

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)

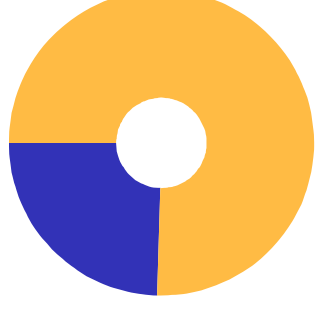
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	560.567,46	3,53%	884	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	1.483.468,49	9,35%	901	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI R...	D+0	Não há	1.379.478,73	8,69%	956	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.047.011,07	6,60%	1.364	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	1.043.849,99	6,58%	622	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	2.427.864,03	15,30%	763	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	707.825,25	4,46%	912	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	124.020,35	0,78%	64	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	45.051,70	0,28%	1.262	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	219.963,93	1,39%	742	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	694.048,46	4,37%	287	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA...	D+3	Não há	720.480,64	4,54%	419	0,26%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADE FI RENDA FIXA	D+0	Não há	134.306,35	0,85%	318	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	143.073,14	0,90%	106	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	D+0	Não há	176.714,76	1,11%	203	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1 du	Não há	124.815,45	0,79%	56	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	946.592,55	5,96%	174	0,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	930.118,58	5,86%	2.513	0,12%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ DUNA MIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	288.254,19	1,82%	49.451	0,01%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	423.608,98	2,67%	162	0,01%	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
BRDESCO SELECTION FIAÇÕES	D+4	Não há	322.973,96	2,03%	204	0,05%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIAÇÕES	D+4	Não há	461.195,71	2,91%	556	0,12%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	986.446,25	6,22%	20.627	0,04%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	479.919,39	3,02%	18.591	0,01%	Artigo 8º, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			15.871.649,41				

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, Alinea 'b'	100,00%	8.819.137,07	55,57%	15,00%	25,00%	90,00%	5.465.347,40
Artigo 7º, Inciso III, Alinea 'a'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	9.522.989,65
Artigo 7º, Inciso IV, Alinea 'a'	40,00%	3.159.995,28	19,91%	10,00%	30,00%	40,00%	3.188.664,48
Artigo 7º, Inciso VI, Alinea 'a'	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	2.380.747,41
Artigo 7º, Inciso VII, Alinea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	793.582,47
Artigo 7º, Inciso VII, Alinea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	793.582,47
Artigo 7º, Inciso VII, Alinea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	793.582,47
Total Renda Fixa	100,00%	11.979.132,35	75,48%	25,00%	70,00%	220,00%	

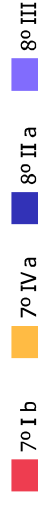


RENDA FIXA 11.979.132,35

RENDA VARIÁVEL 3.892.517,06

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 II, Alinea 'a'	20,00%	2.426.151,42	15,29%	7,00%	10,00%	20,00%	748.178,46
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	1.466.365,64	9,24%	7,00%	10,00%	10,00%	120.799,30
Artigo 8º, Inciso IV, Alinea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	793.582,47
Artigo 8º, Inciso IV, Alinea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	793.582,47
Artigo 8º, Inciso IV, Alinea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	793.582,47
Total Renda Variável	30,00%	3.892.517,06	24,52%	14,00%	30,00%	45,00%	



Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2020			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	1.587.164,94
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	

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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	10.564.807,37	66,56	0,00
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	2.330.628,79	14,68	0,00
ITAÚ UNIBANCO	1.529.931,98	9,64	0,00
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	1.446.281,27	9,11	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, Alinea ' b '	8.819.137,07	55,57	15,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alinea ' a '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alinea ' a '	3.159.995,28	19,91	10,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alinea ' a '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alinea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alinea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alinea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso II, Alinea ' a '	2.426.151,42	15,29	7,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	1.466.365,64	9,24	7,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alinea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alinea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alinea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso II	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
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%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,28%	2,60%	1,15%	2,60%	5,98%	13,67%	-	-
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,28%	2,46%	1,11%	2,46%	5,77%	13,16%	0,00%	0,01%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,26%	2,45%	1,06%	2,45%	5,71%	13,15%	0,00%	0,00%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,26%	2,48%	1,09%	2,48%	5,78%	13,28%	0,00%	0,00%
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%	-	-
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%
CDI (Benchmark)	0,21%	1,75%	0,73%	1,75%	4,58%	11,21%	-	-
BRADERCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	0,19%	1,60%	0,67%	1,60%	4,31%	10,61%	0,00%	0,00%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,13%	1,24%	0,49%	1,24%	3,50%	8,88%	0,00%	0,00%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDA DES FI RENDA FIXA	0,15%	1,34%	0,54%	1,34%	3,73%	9,38%	0,00%	0,00%

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

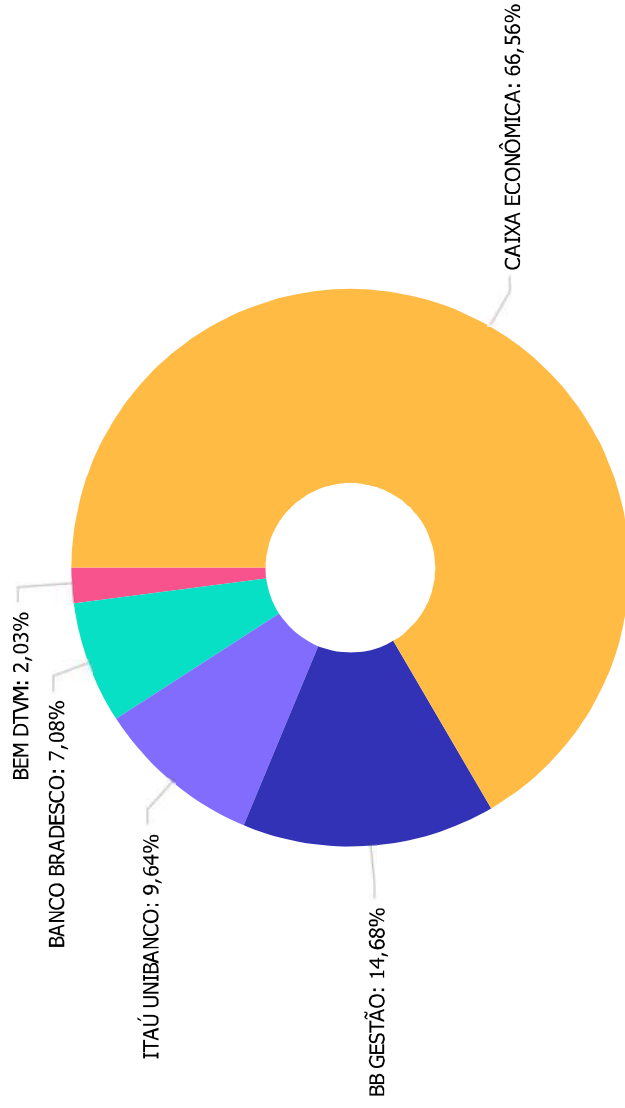
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA (Benchmark)	0,26%	0,10%	-0,43%	0,10%	2,12%	5,57%	-	-
ITÁ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,44%	2,27%	1,12%	2,27%	5,62%	19,25%	0,00%	0,01%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,75%	4,63%	3,27%	4,63%	9,82%	28,20%	0,01%	0,03%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,95%	1,78%	3,13%	1,78%	6,24%	22,63%	0,01%	0,04%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,66%	-	-	-	-	-	0,01%	-
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	0,21%	1,86%	0,78%	1,86%	4,68%	11,21%	0,00%	0,00%
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	1,05%	2,96%	3,58%	2,96%	8,28%	19,85%	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
Ibovespa (Benchmark)	8,76%	-17,80%	30,18%	-17,80%	-6,20%	30,64%	-	-
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIAÇÕES	9,07%	-21,11%	27,93%	-21,11%	-8,75%	24,85%	0,12%	0,39%
ITAU INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	12,10%	-28,51%	33,61%	-28,51%	-13,13%	23,01%	0,15%	0,50%
BRADESCO SELECTION FIAÇÕES	8,95%	-24,53%	25,56%	-24,53%	-13,48%	19,34%	0,12%	0,39%
ITAU 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%

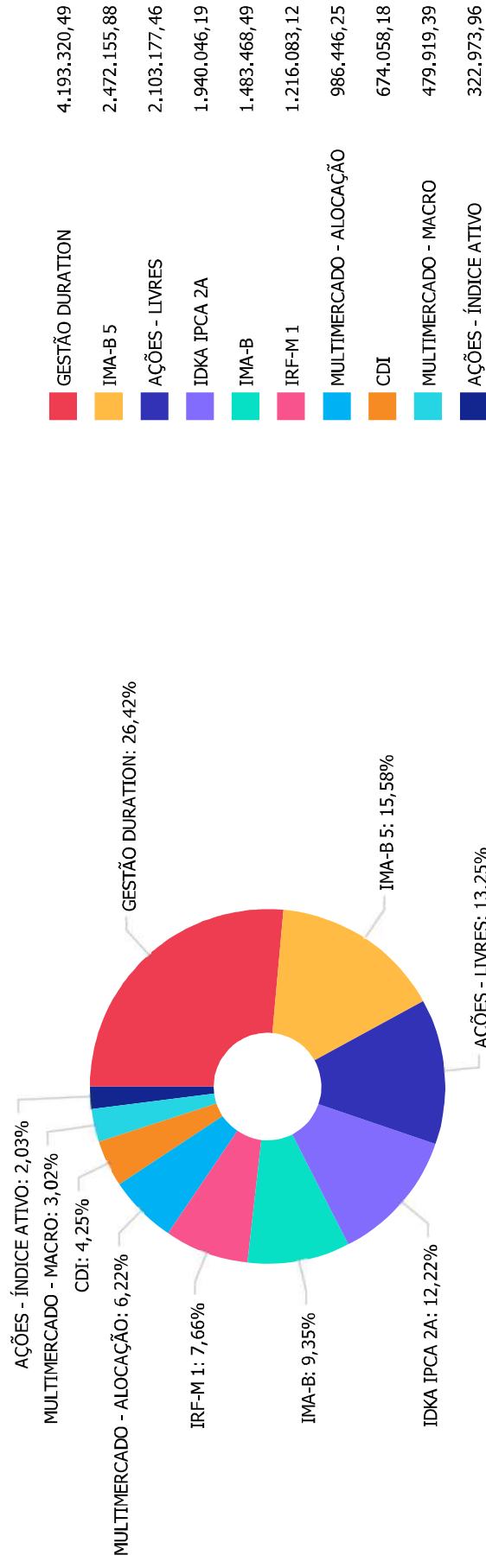
CDI (Benchmark)	0,21%	1,75%	0,73%	1,75%	4,58%	11,21%	-	-
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	2,60%	-3,10%	8,72%	-3,10%	3,61%	18,53%	0,03%	0,11%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,25%	-1,03%	5,40%	-1,03%	6,27%	25,21%	0,01%	0,07%

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



Administrador	Valor
CAIXA ECONÔMICA	10.564.807,37
BB GESTÃO	2.330.628,79
ITAÚ UNIBANCO	1.529.931,98
BANCO BRADESCO	1.123.307,31
BEM DTVM	322.973,96

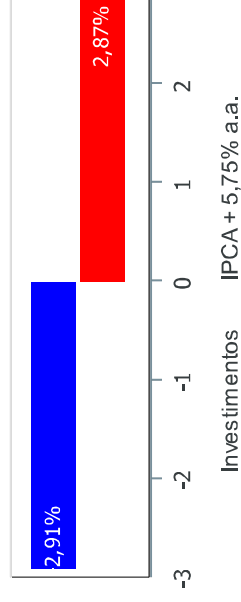
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Junho / 2020)



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

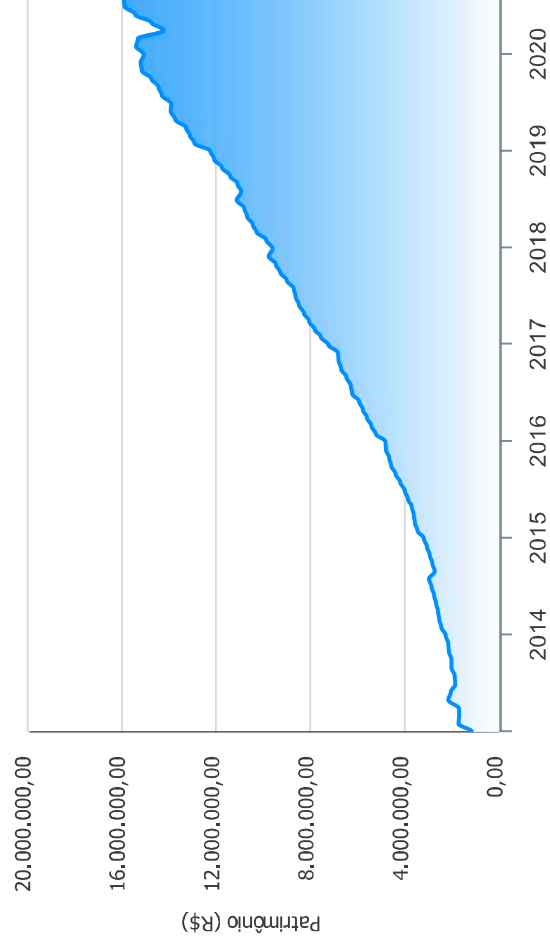
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	15.059.069,11	1.384.523,56	1.102.977,45	15.393.273,05	52.657,83	52.657,83	0,34%	0,34%	0,70%	0,70%	49,02%	2,67%
Fevereiro	15.393.273,05	591.180,86	415.821,46	15.308.565,69	-260.066,76	-207.408,93	-1,67%	-1,33%	0,65%	1,36%	-98,30%	3,76%
Março	15.308.565,69	306.222,91	172.307,47	14.213.051,70	-1.229.429,43	-1.436.838,36	-7,96%	-9,19%	0,56%	1,92%	-477,75%	13,88%
Abril	14.213.051,70	296.220,10	67.703,42	14.747.318,75	305.750,37	-1.131.087,99	2,12%	-7,27%	0,13%	2,06%	-352,85%	6,73%
Mai	14.747.318,75	816.079,90	500.525,03	15.413.531,89	350.658,27	-780.429,72	2,33%	-5,11%	0,06%	2,12%	-240,50%	3,59%
Junho	15.413.531,89	1.508.612,42	1.409.084,28	15.871.649,41	358.589,38	-421.840,34	2,31%	-2,91%	0,73%	2,87%	-101,61%	3,01%

Investimentos x Meta Atuarial

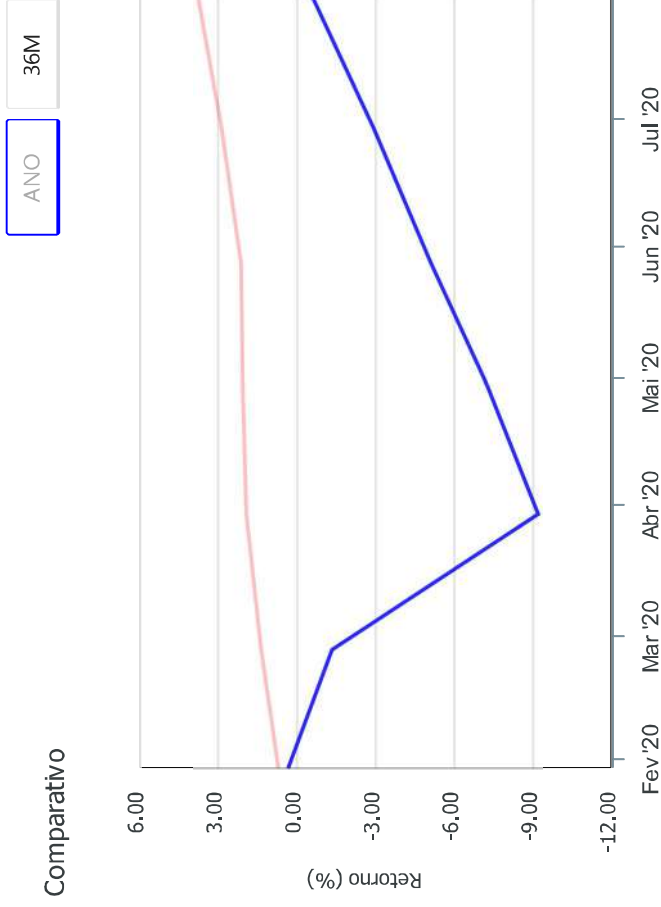


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



ANO

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 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.157.511,32	300.000,00	0,00	1.483.468,49	25.957,17	1,78%	2,03%	2,99%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	553.849,20	0,00	0,00	560.567,46	6.718,26	1,21%	1,21%	0,81%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.363.454,38	0,00	0,00	1.379.478,73	16.024,35	1,18%	1,18%	0,86%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.032.740,05	0,00	0,00	1.043.849,99	11.109,94	1,08%	1,08%	0,89%
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA L...	712.971,00	0,00	0,00	720.480,64	7.509,64	1,05%	1,05%	0,90%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	937.683,81	0,00	0,00	946.592,55	8.908,74	0,95%	0,95%	1,28%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	2.011.253,67	400.000,00	0,00	2.427.864,03	16.610,36	0,69%	0,75%	1,17%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	123.993,29	0,00	0,00	124.815,45	822,16	0,66%	0,66%	1,04%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.498.033,37	0,00	800.000,00	707.825,25	9.791,88	0,65%	1,10%	0,91%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	691.036,67	0,00	0,00	694.048,46	3.011,79	0,44%	0,44%	0,38%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.044.304,05	0,00	0,00	1.047.011,07	2.707,02	0,26%	0,26%	0,05%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	44.936,35	0,00	0,00	45.051,70	115,35	0,26%	0,26%	0,05%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	178.457,08	65.000,00	120.000,00	124.020,35	563,27	0,23%	0,28%	0,06%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	142.772,33	0,00	0,00	143.073,14	300,81	0,21%	0,21%	0,02%
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	176.374,58	0,00	0,00	176.714,76	340,18	0,19%	0,19%	0,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	180.668,18	39.026,37	0,00	219.963,93	269,38	0,12%	0,13%	0,01%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADE FI RENDA FIXA	141.412,38	481.747,75	489.084,28	134.306,35	230,50	0,04%	0,14%	0,01%
Total Renda Fixa	11.991.451,71	1.285.774,12	1.409.084,28	11.979.132,35	110.990,80	0,84%		1,07%

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	377.891,40	0,00	0,00	423.608,98	45.717,58	12,10%	12,10%	14,62%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	846.507,53	0,00	0,00	930.118,58	83.611,05	9,88%	9,88%	12,39%
ITAÚ DUNA MIS FIC AÇÕES	263.775,69	0,00	0,00	288.254,19	24.478,50	9,28%	9,28%	13,00%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIAÇÕES	422.838,47	0,00	0,00	461.195,71	38.357,24	9,07%	9,07%	12,25%
BRADESCO SELECTION FIAÇÕES	296.433,62	0,00	0,00	322.973,96	26.540,34	8,95%	8,95%	12,00%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	961.448,80	0,00	0,00	986.446,25	24.997,45	2,60%	2,60%	3,49%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	253.184,67	222.838,30	0,00	479.919,39	3.896,42	0,82%	1,25%	1,24%
Total Renda Variável	3.422.080,18	222.838,30	0,00	3.892.517,06	247.598,58	6,79%		9,00%

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 (%)	(%) Insstit
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1.962.096,54	400.000,00	0,00	2.427.864,03	66.767,49	2,78%	3,27%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.125.728,54	300.000,00	0,00	1.483.468,49	57.739,95	4,05%	4,91%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.460.351,71	0,00	800.000,00	707.825,25	47.473,54	3,25%	3,71%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.332.287,67	0,00	0,00	1.379.478,73	47.191,06	3,54%	3,54%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.006.523,29	0,00	0,00	1.043.849,99	37.326,70	3,71%	3,71%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	917.878,37	0,00	0,00	946.592,55	28.714,18	3,13%	3,13%
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA L...	695.575,99	0,00	0,00	720.480,64	24.904,65	3,58%	3,58%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	541.234,21	0,00	0,00	560.567,46	19.333,25	3,57%	3,57%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.035.728,54	0,00	0,00	1.047.011,07	11.282,53	1,09%	1,09%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	564.641,13	122.704,63	0,00	694.048,46	6.702,70	0,98%	1,12%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	157.038,21	95.000,00	130.000,00	124.020,35	1.982,14	0,79%	1,11%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,00	123.120,61	0,00	124.815,45	1.694,84	1,38%	-
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	175.545,24	0,00	0,00	176.714,76	1.169,52	0,67%	0,67%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	141.964,17	0,00	0,00	143.073,14	1.108,97	0,78%	0,78%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADE FI RENDA FIXA	42.890,03	1.137.885,38	1.047.312,73	134.306,35	843,67	0,07%	0,54%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	219.363,50	0,00	219.963,93	600,43	0,27%	0,49%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	44.578,55	0,00	0,00	45.051,70	473,15	1,06%	1,06%
			Total Renda Fixa		354.308,77	3,05%	

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	698.185,38	0,00	0,00	930.118,58	231.933,20	33,22%	33,22%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	317.045,61	0,00	0,00	423.608,98	106.563,37	33,61%	33,61%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIAÇÕES	360.499,68	0,00	0,00	461.195,71	100.696,03	27,93%	27,93%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	907.316,32	0,00	0,00	986.446,25	79.129,93	8,72%	8,72%
BRADESCO SELECTION FIAÇÕES	257.231,55	0,00	0,00	322.973,96	65.742,41	25,56%	25,56%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	225.491,32	0,00	0,00	288.254,19	62.762,87	27,83%	27,83%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	243.219,65	222.838,30	0,00	479.919,39	13.861,44	2,97%	5,40%
			Total Renda Variável		660.689,25	20,44%	

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 (%)	(%) Insstit
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIRENDA FIXA	1.764.644,47	573.138,05	0,00	2.427.864,03	90.081,51	3,85%	4,63%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FIREND...	1.337.742,46	0,00	0,00	1.379.478,73	41.736,27	3,12%	3,12%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FIRENDA FIX...	1.469.776,04	0,00	800.000,00	707.825,25	38.049,21	2,59%	3,04%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.609.666,18	0,00	600.000,00	1.043.849,99	34.183,81	2,12%	3,08%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIRENDA FIX...	1.021.632,06	0,00	0,00	1.047.011,07	25.379,01	2,48%	2,48%
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA L...	699.779,30	0,00	0,00	720.480,64	20.701,34	2,96%	2,96%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENC...	544.851,79	0,00	0,00	560.567,46	15.715,67	2,88%	2,88%
ITAÚ INSTITUCIONAL- ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	558.325,63	122.704,63	0,00	694.048,46	13.018,20	1,91%	2,27%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	583.980,26	350.000,00	0,00	946.592,55	12.612,29	1,35%	1,78%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FIC RENDA FIXA	3.187,26	390.761,19	273.000,00	124.020,35	3.071,90	0,78%	2,46%
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA	173.925,73	0,00	0,00	176.714,76	2.789,03	1,60%	1,60%
CAIXA ALIANÇA TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	140.460,79	0,00	0,00	143.073,14	2.612,35	1,86%	1,86%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,00	123.120,61	0,00	124.815,45	1.694,84	1,38%	-
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDA DES FIC RENDA FIXA	82.698,57	1.364.264,33	1.313.971,96	134.306,35	1.315,41	0,09%	1,34%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	43.973,47	0,00	0,00	45.051,70	1.078,23	2,45%	2,45%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	350.510,26	131.447,15	219.963,93	900,82	0,26%	1,24%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA ...	1.203.527,38	300.000,00	0,00	1.483.468,49	-20.058,89	-1,33%	-1,88%
		Total Renda Fixa			284.881,00	2,44%	

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
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	259.029,62	222.838,30	0,00	479.919,39	-1.948,53	-0,40%	-1,03%
CAIXA RY 30 FI MULTIMERCADO LP	1.267.756,45	0,00	250.000,00	986.446,25	-31.310,20	-2,47%	-3,10%
ITAU DUNA MIS FIC AÇÕES	370.722,26	0,00	0,00	288.254,19	-82.468,07	-22,25%	-22,25%
BRADESCO SELECTION FIAÇÕES	733.431,13	0,00	300.000,00	322.973,96	-110.457,17	-15,06%	-24,53%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FIAÇÕES	0,00	600.000,00	0,00	461.195,71	-138.804,29	-23,13%	-21,10%
ITAU INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	592.552,93	0,00	0,00	423.608,98	-168.943,95	-28,51%	-28,51%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	597.405,33	505.502,38	0,00	930.118,58	-172.789,13	-15,67%	-14,67%
			Total Renda Variável		-706.721,34	-15,37%	