373.730,51	4,91%	4,91%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	8.391.605,31	0,00	0,00	8.691.359,08	299.753,77	3,57%	3,57%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	5.676.083,09	0,00	0,00	5.886.579,42	210.496,33	3,71%	3,71%
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	5.169.396,60	0,00	0,00	5.331.111,85	161.715,25	3,13%	3,13%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENC...	4.232.423,35	0,00	0,00	4.392.789,05	160.365,70	3,79%	3,79%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	19.816.988,92	4.409.516,80	18.069.921,72	6.271.476,60	114.892,60	0,47%	0,63%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	9.911.388,24	0,00	0,00	10.016.587,77	105.199,53	1,06%	1,06%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,00	20.000.000,00	0,00	20.094.580,83	94.580,83	0,47%	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.658.408,19	0,00	0,00	2.744.958,86	86.550,67	3,26%	3,26%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	2.194.619,55	0,00	0,00	2.267.625,65	73.006,10	3,33%	3,33%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	3.464.222,18	0,00	0,00	3.508.223,82	44.001,64	1,27%	1,27%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	1.889.740,28	0,00	0,00	1.910.968,54	21.228,26	1,12%	1,12%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.585.781,53	6.022.686,92	6.960.016,12	3.669.283,51	20.831,18	0,20%	0,49%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	384.105,10	0,00	0,00	393.319,74	9.214,64	2,40%	2,40%
BRANCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	258.827,66	0,00	0,00	260.186,16	1.358,50	0,52%	0,52%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
				Total Renda Fixa	5.037.824,28	2,51%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2020

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	9.208.753,68	0,00	0,00	12.124.996,51	2.916.242,83	31,67%	31,67%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	4.838.280,23	0,00	0,00	6.074.832,43	1.236.552,20	25,56%	25,56%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	3.333.843,16	0,00	0,00	4.261.779,27	927.936,11	27,83%	27,83%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.561.955,14	2.000.000,00	0,00	4.211.252,82	649.297,68	18,23%	41,67%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	3.421.566,89	0,00	0,00	4.063.975,08	642.408,19	18,78%	18,78%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	2.291.597,52	2.000.000,00	0,00	4.841.630,31	550.032,79	12,82%	25,16%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	1.615.289,76	2.000.000,00	0,00	4.129.430,94	514.141,18	14,22%	29,82%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	1.491.252,67	2.000.000,00	0,00	3.984.937,57	493.684,90	14,14%	33,78%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	7.876.481,39	0,00	0,00	8.301.929,21	425.447,82	5,40%	5,40%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	915.676,42	0,00	0,00	1.085.719,68	170.043,26	18,57%	18,57%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	1.834.284,95	0,00	0,00	1.217.142,35	-617.142,60	-33,64%	-33,64%
				Total Renda Variável	7.908.644,36	17,05%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre/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	38.511.116,49	5.000.000,00	12.500.000,00	32.849.187,22	1.838.070,73	4,22%	4,63%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	13.976.596,95	2.500.000,00	0,00	16.961.967,78	485.370,83	2,95%	3,12%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	15.893.996,76	0,00	0,00	16.377.539,69	483.542,93	3,04%	3,04%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.075.023,23	0,00	192.187,35	8.190.591,54	307.755,66	3,81%	1,43%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	24.268.998,63	14.250.531,24	32.547.579,44	6.271.476,60	299.526,17	0,78%	1,52%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	8.447.694,34	0,00	0,00	8.691.359,08	243.664,74	2,88%	2,88%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.037.494,67	0,00	0,00	13.265.681,45	228.186,78	1,75%	1,75%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	8.538.961,14	1.251.000,00	0,00	10.016.587,77	226.626,63	2,31%	2,45%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	5.710.505,77	0,00	0,00	5.886.579,42	176.073,65	3,08%	3,08%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENC...	4.357.790,85	0,00	110.537,30	4.392.789,05	145.535,50	3,34%	3,40%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.622.220,68	0,00	0,00	2.744.958,86	122.738,18	4,68%	4,68%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	2.165.163,30	0,00	0,00	2.267.625,65	102.462,35	4,73%	4,73%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,00	20.000.000,00	0,00	20.094.580,83	94.580,83	0,47%	-
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	5.237.965,45	0,00	0,00	5.331.111,85	93.146,40	1,78%	1,78%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	3.440.096,11	0,00	0,00	3.508.223,82	68.127,71	1,98%	1,98%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	1.868.603,60	0,00	0,00	1.910.968,54	42.364,94	2,27%	2,27%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.808.623,60	11.833.021,44	10.007.260,03	3.669.283,51	34.898,50	0,26%	1,24%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	397.375,14	0,00	10.462,01	393.319,74	6.406,61	1,61%	1,64%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	257.215,87	0,00	0,00	260.186,16	2.970,29	1,15%	1,15%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	8.144.821,08	0,00	0,00	7.992.051,23	-152.769,85	-1,88%	-1,88%

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
				Total Renda Fixa	4.849.279,58	2,19%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre/2020**FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL**

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	1.153.567,81	0,00	0,00	1.085.719,68	-67.848,13	-5,88%	-5,88%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	8.388.474,97	0,00	0,00	8.301.929,21	-86.545,76	-1,03%	-1,03%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	4.341.977,80	0,00	0,00	4.063.975,08	-278.002,72	-6,40%	-6,40%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,00	4.500.000,00	0,00	4.211.252,82	-288.747,18	-6,42%	-8,33%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	0,00	4.500.000,00	0,00	4.129.430,94	-370.569,06	-8,23%	-15,79%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	0,00	4.500.000,00	0,00	3.984.937,57	-515.062,43	-11,45%	-17,76%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	3.500.810,97	2.000.000,00	0,00	4.841.630,31	-659.180,66	-11,98%	-18,07%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	2.211.427,65	0,00	0,00	1.217.142,35	-994.285,30	-44,96%	-44,96%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	5.481.052,54	0,00	0,00	4.261.779,27	-1.219.273,27	-22,25%	-22,25%
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	8.049.448,35	0,00	0,00	6.074.832,43	-1.974.615,92	-24,53%	-24,53%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	15.436.606,61	0,00	0,00	12.124.996,51	-3.311.610,10	-21,45%	-21,45%
				Total Renda Variável	-9.765.740,53	-15,24%	