

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)

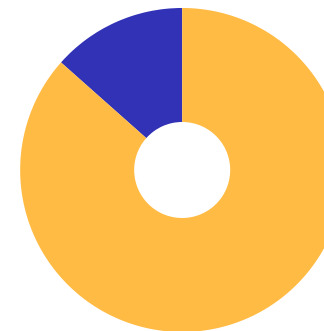
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	15.297.672,61	13,70%	622	0,38%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	10.791.809,35	9,67%	763	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	10.539.665,80	9,44%	670	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	2.543.895,36	2,28%	600	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	8.060.371,38	7,22%	340	0,41%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	266,88	0,00%	714	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA...	D+1	Não há	173.807,97	0,16%	135	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	4.438.331,57	3,98%	1.262	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	423.104,97	0,38%	901	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	16.525.411,16	14,80%	884	0,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	D+0	Não há	3.531.497,11	3,16%	305	0,12%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
UM INVEST IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	244.396,12	0,22%	6	14,95%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	6.574.199,34	5,89%	608	0,27%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	118.927,05	0,11%	434	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	5.272.390,31	4,72%	678	0,10%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	4.998.865,33	4,48%	275	0,34%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CDB - BANCO RENNER	S/Info		317.476,50	0,28%		0,00%	Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	Não pos...	1008 dias úteis	6.767.485,21	6,06%	8	18,54%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	2.757.672,38	2,47%	2.513	0,36%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	6.227.885,76	5,58%	18.591	0,14%	Artigo 8º, Inciso III

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	3.327.899,57	2,98%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	S/Info	Não se aplica	1.871.265,84	1,68%		3,86%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII ...	Não se ...	Não se aplica	824.515,90	0,74%		0,66%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
Total para cálculo dos limites da Resolução			111.628.813,47				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			161.927,86				Artigo 6º
PL Total			111.790.741,33				

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%	68.794.337,05	61,63%	20,00%	37,00%	100,00%	42.834.476,42
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	3.531.497,11	3,16%	0,00%	11,00%	30,00%	29.957.146,93
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	17.208.778,15	15,42%	5,00%	15,00%	40,00%	27.442.747,24
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	317.476,50	0,28%	0,00%	0,50%	10,00%	10.845.404,85
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	6.767.485,21	6,06%	0,00%	6,50%	5,00%	-1.186.044,54
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	5.581.440,67
Total Renda Fixa	100,00%	96.619.574,02	86,55%	25,00%	70,00%	190,00%	

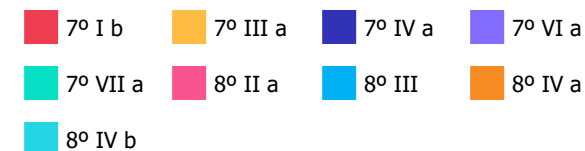
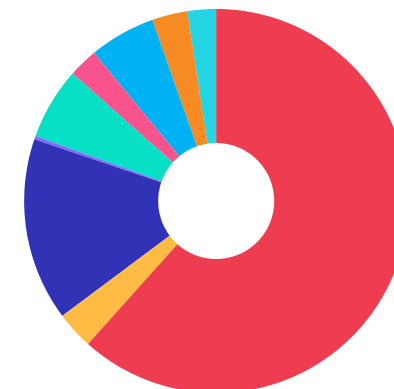


RENDA FIXA 96.619.574,02

RENDA VARIÁVEL 15.009.239,45

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%	30,00%	33.488.644,04
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	2.757.672,38	2,47%	0,00%	15,00%	20,00%	19.568.090,31
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	6.227.885,76	5,58%	0,00%	5,00%	10,00%	4.934.995,59
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	3.327.899,57	2,98%	0,00%	4,00%	5,00%	2.253.541,10
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	2.695.781,74	2,41%	0,00%	4,00%	5,00%	2.885.658,93
Total Renda Variável	30,00%	15.009.239,45	13,45%	0,00%	30,00%	70,00%	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	61.092.116,02	54,73	0,00
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	37.183.658,31	33,31	0,01
GRAPHEN INVESTIMENTOS	6.767.485,21	6,06	0,11
A5 CAPITAL PARTNERS	3.327.899,57	2,98	-
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	1.871.265,84	1,68	0,42
ZION INVEST	824.515,90	0,74	0,17
UM ASSET	244.396,12	0,22	-

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 '	68.794.337,05	61,63	20,00	100,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	3.531.497,11	3,16	0,00	30,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	17.208.778,15	15,42	5,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	317.476,50	0,28	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	6.767.485,21	6,06	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	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 II, Alínea ' a '	2.757.672,38	2,47	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	6.227.885,76	5,58	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	3.327.899,57	2,98	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	2.695.781,74	2,41	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso III	0,00	0,00	0,00	5,00

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 IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,88%	1,50%	2,65%	1,50%	6,00%	22,30%	0,01%	0,03%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,95%	1,75%	2,96%	1,75%	6,31%	23,30%	0,01%	0,04%
IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	0,91%	3,93%	1,44%	3,93%	10,29%	23,06%	-	-
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	-7,57%	-2,69%	-8,06%	-2,69%	1,33%	14,32%	0,04%	0,12%
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%
IMA-B 5+ (Benchmark)	2,84%	-5,26%	5,99%	-5,26%	1,68%	43,55%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,83%	-5,44%	5,88%	-5,44%	1,57%	42,12%	0,05%	0,15%
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%	-	-
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%
UM INVEST IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,30%	0,72%	-0,93%	0,72%	5,34%	17,76%	0,00%	0,03%

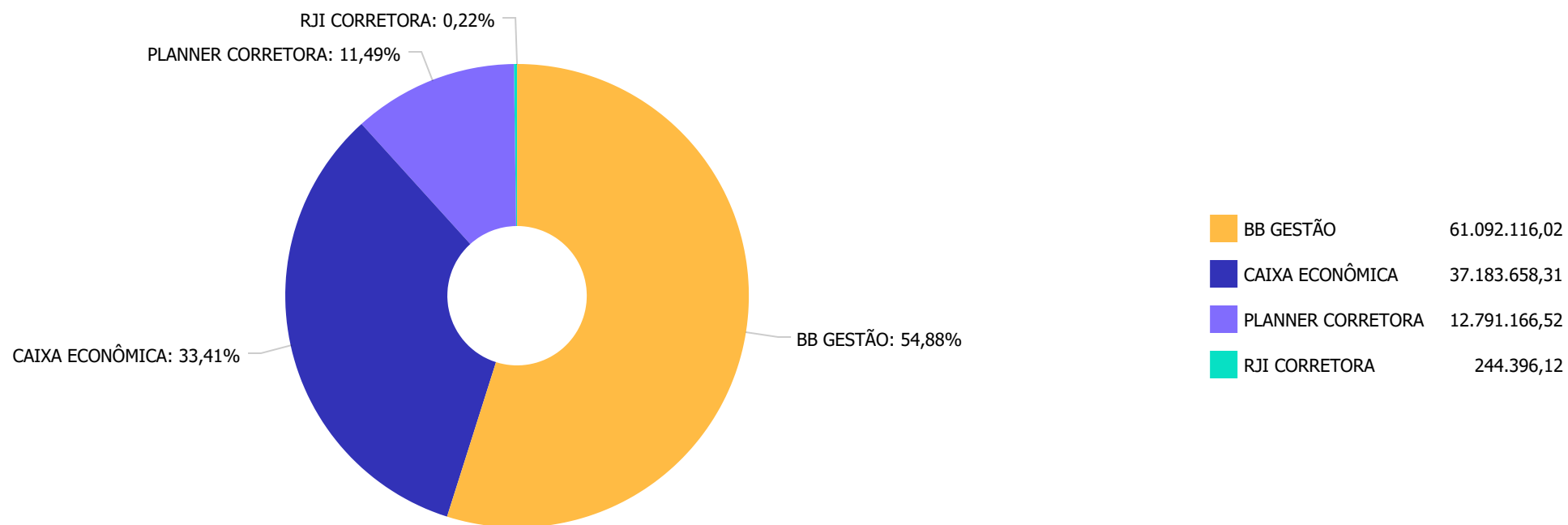
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2020 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA-B (Benchmark)	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%
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%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	2,03%	-1,86%	4,83%	-1,86%	4,56%	34,21%	0,03%	0,10%
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%
CDB - BANCO RENNER	-	-	-	-	-	-	-	-
IRF-M (Benchmark)	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%
CDI (Benchmark)	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%
IPCA (Benchmark)	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%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,22%	1,83%	0,78%	1,83%	4,64%	11,15%	0,00%	0,00%

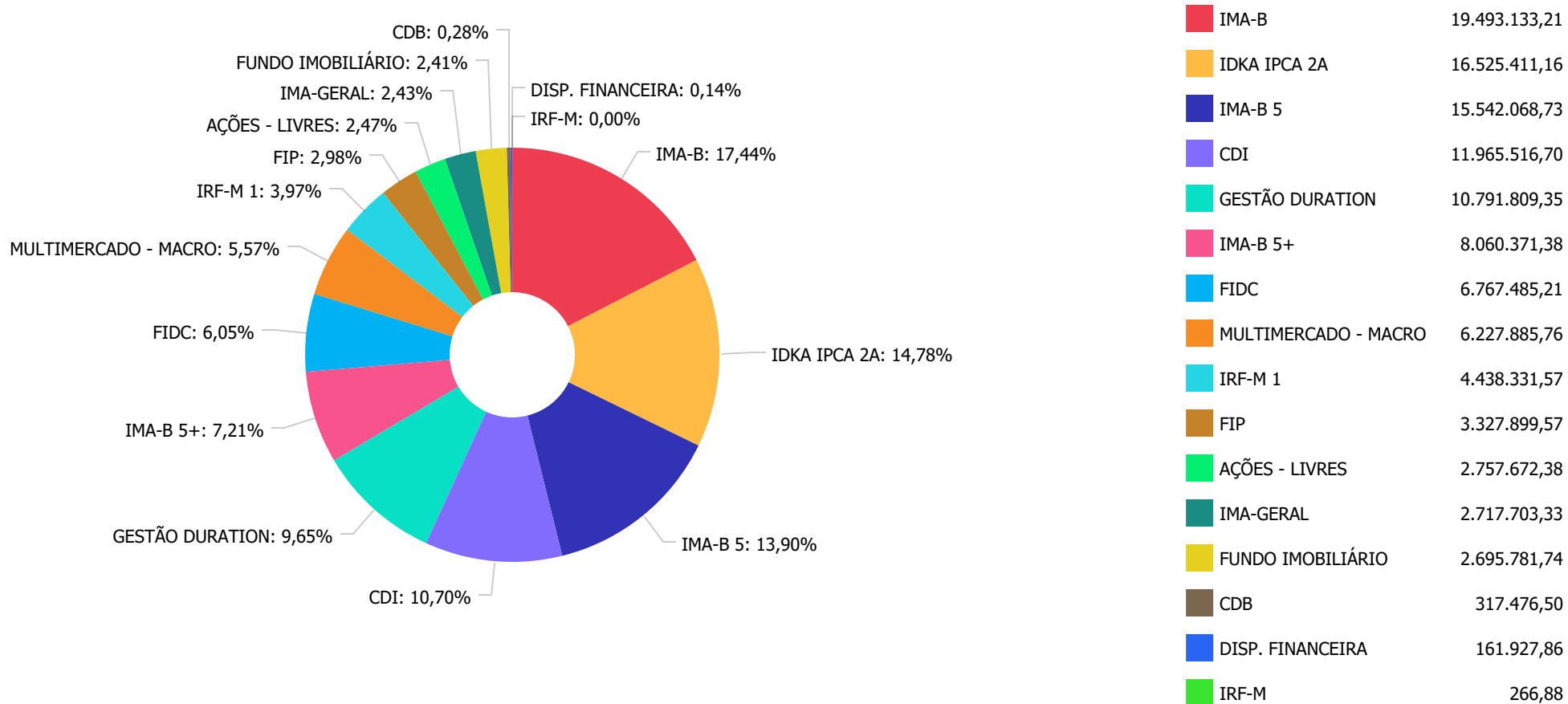
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	1,10%	5,10%	2,01%	5,10%	12,85%	28,80%	-	-
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	-	-
Ibovespa (Benchmark)	8,76%	-17,80%	30,18%	-17,80%	-6,20%	30,64%	-	-
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	9,88%	-14,67%	33,22%	-14,67%	5,17%	-	0,12%	0,41%
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)	-	-	-	-	-	-	-	-
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	0,29%	-15,80%	2,63%	-15,80%	73,46%	-	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	2,90%	-44,96%	-33,65%	-44,96%	-60,34%	-71,02%	0,16%	0,44%

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



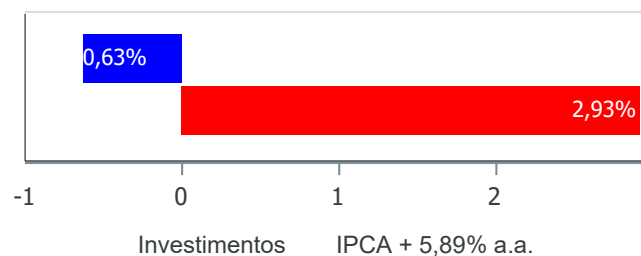
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Junho / 2020)



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

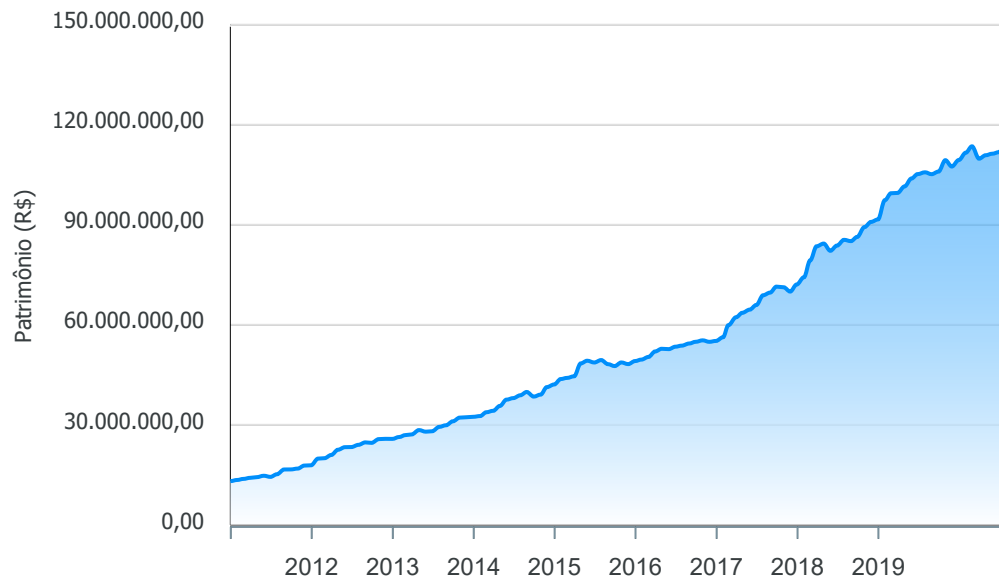
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	109.441.328,62	3.089.999,48	1.374.620,68	111.616.231,73	459.524,31	459.524,31	0,41%	0,41%	0,71%	0,71%	58,07%	1,39%
Fevereiro	111.616.231,73	3.908.938,38	7.685.404,89	107.991.681,00	151.915,78	611.440,09	0,14%	0,55%	0,66%	1,38%	39,94%	1,94%
Março	107.991.681,00	10.884.753,92	5.075.984,93	109.505.711,98	-4.294.738,01	-3.683.297,92	-3,77%	-3,24%	0,57%	1,96%	-165,85%	10,00%
Abril	109.505.711,98	1.711.296,54	1.468.623,50	110.698.950,71	950.565,69	-2.732.732,23	0,87%	-2,41%	0,14%	2,10%	-114,43%	5,30%
Mai	110.698.950,71	344.634,16	432.447,61	111.149.244,75	538.107,49	-2.194.624,74	0,49%	-1,93%	0,07%	2,18%	-88,71%	3,38%
Junho	111.149.244,75	1.479.315,77	2.479.808,91	111.628.813,47	1.480.061,86	-714.562,88	1,33%	-0,63%	0,74%	2,93%	-21,35%	2,09%

Investimentos x Meta Atuarial



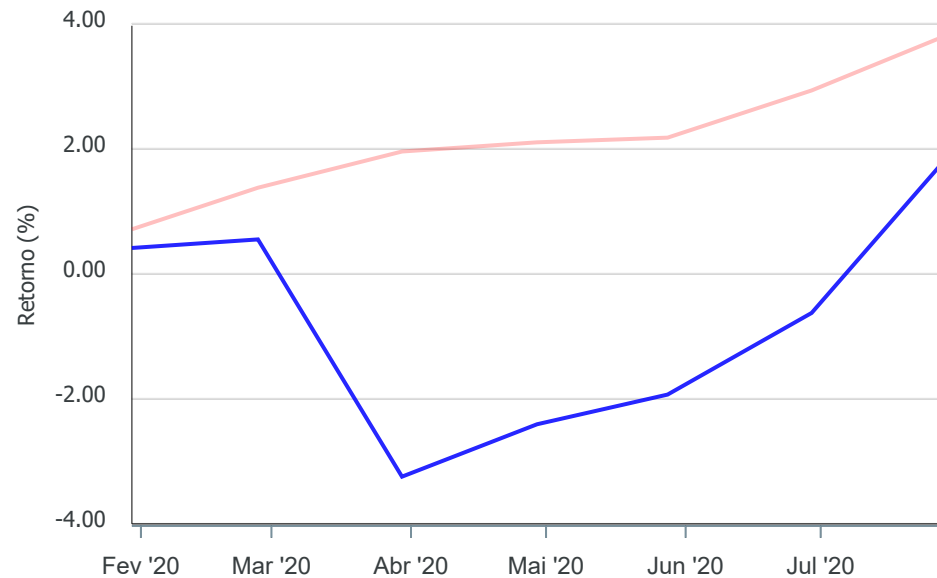
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	7.838.750,92	0,00	0,00	8.060.371,38	221.620,46	2,83%	2,83%	4,98%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.899.342,09	0,00	0,00	4.998.865,33	99.523,24	2,03%	2,03%	2,99%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	3.461.403,96	0,00	0,00	3.531.497,11	70.093,15	2,02%	2,02%	2,98%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	10.429.549,01	0,00	100.000,00	10.539.665,80	210.116,79	2,01%	2,02%	2,98%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	469.066,60	0,00	55.000,00	423.104,97	9.038,37	1,93%	2,03%	2,99%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	16.328.355,41	0,00	1.000,00	16.525.411,16	198.055,75	1,21%	1,21%	0,81%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	15.134.855,92	0,00	0,00	15.297.672,61	162.816,69	1,08%	1,08%	0,89%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.519.988,44	0,00	0,00	2.543.895,36	23.906,92	0,95%	0,95%	1,27%
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P...	172.300,39	0,00	0,00	173.807,97	1.507,58	0,87%	0,87%	1,16%
CDB - BANCO RENNER	314.772,75	0,00	0,00	317.476,50	2.703,75	0,86%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	11.384.482,42	0,00	677.000,00	10.791.809,35	84.326,93	0,74%	0,75%	1,17%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	9.220,83	0,00	9.000,00	266,88	46,05	0,50%	0,77%	1,17%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	6.569.995,83	492.369,74	505.500,87	6.574.199,34	17.334,64	0,25%	0,26%	0,03%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	5.309.554,05	0,00	50.000,00	5.272.390,31	12.836,26	0,24%	0,24%	0,03%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	3.570.916,31	986.946,03	130.000,00	4.438.331,57	10.469,23	0,23%	0,26%	0,05%
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	6.759.848,51	0,00	0,00	6.767.485,21	7.636,70	0,11%	-1,76%	3,53%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.070.574,55	0,00	952.308,04	118.927,05	660,54	0,06%	0,22%	0,03%
UM INVEST IMA-B 5 FI RENDA FIXA	245.125,22	0,00	0,00	244.396,12	-729,10	-0,30%	-0,30%	0,31%
Total Renda Fixa	96.488.103,21	1.479.315,77	2.479.808,91	96.619.574,02	1.131.963,95	1,16%		1,72%

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 AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	2.509.777,29	0,00	0,00	2.757.672,38	247.895,09	9,88%	9,88%	12,39%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	801.290,10	0,00	0,00	824.515,90	23.225,80	2,90%	2,90%	16,11%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	6.150.814,19	0,00	0,00	6.227.885,76	77.071,57	1,25%	1,25%	1,24%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	1.865.863,68	0,00	0,00	1.871.265,84	5.402,16	0,29%	0,29%	-
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	3.333.396,28	0,00	0,00	3.327.899,57	-5.496,71	-0,16%	-	-
Total Renda Variável	14.661.141,54	0,00	0,00	15.009.239,45	348.097,91	2,37%		5,63%

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
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	15.961.342,41	0,00	6.000,00	16.525.411,16	570.068,75	3,57%	3,57%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	14.757.482,97	0,00	7.000,00	15.297.672,61	547.189,64	3,71%	3,71%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	10.459.181,08	0,00	416.546,66	10.539.665,80	497.031,38	4,75%	4,90%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	7.613.040,84	0,00	0,00	8.060.371,38	447.330,54	5,88%	5,88%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	11.106.233,95	0,00	677.000,00	10.791.809,35	362.575,40	3,26%	3,27%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.779.340,70	0,00	13.000,00	4.998.865,33	232.524,63	4,87%	4,87%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	3.368.684,30	0,00	0,00	3.531.497,11	162.812,81	4,83%	4,83%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.470.709,49	0,00	0,00	2.543.895,36	73.185,87	2,96%	2,96%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	6.234.685,64	2.215.647,25	1.929.527,04	6.574.199,34	53.393,49	0,63%	0,78%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	3.373.350,01	1.157.005,48	130.000,00	4.438.331,57	37.976,08	0,84%	1,06%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	5.291.994,23	0,00	50.000,00	5.272.390,31	30.396,08	0,57%	0,58%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	456.187,02	0,00	55.000,00	423.104,97	21.917,95	4,80%	4,91%
CDB - BANCO RENNER	309.848,00	0,00	0,00	317.476,50	7.628,50	2,46%	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.031.544,76	162.593,74	1.081.806,32	118.927,05	6.594,87	0,55%	0,78%
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P...	175.228,54	0,00	6.000,00	173.807,97	4.579,43	2,61%	2,64%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	8.999,03	0,00	9.000,00	266,88	267,85	2,98%	3,26%
UM INVEST IMA-B 5 FI RENDA FIXA	246.647,14	0,00	0,00	244.396,12	-2.251,02	-0,91%	-0,93%
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	7.472.334,67	0,00	0,00	6.767.485,21	-704.849,46	-9,43%	-8,06%
Total Renda Fixa					2.348.372,79	2,38%	

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 AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	2.070.022,72	0,00	0,00	2.757.672,38	687.649,66	33,22%	33,22%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	5.908.726,16	0,00	0,00	6.227.885,76	319.159,60	5,40%	5,40%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	1.823.656,64	0,00	0,00	1.871.265,84	47.609,20	2,61%	2,63%
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	3.343.891,38	0,00	0,00	3.327.899,57	-15.991,81	-0,48%	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	1.242.580,30	0,00	0,00	824.515,90	-418.064,40	-33,64%	-33,64%
				Total Renda Variável	620.362,25	4,31%	

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
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	15.201.971,20	869.262,72	6.000,00	16.525.411,16	460.177,24	2,86%	2,88%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	8.016.058,57	3.000.000,00	677.000,00	10.791.809,35	452.750,78	4,11%	4,63%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	14.416.034,69	1.166.847,58	730.932,81	15.297.672,61	445.723,15	2,86%	3,08%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	7.142.535,41	5.033.882,06	5.698.750,79	6.574.199,34	96.532,66	0,79%	1,37%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	3.330.063,53	1.157.005,48	132.503,79	4.438.331,57	83.766,35	1,87%	2,45%
UM INVEST IMA-B 5 FI RENDA FIXA	5.421.430,19	0,00	5.233.454,72	244.396,12	56.420,65	1,04%	0,72%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.500.137,09	0,00	0,00	2.543.895,36	43.758,27	1,75%	1,75%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4.014.999,67	162.593,74	4.098.701,75	118.927,05	40.035,39	0,96%	1,83%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	56.036,00	5.233.454,72	50.000,00	5.272.390,31	32.899,59	0,62%	1,37%
CDB - BANCO RENNER	302.402,75	0,00	0,00	317.476,50	15.073,75	4,98%	-
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P...	177.209,44	0,00	6.000,00	173.807,97	2.598,53	1,47%	1,50%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	8.876,53	0,00	9.000,00	266,88	390,35	4,40%	4,68%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	487.714,01	0,00	55.000,00	423.104,97	-9.609,04	-1,97%	-1,88%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	3.598.274,62	0,00	0,00	3.531.497,11	-66.777,51	-1,86%	-1,86%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.517.366,61	2.568.217,54	963.000,00	4.998.865,33	-123.718,82	-2,03%	-1,94%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	9.352.505,75	2.227.674,41	856.546,66	10.539.665,80	-183.967,70	-1,59%	-1,75%
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	7.138.770,22	0,00	0,00	6.767.485,21	-371.285,01	-5,20%	-2,69%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	8.523.661,61	0,00	0,00	8.060.371,38	-463.290,23	-5,44%	-5,44%
				Total Renda Fixa	511.478,40	0,53%	

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
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	1.852.550,43	0,00	0,00	1.871.265,84	18.715,41	1,01%	-15,80%
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	3.360.224,11	0,00	0,00	3.327.899,57	-32.324,54	-0,96%	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	6.292.810,09	0,00	0,00	6.227.885,76	-64.924,33	-1,03%	-1,03%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3.231.632,00	0,00	0,00	2.757.672,38	-473.959,62	-14,67%	-14,67%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	1.498.064,10	0,00	0,00	824.515,90	-673.548,20	-44,96%	-44,96%
				Total Renda Variável	-1.226.041,28	-7,55%	