

CRÉDITO E MERCADO

Engenharia Financeira
Relatório Analítico dos Investimentos
em junho, 2º trimestre e 1º semestre de 2020

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2020)

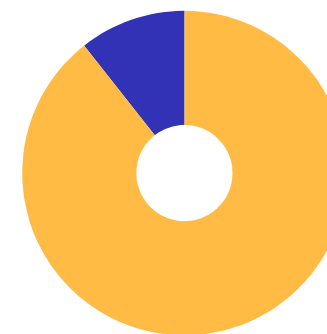
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	2.126.403,16	3,29%	763	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	1.619.792,99	2,51%	1.262	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	12.964.905,13	20,08%	1.364	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	10.949.191,35	16,96%	956	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	11.699.837,77	18,12%	884	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	1.034.396,11	1,60%	600	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	2.096.552,39	3,25%	174	0,18%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	651.226,64	1,01%	31	0,24%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	5.194.503,06	8,05%	434	0,11%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	4.867.737,07	7,54%	318	0,94%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	D+1471	Não há	235.093,48	0,36%	26	0,34%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	Não pos...	1008 dias úteis	2.240.171,74	3,47%	8	6,14%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	1.274.797,88	1,97%	33	0,75%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	745.592,37	1,16%	70	1,01%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	D+15	Não há	514.882,01	0,80%	56	0,25%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	301.579,61	0,47%	556	0,08%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	1.028.233,11	1,59%	18.591	0,02%	Artigo 8º, Inciso III
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+1	Não há	19.345,09	0,03%	12	1,16%	Artigo 8º, Inciso III
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+91 ou...	Não há	1.104.809,98	1,71%	14	0,62%	Artigo 8º, Inciso III
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	2.447.312,97	3,79%		0,00%	Artigo 8º, 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
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII ...	Não se ...	Não se aplica	366.451,59	0,57%		0,30%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b ' '
HAZ FII - ATR11	Não se ...	Não se aplica	1.068.252,93	1,65%		1,48%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b ' '
Total para cálculo dos limites da Resolução			64.551.068,43				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENTA 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%	10,00%	6.455.106,84
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	40.394.526,51	62,58%	20,00%	50,00%	90,00%	17.701.435,08
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	60,00%	38.730.641,06
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	40,00%	13.045.112,64	20,21%	10,00%	15,00%	40,00%	12.775.314,73
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.227.553,42
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea 'a'	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.227.553,42
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'	5,00%	4.260.561,99	6,60%	0,00%	0,00%	5,00%	-1.033.008,57
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.227.553,42
Total Renda Fixa	100,00%	57.700.201,14	89,39%	30,00%	70,00%	220,00%	

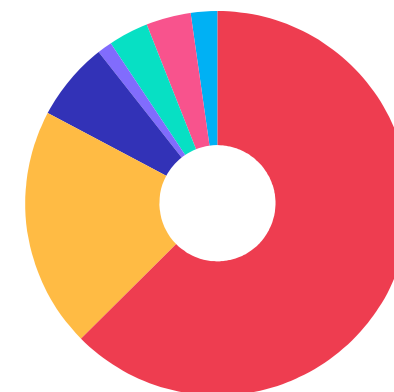


RENDA FIXA 57.700.201,14
RENDA VARIÁVEL 6.850.867,29

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (REDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Junho / 2020)

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'a'	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	10,00%	6.455.106,84
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	816.461,62	1,26%	5,00%	15,00%	20,00%	12.093.752,07
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	2.152.388,18	3,33%	3,00%	10,00%	10,00%	4.302.718,66
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	5,00%	2.447.312,97	3,79%	0,00%	0,00%	5,00%	780.240,45
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	5,00%	1.434.704,52	2,22%	0,00%	2,00%	5,00%	1.792.848,90
Total Renda Variável	30,00%	6.850.867,29	10,61%	8,00%	30,00%	50,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2020			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	1,00%	645.510,68
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	1,00%	



7º I b 7º IV a 7º VII a 8º II a
8º III 8º IV a 8º IV b

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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	37.645.854,89	58,32	0,01
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	14.655.606,48	22,70	0,00
GRAPHEN INVESTIMENTOS LTDA	4.073.362,13	6,31	2,89
A5 CAPITAL PARTNERS	2.447.312,97	3,79	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	2.096.552,39	3,25	0,00
AURORA CAPITAL	1.274.797,88	1,97	1,58
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	1.104.809,98	1,71	0,25
BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUT...	651.226,64	1,01	0,01
ZION INVEST	366.451,59	0,57	0,07
RJI CORRETORA DE VALORES	235.093,48	0,36	0,04

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	10,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	40.394.526,51	62,58	20,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	13.045.112,64	20,21	10,00	40,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea 'a'	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'	4.260.561,99	6,60	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b'	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'a'	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	816.461,62	1,26	5,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	2.152.388,18	3,33	3,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	2.447.312,97	3,79	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	1.434.704,52	2,22	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso III	0,00	0,00	0,00	1,00

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA Geral ex-C (Benchmark)	0,90%	1,71%	2,74%	1,71%	6,19%	22,95%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,95%	1,75%	2,96%	1,75%	6,31%	23,30%	0,01%	0,04%

IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	0,91%	3,93%	1,44%	3,93%	10,29%	23,06%	-	-
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	-7,57%	-2,69%	-8,06%	-2,69%	1,33%	14,32%	0,04%	0,12%

IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,99%	3,35%	3,35%	3,35%	8,68%	23,17%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,21%	2,88%	3,57%	2,88%	8,18%	21,13%	0,01%	0,03%
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%

IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	0,83%	3,46%	1,21%	3,46%	9,27%	20,80%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-0,22%	-2,96%	-0,91%	-2,96%	-4,25%	-	-	0,02%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	0,23%	-15,61%	-2,65%	-15,61%	-18,54%	-18,74%	-	0,07%

IRF-M 1 (Benchmark)	0,28%	2,60%	1,15%	2,60%	5,98%	13,67%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,26%	2,45%	1,06%	2,45%	5,71%	13,15%	0,00%	0,00%
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%	-	-
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-3,09%	-31,24%	-2,96%	-31,24%	-27,12%	-34,47%	0,05%	0,27%

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
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	-3,02%	-18,07%	-1,89%	-18,07%	-16,87%	-13,86%	0,06%	0,17%
CDI (Benchmark)	0,21%	1,75%	0,73%	1,75%	4,58%	11,21%	-	-
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 GESTÃO ESTRATÉGICA FI 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%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,22%	1,83%	0,78%	1,83%	4,64%	11,15%	0,00%	0,00%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	1,10%	5,10%	2,01%	5,10%	12,85%	28,80%	-	-
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	-	-

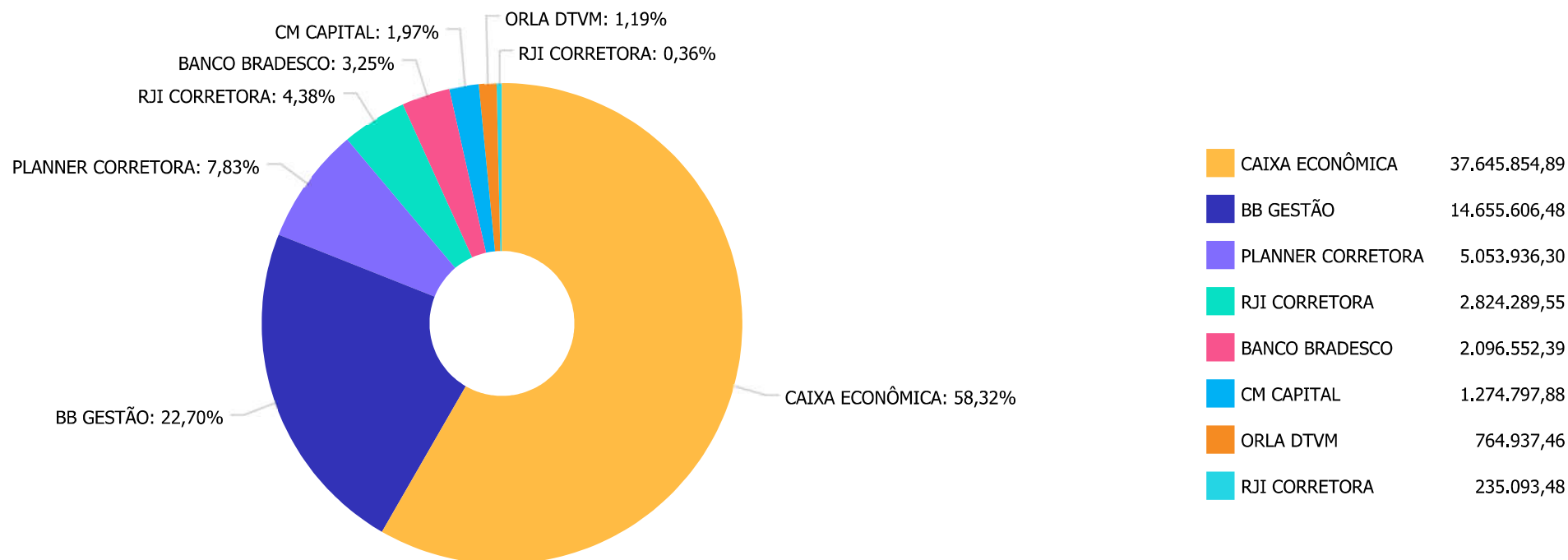
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	0,75%	2,99%	0,98%	2,99%	8,25%	18,56%	-	-
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-1,44%	-11,34%	-1,33%	-11,34%	-13,32%	-	0,03%	0,11%

Ibovespa (Benchmark)	8,76%	-17,80%	30,18%	-17,80%	-6,20%	30,64%	-	-
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	9,07%	-21,11%	27,93%	-21,11%	-8,75%	24,85%	0,12%	0,39%

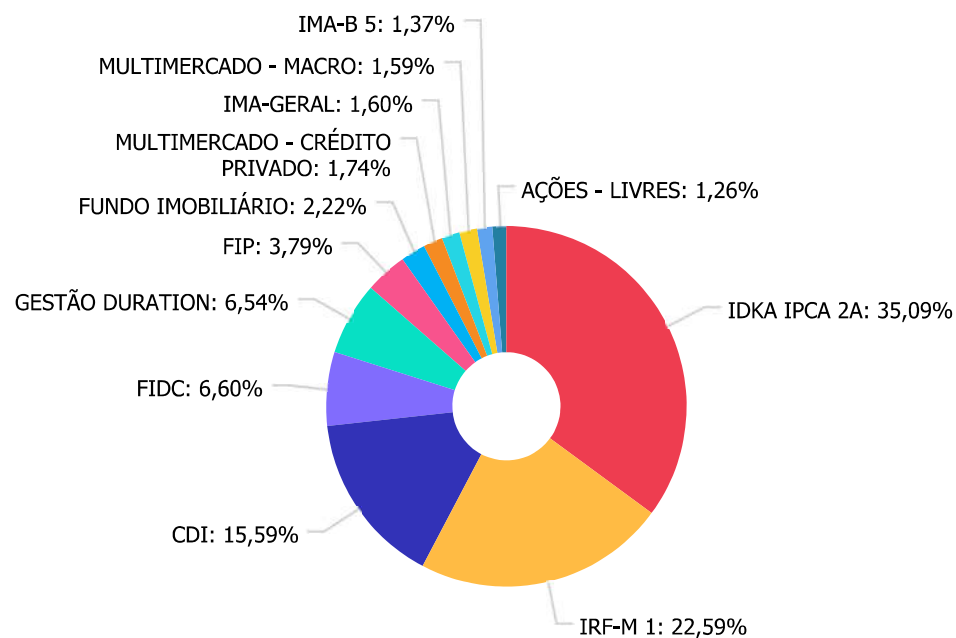
CDI (Benchmark)	0,21%	1,75%	0,73%	1,75%	4,58%	11,21%	-	-
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-0,34%	6,37%	-0,99%	6,37%	0,99%	-94,65%	0,00%	0,08%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,25%	-1,03%	5,40%	-1,03%	6,27%	25,21%	0,01%	0,07%

Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
HAZ FII - ATCR11	2,26%	2,36%	2,21%	2,36%	385,27%	385,27%	-	-
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%	-

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



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

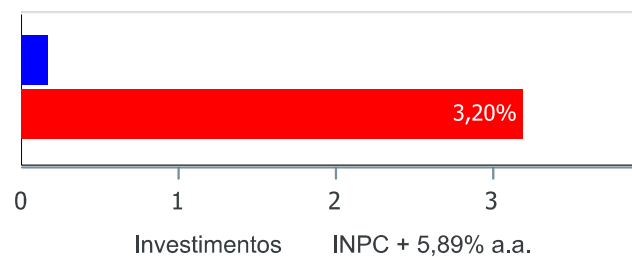


IDKA IPCA 2A	22.649.029,12
IRF-M 1	14.584.698,12
CDI	10.062.240,13
FIDC	4.260.561,99
GESTÃO DURATION	4.222.955,55
FIP	2.447.312,97
FUNDO IMOBILIÁRIO	1.434.704,52
MULTIMERCADO - CRÉDITO PRIVADO	1.124.155,07
IMA-GERAL	1.034.396,11
MULTIMERCADO - MACRO	1.028.233,11
IMA-B 5	886.320,12
AÇÕES - LIVRES	816.461,62

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

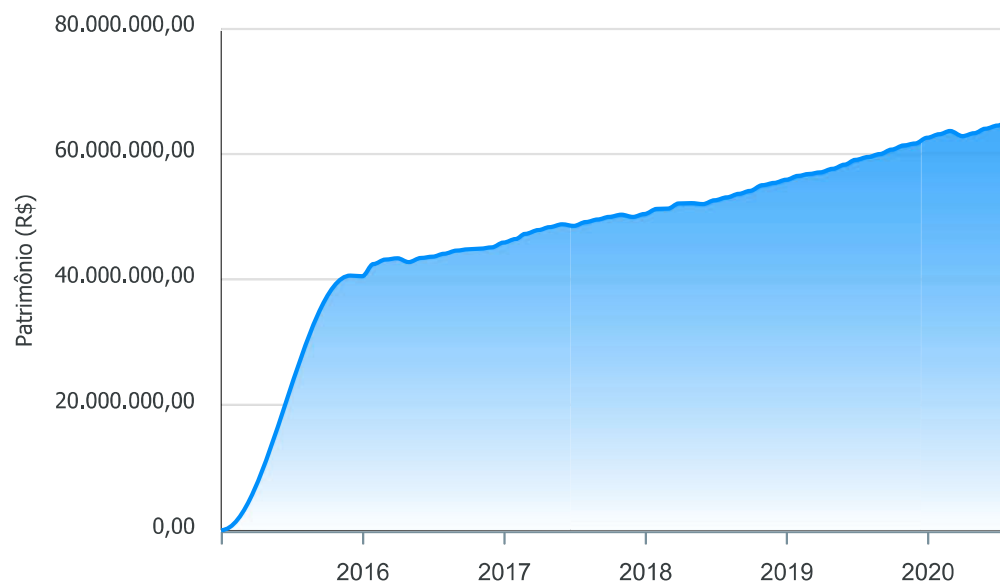
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	62.655.472,33	1.234.574,35	812.767,13	63.187.113,79	109.834,24	109.834,24	0,17%	0,17%	0,69%	0,69%	25,17%	0,92%
Fevereiro	63.187.113,79	759.621,99	378.131,56	63.724.290,23	155.686,01	265.520,25	0,24%	0,42%	0,58%	1,28%	32,87%	1,19%
Março	63.724.290,23	588.321,14	320.079,51	62.895.088,70	-1.097.443,16	-831.922,91	-1,71%	-1,30%	0,68%	1,97%	-66,24%	5,25%
Abril	62.895.088,70	594.837,77	294.670,44	63.371.744,10	176.488,07	-655.434,84	0,28%	-1,03%	0,22%	2,20%	-46,78%	2,22%
Mai	63.371.744,10	482.879,31	290.355,20	64.083.130,82	518.862,61	-136.572,23	0,82%	-0,22%	0,20%	2,40%	-9,12%	1,70%
Junho	64.083.130,82	504.497,92	287.028,75	64.551.068,43	250.468,44	113.896,21	0,39%	0,17%	0,78%	3,20%	5,29%	1,00%

Investimentos x Meta Atuarial



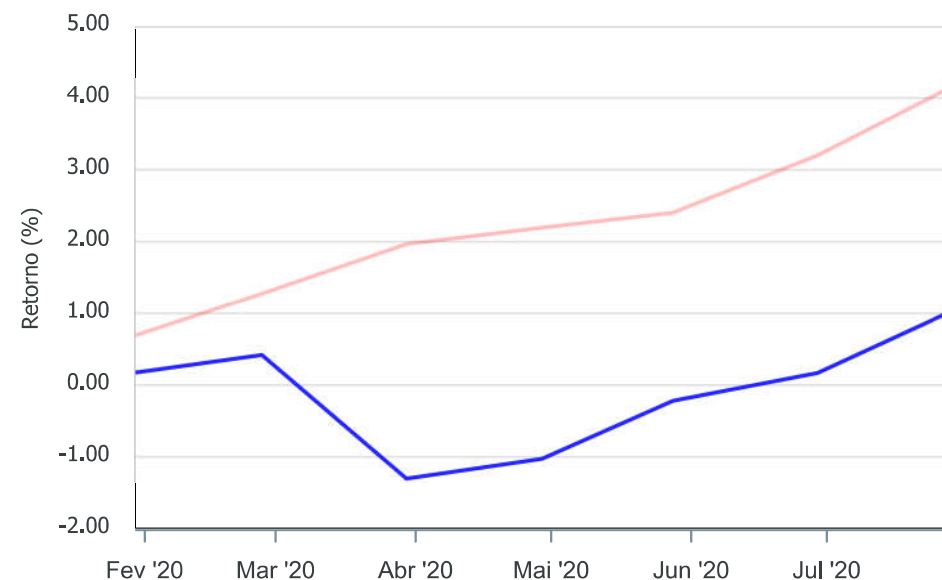
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	11.559.618,13	0,00	0,00	11.699.837,77	140.219,64	1,21%	1,21%	0,81%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	10.822.002,91	0,00	0,00	10.949.191,35	127.188,44	1,18%	1,18%	0,86%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.076.820,98	0,00	0,00	2.096.552,39	19.731,41	0,95%	0,95%	1,28%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.024.675,10	0,00	0,00	1.034.396,11	9.721,01	0,95%	0,95%	1,27%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	2.110.582,01	0,00	0,00	2.126.403,16	15.821,15	0,75%	0,75%	1,17%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	12.931.385,28	0,00	0,00	12.964.905,13	33.519,85	0,26%	0,26%	0,05%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.615.645,50	0,00	0,00	1.619.792,99	4.147,49	0,26%	0,26%	0,05%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1.271.850,75	0,00	0,00	1.274.797,88	2.947,13	0,23%	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.183.319,65	0,00	0,00	5.194.503,06	11.183,41	0,22%	0,22%	0,03%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	4.643.248,67	504.497,92	287.028,75	4.867.737,07	7.019,23	0,14%	0,14%	0,01%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	747.198,28	0,00	0,00	745.592,37	-1.605,91	-0,21%	-	-
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	242.414,21	0,00	0,00	235.093,48	-7.320,73	-3,02%	-3,02%	5,92%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	671.962,15	0,00	0,00	651.226,64	-20.735,51	-3,09%	-3,09%	5,20%
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	2.423.653,94	0,00	0,00	2.240.171,74	-183.482,20	-7,57%	-1,76%	3,53%
Total Renda Fixa	57.324.377,56	504.497,92	287.028,75	57.700.201,14	158.354,41	0,28%		0,70%

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
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	276.497,50	0,00	0,00	301.579,61	25.082,11	9,07%	9,07%	12,25%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	474.190,65	0,00	0,00	514.882,01	40.691,36	8,58%	8,58%	12,44%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	356.129,01	0,00	0,00	366.451,59	10.322,58	2,90%	2,90%	16,11%
HAZ FII - ATCR11	1.044.693,35	0,00	0,00	1.068.252,93	23.559,58	2,26%	2,26%	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.015.508,48	0,00	0,00	1.028.233,11	12.724,63	1,25%	1,25%	1,24%
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	2.451.355,21	0,00	0,00	2.447.312,97	-4.042,24	-0,16%	-	-
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	19.410,18	0,00	0,00	19.345,09	-65,09	-0,34%	-0,34%	0,01%
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.120.968,88	0,00	0,00	1.104.809,98	-16.158,90	-1,44%	-1,44%	2,54%
Total Renda Variável	6.758.753,26	0,00	0,00	6.850.867,29	92.114,03	1,36%		6,02%

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	11.296.325,45	0,00	0,00	11.699.837,77	403.512,32	3,57%	3,57%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	10.574.626,69	0,00	0,00	10.949.191,35	374.564,66	3,54%	3,54%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	12.825.196,47	0,00	0,00	12.964.905,13	139.708,66	1,09%	1,09%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	2.058.997,21	0,00	0,00	2.126.403,16	67.405,95	3,27%	3,27%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.032.955,06	0,00	0,00	2.096.552,39	63.597,33	3,13%	3,13%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.154.091,08	0,00	0,00	5.194.503,06	40.411,98	0,78%	0,78%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.004.637,35	0,00	0,00	1.034.396,11	29.758,76	2,96%	2,96%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	4.133.193,63	1.582.215,00	872.054,39	4.867.737,07	24.382,83	0,43%	0,54%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.602.781,06	0,00	0,00	1.619.792,99	17.011,93	1,06%	1,06%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	239.629,38	0,00	0,00	235.093,48	-4.535,90	-1,89%	-1,89%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	752.411,28	0,00	0,00	745.592,37	-6.818,91	-0,91%	-0,91%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	671.077,09	0,00	0,00	651.226,64	-19.850,45	-2,96%	-2,96%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1.309.540,22	0,00	0,00	1.274.797,88	-34.742,34	-2,65%	-2,65%
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	2.436.578,20	0,00	0,00	2.240.171,74	-196.406,46	-8,06%	-8,06%
			Total Renda Fixa		898.000,36	1,58%	

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 AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	396.029,76	0,00	0,00	514.882,01	118.852,25	30,01%	30,01%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	235.733,66	0,00	0,00	301.579,61	65.845,95	27,93%	27,93%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	975.539,39	0,00	0,00	1.028.233,11	52.693,72	5,40%	5,40%
HAZ FII - ATCR11	1.045.175,70	0,00	0,00	1.068.252,93	23.077,23	2,21%	2,21%
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	19.537,90	0,00	0,00	19.345,09	-192,81	-0,99%	-0,99%
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	2.459.073,23	0,00	0,00	2.447.312,97	-11.760,26	-0,48%	-
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.119.700,86	0,00	0,00	1.104.809,98	-14.890,88	-1,33%	-1,33%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	552.258,03	0,00	0,00	366.451,59	-185.806,44	-33,64%	-33,64%
				Total Renda Variável	47.818,76	0,70%	

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 IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	10.358.303,96	260.295,08	0,00	10.949.191,35	330.592,31	3,11%	3,12%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	11.371.829,47	0,00	0,00	11.699.837,77	328.008,30	2,88%	2,88%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	12.650.643,41	0,00	0,00	12.964.905,13	314.261,72	2,48%	2,48%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	2.032.395,28	0,00	0,00	2.126.403,16	94.007,88	4,63%	4,63%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	5.101.212,86	0,00	0,00	5.194.503,06	93.290,20	1,83%	1,83%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	3.181.294,03	3.904.437,40	2.271.227,53	4.867.737,07	53.233,17	0,75%	1,34%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.581.026,16	0,00	0,00	1.619.792,99	38.766,83	2,45%	2,45%
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	2.059.920,96	0,00	0,00	2.096.552,39	36.631,43	1,78%	1,78%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.016.603,17	0,00	0,00	1.034.396,11	17.792,94	1,75%	1,75%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	768.315,73	0,00	0,00	745.592,37	-22.723,36	-2,96%	-2,96%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	286.947,59	0,00	0,00	235.093,48	-51.854,11	-18,07%	-18,07%
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	2.326.067,51	0,00	0,00	2.240.171,74	-85.895,77	-3,69%	-2,69%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1.510.548,49	0,00	111.805,06	1.274.797,88	-123.945,55	-8,21%	-15,61%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	947.118,24	0,00	0,00	651.226,64	-295.891,60	-31,24%	-31,24%
			Total Renda Fixa		726.274,39	1,27%	

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
HAZ FII - ATCR11	1.043.642,97	0,00	0,00	1.068.252,93	24.609,96	2,36%	2,36%
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	18.187,22	0,00	0,00	19.345,09	1.157,87	6,37%	6,37%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.038.952,21	0,00	0,00	1.028.233,11	-10.719,10	-1,03%	-1,03%
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	2.471.084,20	0,00	0,00	2.447.312,97	-23.771,23	-0,96%	-
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	382.254,14	0,00	0,00	301.579,61	-80.674,53	-21,10%	-21,10%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	597.210,63	0,00	0,00	514.882,01	-82.328,62	-13,79%	-13,79%
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.246.107,69	0,00	0,00	1.104.809,98	-141.297,71	-11,34%	-11,34%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	665.806,41	0,00	0,00	366.451,59	-299.354,82	-44,96%	-44,96%
				Total Renda Variável	-612.378,18	-8,21%	