

CRÉDITO E MERCADO

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

Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	2.090.857,83	1,50%	53	2,32%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA L...	D+1	Não há	9.740.901,15	6,99%	30	15,60%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	5.077.419,85	3,65%	12.843	0,63%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
MULTINVEST FIAÇÕES	D+11	Não há	1.765.333,40	1,27%	284	2,31%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	1.596.697,33	1,15%	1.560	0,19%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BRADESCO SELECTION FIAÇÕES	D+4	Não há	2.457.546,60	1,76%	204	0,37%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIAÇÕES	D+15	Não há	3.075.863,66	2,21%	8.369	0,34%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	4.030.698,50	2,89%	49.451	0,12%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
SICREDI IBOVESPA FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.146.176,82	0,82%	9.478	0,33%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FIAÇÕES	D+4	Não há	4.246.372,46	3,05%	820	1,57%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
META VALOR FIAÇÕES	D+4	Não há	5.945.392,61	4,27%	166	2,51%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	2.973.398,22	2,13%	44	5,75%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	4.898.860,32	3,52%	18.591	0,11%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	4.001.933,01	2,87%	20.627	0,17%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	3.120.000,00	2,24%		1,27%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	Término...	Não há	294.420,03	0,21%	749	0,63%	Desenquadrado - RF
Total para cálculo dos limites da Resolução			139.286.396,20				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	64.758.657,02	46,49%	20,00%	30,00%	90,00%	60.599.099,56
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	804.659,00	0,58%	0,00%	10,00%	60,00%	82.767.178,72
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	29.092.967,37	20,89%	10,00%	30,00%	40,00%	26.621.591,11
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	20.892.959,43
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	6.964.319,81
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	6.964.319,81
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	6.964.319,81
Desenquadrado - RF	0,00%	294.420,03	0,21%	0,00%	0,00%	0,00%	-294.420,03
Total Renda Fixa	100,00%	94.950.703,42	68,17%	30,00%	70,00%	220,00%	

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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	29.341.501,23	21,07%	7,00%	15,00%	20,00%	-1.484.221,99
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	11.874.191,55	8,53%	7,00%	10,00%	10,00%	2.054.448,07
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	6.964.319,81
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	3.120.000,00	2,24%	0,00%	5,00%	5,00%	3.844.319,81
Total Renda Variável	30,00%	44.335.692,78	31,83%	14,00%	30,00%	40,00%	

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA PRÉ 2 ANOS (Benchmark)	0,70%	6,60%	3,31%	6,60%	11,71%	28,80%	-	-
BRDESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	0,70%	6,50%	3,14%	6,50%	11,48%	28,06%	0,01%	0,02%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,99%	3,35%	3,35%	3,35%	8,68%	23,17%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,21%	2,88%	3,57%	2,88%	8,18%	21,13%	0,01%	0,03%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,18%	3,12%	3,54%	3,12%	8,19%	21,36%	0,01%	0,03%
IMA-B 5+ (Benchmark)	2,84%	-5,26%	5,99%	-5,26%	1,68%	43,55%	-	-
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	1,13%	-0,94%	5,76%	-0,94%	2,59%	15,47%	0,03%	0,08%
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%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	1,07%	3,10%	3,69%	3,10%	8,64%	24,11%	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%

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 (Benchmark)	2,05%	-1,66%	4,96%	-1,66%	4,73%	35,13%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,02%	-1,75%	4,90%	-1,75%	4,74%	34,48%	0,03%	0,10%
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%
SICREDI INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1,98%	-2,32%	4,88%	-2,32%	4,04%	33,71%	0,03%	0,10%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,89%	-1,95%	1,66%	-1,95%	-0,60%	3,33%	0,00%	0,04%
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,24%	1,44%	5,15%	1,44%	5,13%	20,83%	0,02%	0,07%
CDI (Benchmark)	0,21%	1,75%	0,73%	1,75%	4,58%	11,21%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	0,27%	1,49%	0,60%	1,49%	4,20%	10,65%	0,00%	0,00%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,24%	1,37%	0,58%	1,37%	4,03%	10,44%	0,00%	0,01%
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	0,38%	1,23%	2,09%	1,23%	3,99%	11,32%	0,01%	0,02%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,26%	1,37%	0,78%	1,37%	4,06%	10,51%	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%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	45,80%	66,52%	69,59%	66,52%	192,35%	258,95%	0,75%	0,84%

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
-----	-----	----	----	-----	-----	---------	------------------

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
IBX (Benchmark)	8,97%	-17,39%	30,39%	-17,39%	-4,94%	34,21%	-	-
META VALOR FIAÇÕES	10,81%	-12,77%	48,26%	-12,77%	6,67%	45,62%	0,14%	0,50%

Ibovespa (Benchmark)	8,76%	-17,80%	30,18%	-17,80%	-6,20%	30,64%	-	-
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	9,88%	-17,76%	33,78%	-17,76%	-3,83%	27,38%	0,12%	0,43%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FIAÇÕES	8,63%	-19,72%	27,57%	-19,72%	-6,09%	31,08%	0,12%	0,38%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIAÇÕES	7,00%	-18,57%	23,70%	-18,57%	3,90%	55,68%	0,10%	0,39%
MULTINVEST FIAÇÕES	10,16%	-15,17%	32,50%	-15,17%	2,25%	44,49%	0,13%	0,42%
SICREDI IBOVESPA FIC AÇÕES	10,47%	-17,48%	29,80%	-17,48%	-2,00%	36,33%	0,12%	0,38%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	7,44%	-18,07%	25,17%	-18,07%	-4,94%	52,01%	0,13%	0,34%
BRANCO SELECTION FIAÇÕES	8,95%	-24,53%	25,56%	-24,53%	-13,48%	19,34%	0,12%	0,39%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	9,28%	-22,25%	27,83%	-22,25%	-4,41%	36,54%	0,13%	0,40%

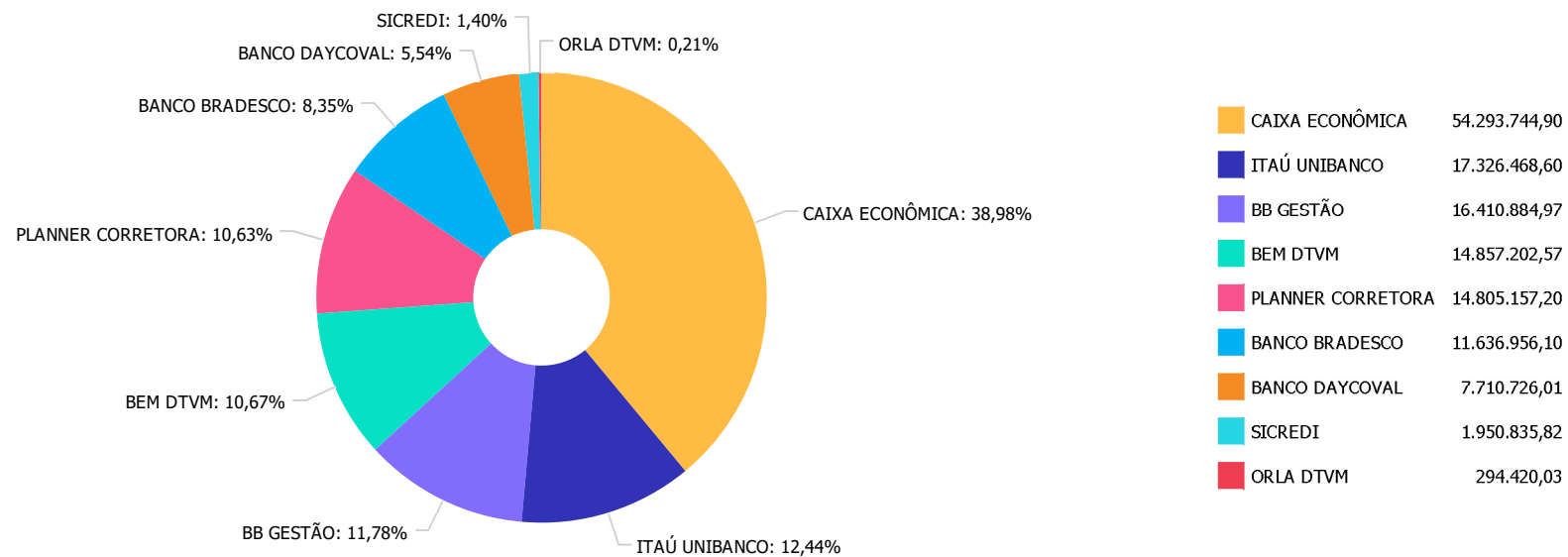
CDI (Benchmark)	0,21%	1,75%	0,73%	1,75%	4,58%	11,21%	-	-
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	0,88%	1,64%	4,38%	1,64%	4,65%	11,81%	0,02%	0,04%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	2,60%	-3,10%	8,72%	-3,10%	3,61%	18,53%	0,03%	0,11%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,25%	-1,03%	5,40%	-1,03%	6,27%	25,21%	0,01%	0,07%

Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	20,00%	4,70%	34,34%	4,70%	51,16%	70,31%	0,15%	0,43%

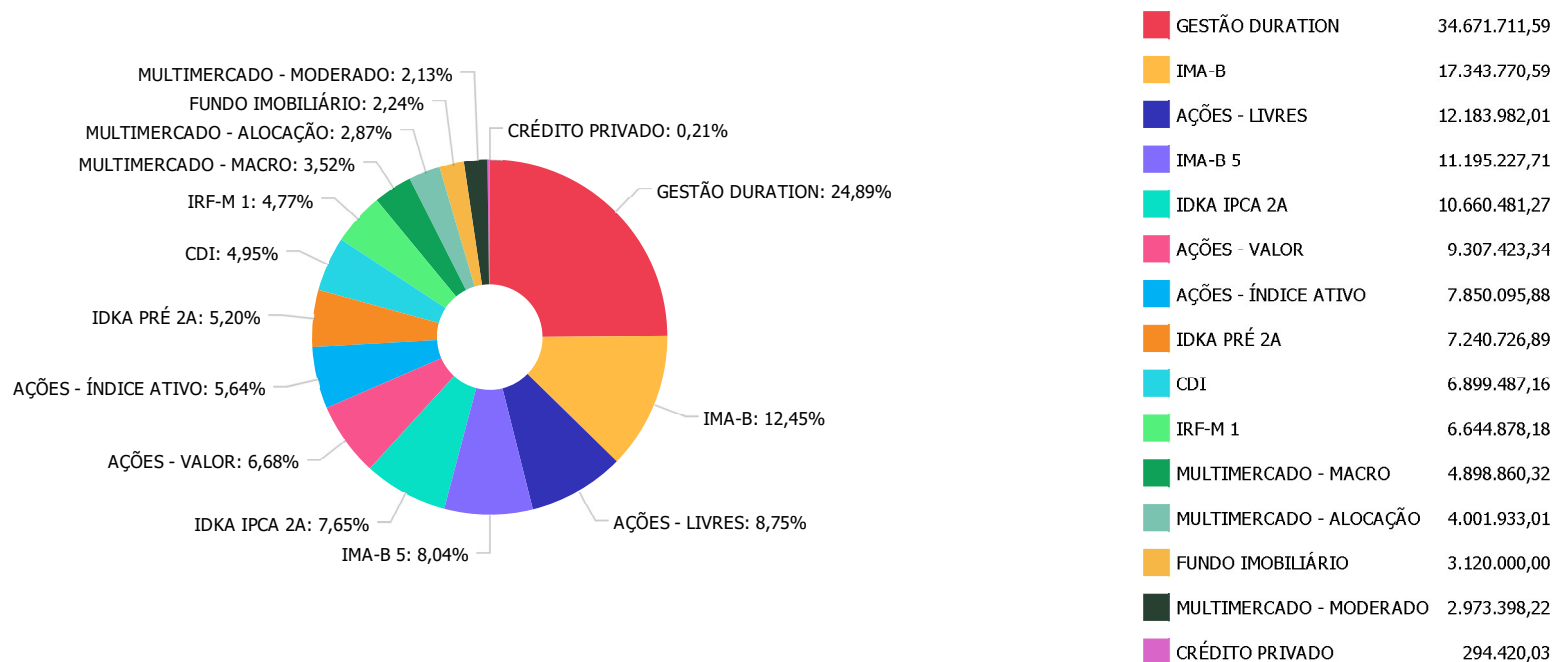
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2020 - RENDA VARIÁVEL

Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
-----	-----	----	----	-----	-----	---------	------------------

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



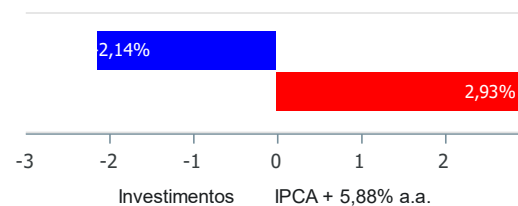
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Junho / 2020)



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

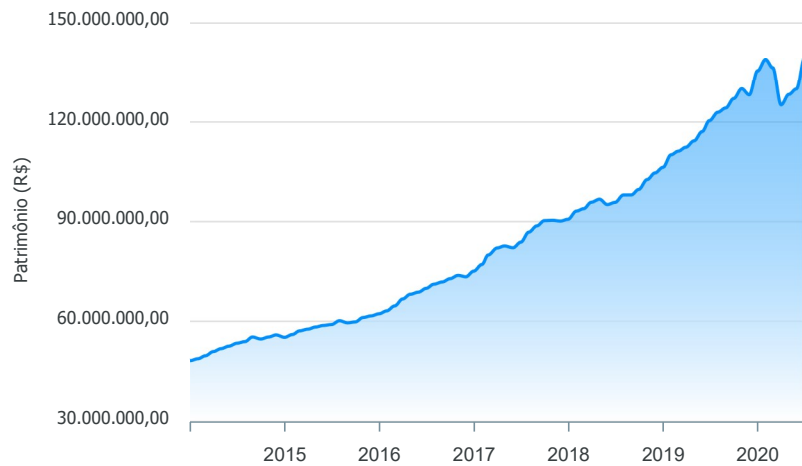
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	132.811.185,40	2.046.060,74	81.831,38	136.141.736,69	1.366.321,93	1.366.321,93	1,01%	1,01%	0,71%	0,71%	142,56%	3,21%
Fevereiro	136.141.736,69	2.514.582,81	2.094.382,31	133.874.815,93	-2.687.121,26	-1.320.799,33	-1,97%	-0,97%	0,66%	1,38%	-70,79%	4,77%
Março	133.874.815,93	5.729.115,99	5.941.084,37	121.293.941,01	-12.368.906,54	-13.689.705,87	-9,24%	-10,12%	0,57%	1,95%	-518,06%	16,44%
Abril	121.293.941,01	8.878.104,74	9.019.382,64	124.555.675,02	3.403.011,91	-10.286.693,96	2,81%	-7,60%	0,14%	2,10%	-361,99%	8,52%
Mai	124.555.675,02	3.913.305,53	5.719.595,02	126.291.021,75	3.541.636,22	-6.745.057,74	2,84%	-4,97%	0,07%	2,17%	-228,78%	4,44%
Junho	126.291.021,75	10.532.923,34	5.054.693,82	135.698.163,70	3.928.912,43	-2.816.145,31	2,98%	-2,14%	0,74%	2,93%	-73,10%	4,24%

Investimentos x Meta Atuarial



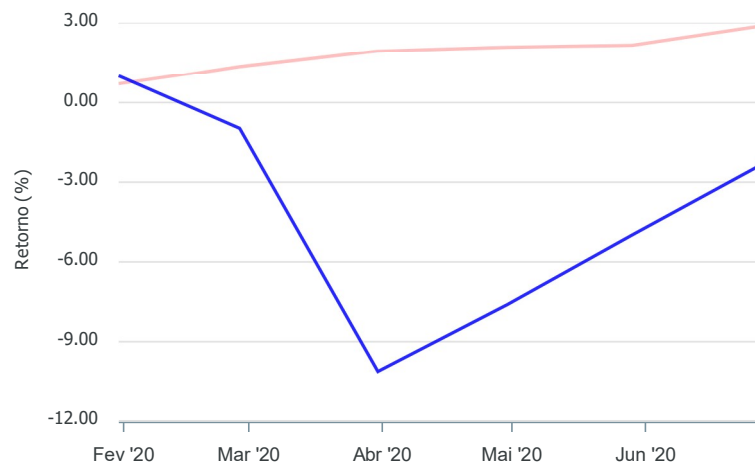
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	201.935,52	0,00	0,00	294.420,03	92.484,51	45,80%	45,80%	74,67%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	4.306.320,28	0,00	0,00	4.396.229,21	89.908,93	2,09%	2,09%	3,04%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	8.297.454,09	0,00	0,00	8.465.493,76	168.039,67	2,03%	2,03%	2,99%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.096.160,65	0,00	0,00	2.138.493,62	42.332,97	2,02%	2,02%	2,98%
SICREDI INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO ...	789.054,49	0,00	0,00	804.659,00	15.604,51	1,98%	1,98%	3,03%
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.520.114,00	0,00	0,00	1.538.895,00	18.781,00	1,24%	1,24%	1,72%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	3.510.715,92	0,00	0,00	3.553.301,35	42.585,43	1,21%	1,21%	0,81%
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	9.631.824,34	0,00	0,00	9.740.901,15	109.076,81	1,13%	1,13%	3,03%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.798.920,27	0,00	0,00	1.818.683,52	19.763,25	1,10%	1,10%	0,91%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.688.549,86	0,00	0,00	3.728.230,28	39.680,42	1,08%	1,08%	0,89%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	3.436.248,65	0,00	0,00	3.473.028,91	36.780,26	1,07%	1,07%	0,90%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	5.254.754,72	1.779.673,93	0,00	7.107.179,92	72.751,27	1,03%	1,18%	0,86%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.156.146,50	0,00	0,00	2.175.285,00	19.138,50	0,89%	0,89%	0,40%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	16.748.909,01	0,00	0,00	16.874.460,59	125.551,58	0,75%	0,75%	1,17%
BRDESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	7.190.332,72	0,00	0,00	7.240.726,89	50.394,17	0,70%	0,70%	0,92%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	8.021.389,79	0,00	0,00	8.056.349,85	34.960,06	0,44%	0,44%	0,38%
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	2.083.054,64	0,00	0,00	2.090.857,83	7.803,19	0,37%	0,37%	1,16%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	83.792,31	0,00	0,00	84.027,62	235,31	0,28%	0,28%	0,06%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	2.578.374,46	0,00	0,00	2.585.078,90	6.704,44	0,26%	0,26%	0,03%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.742.067,12	0,00	0,00	3.751.767,07	9.699,95	0,26%	0,26%	0,05%

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 IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	2.801.890,83	0,00	0,00	2.809.083,49	7.192,66	0,26%	0,26%	0,05%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.538.058,89	0,00	1.000.000,00	541.186,71	3.127,82	0,20%	0,24%	0,03%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	1.518.095,44	3.723.251,14	3.563.987,55	1.682.363,72	5.004,69	0,10%	0,27%	0,05%
Total Renda Fixa	92.994.164,50	5.502.925,07	4.563.987,55	94.950.703,42	1.017.601,40	1,08%		1,60%

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 RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	2.600.000,00	0,00	20.000,00	3.120.000,00	540.000,00	20,77%	20,00%	15,34%
SICREDI IBOVESPA FIC AÇÕES	1.037.595,13	0,00	0,00	1.146.176,82	108.581,69	10,46%	10,46%	12,25%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	3.688.412,25	0,00	0,00	4.030.698,50	342.286,25	9,28%	9,28%	13,00%
META VALOR FIAÇÕES	4.269.515,47	1.200.000,00	0,00	5.945.392,61	475.877,14	8,70%	10,81%	13,96%
BRDESCO SELECTION FIAÇÕES	2.071.613,60	200.000,00	0,00	2.457.546,60	185.933,00	8,19%	8,95%	12,00%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	3.494.430,35	1.200.000,00	0,00	5.077.419,85	382.989,50	8,16%	9,88%	11,74%
MULTINVEST FIAÇÕES	1.140.285,67	500.000,00	0,00	1.765.333,40	125.047,73	7,62%	10,16%	12,67%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FIAÇÕES	3.258.415,14	700.000,00	0,00	4.246.372,46	287.957,32	7,27%	8,63%	12,10%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIAÇÕES	2.874.612,55	0,00	0,00	3.075.863,66	201.251,11	7,00%	7,00%	10,32%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.303.538,39	200.000,00	0,00	1.596.697,33	93.158,94	6,20%	7,44%	13,19%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	3.608.583,10	300.000,00	0,00	4.001.933,01	93.349,91	2,39%	2,60%	3,49%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	4.116.420,38	729.998,27	0,00	4.898.860,32	52.441,67	1,08%	1,25%	1,24%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	3.541.347,17	0,00	600.000,00	2.973.398,22	32.051,05	0,91%	0,88%	1,73%
Total Renda Variável	37.004.769,20	5.029.998,27	620.000,00	44.335.692,78	2.920.925,31	7,05%		9,88%

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	16.382.740,93	954.605,36	1.000.000,00	16.874.460,59	537.114,30	3,10%	3,27%
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	9.210.149,54	0,00	0,00	9.740.901,15	530.751,61	5,76%	5,76%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	8.050.019,46	19.811,47	0,00	8.465.493,76	395.662,83	4,90%	4,91%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	4.180.616,52	0,00	0,00	4.396.229,21	215.612,69	5,16%	5,16%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	6.455.566,53	2.459.952,98	2.000.000,00	7.107.179,92	191.660,41	2,15%	3,54%
BRDESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	4.049.706,25	3.002.220,39	0,00	7.240.726,89	188.800,25	2,68%	3,14%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.594.913,68	0,00	0,00	3.728.230,28	133.316,60	3,71%	3,71%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	4.411.460,69	15.204,92	1.000.000,00	3.553.301,35	126.635,74	2,86%	3,57%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	2.496.587,35	854.885,11	0,00	3.473.028,91	121.556,45	3,63%	3,68%
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	173.609,78	0,00	0,00	294.420,03	120.810,25	69,59%	69,59%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.715.066,53	0,00	3.000.000,00	1.818.683,52	103.616,99	2,20%	3,71%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.023.588,48	15.296,61	0,00	2.138.493,62	99.608,53	4,89%	4,90%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	8.964.583,42	0,00	1.000.000,00	8.056.349,85	91.766,43	1,02%	1,12%
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.463.478,00	0,00	0,00	1.538.895,00	75.417,00	5,15%	5,15%
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	2.048.093,16	0,00	0,00	2.090.857,83	42.764,67	2,09%	2,09%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.390.481,11	320.982,75	0,00	3.751.767,07	40.303,21	1,09%	1,09%
SICREDI INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO ...	767.204,27	0,00	0,00	804.659,00	37.454,73	4,88%	4,88%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.139.679,50	0,00	0,00	2.175.285,00	35.605,50	1,66%	1,66%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	2.777.360,98	1.020.911,65	1.018.542,24	2.809.083,49	29.353,10	0,77%	1,06%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	3.255.684,19	0,00	692.293,86	2.585.078,90	21.688,57	0,67%	0,78%

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
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	2.141.104,86	3.723.251,14	4.192.332,77	1.682.363,72	10.340,49	0,18%	0,60%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.268.920,32	692.103,52	1.429.157,06	541.186,71	9.319,93	0,48%	0,58%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	859.120,00	0,00	863.825,00	0,00	4.705,00	0,55%	5,02%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	83.103,09	0,00	0,00	84.027,62	924,53	1,11%	1,11%
Total Renda Fixa					3.164.789,81	2,93%	

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 (%)	(%) Instt
META VALOR FIAÇÕES	3.190.974,87	1.200.000,00	0,00	5.945.392,61	1.554.417,74	35,40%	48,26%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	2.870.055,64	1.200.000,00	0,00	5.077.419,85	1.007.364,21	24,75%	33,78%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	3.153.076,63	0,00	0,00	4.030.698,50	877.621,87	27,83%	27,83%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	2.339.980,00	0,00	54.000,00	3.120.000,00	834.020,00	35,64%	34,34%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FIAÇÕES	0,00	3.700.000,00	0,00	4.246.372,46	546.372,46	14,77%	27,57%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	2.741.814,81	0,00	3.273.437,96	0,00	531.623,15	19,39%	33,61%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIAÇÕES	1.549.787,41	1.000.000,00	0,00	3.075.863,66	526.076,25	20,63%	23,70%
BRDESCO SELECTION FIAÇÕES	1.797.651,59	200.000,00	0,00	2.457.546,60	459.895,01	23,02%	25,56%
MULTINVEST FIAÇÕES	948.035,21	500.000,00	0,00	1.765.333,40	317.298,19	21,91%	32,50%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	3.405.408,88	300.000,00	0,00	4.001.933,01	296.524,13	8,00%	8,72%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.118.925,79	200.000,00	0,00	1.596.697,33	277.771,54	21,06%	25,16%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	3.744.024,74	945.107,71	0,00	4.898.860,32	209.727,87	4,47%	5,40%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	3.422.740,27	0,00	600.000,00	2.973.398,22	150.657,95	4,40%	4,38%
SICREDI IBOVESPA FIC AÇÕES	0,00	1.000.000,00	0,00	1.146.176,82	146.176,82	14,62%	29,80%
				Total Renda Variável	7.735.547,19	21,14%	

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 (%)	(%) Instt
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	14.824.772,47	2.322.225,90	1.000.000,00	16.874.460,59	727.462,22	4,24%	4,63%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	3.921.869,12	3.002.220,39	0,00	7.240.726,89	316.637,38	4,57%	6,50%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	9.114.976,03	446.157,29	1.700.000,00	8.056.349,85	195.216,53	2,04%	2,27%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	6.481.997,58	2.459.952,98	2.000.000,00	7.107.179,92	165.229,36	1,85%	3,12%
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	176.806,91	0,00	0,00	294.420,03	117.613,12	66,52%	66,52%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.616.715,08	0,00	0,00	3.728.230,28	111.515,20	3,08%	3,08%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	4.440.946,65	15.204,92	1.000.000,00	3.553.301,35	97.149,78	2,18%	2,88%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.133.093,35	535.140,22	0,00	3.751.767,07	83.533,50	2,28%	2,48%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	4.955.688,00	1.855.578,11	3.413.985,64	3.473.028,91	75.748,44	1,11%	3,10%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	2.709.502,34	1.051.415,47	1.018.542,24	2.809.083,49	66.707,92	1,77%	2,45%
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.517.087,00	0,00	35.878,55	1.538.895,00	57.686,55	3,80%	1,44%
SICREDI INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO ...	0,00	750.000,00	0,00	804.659,00	54.659,00	7,29%	-2,32%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	5.765.949,62	0,00	4.000.000,00	1.818.683,52	52.733,90	0,91%	3,04%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	3.236.568,09	0,00	692.293,86	2.585.078,90	40.804,67	1,26%	1,37%
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	2.065.446,82	0,00	0,00	2.090.857,83	25.411,01	1,23%	1,23%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	1.620.885,45	692.103,52	1.793.219,17	541.186,71	21.416,91	0,93%	1,37%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	525.105,57	6.085.121,59	4.943.472,11	1.682.363,72	15.608,67	0,24%	1,49%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.218.594,50	0,00	58.883,07	2.175.285,00	15.573,57	0,70%	-1,95%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	82.011,44	0,00	0,00	84.027,62	2.016,18	2,46%	2,46%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRVAD...	871.338,00	0,00	863.825,00	0,00	-7.513,00	-0,86%	3,55%

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.160.424,10	15.296,61	0,00	2.138.493,62	-37.227,09	-1,71%	-1,75%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	4.227.672,59	250.000,00	0,00	4.396.229,21	-81.443,38	-1,82%	-1,70%
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	9.833.525,46	0,00	0,00	9.740.901,15	-92.624,31	-0,94%	-0,94%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	5.354.822,83	3.302.554,08	0,00	8.465.493,76	-191.883,15	-2,22%	-1,88%
			Total Renda Fixa		1.832.032,98	1,97%	

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 (%)	(%) Instít
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FIAÇÕES	0,00	3.700.000,00	0,00	4.246.372,46	546.372,46	14,77%	-19,72%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	2.979.980,00	0,00	169.000,00	3.120.000,00	309.020,00	10,37%	4,70%
MULTINVEST FIAÇÕES	0,00	1.500.000,00	0,00	1.765.333,40	265.333,40	17,69%	-15,17%
SICREDI IBOVESPA FIC AÇÕES	0,00	1.000.000,00	0,00	1.146.176,82	146.176,82	14,62%	-17,48%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	3.514.950,89	0,00	600.000,00	2.973.398,22	58.447,33	1,66%	1,64%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	4.482.703,49	945.107,71	500.000,00	4.898.860,32	-28.950,88	-0,53%	-1,03%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	4.320.883,60	300.000,00	500.000,00	4.001.933,01	-118.950,59	-2,57%	-3,10%
META VALOR FIAÇÕES	3.873.676,72	2.200.000,00	0,00	5.945.392,61	-128.284,11	-2,11%	-12,77%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIAÇÕES	2.354.227,55	1.000.000,00	0,00	3.075.863,66	-278.363,89	-8,30%	-18,57%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.709.352,39	200.000,00	0,00	1.596.697,33	-312.655,06	-16,37%	-18,07%
BRDESCO SELECTION FIAÇÕES	3.247.407,77	200.000,00	250.000,00	2.457.546,60	-739.861,17	-21,46%	-24,53%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	4.668.899,27	1.200.000,00	0,00	5.077.419,85	-791.479,42	-13,49%	-17,76%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	5.183.860,75	0,00	0,00	4.030.698,50	-1.153.162,25	-22,25%	-22,25%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	6.401.702,93	0,00	4.023.437,96	0,00	-2.378.264,97	-37,15%	-28,51%
Total Renda Variável					-4.604.622,33	-9,41%	