

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 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	4.689.896,97	2,83%	901	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	9.357.900,21	5,65%	884	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVI...	D+2	Não há	1.411.296,46	0,85%	310	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS F...	D+1	Não há	1.930.548,01	1,17%	207	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	4.133.894,83	2,50%	956	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	5.685.061,14	3,43%	1.364	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	8.806.124,49	5,32%	622	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	21.418.745,98	12,94%	763	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	4.480.487,69	2,71%	670	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	1.569.673,35	0,95%	340	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA...	D+0	Não há	227.248,83	0,14%	229	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.831.523,98	2,32%	118	0,40%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA...	D+1	Não há	480.101,84	0,29%	135	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	9.298.915,03	5,62%	912	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	6.369.900,31	3,85%	600	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	D+0	Não há	4.756.267,08	2,87%	305	0,16%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1 du	Não há	6.057.448,49	3,66%	56	2,38%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3 du	Não há	2.508.662,00	1,52%	186	0,32%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	626.360,48	0,38%	318	0,12%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	1.231.659,78	0,74%	678	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' '

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2020)

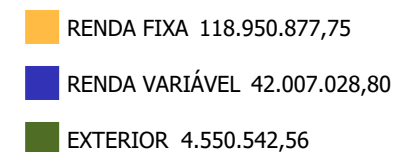
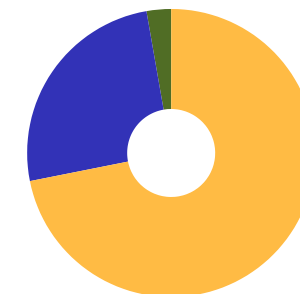
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	11.122.025,26	6,72%	105	1,15%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRASESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	6.040.810,41	3,65%	174	0,51%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIV...	D+0	3 anos	2.916.325,13	1,76%	71	1,61%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+4	Não há	1.332.951,56	0,81%	46	0,18%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	D+7 du	Não há	2.470.789,91	1,49%	25.730	0,39%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
META VALOR FI AÇÕES	D+4	Não há	7.123.246,21	4,30%	166	3,01%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	2.736.323,22	1,65%	8.369	0,31%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	2.657.121,18	1,61%	6.693	0,19%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	D+15	Não há	2.000.094,31	1,21%	56	0,96%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
SANTANDER SELEÇÃO 30 FIC AÇÕES	Não inf...	Não há	2.689.868,49	1,63%	37.528	0,18%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	1.856.685,26	1,12%	1.560	0,22%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	6.290.444,68	3,80%	1.743	2,35%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	2.500.812,13	1,51%	64	0,33%	Artigo 8º, Inciso III
SANTANDER STAR LONG & SHORT DIRECIONAL FIC MULTI...	D+31	Não há	1.978.716,67	1,20%	2.129	0,76%	Artigo 8º, Inciso III
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	2.309.189,28	1,40%	44	4,47%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	1.555.102,07	0,94%	5.317	0,33%	Artigo 8º, Inciso III
AZ QUEST EQUITY HEDGE FIC MULTIMERCADO	D+6	Não há	2.142.713,73	1,29%	4.936	0,95%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	1.534.609,55	0,93%	18.591	0,03%	Artigo 8º, Inciso III
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII ...	Não se ...	Não se aplica	828.360,55	0,50%		0,67%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	D+4	Não há	1.288.411,00	0,78%	104	0,11%	Artigo 9º - A, 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
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	3.262.131,56	1,97%	12.742	1,33%	Artigo 9º - A, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			165.508.449,11				

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

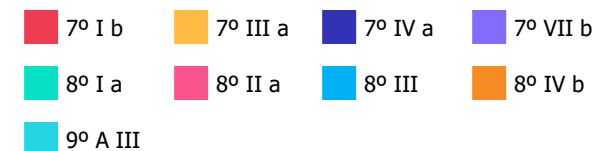
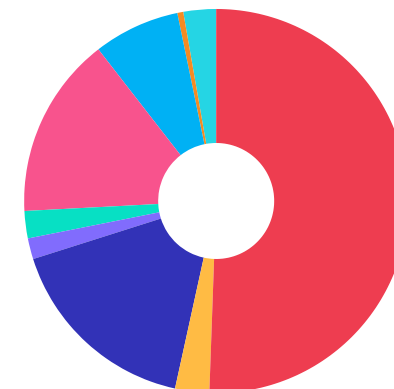
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	83.691.319,12	50,57%	15,00%	50,00%	90,00%	65.266.285,08
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	4.756.267,08	2,87%	0,00%	3,00%	60,00%	94.548.802,39
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	27.586.966,42	16,67%	5,00%	15,00%	40,00%	38.616.413,22
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	24.826.267,37
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	8.275.422,46
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	2.916.325,13	1,76%	0,00%	2,00%	5,00%	5.359.097,33
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	8.275.422,46
Total Renda Fixa	100,00%	118.950.877,75	71,87%	20,00%	70,00%	220,00%	



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%	3.803.741,47	2,30%	0,00%	0,00%	10,00%	12.747.103,44
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	25.353.783,35	15,32%	0,00%	18,00%	20,00%	7.747.906,47
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	12.021.143,43	7,26%	0,00%	10,00%	10,00%	4.529.701,48
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	8.275.422,46
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	828.360,55	0,50%	0,00%	2,00%	5,00%	7.447.061,91
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	8.275.422,46
Total Renda Variável	30,00%	42.007.028,80	25,38%	0,00%	30,00%	55,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2020			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	4.550.542,56	2,75%	0,00%	0,00%	5,00%	3.724.879,90
Total Exterior	10,00%	4.550.542,56	2,75%	0,00%	0,00%	5,00%	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	71.490.526,15	43,19	0,01
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	38.533.289,82	23,28	0,00
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	19.054.109,99	11,51	0,00
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	9.872.334,39	5,96	0,00
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	8.761.234,59	5,29	0,02
META ASSET MANAGEMENT	7.123.246,21	4,30	2,97
AZ QUEST INVESTIMENTOS	4.799.834,91	2,90	0,02
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	2.736.323,22	1,65	0,19
INFINITY ASSET MANAGEMENT	2.309.189,28	1,40	0,46
ZION INVEST	828.360,55	0,50	0,17

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 '	83.691.319,12	50,57	15,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	4.756.267,08	2,87	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	27.586.966,42	16,67	5,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	2.916.325,13	1,76	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	3.803.741,47	2,30	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	25.353.783,35	15,32	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	12.021.143,43	7,26	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	828.360,55	0,50	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso III	4.550.542,56	2,75	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
IDKA PRÉ 2 ANOS (Benchmark)	0,70%	6,60%	3,31%	6,60%	11,71%	28,80%	-	-
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	0,70%	6,50%	3,14%	6,50%	11,48%	28,06%	0,01%	0,02%
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%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,99%	3,35%	3,35%	3,35%	8,68%	23,17%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,21%	2,88%	3,57%	2,88%	8,18%	21,13%	0,01%	0,03%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,18%	3,12%	3,54%	3,12%	8,19%	21,36%	0,01%	0,03%
IMA Geral (Benchmark)	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%	0,01%	0,03%
IMA-B 5+ (Benchmark)	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%	0,05%	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%	0,05%	0,15%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,28%	2,60%	1,15%	2,60%	5,98%	13,67%	-	-
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%

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 5 (Benchmark)	1,12%	3,17%	3,77%	3,17%	8,73%	24,75%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,10%	3,04%	3,71%	3,04%	8,51%	24,21%	0,01%	0,04%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,08%	3,08%	3,71%	3,08%	8,59%	24,25%	0,01%	0,04%
IMA-B (Benchmark)	2,05%	-1,66%	4,96%	-1,66%	4,73%	35,13%	-	-
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%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP	2,00%	-2,03%	4,83%	-2,03%	4,40%	34,09%	0,03%	0,10%
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%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,15%	1,34%	0,54%	1,34%	3,73%	9,38%	0,00%	0,00%
IPCA (Benchmark)	0,26%	0,10%	-0,43%	0,10%	2,12%	5,57%	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,26%	3,55%	5,02%	3,55%	9,75%	27,65%	0,02%	0,05%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,75%	4,63%	3,27%	4,63%	9,82%	28,20%	0,01%	0,03%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,34%	1,98%	1,27%	1,98%	6,89%	20,42%	0,00%	0,02%
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,95%	1,78%	3,13%	1,78%	6,24%	22,63%	0,01%	0,04%

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 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
S&P 500 (Benchmark)	1,84%	-4,04%	19,95%	-4,04%	4,59%	14,05%	-	-
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	0,85%	-6,82%	18,61%	-6,82%	3,50%	-	0,13%	0,23%
IBX (Benchmark)	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%
Ibovespa (Benchmark)	8,76%	-17,80%	30,18%	-17,80%	-6,20%	30,64%	-	-
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	7,71%	-22,03%	29,43%	-22,03%	-9,48%	24,10%	0,12%	0,41%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	7,00%	-18,57%	23,70%	-18,57%	3,90%	55,68%	0,10%	0,39%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	7,79%	-15,79%	29,82%	-15,79%	-3,40%	35,64%	0,12%	0,37%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	7,44%	-18,07%	25,17%	-18,07%	-4,94%	52,01%	0,13%	0,34%
SANTANDER SELEÇÃO 30 FIC AÇÕES	9,31%	-22,85%	28,55%	-22,85%	-10,15%	24,90%	0,13%	0,41%
SMLL (Benchmark)	14,43%	-20,73%	32,49%	-20,73%	5,76%	49,01%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	8,63%	-20,26%	28,01%	-20,26%	7,24%	45,66%	0,13%	0,46%
CDI (Benchmark)	0,21%	1,75%	0,73%	1,75%	4,58%	11,21%	-	-
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	0,88%	1,64%	4,38%	1,64%	4,65%	11,81%	0,02%	0,04%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,25%	-1,03%	5,40%	-1,03%	6,27%	25,21%	0,01%	0,07%
AZ QUEST EQUITY HEDGE FIC MULTIMERCADO	-0,47%	-0,97%	-0,39%	-0,97%	3,77%	-	0,01%	0,04%

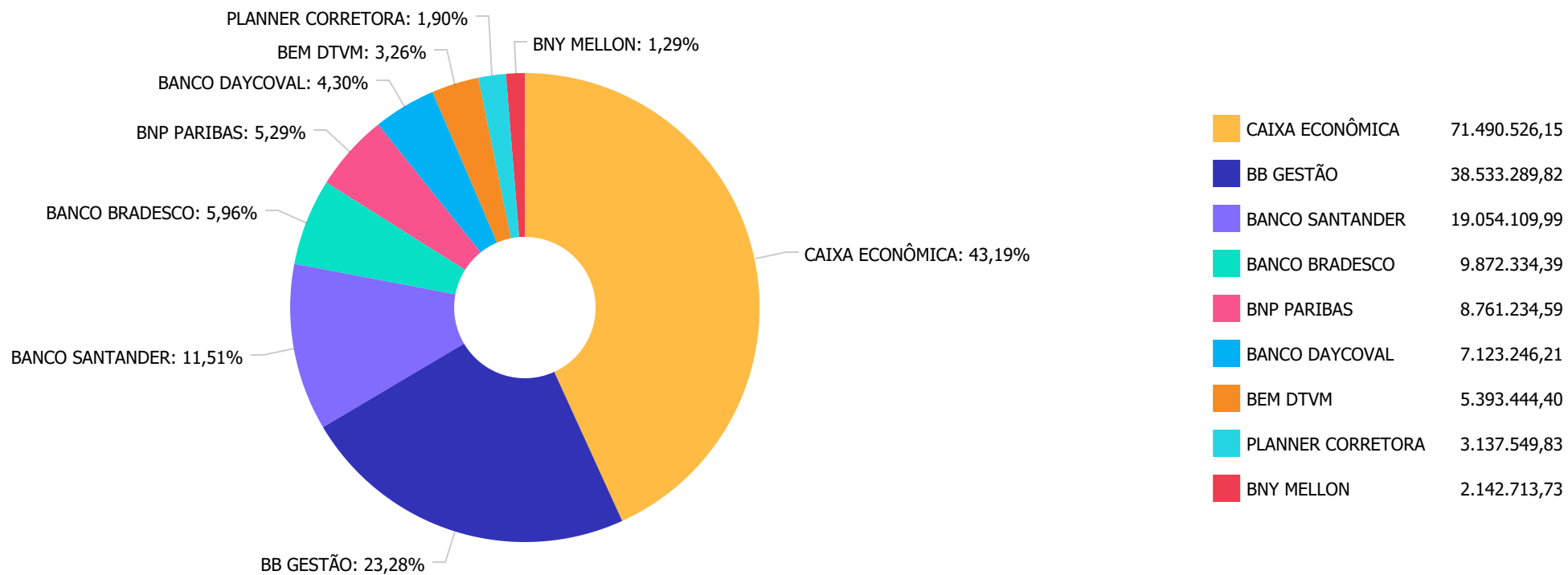
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
SANTANDER STAR LONG & SHORT DIRECIONAL FIC MULTIMERCADO	0,35%	-2,17%	0,66%	-2,17%	0,23%	7,19%	0,01%	0,02%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	2,90%	-44,96%	-33,65%	-44,96%	-60,34%	-71,02%	0,16%	0,44%
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%	-
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	13,15%	-22,01%	37,27%	-22,01%	3,74%	40,44%	0,16%	0,50%

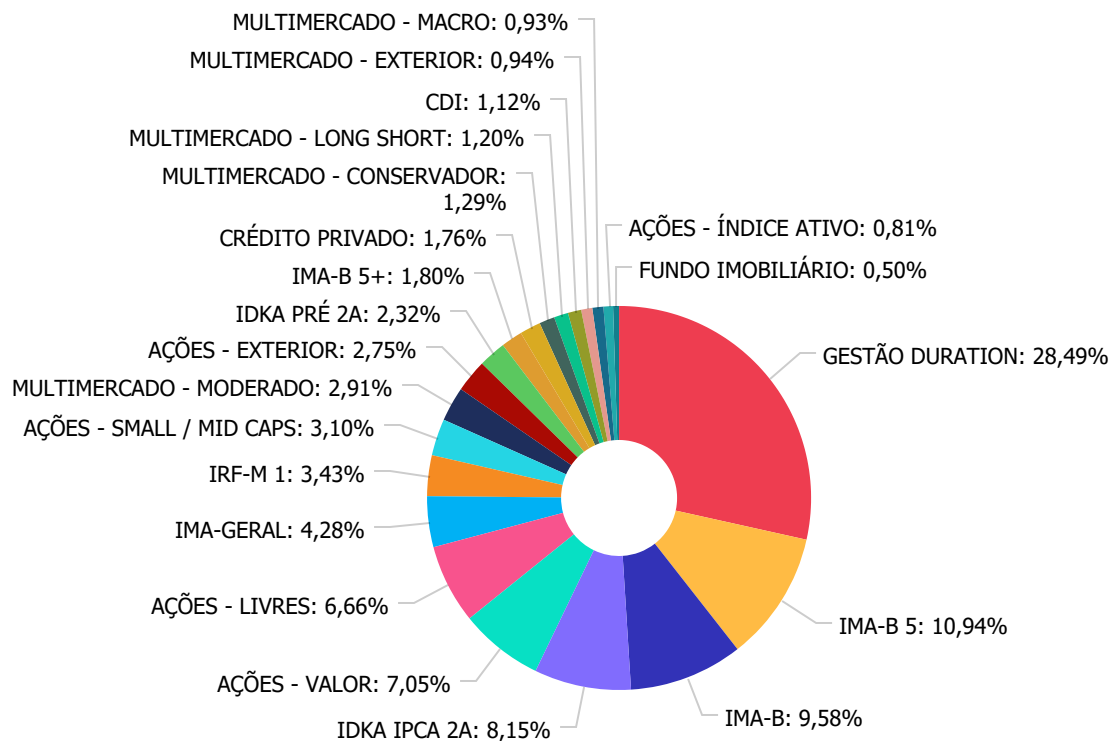
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2020 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	4,50%	32,44%	25,08%	32,44%	52,91%	68,50%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	4,37%	32,85%	24,40%	32,85%	54,59%	66,72%	0,12%	0,20%
IBX (Benchmark)	8,97%	-17,39%	30,39%	-17,39%	-4,94%	34,21%	-	-
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	3,05%	29,32%	21,74%	29,32%	48,07%	55,62%	0,13%	0,19%

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



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

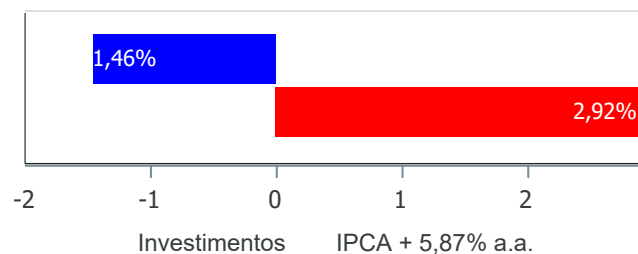


GESTÃO DURATION	47.147.692,14
IMA-B 5	18.105.039,52
IMA-B	15.857.199,75
IDKA IPCA 2A	13.491.795,04
AÇÕES - VALOR	11.669.799,96
AÇÕES - LIVRES	11.026.862,21
IMA-GERAL	7.077.250,98
IRF-M 1	5.685.061,14
AÇÕES - SMALL / MID CAPS	5.127.911,09
MULTIMERCADO - MODERADO	4.810.001,41
AÇÕES - EXTERIOR	4.550.542,56
IDKA PRÉ 2A	3.831.523,98
IMA-B 5+	2.980.969,81
CRÉDITO PRIVADO	2.916.325,13
MULTIMERCADO - CONSERVADOR	2.142.713,73
MULTIMERCADO - LONG SHORT	1.978.716,67
CDI	1.858.020,26
MULTIMERCADO - EXTERIOR	1.555.102,07
MULTIMERCADO - MACRO	1.534.609,55

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	152.862.799,62	14.258.274,50	8.990.003,51	158.993.148,59	862.077,98	862.077,98	0,55%	0,55%	0,71%	0,71%	76,75%	2,66%
Fevereiro	158.993.148,59	5.711.121,50	4.136.928,37	158.735.225,00	-1.832.116,72	-970.038,74	-1,14%	-0,60%	0,66%	1,37%	-43,81%	3,98%
Março	158.735.225,00	6.259.826,47	5.523.476,47	147.036.603,84	-12.434.971,16	-13.405.009,90	-7,80%	-8,35%	0,57%	1,95%	-427,98%	15,41%
Abril	147.036.603,84	6.798.304,96	3.094.155,88	154.560.459,74	3.819.706,82	-9.585.303,08	2,53%	-6,03%	0,14%	2,10%	-287,61%	7,58%
Mai	154.560.459,74	10.170.354,35	7.608.659,45	160.870.142,78	3.747.988,14	-5.837.314,94	2,39%	-3,79%	0,07%	2,17%	-174,58%	4,42%
Junho	160.870.142,78	7.317.665,62	6.599.160,04	165.508.449,11	3.919.800,75	-1.917.514,19	2,43%	-1,46%	0,74%	2,92%	-49,76%	3,84%

Investimentos x Meta Atuarial



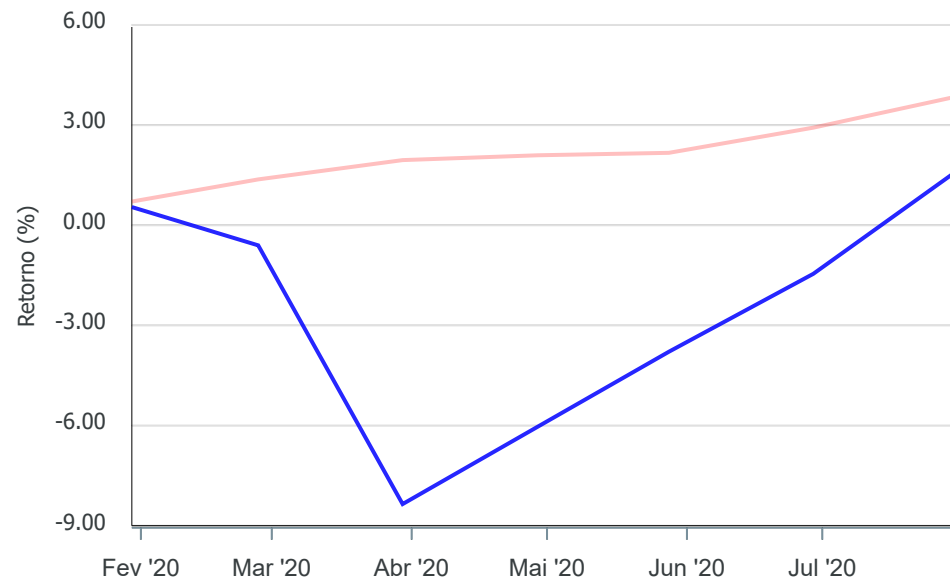
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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...	1.526.515,07	0,00	0,00	1.569.673,35	43.158,28	2,83%	2,83%	4,98%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	1.372.855,83	0,00	0,00	1.411.296,46	38.440,63	2,80%	2,80%	4,98%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	4.596.802,73	0,00	0,00	4.689.896,97	93.094,24	2,03%	2,03%	2,99%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	4.661.864,70	0,00	0,00	4.756.267,08	94.402,38	2,02%	2,02%	2,98%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	4.391.793,31	0,00	0,00	4.480.487,69	88.694,38	2,02%	2,02%	2,98%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC...	1.892.660,32	0,00	0,00	1.930.548,01	37.887,69	2,00%	2,00%	2,98%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	2.879.948,19	0,00	0,00	2.916.325,13	36.376,94	1,26%	1,26%	1,61%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	9.245.748,11	0,00	0,00	9.357.900,21	112.152,10	1,21%	1,21%	0,81%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	4.582.994,13	0,00	500.000,00	4.133.894,83	50.900,70	1,11%	1,18%	0,86%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	9.197.865,70	0,00	0,00	9.298.915,03	101.049,33	1,10%	1,10%	0,91%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	8.712.398,86	0,00	0,00	8.806.124,49	93.725,63	1,08%	1,08%	0,89%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	5.983.958,15	0,00	0,00	6.040.810,41	56.852,26	0,95%	0,95%	1,28%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.302.990,73	0,00	1.000.000,00	6.369.900,31	66.909,58	0,92%	0,95%	1,27%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	21.259.383,36	0,00	0,00	21.418.745,98	159.362,62	0,75%	0,75%	1,17%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	3.804.857,24	0,00	0,00	3.831.523,98	26.666,74	0,70%	0,70%	0,92%
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P...	1.968.296,93	0,00	1.500.000,00	480.101,84	11.804,91	0,60%	0,87%	1,16%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	3.026.631,14	3.000.000,00	0,00	6.057.448,49	30.817,35	0,51%	0,66%	1,04%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	1.720.082,80	0,00	1.500.000,00	227.248,83	7.166,03	0,42%	0,89%	1,18%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	0,00	2.500.000,00	0,00	2.508.662,00	8.662,00	0,35%	0,95%	1,34%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	11.084.670,41	0,00	0,00	11.122.025,26	37.354,85	0,34%	0,34%	0,31%

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 IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	5.670.362,82	0,00	0,00	5.685.061,14	14.698,32	0,26%	0,26%	0,05%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.228.677,13	0,00	0,00	1.231.659,78	2.982,65	0,24%	0,24%	0,03%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	1.405.921,52	1.317.665,62	2.099.160,04	626.360,48	1.933,38	0,07%	0,14%	0,01%
Total Renda Fixa	117.517.279,18	6.817.665,62	6.599.160,04	118.950.877,75	1.215.092,99	1,03%		1,29%

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
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	2.183.713,47	0,00	0,00	2.470.789,91	287.076,44	13,15%	13,15%	15,81%
META VALOR FI AÇÕES	6.428.348,07	0,00	0,00	7.123.246,21	694.898,14	10,81%	10,81%	13,96%
SANTANDER SELEÇÃO 30 FIC AÇÕES	2.460.804,31	0,00	0,00	2.689.868,49	229.064,18	9,31%	9,31%	12,59%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	2.445.932,75	0,00	0,00	2.657.121,18	211.188,43	8,63%	8,63%	12,99%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	1.842.025,96	0,00	0,00	2.000.094,31	158.068,35	8,58%	8,58%	12,44%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	5.835.927,25	0,00	0,00	6.290.444,68	454.517,43	7,79%	7,79%	11,90%
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	1.237.597,41	0,00	0,00	1.332.951,56	95.354,15	7,70%	7,70%	11,80%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.728.141,05	0,00	0,00	1.856.685,26	128.544,21	7,44%	7,44%	13,19%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	2.557.287,95	0,00	0,00	2.736.323,22	179.035,27	7,00%	7,00%	10,32%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	805.026,45	0,00	0,00	828.360,55	23.334,10	2,90%	2,90%	16,11%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	1.956.643,39	500.000,00	0,00	2.500.812,13	44.168,74	1,80%	2,24%	2,60%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.515.618,40	0,00	0,00	1.534.609,55	18.991,15	1,25%	1,25%	1,24%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	2.289.016,71	0,00	0,00	2.309.189,28	20.172,57	0,88%	0,88%	1,73%
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	1.542.016,91	0,00	0,00	1.555.102,07	13.085,16	0,85%	0,85%	12,84%
SANTANDER STAR LONG & SHORT DIRECIONAL FIC MULTIME...	1.971.808,34	0,00	0,00	1.978.716,67	6.908,33	0,35%	0,35%	1,16%
AZ QUEST EQUITY HEDGE FIC MULTIMERCADO	2.152.880,83	0,00	0,00	2.142.713,73	-10.167,10	-0,47%	-0,47%	0,84%
Total Renda Variável	38.952.789,25	500.000,00	0,00	42.007.028,80	2.554.239,55	6,47%		10,12%

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAPECERICA DA SERRA
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/06/2020

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	1.234.471,50	0,00	0,00	1.288.411,00	53.939,50	4,37%	4,37%	12,44%
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	3.165.602,85	0,00	0,00	3.262.131,56	96.528,71	3,05%	3,05%	12,67%
Total Renda Variável	4.400.074,35	0,00	0,00	4.550.542,56	150.468,21	3,42%		12,61%

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	22.220.801,07	1.500.000,00	3.000.000,00	21.418.745,98	697.944,91	2,94%	3,27%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	11.007.467,16	0,00	2.000.000,00	9.357.900,21	350.433,05	3,18%	3,57%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	8.966.501,71	0,00	0,00	9.298.915,03	332.413,32	3,71%	3,71%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	8.491.229,07	0,00	0,00	8.806.124,49	314.895,42	3,71%	3,71%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	4.470.584,35	0,00	0,00	4.689.896,97	219.312,62	4,91%	4,91%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	4.536.988,63	0,00	0,00	4.756.267,08	219.278,45	4,83%	4,83%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.160.179,09	0,00	1.000.000,00	6.369.900,31	209.721,22	2,93%	2,96%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	4.271.380,71	0,00	0,00	4.480.487,69	209.106,98	4,90%	4,90%
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	5.465.407,72	389.483,39	0,00	6.040.810,41	185.919,30	3,18%	3,13%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	4.478.233,14	0,00	500.000,00	4.133.894,83	155.661,69	3,48%	3,54%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	10.982.528,05	0,00	0,00	11.122.025,26	139.497,21	1,27%	1,27%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	2.776.858,39	0,00	0,00	2.916.325,13	139.466,74	5,02%	5,02%
BRANCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	3.714.861,87	0,00	0,00	3.831.523,98	116.662,11	3,14%	3,14%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC...	1.841.640,60	0,00	0,00	1.930.548,01	88.907,41	4,83%	4,83%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	1.482.560,39	0,00	0,00	1.569.673,35	87.112,96	5,88%	5,88%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	1.333.701,99	0,00	0,00	1.411.296,46	77.594,47	5,82%	5,82%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,00	6.000.000,00	0,00	6.057.448,49	57.448,49	0,96%	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.627.852,17	1.000.000,00	0,00	5.685.061,14	57.208,97	1,02%	1,09%
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P...	1.934.362,61	0,00	1.500.000,00	480.101,84	45.739,23	2,36%	2,64%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	1.689.771,68	0,00	1.500.000,00	227.248,83	37.477,15	2,22%	2,70%

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 ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	0,00	2.500.000,00	0,00	2.508.662,00	8.662,00	0,35%	2,88%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	1.023.361,20	7.396.841,54	7.801.975,37	626.360,48	8.133,11	0,10%	0,54%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.224.613,64	0,00	0,00	1.231.659,78	7.046,14	0,58%	0,58%
				Total Renda Fixa	3.765.642,95	3,27%	

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
META VALOR FI AÇÕES	4.804.455,54	0,00	0,00	7.123.246,21	2.318.790,67	48,26%	48,26%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	4.845.627,22	0,00	0,00	6.290.444,68	1.444.817,46	29,82%	29,82%
SANTANDER SELEÇÃO 30 FIC AÇÕES	2.092.494,83	0,00	0,00	2.689.868,49	597.373,66	28,55%	28,55%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	2.075.743,30	0,00	0,00	2.657.121,18	581.377,88	28,01%	28,01%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	2.212.082,61	0,00	0,00	2.736.323,22	524.240,61	23,70%	23,70%
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	0,00	2.000.000,00	0,00	2.470.789,91	470.789,91	23,54%	37,27%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	1.538.404,62	0,00	0,00	2.000.094,31	461.689,69	30,01%	30,01%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.483.394,43	0,00	0,00	1.856.685,26	373.290,83	25,16%	25,16%
SANTANDER IBOVSPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	0,00	1.000.000,00	0,00	1.332.951,56	332.951,56	33,30%	29,43%
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	1.311.134,97	0,00	0,00	1.555.102,07	243.967,10	18,61%	18,61%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	1.834.803,22	500.000,00	0,00	2.500.812,13	166.008,91	7,11%	9,03%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	2.212.352,89	0,00	0,00	2.309.189,28	96.836,39	4,38%	4,38%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.455.965,63	0,00	0,00	1.534.609,55	78.643,92	5,40%	5,40%
SANTANDER STAR LONG & SHORT DIRECIONAL FIC MULTIME...	1.965.765,81	0,00	0,00	1.978.716,67	12.950,86	0,66%	0,66%
AZ QUEST EQUITY HEDGE FIC MULTIMERCADO	2.151.124,59	0,00	0,00	2.142.713,73	-8.410,86	-0,39%	-0,39%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	1.248.374,35	0,00	0,00	828.360,55	-420.013,80	-33,64%	-33,64%
				Total Renda Variável	7.275.304,79	20,95%	

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

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	1.035.713,57	0,00	0,00	1.288.411,00	252.697,43	24,40%	24,40%
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	1.068.281,02	2.000.000,00	0,00	3.262.131,56	193.850,54	6,32%	21,74%
				Total Exterior	446.547,97	10,88%	

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	17.271.384,73	6.191.589,66	3.000.000,00	21.418.745,98	955.771,59	4,07%	4,63%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	11.081.040,46	0,00	2.000.000,00	9.357.900,21	276.859,75	2,50%	2,88%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	9.024.366,80	0,00	0,00	9.298.915,03	274.548,23	3,04%	3,04%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	8.542.724,24	0,00	0,00	8.806.124,49	263.400,25	3,08%	3,08%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	3.597.594,77	0,00	0,00	3.831.523,98	233.929,21	6,50%	6,50%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	11.899.761,67	0,00	1.000.000,00	11.122.025,26	222.263,59	1,87%	1,98%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	4.496.568,40	0,00	500.000,00	4.133.894,83	137.326,43	3,05%	3,12%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.245.461,03	0,00	1.000.000,00	6.369.900,31	124.439,28	1,72%	1,75%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	5.560.971,92	1.000.000,00	1.000.000,00	5.685.061,14	124.089,22	1,89%	2,48%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	5.537.902,98	389.483,39	0,00	6.040.810,41	113.424,04	1,91%	1,78%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	2.816.349,57	0,00	0,00	2.916.325,13	99.975,56	3,55%	3,55%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	0,00	1.500.000,00	0,00	1.569.673,35	69.673,35	4,64%	-5,44%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,00	6.000.000,00	0,00	6.057.448,49	57.448,49	0,96%	-
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P...	3.443.493,88	0,00	3.000.000,00	480.101,84	36.607,96	1,06%	1,50%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	1.031.972,48	20.434.474,35	20.871.156,72	626.360,48	31.070,37	0,14%	1,34%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	1.707.910,29	0,00	1.500.000,00	227.248,83	19.338,54	1,13%	1,61%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.215.028,77	0,00	0,00	1.231.659,78	16.631,01	1,37%	1,37%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	0,00	2.500.000,00	0,00	2.508.662,00	8.662,00	0,35%	-
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	386.193,87	0,00	389.483,39	0,00	3.289,52	0,85%	1,60%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC...	0,00	2.000.000,00	0,00	1.930.548,01	-69.451,99	-3,47%	-2,03%

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 IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	4.560.212,67	0,00	0,00	4.480.487,69	-79.724,98	-1,75%	-1,75%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	0,00	1.500.000,00	0,00	1.411.296,46	-88.703,54	-5,91%	-5,38%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	4.347.622,63	500.000,00	0,00	4.756.267,08	-91.355,55	-1,88%	-1,86%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	4.282.122,41	500.000,00	0,00	4.689.896,97	-92.225,44	-1,93%	-1,88%
				Total Renda Fixa	2.647.286,89	2,28%	

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
BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES	0,00	2.000.000,00	0,00	2.470.789,91	470.789,91	23,54%	-22,01%
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	0,00	1.000.000,00	0,00	1.332.951,56	332.951,56	33,30%	-22,03%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	2.271.954,97	0,00	0,00	2.309.189,28	37.234,31	1,64%	1,64%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MUL...	1.691.564,05	0,00	1.691.743,61	0,00	179,56	0,01%	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.550.607,51	0,00	0,00	1.534.609,55	-15.997,96	-1,03%	-1,03%
AZ QUEST EQUITY HEDGE FIC MULTIMERCADO	2.163.743,15	0,00	0,00	2.142.713,73	-21.029,42	-0,97%	-0,97%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	1.538.748,15	1.000.000,00	0,00	2.500.812,13	-37.936,02	-1,49%	-1,62%
SANTANDER STAR LONG & SHORT DIRECIONAL FIC MULTIME...	2.022.551,78	0,00	0,00	1.978.716,67	-43.835,11	-2,17%	-2,17%
CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP	1.668.930,72	0,00	0,00	1.555.102,07	-113.828,65	-6,82%	-6,82%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	2.319.905,44	0,00	0,00	2.000.094,31	-319.811,13	-13,79%	-13,79%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	2.266.141,19	0,00	0,00	1.856.685,26	-409.455,93	-18,07%	-18,07%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	3.360.296,89	0,00	0,00	2.736.323,22	-623.973,67	-18,57%	-18,57%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	3.332.054,39	0,00	0,00	2.657.121,18	-674.933,21	-20,26%	-20,26%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	1.505.049,45	0,00	0,00	828.360,55	-676.688,90	-44,96%	-44,96%
SANTANDER SELEÇÃO 30 FIC AÇÕES	3.486.688,58	0,00	0,00	2.689.868,49	-796.820,09	-22,85%	-22,85%
META VALOR FI AÇÕES	8.165.634,06	0,00	0,00	7.123.246,21	-1.042.387,85	-12,77%	-12,77%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	7.470.245,72	0,00	0,00	6.290.444,68	-1.179.801,04	-15,79%	-15,79%
				Total Renda Variável	-5.115.343,64	-10,86%	

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

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	0,00	1.000.000,00	0,00	1.288.411,00	288.411,00	28,84%	32,85%
BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I	0,00	3.000.000,00	0,00	3.262.131,56	262.131,56	8,74%	29,32%
				Total Exterior	550.542,56	13,76%	