

# 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 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	3.097.567,79	1,51%	340	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	2.040.153,52	1,00%	1.364	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	2.051.909,17	1,00%	622	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA...	D+1	Não há	249.628,00	0,12%	135	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA...	D+0	Não há	5.643.561,82	2,76%	229	0,43%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	16/08/2020	5.703.656,57	2,79%	107	0,57%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	3.716.245,99	1,82%	912	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	36.001.696,67	17,60%	956	0,47%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	D+0	15/08/2022	2.326.880,90	1,14%	45	1,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	24.106.106,59	11,78%	884	0,39%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	1.670.997,33	0,82%	1.262	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	39.776.828,78	19,44%	763	0,33%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	2.966.153,79	1,45%	714	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.310.888,43	1,13%	118	0,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVI...	D+2	Não há	1.621.158,28	0,79%	310	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	12.396.805,77	6,06%	901	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	11.129.825,07	5,44%	670	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	5.543.201,23	2,71%	600	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	7.623.001,66	3,73%	74	0,53%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	D+0	Não há	1.006.531,85	0,49%	305	0,03%	Artigo 7º, Inciso III, 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 ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	2.842.383,93	1,39%	174	0,24%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.318.225,90	1,13%	318	0,45%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.525.521,43	0,75%	105	0,16%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	2.326.057,34	1,14%	287	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	D+4	Não há	2.407.792,49	1,18%	1.411	0,29%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	D+4	Não há	1.840.891,81	0,90%	96	0,21%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	3.263.570,62	1,60%	1.560	0,38%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	2.104.708,23	1,03%	2.513	0,27%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	1.485.523,66	0,73%	203	0,31%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	4.710.578,60	2,30%	18.591	0,10%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MUL...	D+2	01/10/2020	2.352.641,55	1,15%	956	0,46%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES II FIC ...	D+2	27 meses	1.571.277,68	0,77%	723	1,51%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	4.866.575,35	2,38%	20.627	0,20%	Artigo 8º, Inciso III
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>204.598.547,80</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 ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	40.919.709,56
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	169.976.267,36	83,08%	20,00%	30,00%	100,00%	34.622.280,44
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	1.006.531,85	0,49%	0,00%	10,00%	60,00%	121.752.596,83
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	9.012.188,60	4,40%	1,00%	30,00%	40,00%	72.827.230,52
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	30.689.782,17
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	10.229.927,39
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	10.229.927,39
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>179.994.987,81</b>	<b>87,97%</b>	<b>21,00%</b>	<b>70,00%</b>	<b>245,00%</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%	4.248.684,30	2,08%	0,00%	0,00%	5,00%	5.981.243,09
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	5.368.278,85	2,62%	0,00%	15,00%	20,00%	35.551.430,71
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	14.986.596,84	7,32%	0,00%	10,00%	10,00%	5.473.257,94
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	10.229.927,39
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>24.603.559,99</b>	<b>12,03%</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	136.770.949,54	66,85	0,03
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	58.822.747,13	28,75	0,00
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	5.153.272,36	2,52	0,00
ITAÚ UNIBANCO	2.326.057,34	1,14	0,00
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	1.525.521,43	0,75	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 ' a '	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	169.976.267,36	83,08	20,00	100,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	1.006.531,85	0,49	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	9.012.188,60	4,40	1,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	15,00
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 '	4.248.684,30	2,08	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	5.368.278,85	2,62	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	14.986.596,84	7,32	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 PRÉ 2 ANOS (Benchmark)</b>	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%
<b>IDKA IPCA 3 Anos (Benchmark)</b>	1,18%	4,42%	4,96%	4,42%	10,45%	29,48%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,18%	3,36%	3,77%	3,36%	8,94%	27,78%	0,01%	0,04%
<b>IMA Geral ex-C (Benchmark)</b>	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%
<b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>	0,99%	3,35%	3,35%	3,35%	8,68%	23,17%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,21%	2,88%	3,57%	2,88%	8,18%	21,13%	0,01%	0,03%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,18%	3,12%	3,54%	3,12%	8,19%	21,36%	0,01%	0,03%
<b>IMA 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%	0,01%	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%	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%

**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>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%	0,00%	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%
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	1,12%	3,17%	3,77%	3,17%	8,73%	24,75%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,10%	3,04%	3,71%	3,04%	8,51%	24,21%	0,01%	0,04%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,08%	3,08%	3,71%	3,08%	8,59%	24,25%	0,01%	0,04%
<b>IMA-B (Benchmark)</b>	2,05%	-1,66%	4,96%	-1,66%	4,73%	35,13%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,02%	-1,75%	4,90%	-1,75%	4,74%	34,48%	0,03%	0,10%
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%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,24%	1,43%	5,16%	1,43%	4,77%	20,97%	0,02%	0,07%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,89%	-1,96%	1,68%	-1,96%	-0,62%	3,40%	0,00%	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%	0,01%	0,02%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,21%	1,75%	0,73%	1,75%	4,58%	11,21%	-	-

**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
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,15%	1,34%	0,54%	1,34%	3,73%	9,38%	0,00%	0,00%
<b>IPCA (Benchmark)</b>	0,26%	0,10%	-0,43%	0,10%	2,12%	5,57%	-	-
ITAÚ 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 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 VARIÁVEL**

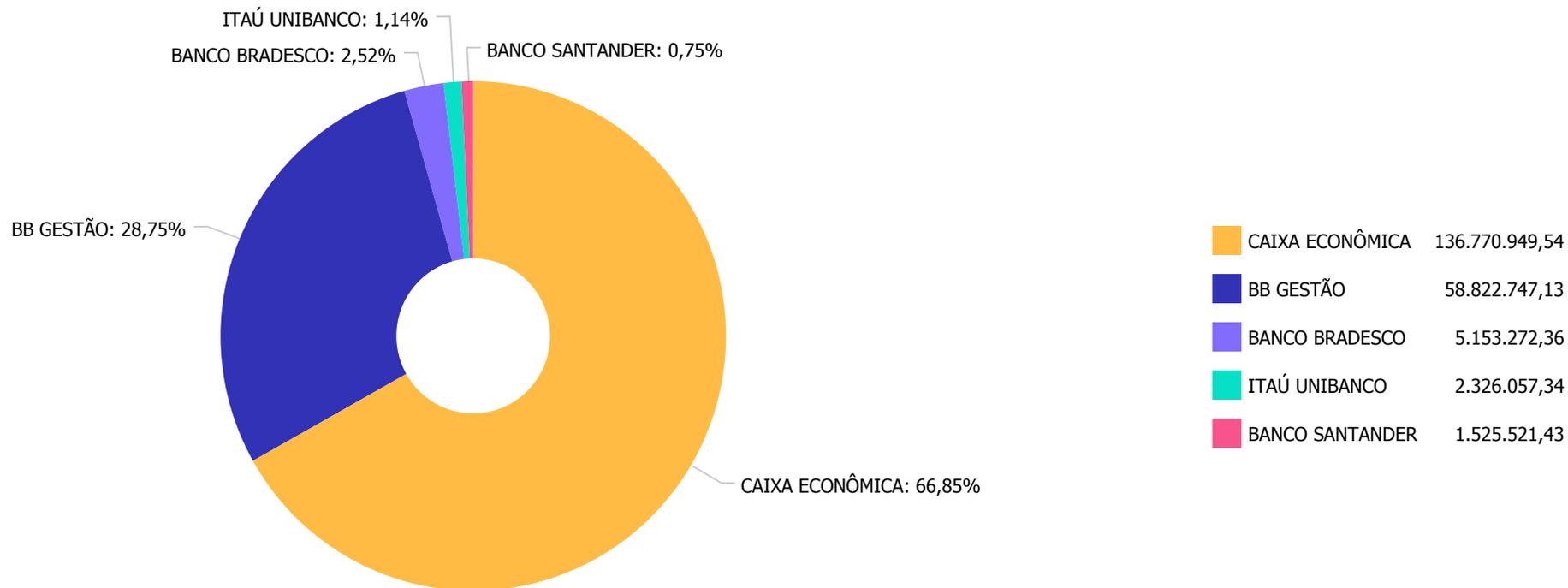
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IBX-50 (Benchmark)</b>	9,33%	-17,76%	31,79%	-17,76%	-7,36%	27,59%	-	-
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	9,45%	-18,44%	31,25%	-18,44%	-6,86%	25,17%	0,13%	0,39%

<b>IGC (Benchmark)</b>	9,24%	-15,27%	32,66%	-15,27%	0,83%	43,12%	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	8,89%	-17,46%	30,78%	-17,46%	-3,94%	35,59%	0,12%	0,38%

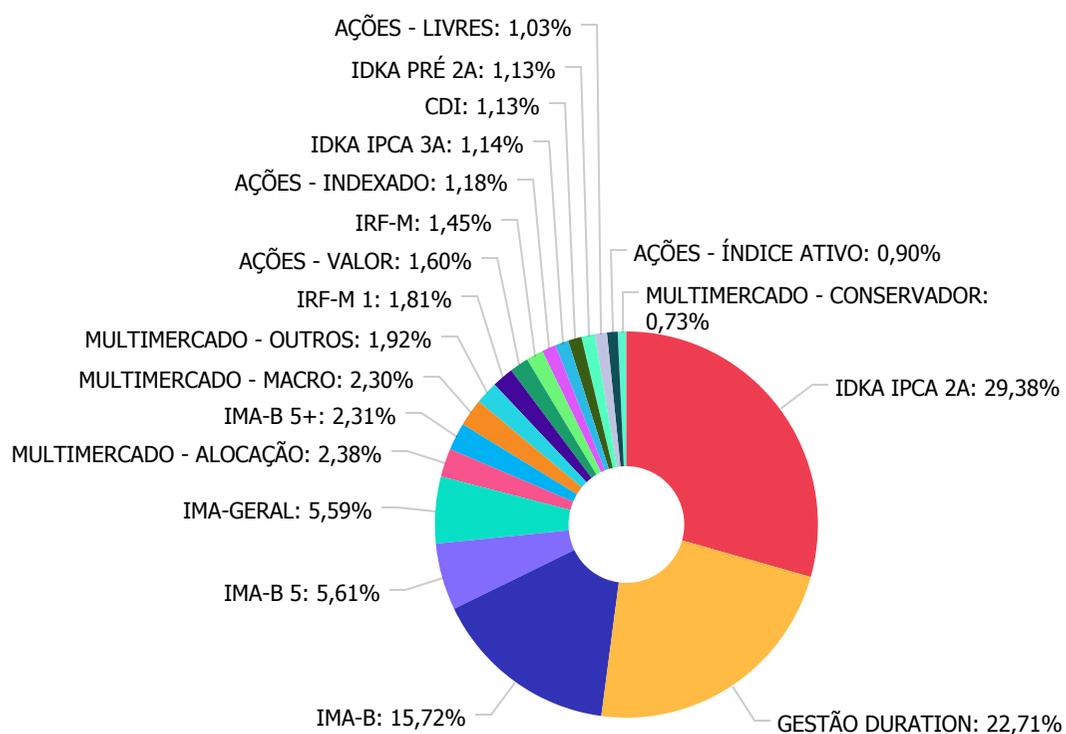
<b>Ibovespa (Benchmark)</b>	8,76%	-17,80%	30,18%	-17,80%	-6,20%	30,64%	-	-
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	7,44%	-18,07%	25,17%	-18,07%	-4,94%	52,01%	0,13%	0,34%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	0,11%	1,79%	0,62%	1,79%	5,40%	-	0,00%	0,01%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	9,88%	-14,67%	33,22%	-14,67%	5,17%	-	0,12%	0,41%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES II FIC MULTIMERCADO	0,77%	3,80%	2,87%	3,80%	-	-	0,01%	-

<b>CDI (Benchmark)</b>	0,21%	1,75%	0,73%	1,75%	4,58%	11,21%	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,46%	0,93%	1,74%	0,93%	5,64%	14,07%	0,01%	0,02%
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)



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

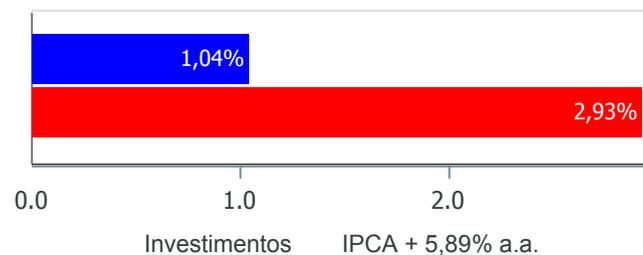


IDKA IPCA 2A	60.107.803,26
GESTÃO DURATION	46.470.791,48
IMA-B	32.156.164,35
IMA-B 5	11.471.811,73
IMA-GERAL	11.436.391,05
MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	4.866.575,35
IMA-B 5+	4.718.726,07
MULTIMERCADO - MACRO	4.710.578,60
MULTIMERCADO - OUTROS	3.923.919,23
IRF-M 1	3.711.150,85
AÇÕES - VALOR	3.263.570,62
IRF-M	2.966.153,79
AÇÕES - INDEXADO	2.407.792,49
IDKA IPCA 3A	2.326.880,90
CDI	2.318.225,90
IDKA PRÉ 2A	2.310.888,43
AÇÕES - LIVRES	2.104.708,23
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	1.840.891,81
MULTIMERCADO - CONSERVADOR	1.485.523,66

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

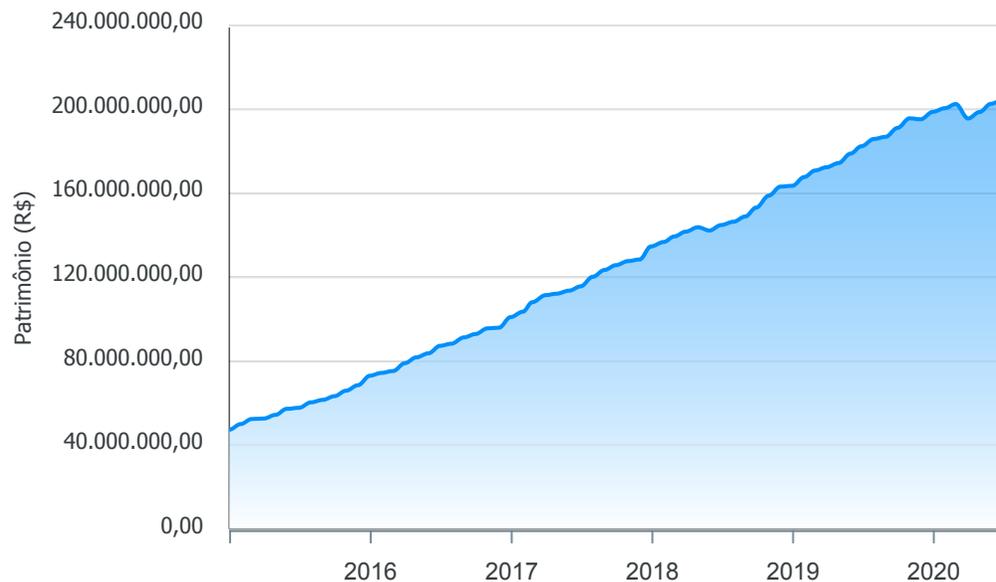
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	198.859.953,22	1.591.702,41	754.383,91	200.571.576,40	874.304,68	874.304,68	0,44%	0,44%	0,71%	0,71%	61,50%	1,25%
Fevereiro	200.571.576,40	8.226.132,40	6.056.323,21	202.557.968,84	-183.416,75	690.887,93	-0,09%	0,35%	0,66%	1,38%	25,19%	2,15%
Março	202.557.968,84	4.435.630,60	3.723.823,29	195.665.115,61	-7.604.660,54	-6.913.772,61	-3,74%	-3,41%	0,57%	1,96%	-174,16%	9,97%
Abril	195.665.115,61	3.805.087,07	3.115.870,21	198.753.405,24	2.399.072,77	-4.514.699,84	1,22%	-2,23%	0,14%	2,10%	-105,90%	5,24%
Mai	198.753.405,24	1.173.551,55	908.085,80	202.644.890,37	3.626.019,38	-888.680,46	1,82%	-0,45%	0,07%	2,18%	-20,46%	2,34%
Junho	202.644.890,37	1.778.237,91	2.849.984,09	204.598.547,80	3.025.403,61	2.136.723,15	1,49%	1,04%	0,74%	2,93%	35,48%	1,90%

**Investimentos x Meta Atuarial**



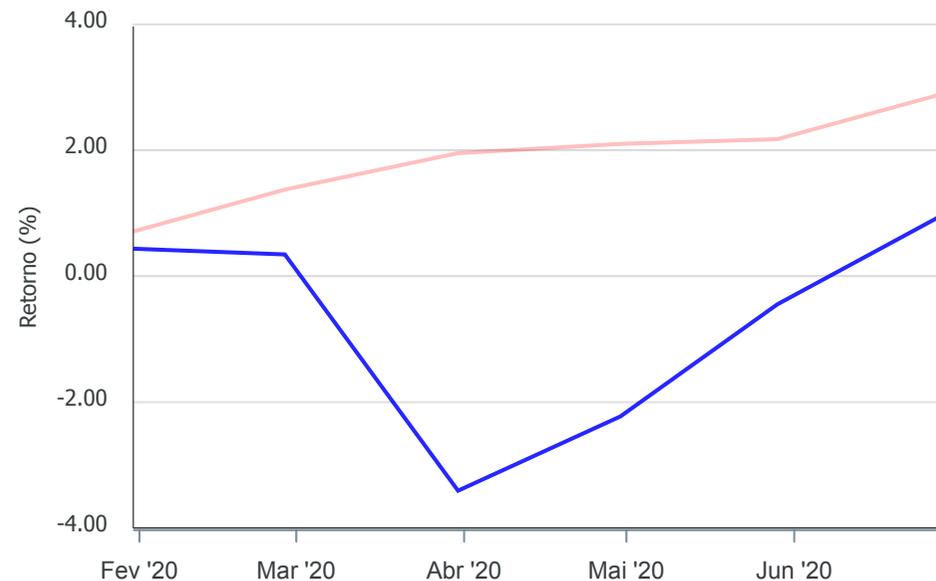
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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...	3.012.399,95	0,00	0,00	3.097.567,79	85.167,84	2,83%	2,83%	4,98%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	1.577.001,48	0,00	0,00	1.621.158,28	44.156,80	2,80%	2,80%	4,98%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	12.150.729,77	0,00	0,00	12.396.805,77	246.076,00	2,03%	2,03%	2,99%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	986.554,21	0,00	0,00	1.006.531,85	19.977,64	2,02%	2,02%	2,98%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	10.909.502,42	0,00	0,00	11.129.825,07	220.322,65	2,02%	2,02%	2,98%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.529.819,33	0,00	0,00	7.623.001,66	93.182,33	1,24%	1,24%	1,72%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	23.817.200,93	0,00	0,00	24.106.106,59	288.905,66	1,21%	1,21%	0,81%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRI...	2.299.687,65	0,00	0,00	2.326.880,90	27.193,25	1,18%	1,18%	0,85%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	35.583.492,37	0,00	0,00	36.001.696,67	418.204,30	1,18%	1,18%	0,86%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.675.862,34	0,00	0,00	3.716.245,99	40.383,65	1,10%	1,10%	0,91%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2.030.070,22	0,00	0,00	2.051.909,17	21.838,95	1,08%	1,08%	0,89%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.815.633,21	0,00	0,00	2.842.383,93	26.750,72	0,95%	0,95%	1,28%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.491.107,54	0,00	0,00	5.543.201,23	52.093,69	0,95%	0,95%	1,27%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	5.593.647,35	0,00	0,00	5.643.561,82	49.914,47	0,89%	0,89%	1,18%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	5.653.284,18	0,00	0,00	5.703.656,57	50.372,39	0,89%	0,89%	0,40%
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P...	247.462,77	0,00	0,00	249.628,00	2.165,23	0,87%	0,87%	1,16%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.943.431,24	0,00	0,00	2.966.153,79	22.722,55	0,77%	0,77%	1,17%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	39.456.020,77	24.927,33	0,00	39.776.828,78	295.880,68	0,75%	0,75%	1,17%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	2.294.805,05	0,00	0,00	2.310.888,43	16.083,38	0,70%	0,70%	0,92%
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	2.315.963,56	0,00	0,00	2.326.057,34	10.093,78	0,44%	0,44%	0,38%

**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
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	1.520.397,76	0,00	0,00	1.525.521,43	5.123,67	0,34%	0,34%	0,31%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.034.878,85	0,00	0,00	2.040.153,52	5.274,67	0,26%	0,26%	0,05%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.574.520,87	92.283,94	0,00	1.670.997,33	4.192,52	0,25%	0,26%	0,05%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	3.501.730,49	1.661.026,64	2.849.984,09	2.318.225,90	5.452,86	0,11%	0,14%	0,01%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>179.015.204,31</b>	<b>1.778.237,91</b>	<b>2.849.984,09</b>	<b>179.994.987,81</b>	<b>2.051.529,68</b>	<b>1,13%</b>		<b>1,34%</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
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	1.915.509,96	0,00	0,00	2.104.708,23	189.198,27	9,88%	9,88%	12,39%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	1.681.881,13	0,00	0,00	1.840.891,81	159.010,68	9,45%	9,45%	13,11%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	2.211.126,76	0,00	0,00	2.407.792,49	196.665,73	8,89%	8,89%	12,41%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	3.037.623,28	0,00	0,00	3.263.570,62	225.947,34	7,44%	7,44%	13,19%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	4.743.251,76	0,00	0,00	4.866.575,35	123.323,59	2,60%	2,60%	3,49%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	4.652.284,07	0,00	0,00	4.710.578,60	58.294,53	1,25%	1,25%	1,24%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES II FIC MU...	1.559.266,37	0,00	0,00	1.571.277,68	12.011,31	0,77%	0,77%	0,78%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1.478.680,32	0,00	0,00	1.485.523,66	6.843,34	0,46%	0,46%	0,86%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTI...	2.350.062,41	0,00	0,00	2.352.641,55	2.579,14	0,11%	0,11%	0,03%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>23.629.686,06</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>24.603.559,99</b>	<b>973.873,93</b>	<b>4,12%</b>		<b>6,04%</b>

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

**FUNDOS DE RENDA FIXA**

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	36.620.537,51	1.908.813,67	0,00	39.776.828,78	1.247.477,60	3,24%	3,27%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	34.770.102,28	0,00	0,00	36.001.696,67	1.231.594,39	3,54%	3,54%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	23.274.718,07	0,00	0,00	24.106.106,59	831.388,52	3,57%	3,57%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	11.817.096,70	0,00	0,00	12.396.805,77	579.709,07	4,91%	4,91%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	10.610.389,61	0,00	0,00	11.129.825,07	519.435,46	4,90%	4,90%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.248.986,72	0,00	0,00	7.623.001,66	374.014,94	5,16%	5,16%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	2.925.660,49	0,00	0,00	3.097.567,79	171.907,30	5,88%	5,88%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.383.727,69	0,00	0,00	5.543.201,23	159.473,54	2,96%	2,96%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	5.495.076,70	0,00	0,00	5.643.561,82	148.485,12	2,70%	2,70%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.583.399,35	0,00	0,00	3.716.245,99	132.846,64	3,71%	3,71%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	5.609.673,67	0,00	0,00	5.703.656,57	93.982,90	1,68%	1,68%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.842.354,49	30.722,49	0,00	2.966.153,79	93.076,81	3,24%	3,26%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	1.532.025,41	0,00	0,00	1.621.158,28	89.132,87	5,82%	5,82%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.756.162,36	0,00	0,00	2.842.383,93	86.221,57	3,13%	3,13%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRI...	2.242.302,81	0,00	0,00	2.326.880,90	84.578,09	3,77%	3,77%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.978.535,60	0,00	0,00	2.051.909,17	73.373,57	3,71%	3,71%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	2.240.526,58	0,00	0,00	2.310.888,43	70.361,85	3,14%	3,14%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	960.127,66	0,00	0,00	1.006.531,85	46.404,19	4,83%	4,83%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.511.698,26	0,00	1.500.000,00	2.040.153,52	28.455,26	0,81%	1,09%
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	2.300.217,99	0,00	0,00	2.326.057,34	25.839,35	1,12%	1,12%

**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
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	1.506.387,69	0,00	0,00	1.525.521,43	19.133,74	1,27%	1,27%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	2.948.185,92	4.725.056,43	5.373.940,10	2.318.225,90	18.923,65	0,25%	0,54%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.561.983,88	92.283,94	0,00	1.670.997,33	16.729,51	1,01%	1,06%
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P...	243.196,41	0,00	0,00	249.628,00	6.431,59	2,64%	2,64%
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>6.148.977,53</b>	<b>3,40%</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
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	2.607.422,28	0,00	0,00	3.263.570,62	656.148,34	25,16%	25,16%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	1.841.073,80	0,00	0,00	2.407.792,49	566.718,69	30,78%	30,78%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	1.579.880,88	0,00	0,00	2.104.708,23	524.827,35	33,22%	33,22%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	1.402.601,58	0,00	0,00	1.840.891,81	438.290,23	31,25%	31,25%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	4.476.192,24	0,00	0,00	4.866.575,35	390.383,11	8,72%	8,72%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	4.469.176,22	0,00	0,00	4.710.578,60	241.402,38	5,40%	5,40%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES II FIC MU...	1.527.519,41	0,00	0,00	1.571.277,68	43.758,27	2,86%	2,86%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1.460.120,24	0,00	0,00	1.485.523,66	25.403,42	1,74%	1,74%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTI...	2.338.055,11	0,00	0,00	2.352.641,55	14.586,44	0,62%	0,62%
				<b>Total Renda Variável</b>	<b>2.901.518,23</b>	<b>13,37%</b>	

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

**FUNDOS DE RENDA FIXA**

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	32.490.149,91	5.603.170,99	0,00	39.776.828,78	1.683.507,88	4,42%	4,63%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	34.912.461,65	0,00	0,00	36.001.696,67	1.089.235,02	3,12%	3,12%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	23.430.285,00	0,00	0,00	24.106.106,59	675.821,59	2,88%	2,88%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.515.844,43	0,00	179.531,45	7.623.001,66	286.688,68	3,81%	1,43%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	2.169.799,84	0,00	0,00	2.310.888,43	141.088,59	6,50%	6,50%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.803.663,01	30.722,49	0,00	2.966.153,79	131.768,29	4,65%	4,68%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.606.524,72	0,00	0,00	3.716.245,99	109.721,27	3,04%	3,04%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.447.851,04	0,00	0,00	5.543.201,23	95.350,19	1,75%	1,75%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	5.448.279,26	0,00	3.500.000,00	2.040.153,52	91.874,26	1,69%	2,48%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	5.554.062,79	0,00	0,00	5.643.561,82	89.499,03	1,61%	1,61%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRI...	2.308.310,21	0,00	57.810,92	2.326.880,90	76.381,61	3,31%	3,36%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.990.534,45	0,00	0,00	2.051.909,17	61.374,72	3,08%	3,08%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1.787.439,01	1.000.000,00	0,00	2.842.383,93	54.944,92	1,97%	1,78%
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	2.274.490,14	0,00	0,00	2.326.057,34	51.567,20	2,27%	2,27%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	3.031.128,76	92.283,94	1.500.000,00	1.670.997,33	47.584,63	1,52%	2,45%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	3.100.329,15	11.186.719,66	12.014.962,92	2.318.225,90	46.140,01	0,32%	1,34%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	5.817.749,75	0,00	156.165,22	5.703.656,57	42.072,04	0,72%	-1,96%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	500.991,74	999.987,50	0,00	1.525.521,43	24.542,19	1,64%	1,98%
BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P...	245.945,66	0,00	0,00	249.628,00	3.682,34	1,50%	1,50%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	1.025.564,48	0,00	0,00	1.006.531,85	-19.032,63	-1,86%	-1,86%

**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 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	1.713.247,53	0,00	0,00	1.621.158,28	-92.089,25	-5,38%	-5,38%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	3.275.608,32	0,00	0,00	3.097.567,79	-178.040,53	-5,44%	-5,44%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	11.327.867,15	0,00	0,00	11.129.825,07	-198.042,08	-1,75%	-1,75%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	12.633.773,50	0,00	0,00	12.396.805,77	-236.967,73	-1,88%	-1,88%
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>4.078.672,24</b>	<b>2,32%</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
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES II FIC MU...	1.513.713,00	0,00	0,00	1.571.277,68	57.564,68	3,80%	3,80%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTI...	2.311.245,24	0,00	0,00	2.352.641,55	41.396,31	1,79%	1,79%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1.471.829,04	0,00	0,00	1.485.523,66	13.694,62	0,93%	0,93%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	4.759.685,33	0,00	0,00	4.710.578,60	-49.106,73	-1,03%	-1,03%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	5.022.434,21	0,00	0,00	4.866.575,35	-155.858,86	-3,10%	-3,10%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	2.466.443,26	0,00	0,00	2.104.708,23	-361.735,03	-14,67%	-14,67%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	2.257.031,47	0,00	0,00	1.840.891,81	-416.139,66	-18,44%	-18,44%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	2.917.181,95	0,00	0,00	2.407.792,49	-509.389,46	-17,46%	-17,46%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.728.488,22	2.097.457,36	0,00	3.263.570,62	-562.374,96	-14,70%	-18,07%
				<b>Total Renda Variável</b>	<b>-1.941.949,09</b>	<b>-7,32%</b>	