

# 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 IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	4.620.388,07	7,52%	912	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	4.408.565,68	7,17%	600	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	3.013.382,08	4,90%	956	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	4.016.169,98	6,53%	884	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	1.528.664,42	2,49%	1.262	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	1.733.809,45	2,82%	714	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	3.248.712,56	5,28%	1.364	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	7.617.681,63	12,39%	763	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	2.970.597,61	4,83%	622	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	1.329.919,52	2,16%	453	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3 du	Não há	262.024,72	0,43%	186	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1 du	Não há	356.283,28	0,58%	56	0,14%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	322.174,92	0,52%	91	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.459.689,04	2,37%	275	0,10%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	342.885,76	0,56%	125	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	5.145.037,30	8,37%	174	0,43%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	366.520,65	0,60%	608	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	237.041,42	0,39%	678	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	4.068.439,37	6,62%	287	0,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.102.503,99	1,79%	6.728	0,68%	Artigo 8º, Inciso I, 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
BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.102.503,99	1,79%	6.728	0,68%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	1.315.244,88	2,14%	162	0,07%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	D+4	Não há	507.252,49	0,83%	2.090	0,03%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	D+15	Não há	1.133.567,24	1,84%	56	0,58%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES	D+23	Não há	1.229.188,39	2,00%	32.344	0,08%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	1.083.121,45	1,76%	1.560	0,13%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	1.918.756,30	3,12%	204	0,29%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	2.398.341,93	3,90%	18.591	0,05%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	1.445.354,09	2,35%	64	1,20%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	193.639,07	0,32%	20.627	0,01%	Artigo 8º, Inciso III
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	1.364.586,71	2,22%	203	0,29%	Artigo 8º, Inciso III
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>61.471.243,03</b>				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			<b>133.409,88</b>				Artigo 6º
<b>PL Total</b>			<b>61.604.652,91</b>				

**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 ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	6.147.124,30
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	34.487.891,00	56,10%	20,00%	50,00%	90,00%	20.836.227,73
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	60,00%	36.882.745,82
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	12.560.096,46	20,43%	10,00%	15,00%	40,00%	12.028.400,75
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.073.562,15
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.073.562,15
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.073.562,15
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>47.047.987,46</b>	<b>76,54%</b>	<b>30,00%</b>	<b>70,00%</b>	<b>215,00%</b>	

**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 I, Alínea ' a '	30,00%	1.834.203,02	2,98%	0,00%	3,00%	10,00%	4.312.921,28
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	7.187.130,75	11,69%	5,00%	15,00%	20,00%	5.107.117,86
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	5.401.921,80	8,79%	3,00%	10,00%	10,00%	745.202,50
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	3.073.562,15
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>14.423.255,57</b>	<b>23,46%</b>	<b>8,00%</b>	<b>30,00%</b>	<b>45,00%</b>	

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%	614.712,43
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>1,00%</b>	

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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	25.594.310,89	41,64	0,01
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	20.296.253,70	33,02	0,00
BRANCO ASSET MANAGEMENT	8.645.630,88	14,06	0,00
ITAÚ UNIBANCO	6.935.047,56	11,28	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	10,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	34.487.891,00	56,10	20,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	12.560.096,46	20,43	10,00	40,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	1.834.203,02	2,98	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	7.187.130,75	11,69	5,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	5.401.921,80	8,79	3,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	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 Junho/2020 - RENDA FIXA**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IMA Geral ex-C (Benchmark)</b>	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%
<b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>	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%
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	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%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,26%	2,48%	1,09%	2,48%	5,78%	13,28%	0,00%	0,00%
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	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%
<b>IMA-B (Benchmark)</b>	2,05%	-1,66%	4,96%	-1,66%	4,73%	35,13%	-	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,03%	-1,94%	4,87%	-1,94%	4,50%	34,26%	0,03%	0,10%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	2,09%	-1,70%	5,16%	-1,70%	4,85%	35,14%	0,03%	0,10%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	1,99%	-0,34%	5,20%	-0,34%	6,72%	38,42%	0,03%	0,09%

**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
<b>IRF-M (Benchmark)</b>	0,79%	4,86%	3,39%	4,86%	9,64%	27,08%	-	-
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%

<b>CDI (Benchmark)</b>	0,21%	1,75%	0,73%	1,75%	4,58%	11,21%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,24%	1,37%	0,58%	1,37%	4,03%	10,44%	0,00%	0,01%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,26%	1,37%	0,78%	1,37%	4,06%	10,51%	0,00%	0,01%

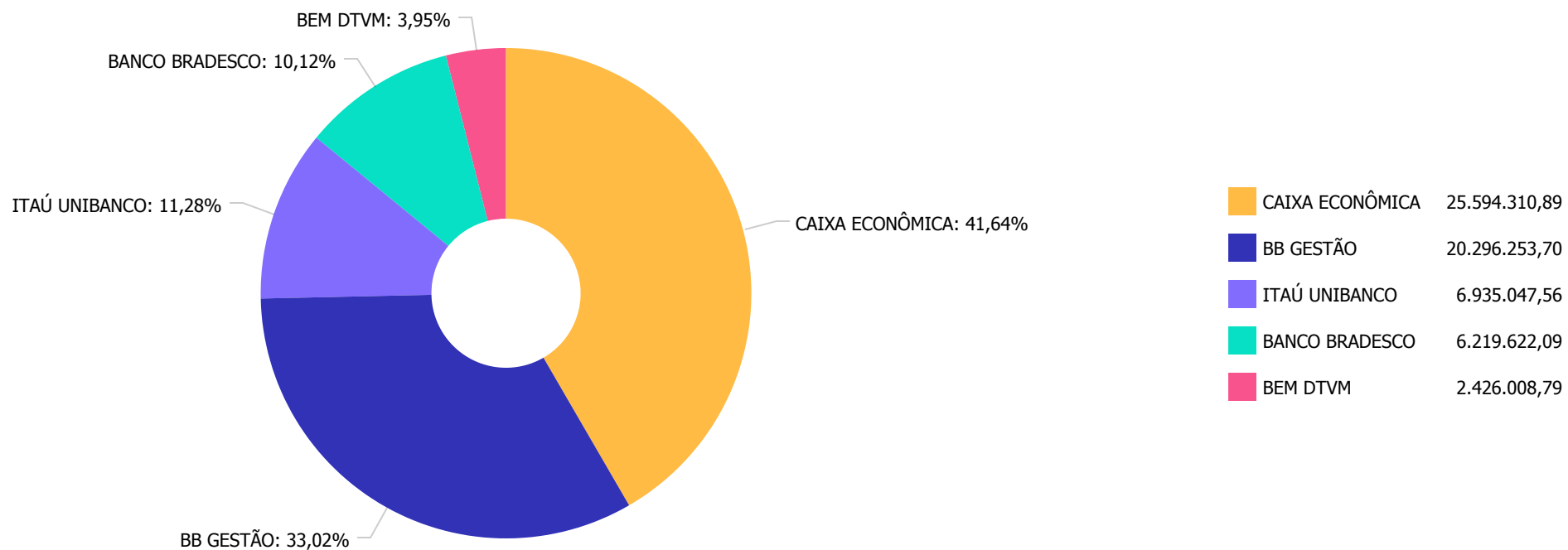
<b>IPCA (Benchmark)</b>	0,26%	0,10%	-0,43%	0,10%	2,12%	5,57%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,44%	2,27%	1,12%	2,27%	5,62%	19,25%	0,00%	0,01%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,75%	4,63%	3,27%	4,63%	9,82%	28,20%	0,01%	0,03%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,95%	1,78%	3,13%	1,78%	6,24%	22,63%	0,01%	0,04%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,95%	-	2,88%	-	-	-	0,01%	-
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,66%	-	-	-	-	-	0,01%	-



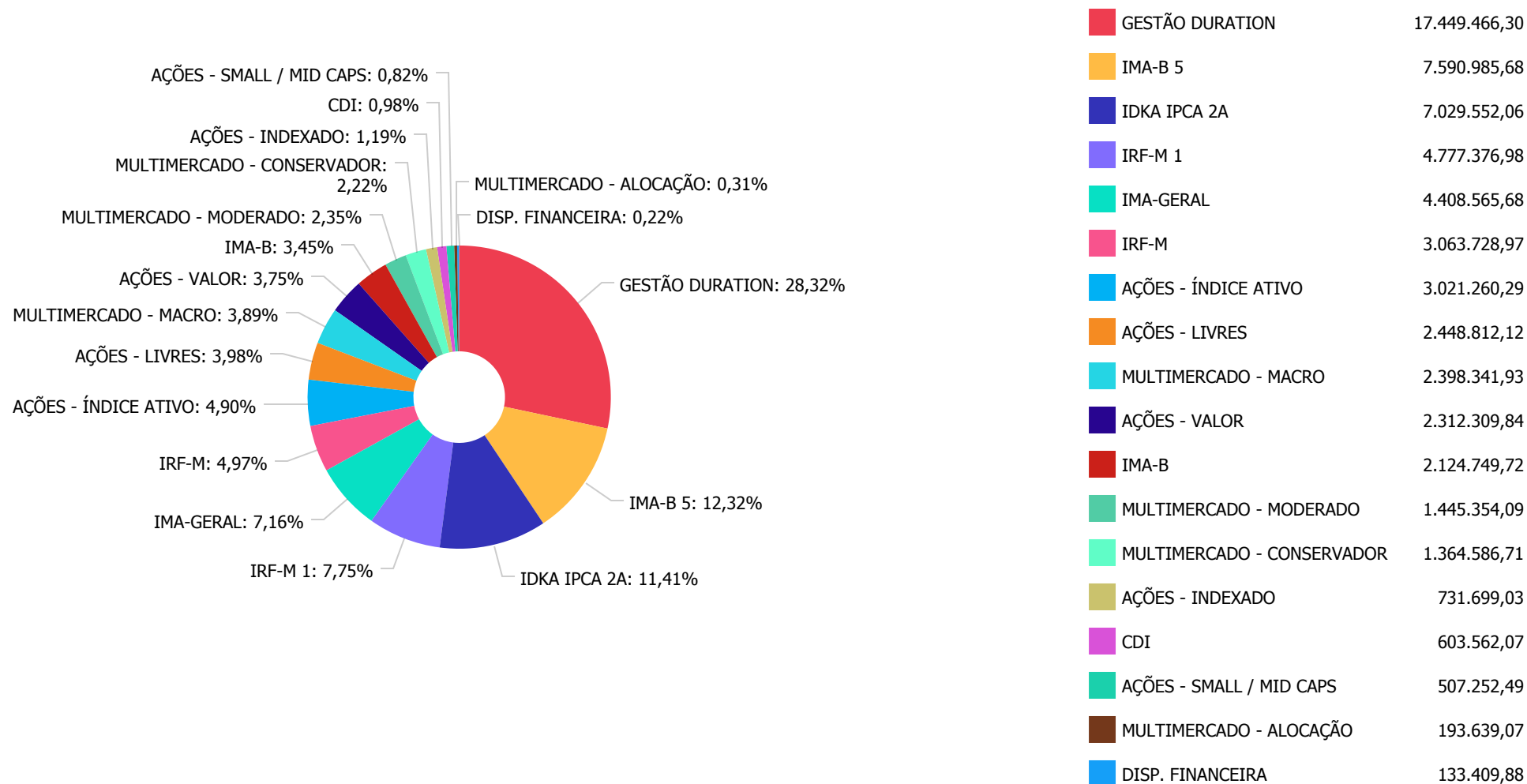
**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2020 - RENDA VARIÁVEL**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>Ibovespa (Benchmark)</b>	8,76%	-17,80%	30,18%	-17,80%	-6,20%	30,64%	-	-
BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	8,70%	-15,75%	31,24%	-15,75%	-3,71%	30,13%	0,12%	0,37%
BRADESCO PLUS IBOVESPA FI AÇÕES	8,72%	-17,94%	30,06%	-17,94%	-6,11%	30,29%	0,13%	0,38%
ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES	11,47%	-14,65%	31,23%	-14,65%	0,85%	42,00%	0,11%	0,39%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	12,10%	-28,51%	33,61%	-28,51%	-13,13%	23,01%	0,15%	0,50%
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%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,21%	1,75%	0,73%	1,75%	4,58%	11,21%	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,46%	0,93%	1,74%	0,93%	5,64%	14,07%	0,01%	0,02%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	2,60%	-3,10%	8,72%	-3,10%	3,61%	18,53%	0,03%	0,11%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,25%	-1,03%	5,40%	-1,03%	6,27%	25,21%	0,01%	0,07%
<b>Não Informado (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	8,58%	-13,79%	30,01%	-13,79%	-	-	0,12%	-
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	2,24%	-1,63%	9,03%	-1,63%	-	-	0,03%	-
<b>Não definido (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	8,50%	-15,58%	31,97%	-15,58%	6,25%	52,81%	0,11%	0,41%

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



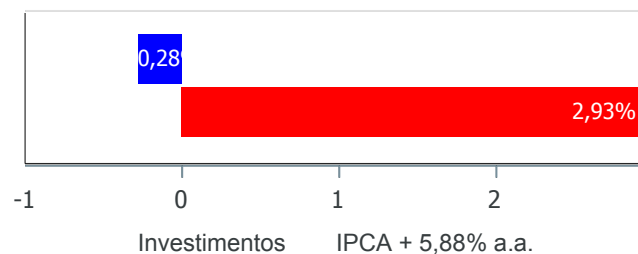
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Junho / 2020)



**Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)**

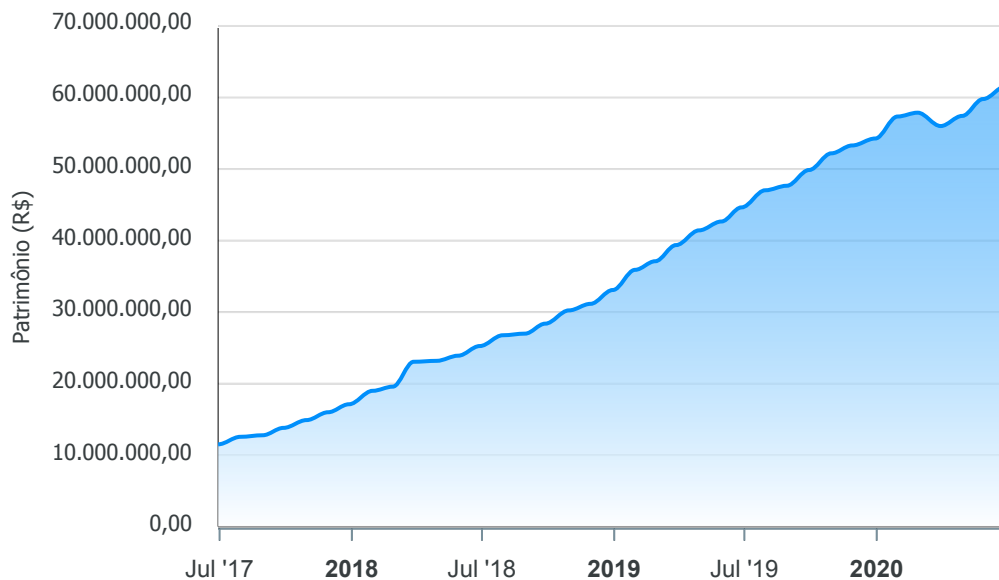
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	54.269.143,32	3.873.858,42	1.050.077,24	57.342.913,30	249.988,80	249.988,80	0,44%	0,44%	0,71%	0,71%	61,58%	1,57%
Fevereiro	57.342.913,30	3.585.545,94	2.597.355,99	57.839.541,87	-491.561,38	-241.572,58	-0,84%	-0,41%	0,66%	1,38%	-29,70%	2,88%
Março	57.839.541,87	1.452.002,00	107.308,09	56.010.479,82	-3.173.755,96	-3.415.328,54	-5,36%	-5,75%	0,57%	1,95%	-294,22%	11,37%
Abril	56.010.479,82	432.509,84	99.539,65	57.248.662,93	905.212,92	-2.510.115,62	1,61%	-4,23%	0,14%	2,10%	-201,67%	5,72%
Mai	57.248.662,93	2.438.209,30	1.135.517,06	59.787.400,05	1.236.044,88	-1.274.070,74	2,11%	-2,21%	0,07%	2,17%	-101,80%	3,17%
Junho	59.787.400,05	1.600.755,44	1.110.311,35	61.471.243,03	1.193.398,89	-80.671,85	1,98%	-0,28%	0,74%	2,93%	-9,47%	2,71%

**Investimentos x Meta Atuarial**



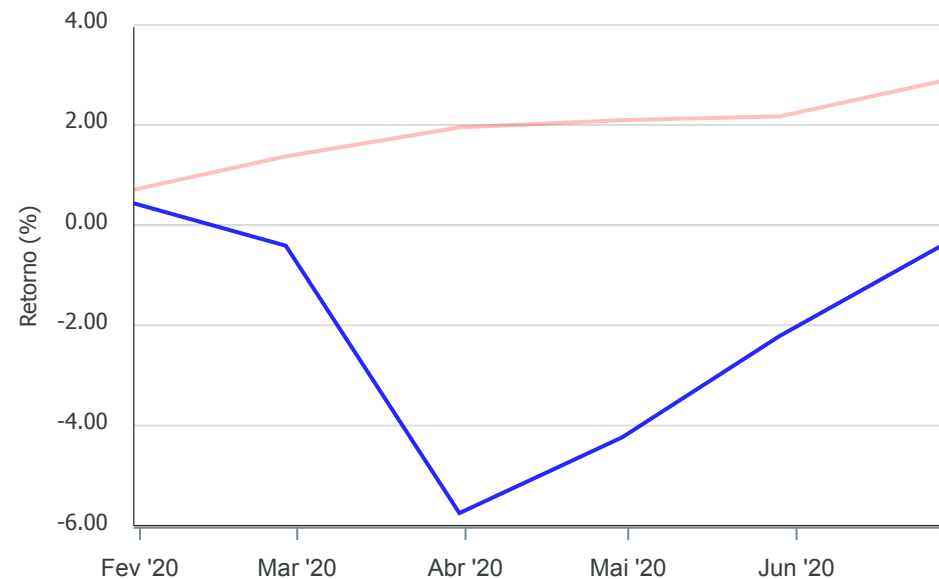
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	335.873,28	0,00	0,00	342.885,76	7.012,48	2,09%	2,09%	3,04%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.430.627,85	0,00	0,00	1.459.689,04	29.061,19	2,03%	2,03%	2,99%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	315.877,92	0,00	0,00	322.174,92	6.297,00	1,99%	1,99%	3,03%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	4.216.388,74	0,00	250.000,00	4.016.169,98	49.781,24	1,18%	1,21%	0,81%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	3.231.972,89	0,00	255.000,00	3.013.382,08	36.409,19	1,13%	1,18%	0,86%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.818.964,11	0,00	250.000,00	4.620.388,07	51.423,96	1,07%	1,10%	0,91%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.187.888,59	0,00	250.000,00	2.970.597,61	32.709,02	1,03%	1,08%	0,89%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	5.096.615,51	0,00	0,00	5.145.037,30	48.421,79	0,95%	0,95%	1,28%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.367.135,03	0,00	0,00	4.408.565,68	41.430,65	0,95%	0,95%	1,27%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.720.527,41	0,00	0,00	1.733.809,45	13.282,04	0,77%	0,77%	1,17%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.319.790,06	0,00	0,00	1.329.919,52	10.129,46	0,77%	0,77%	1,18%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	7.561.003,54	0,00	0,00	7.617.681,63	56.678,09	0,75%	0,75%	1,17%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	294.040,84	60.091,06	0,00	356.283,28	2.151,38	0,61%	0,66%	1,04%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	4.050.784,63	0,00	0,00	4.068.439,37	17.654,74	0,44%	0,44%	0,38%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	0,00	260.992,43	0,00	262.024,72	1.032,29	0,40%	0,95%	1,34%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.232.743,62	7.589,28	0,00	3.248.712,56	8.379,66	0,26%	0,26%	0,05%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.524.750,28	0,00	0,00	1.528.664,42	3.914,14	0,26%	0,26%	0,05%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	407.824,86	4.255,60	46.569,16	366.520,65	1.009,35	0,24%	0,26%	0,03%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	295.074,23	0,00	58.742,19	237.041,42	709,38	0,24%	0,24%	0,03%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>47.407.883,39</b>	<b>332.928,37</b>	<b>1.110.311,35</b>	<b>47.047.987,46</b>	<b>417.487,05</b>	<b>0,87%</b>		<b>0,98%</b>

**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
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.173.298,40	0,00	0,00	1.315.244,88	141.946,48	12,10%	12,10%	14,62%
ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES	1.102.751,74	0,00	0,00	1.229.188,39	126.436,65	11,47%	11,47%	10,81%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	1.761.082,75	0,00	0,00	1.918.756,30	157.673,55	8,95%	8,95%	12,00%
BRADESCO PLUS IBOVESPA FI AÇÕES	672.998,73	0,00	0,00	731.699,03	58.700,30	8,72%	8,72%	12,59%
BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	1.014.311,27	0,00	0,00	1.102.503,99	88.192,72	8,69%	8,69%	11,73%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	375.565,31	100.000,00	0,00	507.252,49	31.687,18	6,66%	8,50%	10,67%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	719.143,91	353.618,15	0,00	1.133.567,24	60.805,18	5,67%	8,58%	12,44%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	720.987,11	314.208,92	0,00	1.083.121,45	47.925,42	4,63%	7,44%	13,19%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	188.732,07	0,00	0,00	193.639,07	4.907,00	2,60%	2,60%	3,49%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	923.682,99	500.000,00	0,00	1.445.354,09	21.671,10	1,52%	2,24%	2,60%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	2.368.661,89	0,00	0,00	2.398.341,93	29.680,04	1,25%	1,25%	1,24%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1.358.300,49	0,00	0,00	1.364.586,71	6.286,22	0,46%	0,46%	0,86%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>12.379.516,66</b>	<b>1.267.827,07</b>	<b>0,00</b>	<b>14.423.255,57</b>	<b>775.911,84</b>	<b>5,69%</b>		<b>8,33%</b>

**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	7.376.204,81	0,00	0,00	7.617.681,63	241.476,82	3,27%	3,27%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	5.188.824,64	0,00	750.000,00	4.620.388,07	181.563,43	3,50%	3,71%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	4.988.966,49	0,00	0,00	5.145.037,30	156.070,81	3,13%	3,13%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	4.120.352,32	0,00	250.000,00	4.016.169,98	145.817,66	3,54%	3,57%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.281.734,71	0,00	0,00	4.408.565,68	126.830,97	2,96%	2,96%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	3.649.858,42	0,00	755.000,00	3.013.382,08	118.523,66	3,25%	3,54%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.106.962,00	0,00	250.000,00	2.970.597,61	113.635,61	3,66%	3,71%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.391.895,58	0,00	0,00	1.459.689,04	67.793,46	4,87%	4,87%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.679.141,09	0,00	0,00	1.733.809,45	54.668,36	3,26%	3,26%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	4.023.244,55	0,00	0,00	4.068.439,37	45.194,82	1,12%	1,12%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.287.102,83	0,00	0,00	1.329.919,52	42.816,69	3,33%	3,33%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.087.612,70	126.938,79	0,00	3.248.712,56	34.161,07	1,06%	1,09%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	326.068,96	0,00	0,00	342.885,76	16.816,80	5,16%	5,16%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	306.249,06	0,00	0,00	322.174,92	15.925,86	5,20%	5,20%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	601.124,74	916.316,54	0,00	1.528.664,42	11.223,14	0,74%	1,06%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	405.552,26	128.564,43	170.798,02	366.520,65	3.201,98	0,60%	0,78%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,00	353.835,32	0,00	356.283,28	2.447,96	0,69%	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	404.764,04	0,00	169.570,04	237.041,42	1.847,42	0,46%	0,58%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	0,00	260.992,43	0,00	262.024,72	1.032,29	0,40%	2,88%
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>1.381.048,81</b>	<b>2,88%</b>	



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
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	1.528.187,11	0,00	0,00	1.918.756,30	390.569,19	25,56%	25,56%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	984.380,98	0,00	0,00	1.315.244,88	330.863,90	33,61%	33,61%
ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES	624.495,22	350.000,00	0,00	1.229.188,39	254.693,17	26,14%	31,23%
BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	527.501,46	350.000,00	0,00	1.102.503,99	225.002,53	25,64%	31,24%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	618.877,88	314.208,92	0,00	1.083.121,45	150.034,65	16,08%	25,16%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	340.482,89	653.618,15	0,00	1.133.567,24	139.466,20	14,03%	30,01%
BRADESCO PLUS IBOVESPA FI AÇÕES	191.160,88	417.000,00	0,00	731.699,03	123.538,15	20,31%	30,06%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	2.275.434,44	0,00	0,00	2.398.341,93	122.907,49	5,40%	5,40%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	308.777,23	100.000,00	0,00	507.252,49	98.475,26	24,09%	31,97%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	866.165,26	500.000,00	0,00	1.445.354,09	79.188,83	5,80%	9,03%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1.341.251,39	0,00	0,00	1.364.586,71	23.335,32	1,74%	1,74%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	178.105,88	0,00	0,00	193.639,07	15.533,19	8,72%	8,72%
				<b>Total Renda Variável</b>	<b>1.953.607,88</b>	<b>15,67%</b>	

**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	7.280.905,42	0,00	0,00	7.617.681,63	336.776,21	4,63%	4,63%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	5.004.242,66	226.350,42	756.650,56	4.620.388,07	146.445,55	2,80%	3,04%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	3.972.896,45	670.566,98	750.000,00	4.016.169,98	122.706,55	2,64%	2,88%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	5.148.663,75	0,00	2.255.000,00	3.013.382,08	119.718,33	2,33%	3,12%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	4.701.170,77	348.710,19	0,00	5.145.037,30	95.156,34	1,88%	1,78%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2.386.822,48	739.848,24	250.000,00	2.970.597,61	93.926,89	3,00%	3,08%
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	3.847.337,20	131.333,12	0,00	4.068.439,37	89.769,05	2,26%	2,27%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.656.283,83	0,00	0,00	1.733.809,45	77.525,62	4,68%	4,68%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.043.157,71	129.399,57	0,00	3.248.712,56	76.155,28	2,40%	2,48%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.332.732,69	0,00	0,00	4.408.565,68	75.832,99	1,75%	1,75%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.269.827,30	0,00	0,00	1.329.919,52	60.092,22	4,73%	4,73%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	413.574,42	1.097.627,14	0,00	1.528.664,42	17.462,86	1,16%	2,45%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	1.094.854,35	167.176,00	905.085,81	366.520,65	9.576,11	0,76%	1,37%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	1.454.897,04	0,00	1.459.689,04	4.792,00	0,33%	-1,94%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,00	353.835,32	0,00	356.283,28	2.447,96	0,69%	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.463,16	452.925,89	219.367,61	237.041,42	2.019,98	0,44%	1,37%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	0,00	260.992,43	0,00	262.024,72	1.032,29	0,40%	-
ITAU IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	0,00	329.403,05	0,00	322.174,92	-7.228,13	-2,19%	-0,34%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	0,00	354.983,81	0,00	342.885,76	-12.098,05	-3,41%	-1,70%
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>1.312.110,05</b>	<b>2,87%</b>	

**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
ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES	0,00	1.178.999,27	0,00	1.229.188,39	50.189,12	4,26%	-14,65%
BRADESCO PLUS IBOVESPA FI AÇÕES	0,00	717.000,00	0,00	731.699,03	14.699,03	2,05%	-17,94%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1.265.275,79	87.000,00	0,00	1.364.586,71	12.310,92	0,91%	0,93%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MUL...	960.899,50	0,00	964.005,40	0,00	3.105,90	0,32%	-
BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	0,00	1.100.000,00	0,00	1.102.503,99	2.503,99	0,23%	-15,75%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	0,00	200.000,00	0,00	193.639,07	-6.360,93	-3,18%	-3,10%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	0,00	1.464.005,40	0,00	1.445.354,09	-18.651,31	-1,27%	-1,62%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	2.423.344,11	0,00	0,00	2.398.341,93	-25.002,18	-1,03%	-1,03%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	416.634,79	753.618,15	0,00	1.133.567,24	-36.685,70	-3,13%	-13,79%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	0,00	600.000,00	0,00	507.252,49	-92.747,51	-15,46%	-15,58%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	666.820,03	564.208,92	0,00	1.083.121,45	-147.907,50	-12,01%	-18,07%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.839.791,52	0,00	0,00	1.315.244,88	-524.546,64	-28,51%	-28,51%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	2.542.445,39	0,00	0,00	1.918.756,30	-623.689,09	-24,53%	-24,53%
<b>Total Renda Variável</b>					<b>-1.392.781,90</b>	<b>-8,81%</b>	