

# 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)**

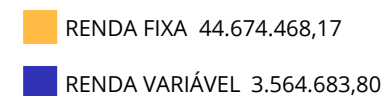
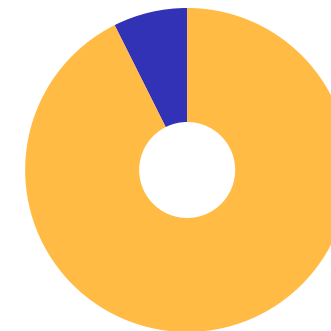
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	6.119.581,48	12,69%	1.364	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	1.785.313,72	3,70%	670	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA...	D+0	Não há	1.864.129,12	3,86%	229	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	17/08/2020	435.057,00	0,90%	20	0,64%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	3.216.122,67	6,67%	912	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	1.854.069,22	3,84%	340	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	5.020.909,94	10,41%	884	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	2.940.234,27	6,10%	1.262	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	4.653.342,15	9,65%	367	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	1.133.091,67	2,35%	714	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVI...	D+2	Não há	1.313.156,24	2,72%	310	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	1.028.471,15	2,13%	622	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	D+0	Não há	4.695.205,50	9,73%	305	0,16%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	D+31 ou...	Não há	1.104.731,98	2,29%	15	0,64%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	1.049.645,25	2,18%	287	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	4.140.557,56	8,58%	608	0,17%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.059.021,75	2,20%	106	0,26%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1800	Não há	1.112.358,47	2,31%	14	0,82%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se ...	Não se aplica	149.469,03	0,31%	98	0,18%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	D+4	Não há	1.465.258,99	3,04%	96	0,16%	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
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	896.079,19	1,86%	49.451	0,02%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	1.203.345,62	2,49%	162	0,03%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>48.239.151,97</b>				

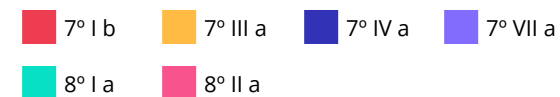
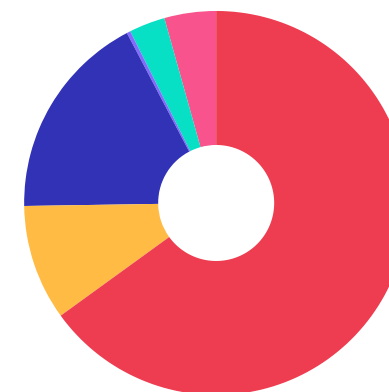
**Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Junho / 2020)**

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	31.363.478,63	65,02%	20,00%	30,00%	90,00%	12.051.758,14
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	4.695.205,50	9,73%	0,00%	10,00%	60,00%	24.248.285,68
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	8.466.315,01	17,55%	10,00%	30,00%	40,00%	10.829.345,78
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	7.235.872,80
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	149.469,03	0,31%	0,00%	0,00%	5,00%	2.262.488,57
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.411.957,60
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.411.957,60
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>44.674.468,17</b>	<b>92,61%</b>	<b>30,00%</b>	<b>70,00%</b>	<b>220,00%</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%	1.465.258,99	3,04%	0,00%	5,00%	5,00%	946.698,61
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	2.099.424,81	4,35%	0,00%	15,00%	20,00%	7.548.405,58
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	4.823.915,20
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	2.411.957,60
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>3.564.683,80</b>	<b>7,39%</b>	<b>0,00%</b>	<b>30,00%</b>	<b>40,00%</b>	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	25.361.787,88	52,58	0,01
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	17.361.734,55	35,99	0,00
ITAÚ UNIBANCO	3.149.070,06	6,53	0,00
VERITAS CAPITAL MANAGEMENT	2.217.090,45	4,60	0,13
PETRA CAPITAL	149.469,03	0,31	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 ' b '	31.363.478,63	65,02	20,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	4.695.205,50	9,73	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	8.466.315,01	17,55	10,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	149.469,03	0,31	0,00	5,00
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 '	1.465.258,99	3,04	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	2.099.424,81	4,35	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	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
<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%	0,81%	0,03%
<b>IMA Geral (Benchmark)</b>	0,99%	1,87%	2,89%	1,87%	6,39%	23,45%	-	-
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,89%	1,61%	2,70%	1,61%	6,10%	22,48%	1,18%	0,03%
<b>IRF-M 1+ (Benchmark)</b>	1,04%	6,03%	4,53%	6,03%	11,57%	33,23%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,02%	5,88%	4,41%	5,88%	11,53%	32,77%	1,75%	0,03%
<b>IMA-B 5+ (Benchmark)</b>	2,84%	-5,26%	5,99%	-5,26%	1,68%	43,55%	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,80%	-5,38%	5,82%	-5,38%	1,88%	42,80%	4,98%	0,15%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,83%	-5,44%	5,88%	-5,44%	1,57%	42,12%	4,98%	0,15%
<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%	0,05%	0,00%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,26%	2,48%	1,09%	2,48%	5,78%	13,28%	0,05%	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%	0,91%	0,04%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,40%	1,71%	-0,81%	1,71%	-5,46%	-17,39%	8,75%	0,05%

**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 IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,08%	3,08%	3,71%	3,08%	8,59%	24,25%	0,89%	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%	2,98%	0,10%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	2,03%	-1,86%	4,83%	-1,86%	4,56%	34,21%	2,98%	0,10%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	-1,57%	-16,78%	-6,29%	-16,78%	-13,33%	-10,36%	2,83%	0,14%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,89%	-1,95%	1,66%	-1,95%	-0,60%	3,33%	0,40%	0,04%
<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%	1,17%	0,02%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,21%	1,75%	0,73%	1,75%	4,58%	11,21%	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,26%	1,37%	0,78%	1,37%	4,06%	10,51%	0,03%	0,01%
<b>IPCA (Benchmark)</b>	0,26%	0,10%	-0,43%	0,10%	2,12%	5,57%	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,21%	-1,55%	-0,59%	-1,55%	-8,44%	-12,07%	0,05%	0,06%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,44%	2,27%	1,12%	2,27%	5,62%	19,25%	0,38%	0,01%
<b>Não Informado (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,21%	1,86%	0,78%	1,86%	4,68%	11,21%	0,02%	0,00%



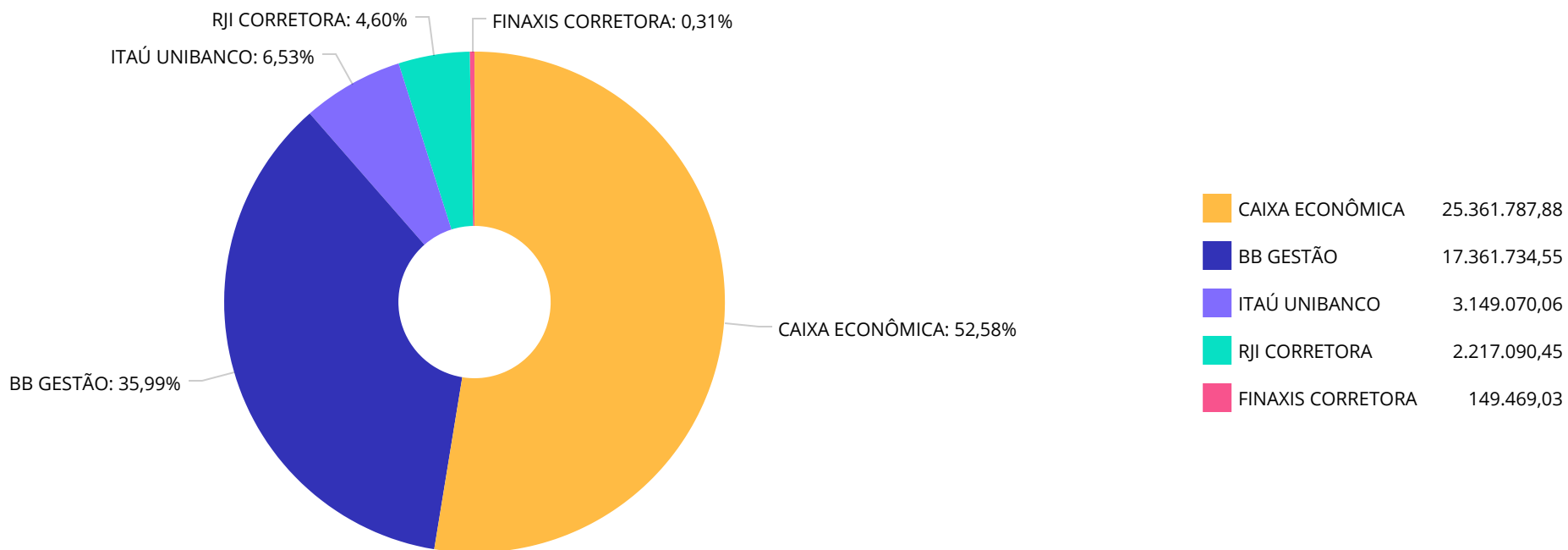
**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2020 - RENDA FIXA**

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

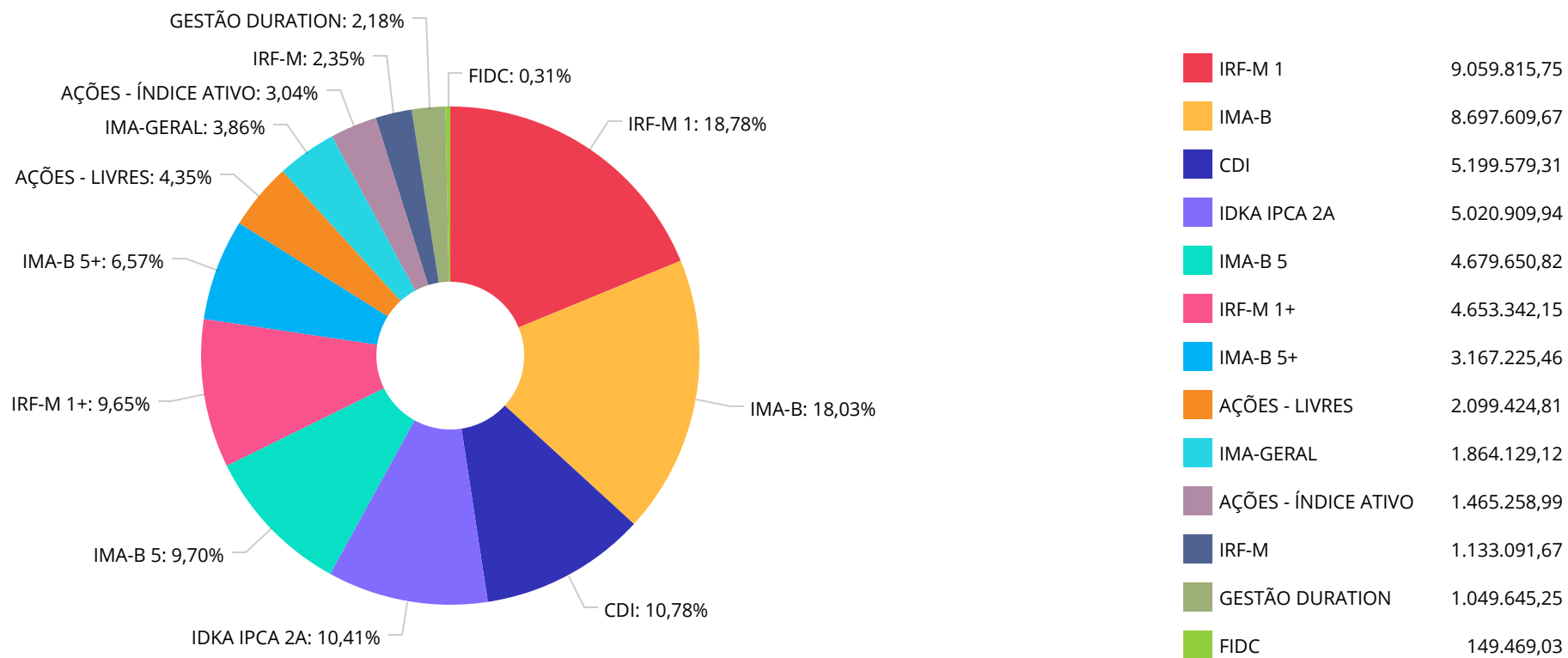
**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2020 - RENDA VARIÁVEL**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IBX-50 (Benchmark)</b>	9,33%	-17,76%	31,79%	-17,76%	-7,36%	27,59%	-	-
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	9,45%	-18,44%	31,25%	-18,44%	-6,86%	25,17%	13,11%	0,39%
<b>Ibovespa (Benchmark)</b>	8,76%	-17,80%	30,18%	-17,80%	-6,20%	30,64%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	12,10%	-28,51%	33,61%	-28,51%	-13,13%	23,01%	14,62%	0,50%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	9,28%	-22,25%	27,83%	-22,25%	-4,41%	36,54%	13,00%	0,40%

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



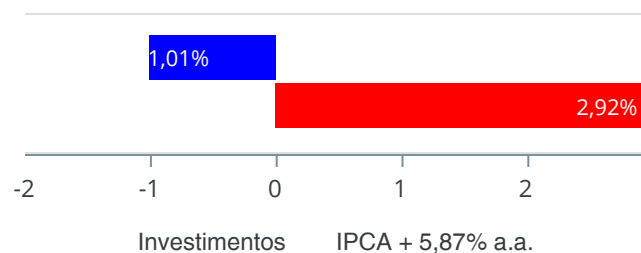
**Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Junho / 2020)**



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

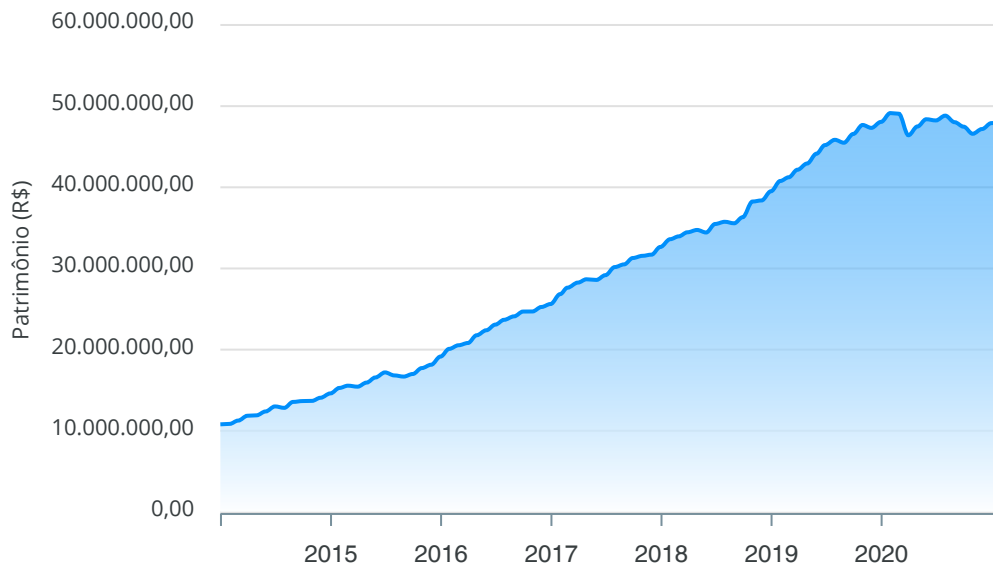
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	48.059.780,96	901.400,00	0,00	49.146.425,94	185.244,98	185.244,98	0,38%	0,38%	0,71%	0,71%	53,27%	1,64%
Fevereiro	49.146.425,94	1.200.000,00	1.061.776,61	49.066.854,25	-217.795,08	-32.550,10	-0,44%	-0,07%	0,66%	1,37%	-4,75%	2,30%
Março	49.066.854,25	890.000,00	1.030.000,00	46.415.585,07	-2.511.269,18	-2.543.819,28	-5,12%	-5,18%	0,57%	1,95%	-265,41%	10,46%
Abril	46.415.585,07	1.250.000,00	750.000,00	47.498.598,93	583.013,86	-1.960.805,42	1,24%	-4,00%	0,14%	2,10%	-190,85%	5,46%
Mai	47.498.598,93	953.000,00	798.787,98	48.386.127,30	733.316,35	-1.227.489,07	1,54%	-2,52%	0,07%	2,17%	-116,31%	2,98%
Junho	48.386.127,30	400.000,00	1.300.000,00	48.239.151,97	753.024,67	-474.464,40	1,56%	-1,01%	0,74%	2,92%	-34,45%	2,43%

Investimentos x Meta Atuarial



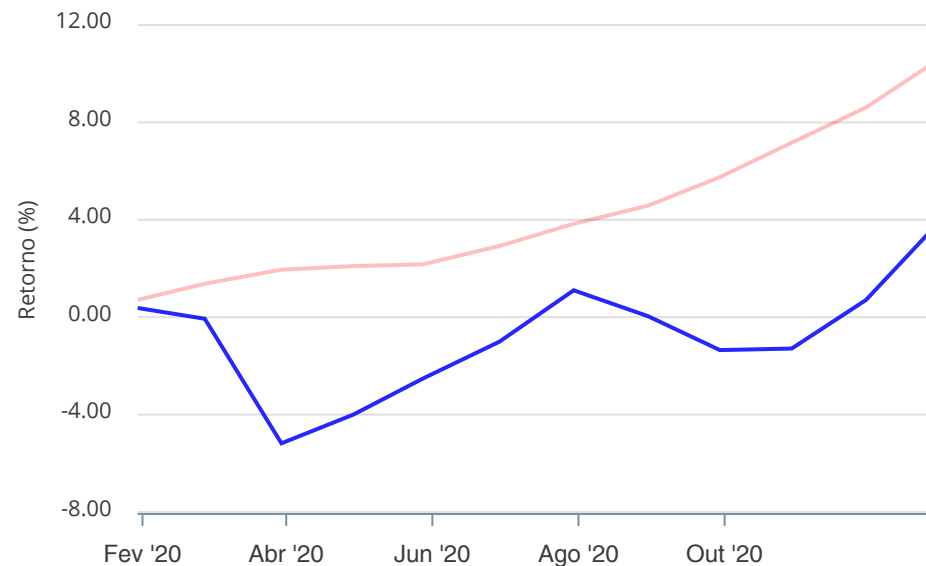
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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...	1.803.091,46	0,00	0,00	1.854.069,22	50.977,76	2,83%	2,83%	4,98%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	1.277.388,74	0,00	0,00	1.313.156,24	35.767,50	2,80%	2,80%	4,98%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.749.972,19	0,00	0,00	1.785.313,72	35.341,53	2,02%	2,02%	2,98%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	4.206.891,09	400.000,00	0,00	4.695.205,50	88.314,41	1,92%	2,02%	2,98%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	4.960.735,59	0,00	0,00	5.020.909,94	60.174,35	1,21%	1,21%	0,81%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.181.173,76	0,00	0,00	3.216.122,67	34.948,91	1,10%	1,10%	0,91%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.017.524,89	0,00	0,00	1.028.471,15	10.946,26	1,08%	1,08%	0,89%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	4.606.500,14	0,00	0,00	4.653.342,15	46.842,01	1,02%	1,02%	1,75%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	1.847.641,84	0,00	0,00	1.864.129,12	16.487,28	0,89%	0,89%	1,18%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	431.229,30	0,00	0,00	435.057,00	3.827,70	0,89%	0,89%	0,40%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.124.411,49	0,00	0,00	1.133.091,67	8.680,18	0,77%	0,77%	1,17%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	1.045.090,37	0,00	0,00	1.049.645,25	4.554,88	0,44%	0,44%	0,38%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.108.185,81	0,00	0,00	1.112.358,47	4.172,66	0,38%	0,38%	8,75%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	4.129.818,96	0,00	0,00	4.140.557,56	10.738,60	0,26%	0,26%	0,03%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	2.932.705,79	0,00	0,00	2.940.234,27	7.528,48	0,26%	0,26%	0,05%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.402.813,70	0,00	1.300.000,00	6.119.581,48	16.767,78	0,23%	0,26%	0,05%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.056.795,17	0,00	0,00	1.059.021,75	2.226,58	0,21%	0,21%	0,02%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	149.787,04	0,00	0,00	149.469,03	-318,01	-0,21%	-0,21%	0,05%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	1.122.215,60	0,00	0,00	1.104.731,98	-17.483,62	-1,56%	-1,56%	2,83%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>45.153.972,93</b>	<b>400.000,00</b>	<b>1.300.000,00</b>	<b>44.674.468,17</b>	<b>420.495,24</b>	<b>0,92%</b>		<b>1,54%</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	1.073.475,76	0,00	0,00	1.203.345,62	129.869,86	12,10%	12,10%	14,62%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	1.338.694,32	0,00	0,00	1.465.258,99	126.564,67	9,45%	9,45%	13,11%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	819.984,29	0,00	0,00	896.079,19	76.094,90	9,28%	9,28%	13,00%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>3.232.154,37</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>3.564.683,80</b>	<b>332.529,43</b>	<b>10,29%</b>		<b>13,59%</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 NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	3.163.442,96	1.330.000,00	0,00	4.695.205,50	201.762,54	4,49%	4,83%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	4.456.780,62	0,00	0,00	4.653.342,15	196.561,53	4,41%	4,41%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	4.847.745,23	0,00	0,00	5.020.909,94	173.164,71	3,57%	3,57%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.101.154,20	0,00	0,00	3.216.122,67	114.968,47	3,71%	3,71%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	1.751.173,01	0,00	0,00	1.854.069,22	102.896,21	5,88%	5,88%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.701.992,08	0,00	0,00	1.785.313,72	83.321,64	4,90%	4,90%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	6.143.572,48	1.200.000,00	1.300.000,00	6.119.581,48	76.009,00	1,04%	1,09%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	1.240.957,62	0,00	0,00	1.313.156,24	72.198,62	5,82%	5,82%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	1.815.082,90	0,00	0,00	1.864.129,12	49.046,22	2,70%	2,70%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	968.886,47	23.000,00	0,00	1.028.471,15	36.584,68	3,69%	3,71%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.097.364,41	0,00	0,00	1.133.091,67	35.727,26	3,26%	3,26%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	4.108.674,44	0,00	0,00	4.140.557,56	31.883,12	0,78%	0,78%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	2.859.463,76	50.000,00	0,00	2.940.234,27	30.770,51	1,06%	1,06%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	1.037.985,11	0,00	0,00	1.049.645,25	11.660,14	1,12%	1,12%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.533.400,51	0,00	1.485.000,00	1.059.021,75	10.621,24	0,42%	0,78%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	427.935,90	0,00	0,00	435.057,00	7.121,10	1,66%	1,66%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.112.758,75	0,00	0,00	1.112.358,47	-400,28	-0,04%	-0,81%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	150.351,42	0,00	0,00	149.469,03	-882,39	-0,59%	-0,59%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	1.178.858,53	0,00	63.787,98	1.104.731,98	-10.338,57	-0,88%	-6,29%
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>1.222.675,75</b>	<b>2,64%</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
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	1.116.401,59	0,00	0,00	1.465.258,99	348.857,40	31,25%	31,25%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	900.631,19	0,00	0,00	1.203.345,62	302.714,43	33,61%	33,61%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	700.971,89	0,00	0,00	896.079,19	195.107,30	27,83%	27,83%
				<b>Total Renda Variável</b>	<b>846.679,13</b>	<b>31,15%</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 IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	4.394.905,69	0,00	0,00	4.653.342,15	258.436,46	5,88%	5,88%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.916.742,47	2.350.000,00	1.300.000,00	6.119.581,48	152.839,01	2,10%	2,48%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	4.880.147,30	0,00	0,00	5.020.909,94	140.762,64	2,88%	2,88%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.121.167,43	0,00	0,00	3.216.122,67	94.955,24	3,04%	3,04%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	3.099.122,40	100.000,00	330.000,00	2.940.234,27	71.111,87	2,22%	2,45%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	4.084.549,91	0,00	0,00	4.140.557,56	56.007,65	1,37%	1,37%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.082.426,57	0,00	0,00	1.133.091,67	50.665,10	4,68%	4,68%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3.362.779,67	890.000,00	3.235.000,00	1.059.021,75	41.242,08	0,97%	1,86%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	953.483,93	44.400,00	0,00	1.028.471,15	30.587,22	3,07%	3,08%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	1.834.566,64	0,00	0,00	1.864.129,12	29.562,48	1,61%	1,61%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.085.175,59	0,00	0,00	1.112.358,47	27.182,88	2,50%	1,71%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	1.026.375,28	0,00	0,00	1.049.645,25	23.269,97	2,27%	2,27%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	443.718,90	0,00	11.776,61	435.057,00	3.114,71	0,70%	-1,95%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	151.828,29	0,00	0,00	149.469,03	-2.359,26	-1,55%	-1,55%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA...	2.497.682,29	2.210.000,00	0,00	4.695.205,50	-12.476,79	-0,27%	-1,86%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.817.081,27	0,00	0,00	1.785.313,72	-31.767,55	-1,75%	-1,75%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	1.387.749,55	0,00	0,00	1.313.156,24	-74.593,31	-5,38%	-5,38%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	1.960.636,54	0,00	0,00	1.854.069,22	-106.567,32	-5,44%	-5,44%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	1.327.448,27	0,00	63.787,98	1.104.731,98	-158.928,31	-11,97%	-16,78%
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>593.044,77</b>	<b>1,35%</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 DUNAMIS FIC AÇÕES	1.152.442,86	0,00	0,00	896.079,19	-256.363,67	-22,25%	-22,25%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	1.796.485,58	0,00	0,00	1.465.258,99	-331.226,59	-18,44%	-18,44%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.683.264,53	0,00	0,00	1.203.345,62	-479.918,91	-28,51%	-28,51%
				<b>Total Renda Variável</b>	<b>-1.067.509,17</b>	<b>-23,05%</b>	