

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 GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	8.555.262,84	19,86%	763	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	1.558.650,27	3,62%	622	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	1.047.893,53	2,43%	600	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	2.094.397,49	4,86%	956	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	3.884.045,05	9,02%	884	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	1.594.625,98	3,70%	670	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	3.203.062,27	7,44%	1.262	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	D+1471	Não há	497.658,89	1,16%	26	0,72%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	1.378.552,59	3,20%	31	0,50%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3 du	Não há	3.593.200,17	8,34%	186	0,46%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
UM INVEST IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	52.198,00	0,12%	6	3,19%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	D+1009	Não há	1.390.540,78	3,23%	28	1,98%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.172.973,14	2,72%	742	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	1.826.208,30	4,24%	287	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	622.865,08	1,45%	608	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se ...	Não se aplica	21.824,38	0,05%	98	0,03%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	1.798.440,30	4,17%	33	1,05%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	102.390,27	0,24%	70	0,14%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
ITAU MOMENTO 30 FIC AÇÕES	D+23	Não há	987.744,37	2,29%	32.344	0,06%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	1.831.801,97	4,25%	8.369	0,20%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
META VALOR FI AÇÕES	D+4	Não há	2.558.114,88	5,94%	166	1,08%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+3	Não há	334.743,36	0,78%	7.875	0,21%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	334.080,89	0,78%	1.560	0,04%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	1.197.277,30	2,78%	18.591	0,03%	Artigo 8º, Inciso III
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+1	Não há	1.009.517,40	2,34%	34.739	0,06%	Artigo 8º, Inciso III
OSASCO PROPERTIES FII	Não se ...	Não se aplica	429.209,56	1,00%		0,10%	Desenquadrado - RV
Total para cálculo dos limites da Resolução			43.077.279,06				

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%	21.937.937,43	50,93%	20,00%	30,00%	90,00%	16.831.613,72
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	25.846.367,44
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	10.534.196,95	24,45%	10,00%	30,00%	40,00%	6.696.714,67
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	6.461.591,86
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	1.922.654,95	4,46%	0,00%	0,00%	5,00%	231.209,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.153.863,95
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.153.863,95
Total Renda Fixa	100,00%	34.394.789,33	79,84%	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%	6.046.485,47	14,04%	7,00%	15,00%	20,00%	2.568.970,34
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	2.206.794,70	5,12%	7,00%	10,00%	10,00%	2.100.933,21
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	2.153.863,95
Desenquadrado - RV	0,00%	429.209,56	1,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-429.209,56
Total Renda Variável	30,00%	8.682.489,73	20,16%	14,00%	30,00%	35,00%	

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

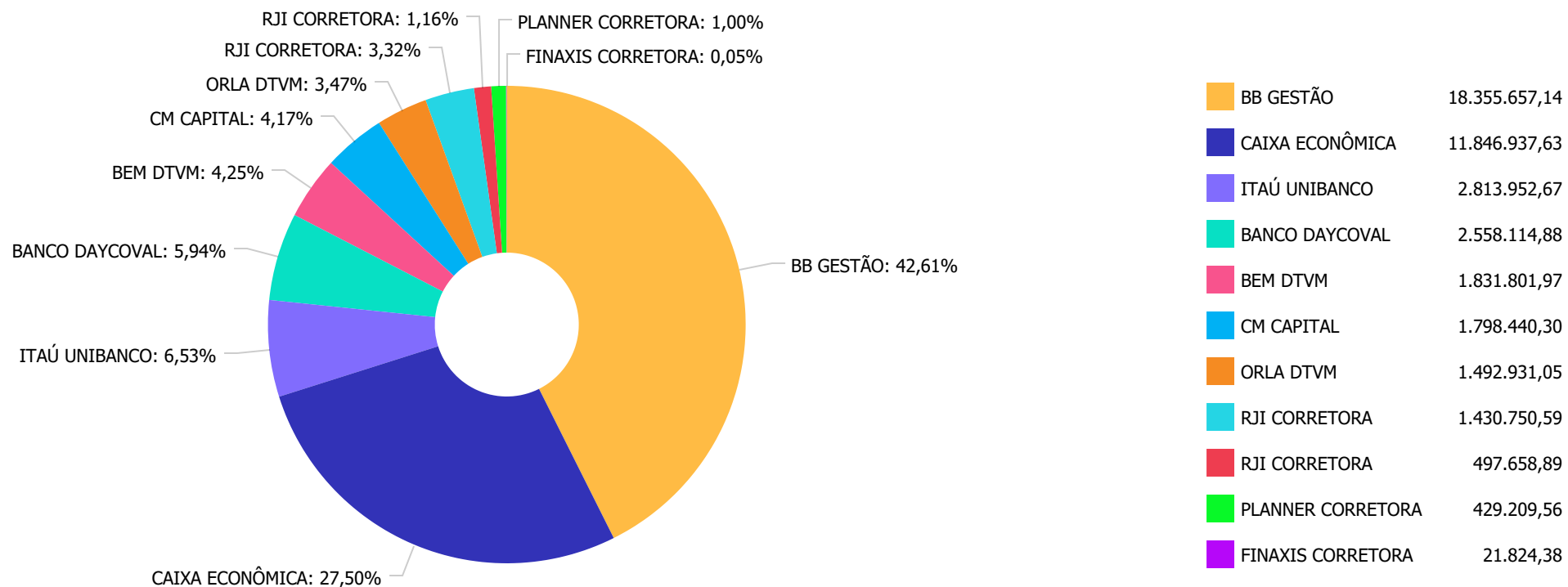
Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	18.355.657,14	42,61	0,00
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	11.846.937,63	27,50	0,00
ITAÚ UNIBANCO	2.813.952,67	6,53	0,00
META ASSET MANAGEMENT	2.558.114,88	5,94	1,07
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	1.831.801,97	4,25	0,13
AURORA CAPITAL	1.798.440,30	4,17	2,23
GRAPHEN INVESTIMENTOS LTDA	1.492.931,05	3,47	1,06
BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUT...	1.378.552,59	3,20	0,02
RJI CORRETORA DE VALORES	497.658,89	1,16	0,09
CADENCE GESTORA	429.209,56	1,00	-
UM ASSET	52.198,00	0,12	-
PETRA CAPITAL	21.824,38	0,05	0,00

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

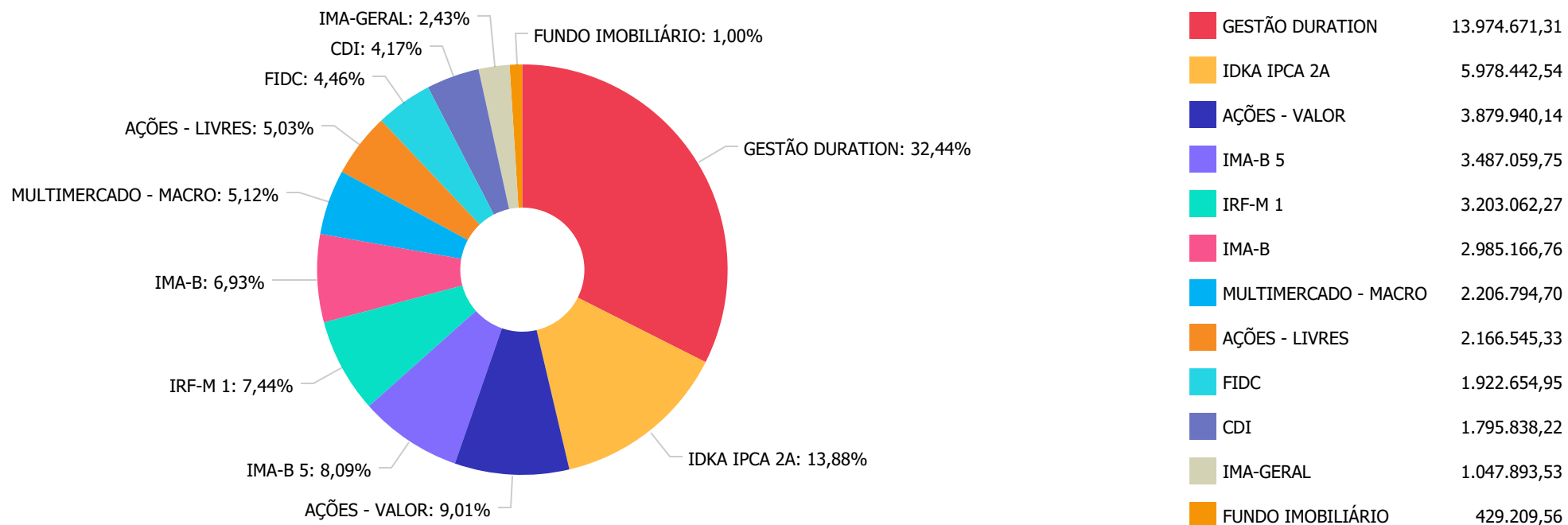
Artigos	Estratégia de Alocação - 2020		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	21.937.937,43	50,93	20,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	10.534.196,95	24,45	10,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	1.922.654,95	4,46	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 II, Alínea ' a '	6.046.485,47	14,04	7,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	2.206.794,70	5,12	7,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00

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)

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



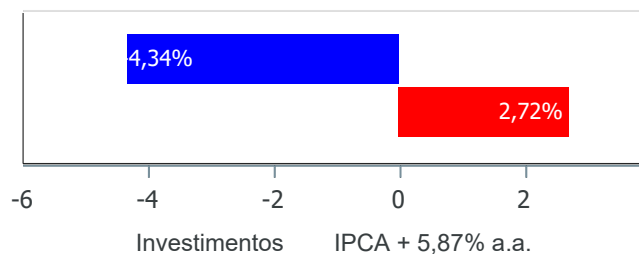
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Junho / 2020)



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	42.566.564,70	1.758.591,31	514.453,82	44.136.611,52	325.909,33	325.909,33	0,74%	0,74%	0,71%	0,71%	104,73%	2,54%
Fevereiro	44.136.611,52	7.629.523,55	8.347.202,00	42.839.909,18	-579.023,89	-253.114,56	-1,31%	-0,58%	0,66%	1,37%	-42,04%	4,17%
Março	42.839.909,18	2.349.885,62	1.284.298,51	40.459.816,36	-3.445.679,93	-3.698.794,49	-7,85%	-8,38%	0,57%	1,95%	-429,40%	13,62%
Abril	40.459.816,36	816.548,74	461.784,51	41.592.996,50	778.415,91	-2.920.378,58	1,91%	-6,63%	0,14%	2,10%	-316,34%	5,91%
Mai	41.592.996,50	629.810,42	449.327,20	42.585.667,43	812.187,71	-2.108.190,87	1,94%	-4,82%	0,07%	2,17%	-221,98%	3,13%
Junho	42.585.667,43	4.320.775,46	4.045.385,48	43.077.279,06	216.221,65	-1.891.969,22	0,50%	-4,34%	0,54%	2,72%	-159,54%	3,86%

Investimentos x Meta Atuarial



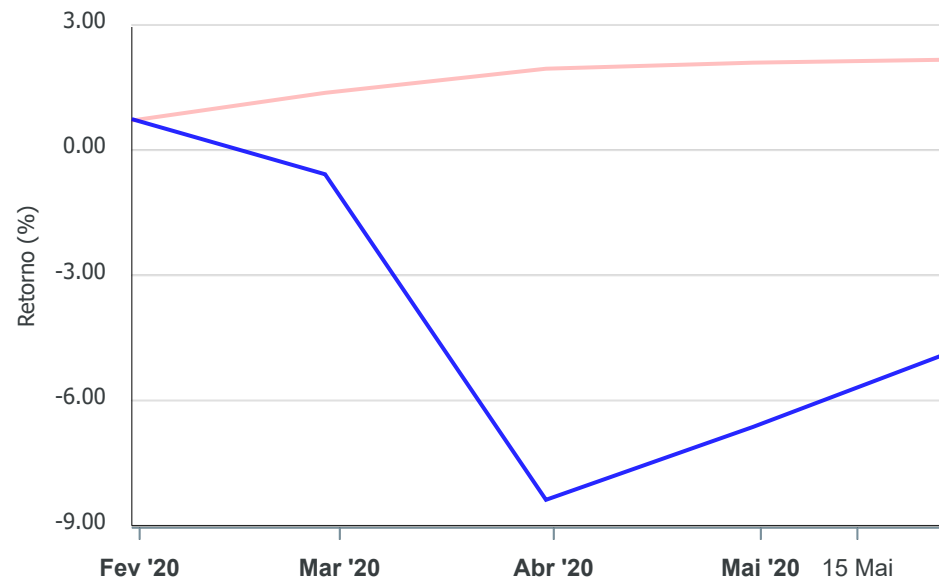
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.563.059,25	0,00	0,00	1.594.625,98	31.566,73	2,02%	2,02%	2,98%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	3.837.495,74	0,00	0,00	3.884.045,05	46.549,31	1,21%	1,21%	0,81%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	2.070.068,48	0,00	0,00	2.094.397,49	24.329,01	1,18%	1,18%	0,86%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.542.061,19	0,00	0,00	1.558.650,27	16.589,08	1,08%	1,08%	0,89%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.038.045,67	0,00	0,00	1.047.893,53	9.847,86	0,95%	0,95%	1,27%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	1.378.215,26	0,00	0,00	1.390.540,78	12.325,52	0,89%	0,89%	30,99%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	8.491.608,82	0,00	0,00	8.555.262,84	63.654,02	0,75%	0,75%	1,17%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	0,00	3.573.930,50	0,00	3.593.200,17	19.269,67	0,54%	0,95%	1,34%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	1.818.283,59	0,00	0,00	1.826.208,30	7.924,71	0,44%	0,44%	0,38%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	621.249,66	0,00	0,00	622.865,08	1.615,42	0,26%	0,26%	0,03%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	3.194.860,82	0,00	0,00	3.203.062,27	8.201,45	0,26%	0,26%	0,05%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1.794.282,60	0,00	0,00	1.798.440,30	4.157,70	0,23%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.469.051,36	746.844,96	4.045.385,48	1.172.973,14	2.462,30	0,05%	0,13%	0,01%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	21.870,81	0,00	0,00	21.824,38	-46,43	-0,21%	-0,21%	0,05%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	102.610,81	0,00	0,00	102.390,27	-220,54	-0,21%	-	-
UM INVEST IMA-B 5 FI RENDA FIXA	52.353,73	0,00	0,00	52.198,00	-155,73	-0,30%	-0,30%	0,31%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	513.155,82	0,00	0,00	497.658,89	-15.496,93	-3,02%	-3,02%	5,92%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.422.446,66	0,00	0,00	1.378.552,59	-43.894,07	-3,09%	-3,09%	5,20%
Total Renda Fixa	33.930.720,27	4.320.775,46	4.045.385,48	34.394.789,33	188.679,08	0,55%		2,51%

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 MOMENTO 30 FIC AÇÕES	886.143,10	0,00	0,00	987.744,37	101.601,27	11,47%	11,47%	10,81%
META VALOR FI AÇÕES	2.308.561,63	0,00	0,00	2.558.114,88	249.553,25	10,81%	10,81%	13,96%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	306.424,05	0,00	0,00	334.743,36	28.319,31	9,24%	9,24%	10,72%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	310.951,41	0,00	0,00	334.080,89	23.129,48	7,44%	7,44%	13,19%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	1.711.948,74	0,00	0,00	1.831.801,97	119.853,23	7,00%	7,00%	10,32%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.182.460,72	0,00	0,00	1.197.277,30	14.816,58	1,25%	1,25%	1,24%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.000.455,28	0,00	0,00	1.009.517,40	9.062,12	0,91%	0,91%	0,93%
OSASCO PROPERTIES FII	948.002,23	0,00	0,00	429.209,56	-518.792,67	-54,72%	0,00%	-
Total Renda Variável	8.654.947,16	0,00	0,00	8.682.489,73	27.542,57	0,32%		9,17%

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	8.284.065,17	0,00	0,00	8.555.262,84	271.197,67	3,27%	3,27%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	3.750.089,34	0,00	0,00	3.884.045,05	133.955,71	3,57%	3,57%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.520.203,85	0,00	0,00	1.594.625,98	74.422,13	4,90%	4,90%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	2.022.749,53	0,00	0,00	2.094.397,49	71.647,96	3,54%	3,54%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.502.914,98	0,00	0,00	1.558.650,27	55.735,29	3,71%	3,71%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	3.169.422,00	0,00	0,00	3.203.062,27	33.640,27	1,06%	1,06%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.017.746,46	0,00	0,00	1.047.893,53	30.147,07	2,96%	2,96%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	1.367.034,01	0,00	0,00	1.390.540,78	23.506,77	1,72%	1,72%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	1.805.921,61	0,00	0,00	1.826.208,30	20.286,69	1,12%	1,12%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	0,00	3.573.930,50	0,00	3.593.200,17	19.269,67	0,54%	2,88%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.918.063,55	2.193.204,12	4.956.497,19	1.172.973,14	18.202,66	0,30%	0,49%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	618.068,90	0,00	0,00	622.865,08	4.796,18	0,78%	0,78%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	21.953,22	0,00	0,00	21.824,38	-128,84	-0,59%	-0,59%
UM INVEST IMA-B 5 FI RENDA FIXA	52.678,78	0,00	0,00	52.198,00	-480,78	-0,91%	-0,93%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	103.326,69	0,00	0,00	102.390,27	-936,42	-0,91%	-0,91%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	507.260,72	0,00	0,00	497.658,89	-9.601,83	-1,89%	-1,89%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.420.573,12	0,00	0,00	1.378.552,59	-42.020,53	-2,96%	-2,96%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	1.847.453,59	0,00	0,00	1.798.440,30	-49.013,29	-2,65%	-2,65%
				Total Renda Fixa	654.626,38	1,94%	

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
META VALOR FI AÇÕES	1.725.385,99	0,00	0,00	2.558.114,88	832.728,89	48,26%	48,26%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	1.480.854,76	0,00	0,00	1.831.801,97	350.947,21	23,70%	23,70%
ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES	752.667,03	0,00	0,00	987.744,37	235.077,34	31,23%	31,23%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	246.311,46	0,00	0,00	334.743,36	88.431,90	35,90%	35,90%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	266.913,16	0,00	0,00	334.080,89	67.167,73	25,16%	25,16%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.135.920,60	0,00	0,00	1.197.277,30	61.356,70	5,40%	5,40%
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	971.769,64	0,00	0,00	1.009.517,40	37.747,76	3,88%	3,88%
OSASCO PROPERTIES FII	950.468,20	0,00	0,00	429.209,56	-521.258,64	-54,84%	-0,26%
				Total Renda Variável	1.152.198,89	15,30%	

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	8.076.269,98	101.591,93	0,00	8.555.262,84	377.400,93	4,61%	4,63%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	4.566.990,64	0,00	800.000,00	3.884.045,05	117.054,41	2,56%	2,88%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	3.126.402,75	0,00	0,00	3.203.062,27	76.659,52	2,45%	2,45%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	2.031.031,29	0,00	0,00	2.094.397,49	63.366,20	3,12%	3,12%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.960.033,29	6.386.604,51	10.225.108,33	1.172.973,14	51.443,67	0,45%	1,24%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.512.029,43	0,00	0,00	1.558.650,27	46.620,84	3,08%	3,08%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	0,00	1.790.423,46	0,00	1.826.208,30	35.784,84	2,00%	2,27%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	0,00	3.573.930,50	0,00	3.593.200,17	19.269,67	0,54%	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.029.868,41	0,00	0,00	1.047.893,53	18.025,12	1,75%	1,75%
UM INVEST IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.157.906,42	0,00	1.117.758,71	52.198,00	12.050,29	1,04%	0,72%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	614.439,83	0,00	0,00	622.865,08	8.425,25	1,37%	1,37%
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES LP	0,00	1.000.000,00	1.000.153,78	0,00	153,78	0,02%	1,67%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	22.168,86	0,00	0,00	21.824,38	-344,48	-1,55%	-1,55%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	105.510,80	0,00	0,00	102.390,27	-3.120,53	-2,96%	-2,96%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	1.435.927,79	0,00	0,00	1.390.540,78	-45.387,01	-3,16%	-3,16%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	2.131.029,03	0,00	283.915,19	1.798.440,30	-48.673,54	-2,28%	-15,61%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	0,00	1.657.730,66	0,00	1.594.625,98	-63.104,68	-3,81%	-1,75%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	607.426,54	0,00	0,00	497.658,89	-109.767,65	-18,07%	-18,07%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2.004.912,30	0,00	0,00	1.378.552,59	-626.359,71	-31,24%	-31,24%
Total Renda Fixa					-70.503,08	-0,20%	

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
BB MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,00	1.000.000,00	0,00	1.009.517,40	9.517,40	0,95%	1,64%
FRANKLIN TEMPLETON VALOR E FVL FI AÇÕES	948.573,87	0,00	946.515,31	0,00	-2.058,56	-0,22%	-21,40%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.209.758,66	0,00	0,00	1.197.277,30	-12.481,36	-1,03%	-1,03%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	0,00	400.000,00	0,00	334.743,36	-65.256,64	-16,31%	-13,61%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	0,00	400.000,00	0,00	334.080,89	-65.919,11	-16,48%	-18,07%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	890.007,96	0,00	729.000,20	0,00	-161.007,76	-18,09%	-12,98%
ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES	0,00	1.194.854,04	0,00	987.744,37	-207.109,67	-17,33%	-14,65%
META VALOR FI AÇÕES	2.932.459,35	0,00	0,00	2.558.114,88	-374.344,47	-12,77%	-12,77%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	2.249.514,38	0,00	0,00	1.831.801,97	-417.712,41	-18,57%	-18,57%
OSASCO PROPERTIES FII	954.303,12	0,00	0,00	429.209,56	-525.093,56	-55,02%	-0,80%
				Total Renda Variável	-1.821.466,14	-17,34%	