

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
TÍTULOS PÚBLICOS			2.055.345,63	0,45%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	13.515.493,37	2,99%	622	0,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	51.433.456,10	11,38%	763	0,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	55.697,15	0,01%	1.262	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	15.953.781,04	3,53%	600	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	25.386.050,91	5,62%	956	0,33%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	12.107.291,52	2,68%	884	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	82.581.317,98	18,27%	901	1,38%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	42.193,29	0,01%	1.364	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	15.011.320,78	3,32%	340	0,76%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	75.814.273,04	16,77%	912	0,87%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	137,22	0,00%	678	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	13.101.413,61	2,90%	125	0,67%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	12.816,02	0,00%	287	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
ITAU IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	15.699.416,08	3,47%	91	3,62%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	D+1009	Não há	740.679,14	0,16%	28	1,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	806.943,43	0,18%	70	1,09%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL	D+1260	Não há	2.380.383,04	0,53%	19	4,20%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	3.541.764,08	0,78%	33	2,08%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	D+4	Não há	17.843.832,06	3,95%	1.411	2,15%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'a'

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	15.674.132,37	3,47%	53	2,04%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	D+4	Não há	11.408.317,87	2,52%	15.538	1,07%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	11.418.359,68	2,53%	3.749	1,12%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	15.143.471,17	3,35%	820	5,59%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	12.951.582,04	2,87%	162	0,73%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	18.048.181,54	3,99%	49.451	0,55%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	9.680.628,50	2,14%	18.591	0,21%	Artigo 8º, Inciso III
ÁTICO FLORESTAL BRASIL FICFIP	Não se ...	Não se aplica	773.431,06	0,17%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRASIL FLORESTAL MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	776.626,28	0,17%	21	0,56%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	4.699.071,81	1,04%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	Não se ...	Não se aplica	2.438.814,13	0,54%		1,55%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
OSASCO PROPERTIES FII	Não se ...	Não se aplica	867.555,02	0,19%		0,21%	Desenquadrado - RV
Total para cálculo dos limites da Resolução			451.963.776,96				

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%	2.055.345,63	0,45%	0,00%	0,50%	50,00%	223.926.542,85
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	291.900.875,18	64,59%	15,00%	50,50%	90,00%	114.866.524,08
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	22.598.188,85
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	40,00%	29.554.462,07	6,54%	2,00%	10,00%	40,00%	151.231.048,71
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'	5,00%	6.729.090,55	1,49%	0,00%	2,00%	5,00%	15.869.098,30
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	22.598.188,85
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	22.598.188,85
Total Renda Fixa	100,00%	330.239.773,43	73,07%	17,00%	63,00%	200,00%	

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%	17.843.832,06	3,95%	0,00%	5,00%	10,00%	27.352.545,64
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'b'	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	22.598.188,85
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	84.644.044,67	18,73%	7,00%	19,00%	20,00%	5.748.710,72
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'b'	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	45.196.377,70
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	9.680.628,50	2,14%	0,00%	3,00%	10,00%	35.515.749,20
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	5,00%	6.249.129,15	1,38%	0,00%	2,00%	5,00%	16.349.059,70
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	5,00%	2.438.814,13	0,54%	0,00%	1,00%	5,00%	20.159.374,72
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	22.598.188,85
Desenquadrado - RV	0,00%	867.555,02	0,19%	0,00%	0,00%	0,00%	-867.555,02
Total Renda Variável	30,00%	121.724.003,53	26,93%	7,00%	30,00%	70,00%	

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%	5,00%	10,00%	45.196.377,70
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	22.598.188,85
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	7,00%	15,00%	

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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	259.949.377,82	57,52	0,05
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	59.476.095,14	13,16	0,00
ITAÚ UNIBANCO	46.711.995,68	10,34	0,00
ITAÚ DTVM	15.674.132,37	3,47	0,00
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	15.143.471,17	3,35	1,06
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	13.101.413,61	2,90	0,00
NAVI CAPITAL	11.418.359,68	2,53	0,70
SUL AMERICA INVESTIMENTOS GEST...	11.408.317,87	2,52	0,03
A5 CAPITAL PARTNERS	4.699.071,81	1,04	-
GRAPHEN INVESTIMENTOS LTDA	3.986.436,70	0,88	2,83
AURORA CAPITAL	3.541.764,08	0,78	4,39
RJI CORRETORA DE VALORES	2.380.383,04	0,53	-
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	2.055.345,63	0,45	-
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	1.550.057,34	0,34	0,35
CADENCE GESTORA	867.555,02	0,19	-

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'	2.055.345,63	0,45	0,00	50,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	291.900.875,18	64,59	15,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	29.554.462,07	6,54	2,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'	6.729.090,55	1,49	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b'	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'c'	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'a'	17.843.832,06	3,95	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'b'	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	84.644.044,67	18,73	7,00	20,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'b'	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso III	9.680.628,50	2,14	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	6.249.129,15	1,38	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	2.438.814,13	0,54	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'c'	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º - A, Inciso III	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
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%
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%
IMA-B 5+ (Benchmark)	2,84%	-5,26%	5,99%	-5,26%	1,68%	43,55%	-	-
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%
120% do CDI (Benchmark)	0,25%	2,11%	0,88%	2,11%	5,52%	13,60%	-	-
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL	-0,08%	-0,57%	-0,26%	-0,57%	-0,12%	-	-	-
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%

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%	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	2,09%	-1,70%	5,16%	-1,70%	4,85%	35,14%	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%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	1,99%	-0,34%	5,20%	-0,34%	6,72%	38,42%	0,03%	0,09%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	0,89%	-3,16%	1,72%	-3,16%	-0,25%	-13,67%	0,31%	0,06%
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%
IPCA (Benchmark)	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%

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 + 9,00% ao ano (Benchmark)	0,98%	4,40%	1,67%	4,40%	11,32%	25,34%	-	-
BRASIL FLORESTAL MULTISTRATÉGIA FIP	-0,13%	-	-	-	32,75%	-19,74%	0,00%	-

IGC (Benchmark)	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%

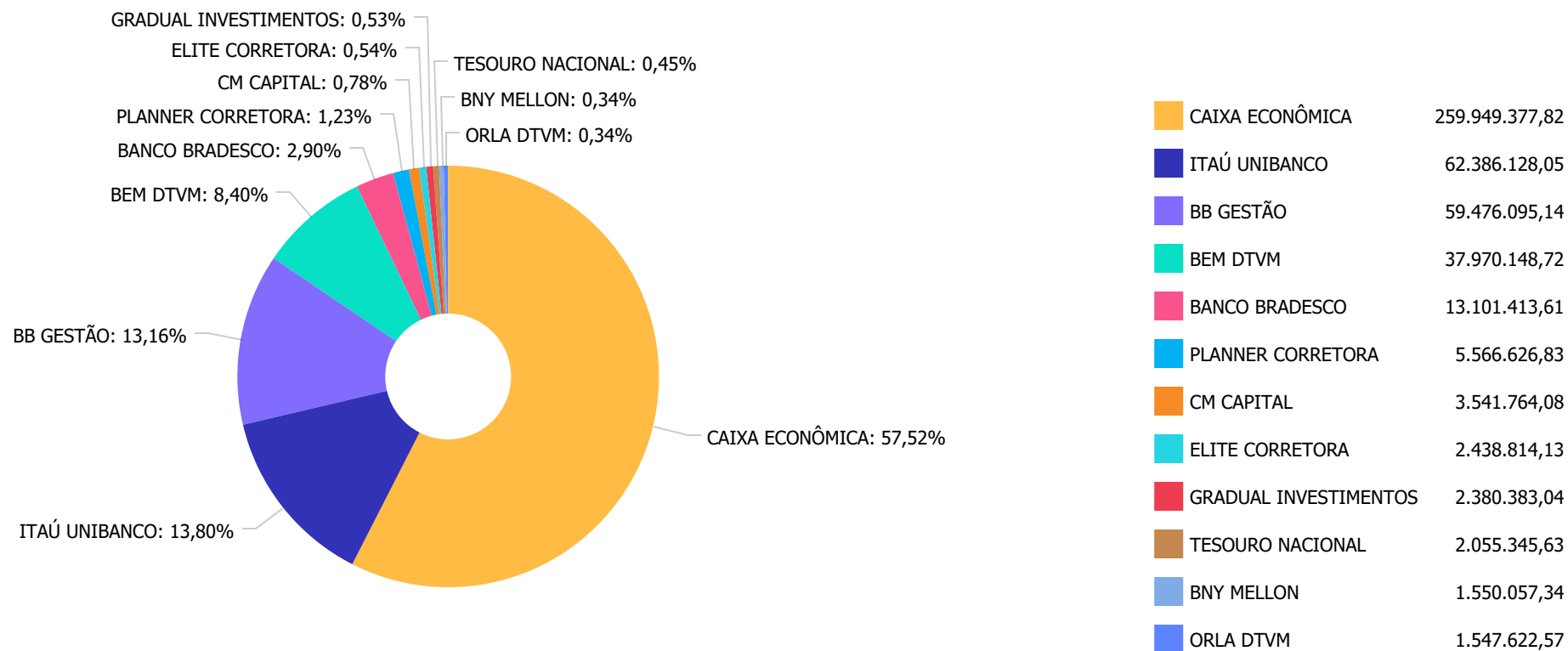
Ibovespa (Benchmark)	8,76%	-17,80%	30,18%	-17,80%	-6,20%	30,64%	-	-
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	8,62%	-16,61%	30,81%	-16,61%	-1,66%	35,75%	0,12%	0,39%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	7,94%	-25,33%	30,81%	-25,33%	-8,45%	27,44%	0,14%	0,46%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	8,63%	-19,72%	27,57%	-19,72%	-6,09%	31,08%	0,12%	0,38%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	12,10%	-28,51%	33,61%	-28,51%	-13,13%	23,01%	0,15%	0,50%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8,30%	-13,97%	30,24%	-13,97%	3,76%	48,79%	0,13%	0,36%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	9,28%	-22,25%	27,83%	-22,25%	-4,41%	36,54%	0,13%	0,40%

CDI (Benchmark)	0,21%	1,75%	0,73%	1,75%	4,58%	11,21%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,25%	-1,03%	5,40%	-1,03%	6,27%	25,21%	0,01%	0,07%

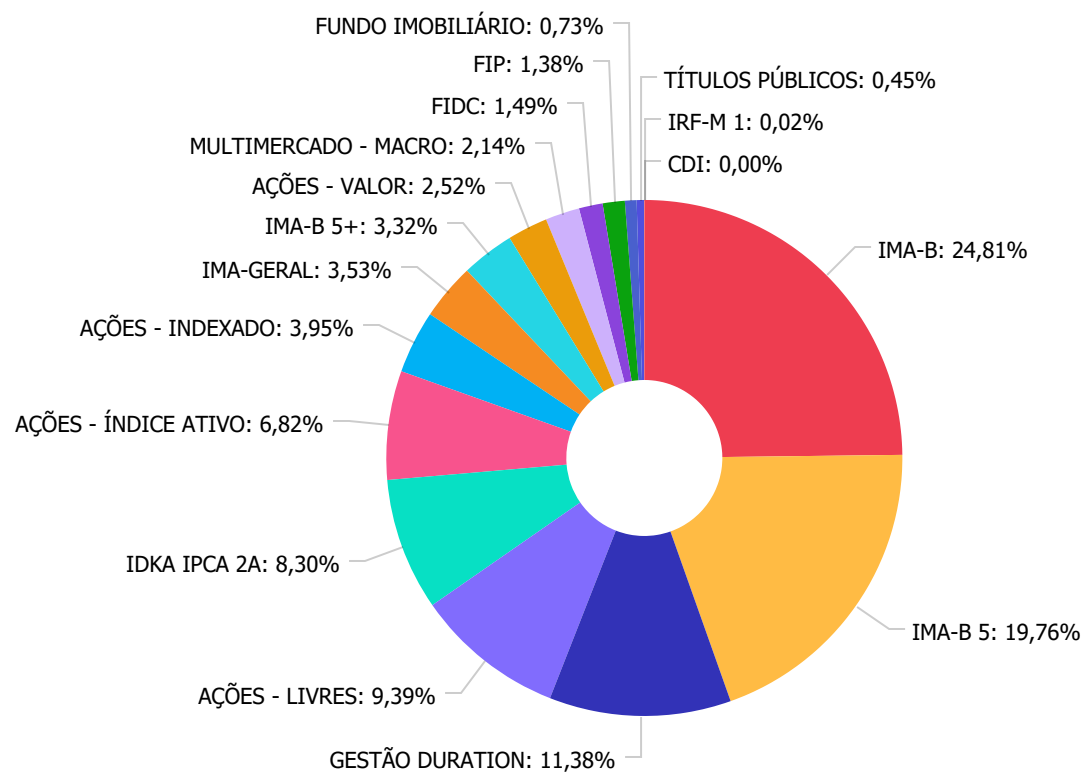
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	0,00%	-0,69%	-0,24%	-0,69%	-	-	0,00%	0,00%
OSASCO PROPERTIES FII	0,00%	-0,80%	-0,26%	-0,80%	440.744.831,13%	-	-	-
ÁTICO FLORESTAL BRASIL FICFIP	-	-	-	-	-	-	-	-

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



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



IMA-B	112.122.826,81
IMA-B 5	89.329.766,41
GESTÃO DURATION	51.446.272,12
AÇÕES - LIVRES	42.418.123,26
IDKA IPCA 2A	37.493.342,43
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	30.817.603,54
AÇÕES - INDEXADO	17.843.832,06
IMA-GERAL	15.953.781,04
IMA-B 5+	15.011.320,78
AÇÕES - VALOR	11.408.317,87
MULTIMERCADO - MACRO	9.680.628,50
FIDC	6.729.090,55
FIP	6.249.129,15
FUNDO IMOBILIÁRIO	3.306.369,15
TÍTULOS PÚBLICOS	2.055.345,63
IRF-M 1	97.890,44
CDI	137,22

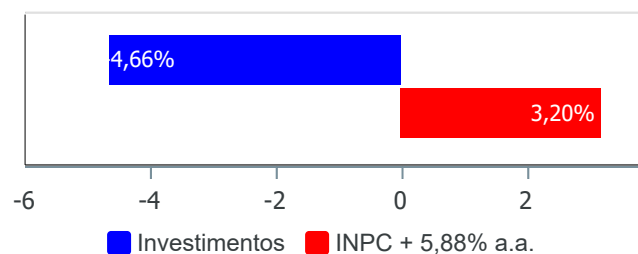
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Junho / 2020)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	31/07/2019	414	4.824,512202	4.878,676646	1.997.348,05	2.019.772,13	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	18/11/2019	7	4.995,267412	5.081,929585	34.966,87	35.573,51	Curva

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

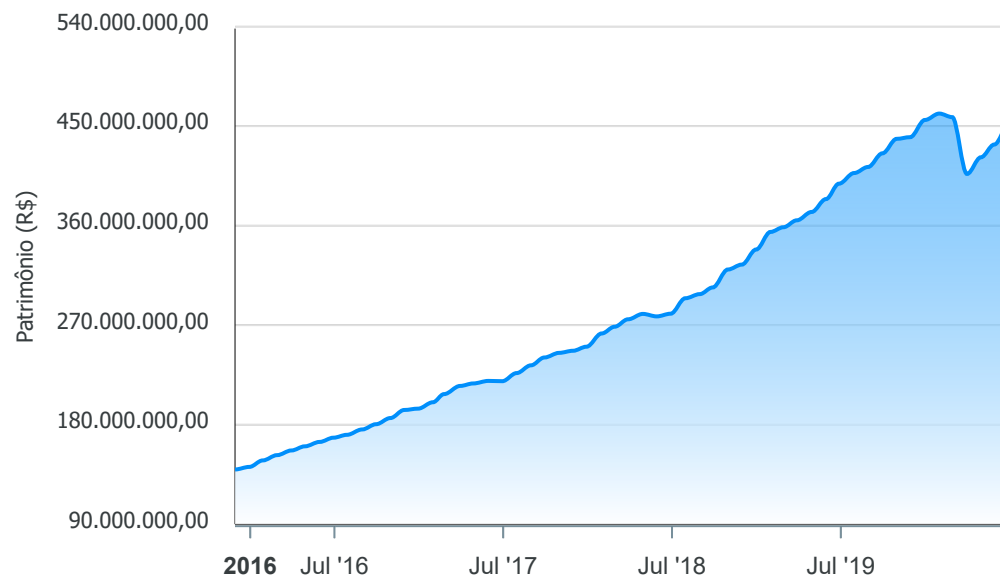
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	454.864.737,50	21.816.085,69	16.528.778,45	461.323.639,85	1.171.595,11	1.171.595,11	0,25%	0,25%	0,69%	0,69%	36,85%	3,25%
Fevereiro	461.323.639,85	10.707.825,40	6.130.332,45	457.995.410,88	-7.905.721,92	-6.734.126,81	-1,70%	-1,45%	0,58%	1,27%	-113,49%	4,88%
Março	457.995.410,88	28.820.410,36	32.625.991,25	406.736.215,22	-47.453.614,77	-54.187.741,58	-10,36%	-11,66%	0,68%	1,96%	-593,49%	19,18%
Abril	406.736.215,22	11.794.948,55	7.062.000,00	421.782.320,35	10.313.156,58	-43.874.585,00	2,51%	-9,44%	0,22%	2,19%	-430,80%	9,16%
Mai	421.782.320,35	645.611,92	226.784,81	433.326.657,26	11.125.509,80	-32.749.075,20	2,64%	-7,06%	0,20%	2,40%	-294,06%	4,98%
Junho	433.326.657,26	28.272.120,91	21.004.703,97	451.963.776,96	11.369.702,76	-21.379.372,44	2,58%	-4,66%	0,78%	3,20%	-145,71%	4,45%

Investimentos x Meta Atuarial



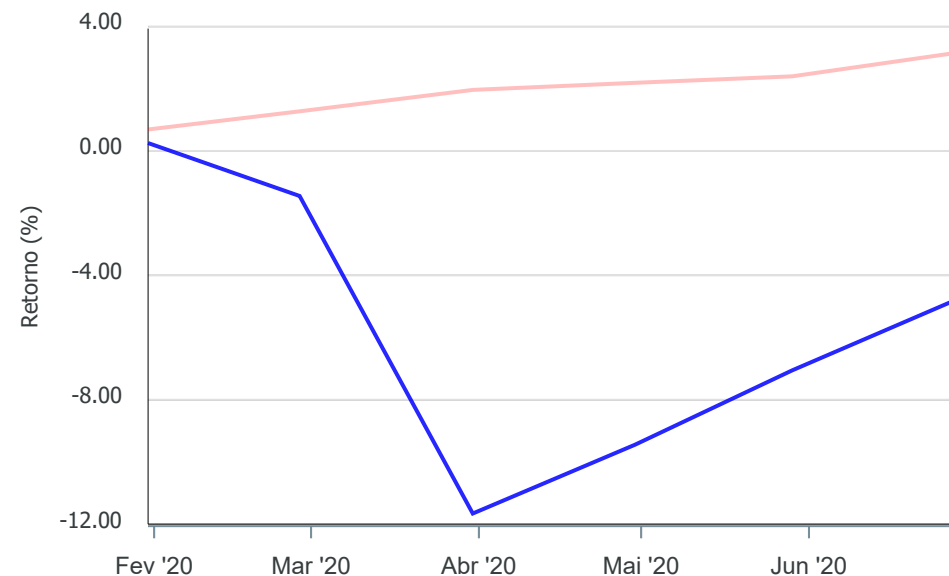
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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...	14.598.583,49	0,00	0,00	15.011.320,78	412.737,29	2,83%	2,83%	4,98%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	12.833.471,70	0,00	0,00	13.101.413,61	267.941,91	2,09%	2,09%	3,04%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	80.942.082,71	0,00	0,00	82.581.317,98	1.639.235,27	2,03%	2,03%	2,99%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	15.392.566,14	0,00	0,00	15.699.416,08	306.849,94	1,99%	1,99%	3,03%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	11.962.188,66	0,00	0,00	12.107.291,52	145.102,86	1,21%	1,21%	0,81%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	25.091.160,49	0,00	0,00	25.386.050,91	294.890,42	1,18%	1,18%	0,86%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	74.990.415,42	0,00	0,00	75.814.273,04	823.857,62	1,10%	1,10%	0,91%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	13.371.644,84	0,00	0,00	13.515.493,37	143.848,53	1,08%	1,08%	0,89%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.803.851,18	0,00	0,00	15.953.781,04	149.929,86	0,95%	0,95%	1,27%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	734.113,89	0,00	0,00	740.679,14	6.565,25	0,89%	0,89%	30,99%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	35.155.116,75	16.031.610,55	100.991,50	51.433.456,10	347.720,30	0,68%	0,75%	1,17%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	12.760,41	0,00	0,00	12.816,02	55,61	0,44%	0,44%	0,38%
TÍTULOS PÚBLICOS	2.049.753,67	0,00	0,00	2.055.345,63	5.591,96	0,27%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	55.554,54	0,00	0,00	55.697,15	142,61	0,26%	0,26%	0,05%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	3.533.576,09	0,00	0,00	3.541.764,08	8.187,99	0,23%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	15.954.331,64	0,00	15.936.100,57	42.193,29	23.962,22	0,15%	0,26%	0,05%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.967.205,27	0,00	4.967.611,90	137,22	543,85	0,01%	0,24%	0,03%
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL	2.382.236,96	0,00	0,00	2.380.383,04	-1.853,92	-0,08%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	808.681,48	0,00	0,00	806.943,43	-1.738,05	-0,21%	-	-
Total Renda Fixa	330.639.295,33	16.031.610,55	21.004.703,97	330.239.773,43	4.573.571,52	1,32%		1,94%

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	11.553.795,66	0,00	0,00	12.951.582,04	1.397.786,38	12,10%	12,10%	14,62%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	16.515.532,95	0,00	0,00	18.048.181,54	1.532.648,59	9,28%	9,28%	13,00%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	16.386.368,30	0,00	0,00	17.843.832,06	1.457.463,76	8,89%	8,89%	12,41%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	13.939.845,09	0,00	0,00	15.143.471,17	1.203.626,08	8,63%	8,63%	12,10%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	10.543.014,79	0,00	0,00	11.418.359,68	875.344,89	8,30%	8,30%	12,56%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	10.425.986,01	4.147.889,75	0,00	15.674.132,37	1.100.256,61	7,55%	8,62%	11,52%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	3.145.077,04	8.092.620,61	0,00	11.408.317,87	170.620,22	1,52%	7,94%	13,71%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	9.560.828,42	0,00	0,00	9.680.628,50	119.800,08	1,25%	1,25%	1,24%
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	2.441.607,67	0,00	0,00	2.438.814,13	-2.793,54	-0,11%	0,00%	0,00%
BRASIL FLORESTAL MULTISTRATÉGIA FIP	777.639,12	0,00	0,00	776.626,28	-1.012,84	-0,13%	-0,13%	0,00%
ÁTICO FLORESTAL BRASIL FICFIP	774.650,51	0,00	0,00	773.431,06	-1.219,45	-0,16%	-	-
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	4.706.833,29	0,00	0,00	4.699.071,81	-7.761,48	-0,16%	-	-
OSASCO PROPERTIES FII	1.916.183,08	0,00	0,00	867.555,02	-1.048.628,06	-54,72%	0,00%	-
Total Renda Variável	102.687.361,93	12.240.510,36	0,00	121.724.003,53	6.796.131,24	5,91%		11,45%

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 IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	78.719.586,19	0,00	0,00	82.581.317,98	3.861.731,79	4,91%	4,91%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	73.104.099,41	0,00	0,00	75.814.273,04	2.710.173,63	3,71%	3,71%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	33.315.087,52	17.027.188,98	100.991,50	51.433.456,10	1.192.171,10	2,37%	3,27%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	24.517.610,75	0,00	0,00	25.386.050,91	868.440,16	3,54%	3,54%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	14.178.229,86	0,00	0,00	15.011.320,78	833.090,92	5,88%	5,88%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	14.923.357,03	0,00	0,00	15.699.416,08	776.059,05	5,20%	5,20%
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	12.458.855,90	0,00	0,00	13.101.413,61	642.557,71	5,16%	5,16%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	13.032.197,12	0,00	0,00	13.515.493,37	483.296,25	3,71%	3,71%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.494.803,29	0,00	0,00	15.953.781,04	458.977,75	2,96%	2,96%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	11.689.726,65	0,00	0,00	12.107.291,52	417.564,87	3,57%	3,57%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.490.099,40	11.353.447,74	15.936.100,57	42.193,29	134.746,72	0,85%	1,09%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	728.158,13	0,00	0,00	740.679,14	12.521,01	1,72%	1,72%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	12.112.761,40	91.534,30	12.215.296,58	137,22	11.138,10	0,09%	0,58%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	55.112,19	0,00	0,00	55.697,15	584,96	1,06%	1,06%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	12.673,65	0,00	0,00	12.816,02	142,37	1,12%	1,12%
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL	2.386.527,46	0,00	0,00	2.380.383,04	-6.144,42	-0,26%	-0,26%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	814.323,42	0,00	0,00	806.943,43	-7.379,99	-0,91%	-0,91%
TÍTULOS PÚBLICOS	2.156.525,57	0,00	41.100,13	2.055.345,63	-60.079,81	-2,79%	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	3.638.288,55	0,00	0,00	3.541.764,08	-96.524,47	-2,65%	-2,65%

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
				Total Renda Fixa	12.233.067,70	3,85%	

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 GOVERNANÇA FI AÇÕES	13.643.954,69	0,00	0,00	17.843.832,06	4.199.877,37	30,78%	30,78%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	14.118.470,92	0,00	0,00	18.048.181,54	3.929.710,62	27,83%	27,83%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	11.871.174,89	0,00	0,00	15.143.471,17	3.272.296,28	27,57%	27,57%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	9.693.473,37	0,00	0,00	12.951.582,04	3.258.108,67	33,61%	33,61%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	8.657.311,96	4.147.889,75	0,00	15.674.132,37	2.868.930,66	22,40%	30,81%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8.766.950,81	0,00	0,00	11.418.359,68	2.651.408,87	30,24%	30,24%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	2.595.168,67	8.092.620,61	0,00	11.408.317,87	720.528,59	6,74%	30,81%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	9.184.526,68	0,00	0,00	9.680.628,50	496.101,82	5,40%	5,40%
ÁTICO FLORESTAL BRASIL FICFIP	641.686,36	0,00	0,00	773.431,06	131.744,70	20,53%	-
BRASIL FLORESTAL MULTIESTRATÉGIA FIP	645.249,29	0,00	0,00	776.626,28	131.376,99	20,36%	-
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	2.447.403,97	0,00	0,00	2.438.814,13	-8.589,84	-0,35%	-0,24%
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	4.721.652,63	0,00	0,00	4.699.071,81	-22.580,82	-0,48%	-
OSASCO PROPERTIES FII	1.921.167,49	0,00	0,00	867.555,02	-1.053.612,47	-54,84%	-0,26%
				Total Renda Variável	20.575.301,44	20,34%	

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 IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	82.694.806,47	4.972.532,79	13.761.347,61	75.814.273,04	1.908.281,39	2,18%	3,04%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	20.252.205,04	29.811.507,68	100.991,50	51.433.456,10	1.470.734,88	2,94%	4,63%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	24.617.993,32	0,00	0,00	25.386.050,91	768.057,59	3,12%	3,12%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	5.739.361,57	7.379.704,64	0,00	13.515.493,37	396.427,16	3,02%	3,08%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	11.767.860,14	0,00	0,00	12.107.291,52	339.431,38	2,88%	2,88%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.679.355,50	0,00	0,00	15.953.781,04	274.425,54	1,75%	1,75%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	39.384,23	15.799.371,98	15.936.100,57	42.193,29	139.537,65	0,88%	2,48%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	5.698.396,84	0,00	5.707.000,00	12.816,02	21.419,18	0,38%	2,27%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	40.343,34	30.913.667,78	30.972.068,42	137,22	18.194,52	0,06%	1,37%
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	7.181.304,77	0,00	7.195.505,33	0,00	14.200,56	0,20%	1,78%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	54.364,14	0,00	0,00	55.697,15	1.333,01	2,45%	2,45%
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL	2.393.920,60	0,00	0,00	2.380.383,04	-13.537,56	-0,57%	-0,57%
TÍTULOS PÚBLICOS	2.113.655,00	0,00	41.100,13	2.055.345,63	-17.209,24	-0,81%	-
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	764.854,78	0,00	0,00	740.679,14	-24.175,64	-3,16%	-3,16%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	831.536,57	0,00	0,00	806.943,43	-24.593,14	-2,96%	-2,96%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	15.752.844,39	0,00	0,00	15.699.416,08	-53.428,31	-0,34%	-0,34%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	4.196.748,74	0,00	559.129,29	3.541.764,08	-95.855,37	-2,28%	-15,61%
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	13.327.880,20	0,00	0,00	13.101.413,61	-226.466,59	-1,70%	-1,70%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	15.874.134,39	0,00	0,00	15.011.320,78	-862.813,61	-5,44%	-5,44%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	85.116.569,19	939.707,60	1.925.643,44	82.581.317,98	-1.549.315,37	-1,80%	-1,88%

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
				Total Renda Fixa	2.484.648,03	0,76%	

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
BRASIL FLORESTAL MULTIESTRATÉGIA FIP	647.791,40	0,00	0,00	776.626,28	128.834,88	19,89%	-
ÁTICO FLORESTAL BRASIL FICFIP	644.860,44	0,00	0,00	773.431,06	128.570,62	19,94%	-
BB DIVIDENDOS FIC AÇÕES	7.315.765,53	0,00	7.379.704,64	0,00	63.939,11	0,87%	-22,29%
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	2.453.590,16	0,00	0,00	2.438.814,13	-14.776,03	-0,60%	-0,69%
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	4.744.714,82	0,00	0,00	4.699.071,81	-45.643,01	-0,96%	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	9.781.546,90	0,00	0,00	9.680.628,50	-100.918,40	-1,03%	-1,03%
OSASCO PROPERTIES FII	1.928.918,98	0,00	0,00	867.555,02	-1.061.363,96	-55,02%	-0,80%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	4.546.397,84	8.092.620,61	0,00	11.408.317,87	-1.230.700,58	-9,74%	-25,33%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	13.272.043,55	0,00	0,00	11.418.359,68	-1.853.683,87	-13,97%	-13,97%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	13.580.620,87	4.147.889,75	0,00	15.674.132,37	-2.054.378,25	-11,59%	-16,61%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	18.863.505,21	0,00	0,00	15.143.471,17	-3.720.034,04	-19,72%	-19,72%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	21.618.850,00	0,00	0,00	17.843.832,06	-3.775.017,94	-17,46%	-17,46%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	23.211.674,06	0,00	0,00	18.048.181,54	-5.163.492,52	-22,25%	-22,25%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	18.116.938,52	0,00	0,00	12.951.582,04	-5.165.356,48	-28,51%	-28,51%
				Total Renda Variável	-23.864.020,47	-16,39%	