

# CRÉDITO E MERCADO

*Consultoria em Investimentos*  
Relatório Analítico dos Investimentos  
em junho, 2º trimestre e 1º semestre 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 (Junho / 2020)**

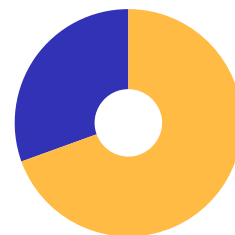
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	16.555.336,36	14,44%	912	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	15/08/2022	1.385.252,09	1,21%	165	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	8.490,20	0,01%	956	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	2.305.081,14	2,01%	884	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	763.047,59	0,67%	670	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	11.991.417,79	10,46%	600	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	13.691.042,36	11,94%	622	0,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	22.296.091,33	19,45%	763	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB SELIC FIC RENDA FIXA LP	D+0	Não há	193,95	0,00%	21.769	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	339.008,76	0,30%	318	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	274.162,53	0,24%	742	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	8.297,36	0,01%	222	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3 du	Não há	10.044.426,40	8,76%	186	1,30%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	2.395.412,62	2,09%	62	2,00%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '
META VALOR FI AÇÕES	D+4	Não há	4.451.507,81	3,88%	166	1,88%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES	D+23	Não há	111.149,86	0,10%	32.344	0,01%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	3.274.586,19	2,86%	2.513	0,43%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BRDESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	D+4	Não há	1.753.421,61	1,53%	2.090	0,09%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	4.802.517,99	4,19%	49.451	0,12%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	114.439,19	0,10%	162	0,00%	Artigo 8º, Inciso II, 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 SMALL CAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	3.071.082,16	2,68%	19.744	0,69%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	4.616.571,02	4,03%	1.560	0,54%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	4.448.983,69	3,88%	20.627	0,19%	Artigo 8º, Inciso III
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	102.036,68	0,09%	950	0,01%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	4.408.892,28	3,85%	18.591	0,10%	Artigo 8º, Inciso III
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII ...	Não se ...	Não se aplica	1.419.999,29	1,24%		1,14%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>114.632.448,25</b>				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			<b>117,00</b>				Artigo 6º
<b>PL Total</b>			<b>114.632.565,25</b>				

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

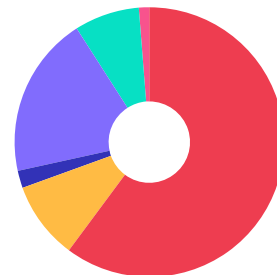
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	68.995.758,86	60,19%	20,00%	30,00%	90,00%	34.173.444,57
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	68.779.468,95
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	10.666.089,00	9,30%	0,00%	30,00%	40,00%	35.186.890,30
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	1,00%	1.146.324,48
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	5.731.622,41
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	5.731.622,41
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>79.661.847,86</b>	<b>69,49%</b>	<b>20,00%</b>	<b>70,00%</b>	<b>201,00%</b>	



RENDA FIXA 79.661.847,86  
RENDA VARIÁVEL 34.970.600,39

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%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	11.463.244,83
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'b'	30,00%	2.395.412,62	2,09%	0,00%	2,00%	10,00%	9.067.832,21
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	22.195.275,83	19,36%	7,00%	11,00%	20,00%	731.213,82
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	8.959.912,65	7,82%	7,00%	10,00%	10,00%	2.503.332,18
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	5,00%	1.419.999,29	1,24%	0,00%	5,00%	5,00%	4.311.623,12
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>34.970.600,39</b>	<b>30,51%</b>	<b>14,00%</b>	<b>30,00%</b>	<b>55,00%</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%	10,00%	11.463.244,83
<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>10,00%</b>	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	53.726.801,43	46,87	0,01
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	48.142.277,03	42,00	0,00
ITAÚ UNIBANCO	5.130.143,72	4,48	0,00
META ASSET MANAGEMENT	4.451.507,81	3,88	1,86
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	1.761.718,97	1,54	0,00
ZION INVEST	1.419.999,29	1,24	0,29

**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 '	68.995.758,86	60,19	20,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	10.666.089,00	9,30	0,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	1,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	0,00	0,00	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	10,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	2.395.412,62	2,09	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	22.195.275,83	19,36	7,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	8.959.912,65	7,82	7,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	1.419.999,29	1,24	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso III	0,00	0,00	0,00	10,00

## Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de 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>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 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,02%	-1,75%	4,90%	-1,75%	4,74%	34,48%	0,03%	0,10%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,99%	1,64%	2,40%	1,64%	6,28%	19,00%	0,00%	0,02%
<b>Selic (Benchmark)</b>	0,21%	1,75%	0,73%	1,75%	4,58%	11,21%	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,26%	1,16%	0,53%	1,16%	3,89%	10,37%	0,00%	0,01%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,21%	1,75%	0,73%	1,75%	4,58%	11,21%	-	-
BB SELIC FIC RENDA FIXA LP	0,19%	1,58%	0,65%	1,58%	4,25%	10,48%	0,00%	0,00%

## 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
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,13%	1,24%	0,49%	1,24%	3,50%	8,88%	0,00%	0,00%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,15%	1,34%	0,54%	1,34%	3,73%	9,38%	0,00%	0,00%
<b>IPCA (Benchmark)</b>	0,26%	0,10%	-0,43%	0,10%	2,12%	5,57%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,75%	4,63%	3,27%	4,63%	9,82%	28,20%	0,01%	0,03%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,95%	-	2,88%	-	-	-	0,01%	-



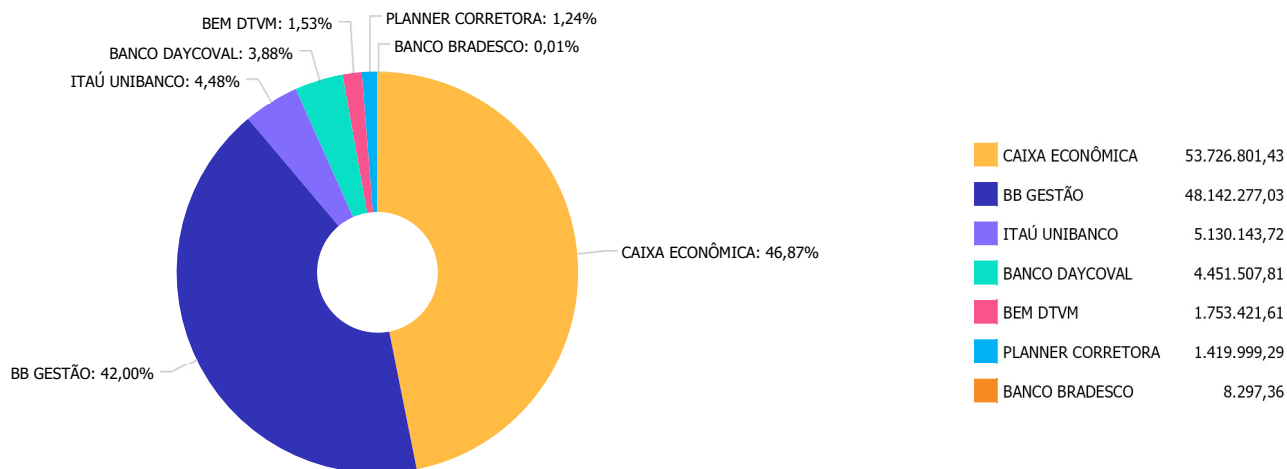
## Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>S&amp;P 500 (Benchmark)</b>	1,84%	-4,04%	19,95%	-4,04%	4,59%	14,05%	-	-
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	1,14%	-5,94%	19,24%	-5,94%	4,67%	17,37%	0,13%	0,23%
<b>IBX (Benchmark)</b>	8,97%	-17,39%	30,39%	-17,39%	-4,94%	34,21%	-	-
META VALOR FI AÇÕES	10,81%	-12,77%	48,26%	-12,77%	6,67%	45,62%	0,14%	0,50%
<b>Ibovespa (Benchmark)</b>	8,76%	-17,80%	30,18%	-17,80%	-6,20%	30,64%	-	-
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	9,11%	-17,71%	29,45%	-17,71%	-6,12%	29,35%	0,12%	0,37%
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%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	9,28%	-22,25%	27,83%	-22,25%	-4,41%	36,54%	0,13%	0,40%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	9,88%	-14,67%	33,22%	-14,67%	5,17%	-	0,12%	0,41%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,21%	1,75%	0,73%	1,75%	4,58%	11,21%	-	-
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>	-	-	-	-	-	-	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	2,90%	-44,96%	-33,65%	-44,96%	-60,34%	-71,02%	0,16%	0,44%

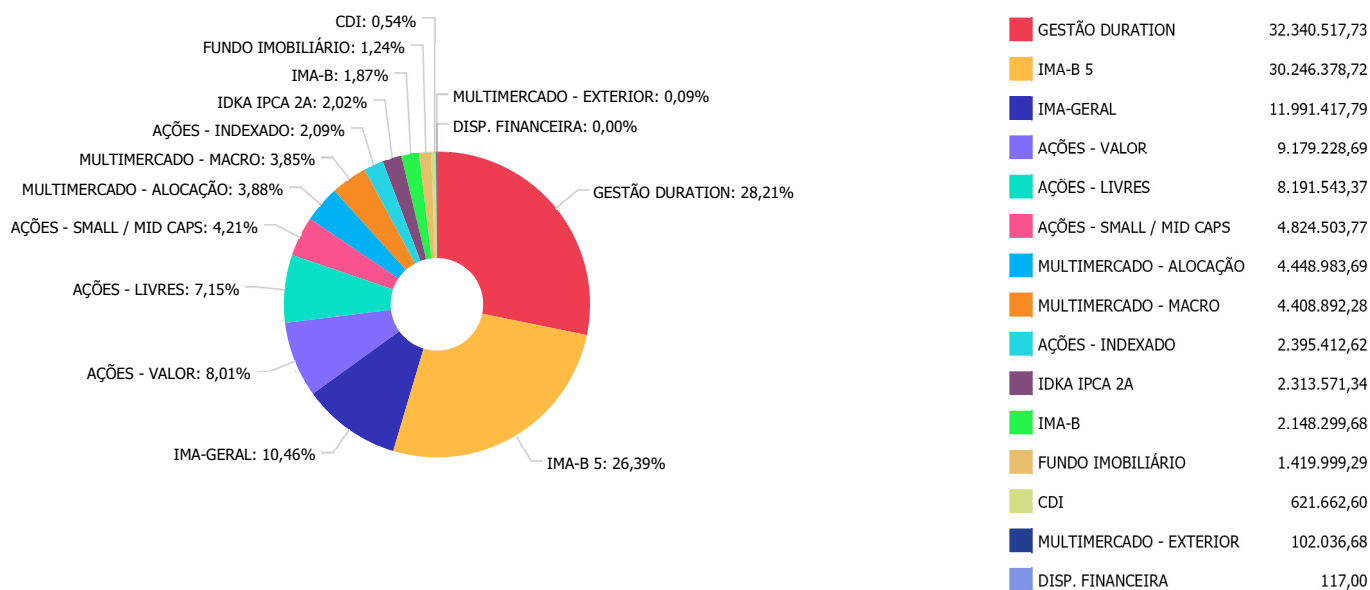
## Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>Não definido (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
BRDESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	8,50%	-15,58%	31,97%	-15,58%	6,25%	52,81%	0,11%	0,41%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	13,39%	-25,06%	30,82%	-25,06%	-2,60%	34,82%	0,16%	0,47%

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



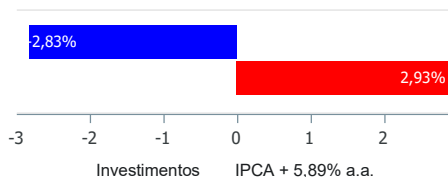
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Junho / 2020)



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	118.774.638,21	3.850.036,31	1.946.775,43	120.932.764,64	254.865,55	254.865,55	0,21%	0,21%	0,71%	0,71%	29,66%	2,53%
Fevereiro	120.932.764,64	4.884.210,82	5.422.959,57	118.467.898,01	-1.926.117,88	-1.671.252,33	-1,59%	-1,38%	0,66%	1,38%	-100,55%	4,31%
Março	118.467.898,01	558.759,03	1.254.563,18	108.169.559,58	-9.602.534,28	-11.273.786,61	-8,11%	-9,38%	0,57%	1,96%	-479,36%	15,74%
Abril	108.169.559,58	2.652.475,83	3.004.186,59	110.074.269,05	2.256.420,23	-9.017.366,38	2,09%	-7,49%	0,14%	2,10%	-356,05%	7,97%
Mai	110.074.269,05	1.083.137,88	1.611.194,66	112.097.150,06	2.550.937,79	-6.466.428,59	2,32%	-5,34%	0,07%	2,18%	-245,35%	4,55%
Junho	112.097.150,06	15.149.646,01	15.595.101,87	114.632.448,25	2.980.754,05	-3.485.674,54	2,66%	-2,83%	0,74%	2,93%	-96,37%	4,01%

Investimentos x Meta Atuarial



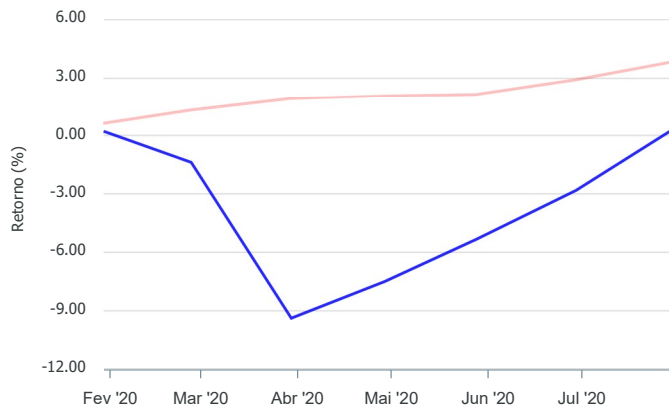
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	747.942,53	0,00	0,00	763.047,59	15.105,06	2,02%	2,02%	2,98%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	2.277.455,31	0,00	0,00	2.305.081,14	27.625,83	1,21%	1,21%	0,81%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	8.391,58	0,00	0,00	8.490,20	98,62	1,18%	1,18%	0,86%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	17.980.314,11	0,00	1.610.753,50	16.555.336,36	185.775,75	1,03%	1,10%	0,91%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	14.542.338,36	0,00	1.000.000,00	13.691.042,36	148.704,00	1,02%	1,08%	0,89%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	1.371.641,26	0,00	0,00	1.385.252,09	13.610,83	0,99%	0,99%	0,45%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	21.827.525,65	0,00	10.000.000,00	11.991.417,79	163.892,14	0,75%	0,95%	1,27%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	22.130.200,95	0,00	0,00	22.296.091,33	165.890,38	0,75%	0,75%	1,17%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	0,00	10.000.000,00	0,00	10.044.426,40	44.426,40	0,44%	0,95%	1,34%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	8.275,91	0,00	0,00	8.297,36	21,45	0,26%	0,26%	0,04%
BB SELIC FIC RENDA FIXA LP	193,59	0,00	0,00	193,95	0,36	0,19%	0,19%	0,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	411.186,18	1.390.734,89	1.528.577,16	274.162,53	818,62	0,05%	0,13%	0,01%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	24.164,18	1.770.239,02	1.455.771,21	339.008,76	376,77	0,02%	0,14%	0,01%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>81.329.629,61</b>	<b>13.160.973,91</b>	<b>15.595.101,87</b>	<b>79.661.847,86</b>	<b>766.346,21</b>	<b>0,81%</b>		<b>1,09%</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
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	2.708.422,83	0,00	0,00	3.071.082,16	362.659,33	13,39%	13,39%	16,45%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	102.088,45	0,00	0,00	114.439,19	12.350,74	12,10%	12,10%	14,62%
ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES	99.716,78	0,00	0,00	111.149,86	11.433,08	11,47%	11,47%	10,81%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	2.980.224,23	0,00	0,00	3.274.586,19	294.361,96	9,88%	9,88%	12,39%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	4.394.688,96	0,00	0,00	4.802.517,99	407.829,03	9,28%	9,28%	13,00%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	2.195.416,00	0,00	0,00	2.395.412,62	199.996,62	9,11%	9,11%	12,43%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	1.616.051,15	0,00	0,00	1.753.421,61	137.370,46	8,50%	8,50%	10,67%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	4.296.951,17	0,00	0,00	4.616.571,02	319.619,85	7,44%	7,44%	13,19%
META VALOR FI AÇÕES	2.202.504,76	1.988.672,10	0,00	4.451.507,81	260.330,95	6,21%	10,81%	13,96%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	1.379.999,31	0,00	0,00	1.419.999,29	39.999,98	2,90%	2,90%	16,11%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	4.336.242,28	0,00	0,00	4.448.983,69	112.741,41	2,60%	2,60%	3,49%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	4.354.331,20	0,00	0,00	4.408.892,28	54.561,08	1,25%	1,25%	1,24%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	100.883,33	0,00	0,00	102.036,68	1.153,35	1,14%	1,14%	13,28%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30.767.520,45</b>	<b>1.988.672,10</b>	<b>0,00</b>	<b>34.970.600,39</b>	<b>2.214.407,84</b>	<b>6,76%</b>		<b>10,67%</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	21.589.316,03	0,00	0,00	22.296.091,33	706.775,30	3,27%	3,27%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	17.528.035,59	0,00	1.610.753,50	16.555.336,36	638.054,27	3,64%	3,71%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	21.400.683,44	0,00	10.000.000,00	11.991.417,79	590.734,35	2,76%	2,96%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	14.881.084,33	0,00	1.725.000,00	13.691.042,36	534.958,03	3,59%	3,71%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	2.225.581,86	0,00	0,00	2.305.081,14	79.499,28	3,57%	3,57%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	0,00	10.000.000,00	0,00	10.044.426,40	44.426,40	0,44%	2,88%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	727.435,72	0,00	0,00	763.047,59	35.611,87	4,90%	4,90%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	1.352.798,59	0,00	0,00	1.385.252,09	32.453,50	2,40%	2,40%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	173.574,03	2.795.663,17	2.697.572,03	274.162,53	2.497,36	0,08%	0,49%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	417.334,32	0,00	410.852,00	8.490,20	2.007,88	0,48%	3,54%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	3.963,12	1.825.924,45	1.491.305,59	339.008,76	426,78	0,02%	0,54%
BB SELIC FIC RENDA FIXA LP	0,00	275.000,00	275.000,00	193,95	193,95	0,07%	0,65%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	8.254,04	0,00	0,00	8.297,36	43,32	0,52%	0,52%
			<b>Total Renda Fixa</b>		<b>2.667.682,29</b>	<b>2,80%</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
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	3.756.844,45	0,00	0,00	4.802.517,99	1.045.673,54	27,83%	27,83%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	3.688.398,85	0,00	0,00	4.616.571,02	928.172,17	25,16%	25,16%
META VALOR FI AÇÕES	1.646.120,60	1.988.672,10	0,00	4.451.507,81	816.715,11	22,47%	48,26%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	2.458.039,56	0,00	0,00	3.274.586,19	816.546,63	33,22%	33,22%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	2.347.503,40	0,00	0,00	3.071.082,16	723.578,76	30,82%	30,82%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	1.328.663,15	0,00	0,00	1.753.421,61	424.758,46	31,97%	31,97%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	0,00	2.000.000,00	0,00	2.395.412,62	395.412,62	19,77%	29,45%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	4.092.098,63	0,00	0,00	4.448.983,69	356.885,06	8,72%	8,72%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	6.147.908,14	0,00	2.000.000,00	4.408.892,28	260.984,14	4,25%	5,40%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	85.650,79	0,00	0,00	114.439,19	28.788,40	33,61%	33,61%
ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES	84.696,85	0,00	0,00	111.149,86	26.453,01	31,23%	31,23%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	85.575,16	0,00	0,00	102.036,68	16.461,52	19,24%	19,24%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	2.139.998,93	0,00	0,00	1.419.999,29	-719.999,64	-33,64%	-33,64%
<b>Total Renda Variável</b>					<b>5.120.429,78</b>	<b>17,15%</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	21.310.385,42	0,00	0,00	22.296.091,33	985.705,91	4,63%	4,63%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	22.028.067,01	0,00	6.028.394,34	16.555.336,36	555.663,69	2,52%	3,04%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	16.087.720,87	0,00	2.845.000,00	13.691.042,36	448.321,49	2,79%	3,08%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	21.655.578,14	0,00	10.000.000,00	11.991.417,79	335.839,65	1,55%	1,75%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	2.240.457,52	0,00	0,00	2.305.081,14	64.623,62	2,88%	2,88%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	0,00	10.000.000,00	0,00	10.044.426,40	44.426,40	0,44%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	1.399.534,94	0,00	36.846,65	1.385.252,09	22.563,80	1,61%	1,64%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	263.094,97	4.905.944,46	4.903.229,30	274.162,53	8.352,40	0,16%	1,24%
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	102.659,54	0,00	104.800,76	0,00	2.141,22	2,09%	5,44%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	547.417,72	0,00	540.852,00	8.490,20	1.924,48	0,35%	3,12%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	34.747,49	2.403.848,56	2.100.658,25	339.008,76	1.070,96	0,04%	1,34%
BB SELIC FIC RENDA FIXA LP	0,00	275.000,00	275.000,00	193,95	193,95	0,07%	1,58%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	8.202,64	0,00	0,00	8.297,36	94,72	1,15%	1,15%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	776.625,12	0,00	0,00	763.047,59	-13.577,53	-1,75%	-1,75%
			<b>Total Renda Fixa</b>		<b>2.457.344,76</b>	<b>2,36%</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 (%)	(%) Insttit
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA FI AÇÕES	0,00	2.000.000,00	0,00	2.395.412,62	395.412,62	19,77%	-17,71%
ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES	0,00	104.800,76	0,00	111.149,86	6.349,10	6,06%	-14,65%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	108.476,38	0,00	0,00	102.036,68	-6.439,70	-5,94%	-5,94%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	160.079,89	0,00	0,00	114.439,19	-45.640,70	-28,51%	-28,51%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	6.547.539,56	0,00	2.000.000,00	4.408.892,28	-138.647,28	-2,12%	-1,03%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	4.591.468,61	0,00	0,00	4.448.983,69	-142.484,92	-3,10%	-3,10%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	2.077.112,42	0,00	0,00	1.753.421,61	-323.690,81	-15,58%	-15,58%
META VALOR FI AÇÕES	2.797.740,21	1.988.672,10	0,00	4.451.507,81	-334.904,50	-7,00%	-12,77%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	0,00	4.000.000,00	0,00	3.274.586,19	-725.413,81	-18,14%	-14,67%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	5.634.666,25	0,00	0,00	4.616.571,02	-1.018.095,23	-18,07%	-18,07%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	1.646.570,95	2.500.000,00	0,00	3.071.082,16	-1.075.488,79	-25,94%	-25,06%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	2.579.998,71	0,00	0,00	1.419.999,29	-1.159.999,42	-44,96%	-44,96%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	6.176.493,85	0,00	0,00	4.802.517,99	-1.373.975,86	-22,25%	-22,25%
				<b>Total Renda Variável</b>	<b>-5.943.019,30</b>	<b>-14,53%</b>	