

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
TÍTULOS PÚBLICOS			109.740.852,05	8,05%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	50.912.036,46	3,73%	901	0,85%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	15/08/2030	16.306.749,76	1,20%	27	4,52%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	7.248.020,76	0,53%	6	13,63%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	15/08/2022	10.592.108,19	0,78%	165	1,55%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	50.898.091,64	3,73%	554	8,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	63.895.632,92	4,69%	340	3,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	80.769.230,58	5,92%	622	2,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	101.659.588,36	7,46%	763	0,83%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	76.143.407,90	5,59%	956	0,98%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	15.107.893,24	1,11%	74	1,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	16/08/2020	3.728.314,43	0,27%	107	0,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	44.709.923,59	3,28%	91	10,31%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	9.182.729,28	0,67%	421	0,11%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	64.281,75	0,00%	742	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	34.615.245,49	2,54%	434	0,70%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	D+1 du ...	Não há	11.818.539,02	0,87%	12.994	2,52%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	170.443.143,40	12,50%	125	8,74%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO H NILO FI RENDA FIXA	D+4	Não há	108.969.125,73	7,99%	23	12,85%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	93.863.512,43	6,89%	287	1,82%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2020)

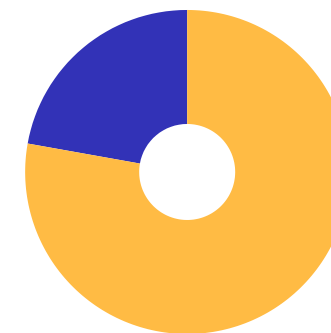
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
SILVERADO MAXIMUM II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR ...	Não se ...	Não se aplica	47.916,59	0,00%		0,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	46.205.319,22	3,39%	3.749	2,94%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
VINCI SELECTION EQUITIES FI AÇÕES	D+63	Não há	32.564.101,20	2,39%	138	7,77%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	27.461.270,99	2,01%	820	10,14%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	22.049.599,38	1,62%	6.693	1,56%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	4.186.705,35	0,31%	3.363	1,56%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+29	Não há	4.674.979,67	0,34%	30	0,33%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
XP DIVIDENDOS 30 FIC AÇÕES	D+33	Não há	7.090.949,20	0,52%	2.138	7,02%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
VINCI MOSAICO FI AÇÕES	D+4 du ...	Não há	32.697.439,41	2,40%	1.703	2,20%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	29.959.338,04	2,20%	53	3,53%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	34.447.136,40	2,53%	49.451	0,88%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
XP LONG SHORT 60 FIC MULTIMERCADO	D+2 a D...	Não há	9.594.709,96	0,70%	2.424	3,14%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	32.305.426,01	2,37%	9.851	3,60%	Artigo 8º, Inciso III
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou...	Não há	318.101,79	0,02%	12	1,31%	Artigo 8º, Inciso III
ITAÚ VISION INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	960.777,28	0,07%	12	0,85%	Artigo 8º, Inciso III
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	Não se ...	Não se aplica	2.124.367,38	0,16%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	5.232.107,43	0,38%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'
LSH FIP	Não se ...	Não se aplica	1.226.004,56	0,09%	17	1,11%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'
BRASIL ENERGIA RENOVÁVEL MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	304.442,03	0,02%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'
REAG RENDA IMOBILIÁRIA FII - DOMC11	Não se ...	Não se aplica	2.118.990,16	0,16%		1,74%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	S/Info	Não se aplica	6.957.150,37	0,51%		14,36%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
Total para cálculo dos limites da Resolução			1.363.195.259,40				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	109.740.852,05	8,05%	0,00%	5,00%	25,00%	231.057.962,80
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	477.261.074,24	35,01%	20,00%	25,00%	70,00%	476.975.607,34
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	4,00%	70,00%	954.236.681,58
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	473.666.500,69	34,75%	10,00%	25,00%	50,00%	207.931.129,01
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	68.159.762,97
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	47.916,59	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	136.271.609,35
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	204.479.288,91
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	136.319.525,94
Total Renda Fixa	100,00%	1.060.716.343,57	77,81%	30,00%	60,00%	255,00%	

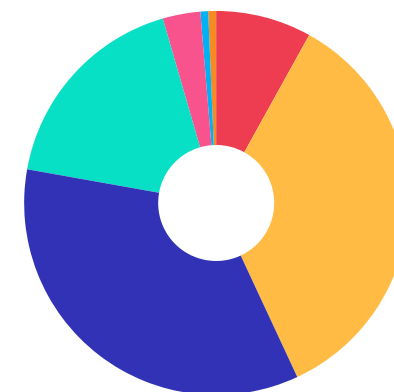


RENDA FIXA 1.060.716.343,57
RENDA VARIÁVEL 302.478.915,83

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%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	136.319.525,94
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	136.319.525,94
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	241.336.838,86	17,70%	7,00%	20,00%	30,00%	167.621.738,96
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	43.179.015,04	3,17%	2,00%	10,00%	10,00%	93.140.510,90
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	8.886.921,40	0,65%	0,00%	5,00%	5,00%	59.272.841,57
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	9.076.140,53	0,67%	0,00%	5,00%	5,00%	59.083.622,44
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	136.319.525,94
Total Renda Variável	30,00%	302.478.915,83	22,19%	9,00%	40,00%	80,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2020			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	68.159.762,97
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	136.319.525,94
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	136.319.525,94
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	25,00%	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	362.368.868,56	26,58	0,07
BRASESCO ASSET MANAGEMENT	288.594.998,41	21,17	0,03
ITAU UNIBANCO	173.981.349,70	12,76	0,01
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	109.740.852,05	8,05	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	91.425.620,52	6,71	0,01
WESTERN ASSET	83.203.517,65	6,10	0,18
NAVI CAPITAL	46.205.319,22	3,39	2,84
VINCI PARTNERS	32.697.439,41	2,40	0,04
VINCI GESTÃO DE PATRIMÔNIO LTD...	32.564.101,20	2,39	0,04
ITAU DTVM	29.959.338,04	2,20	0,00
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	27.461.270,99	2,01	1,93
AZ QUEST INVESTIMENTOS	26.724.579,05	1,96	0,10
XP GESTÃO DE RECURSOS	20.872.364,51	1,53	0,00
XP VISTA ASSET MANAGEMENT	11.818.539,02	0,87	0,00
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	7.248.020,76	0,53	0,01
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	6.957.150,37	0,51	1,58
A5 CAPITAL PARTNERS	5.232.107,43	0,38	-
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	2.124.367,38	0,16	0,00
REAG GESTORA DE RECURSOS	2.118.990,16	0,16	0,02
ROMA ASSET	1.226.004,56	0,09	1,11
CAPITÂNIA	318.101,79	0,02	0,00
BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUT...	304.442,03	0,02	0,00
GRADUAL INVESTIMENTOS	47.916,59	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 ' a '	109.740.852,05	8,05	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	477.261.074,24	35,01	20,00	70,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	5,00	70,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	473.666.500,69	34,75	10,00	50,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	47.916,59	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	241.336.838,86	17,70	7,00	30,00
Artigo 8º, Inciso III	43.179.015,04	3,17	2,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	8.886.921,40	0,65	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	9.076.140,53	0,67	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º - A, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00

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
130% do CDI (Benchmark)	0,28%	2,29%	0,96%	2,29%	5,99%	14,82%	-	-
SILVERADO MAXIMUM II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	-3,85%	-12,92%	-8,21%	-12,92%	-25,68%	-	-	-
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,99%	3,35%	3,35%	3,35%	8,68%	23,17%	-	-
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%	-	-
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%
IMA-B 5 (Benchmark)	1,12%	3,17%	3,77%	3,17%	8,73%	24,75%	-	-
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	1,45%	2,12%	4,09%	2,12%	7,48%	24,00%	0,01%	0,05%
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%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	1,41%	4,81%	5,29%	4,81%	11,07%	32,87%	0,02%	0,05%
IMA-B (Benchmark)	2,05%	-1,66%	4,96%	-1,66%	4,73%	35,13%	-	-
BRANCO 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%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,24%	1,43%	5,16%	1,43%	4,77%	20,97%	0,02%	0,07%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,87%	-1,36%	6,25%	-1,36%	2,23%	28,13%	0,03%	0,10%

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
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,99%	1,64%	2,40%	1,64%	6,28%	19,00%	0,00%	0,02%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,89%	-1,96%	1,68%	-1,96%	-0,62%	3,40%	0,00%	0,04%
BRDESCO H NILO FI RENDA FIXA	2,28%	-1,30%	5,79%	-1,30%	5,55%	37,94%	0,03%	0,11%
Selic (Benchmark)	0,21%	1,75%	0,73%	1,75%	4,58%	11,21%	-	-
BRDESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	0,20%	1,65%	0,69%	1,65%	4,41%	10,82%	0,00%	0,00%
CDI (Benchmark)	0,21%	1,75%	0,73%	1,75%	4,58%	11,21%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,13%	1,24%	0,49%	1,24%	3,50%	8,88%	0,00%	0,00%
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 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%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,20%	0,18%	3,88%	0,18%	3,05%	13,49%	0,01%	0,06%

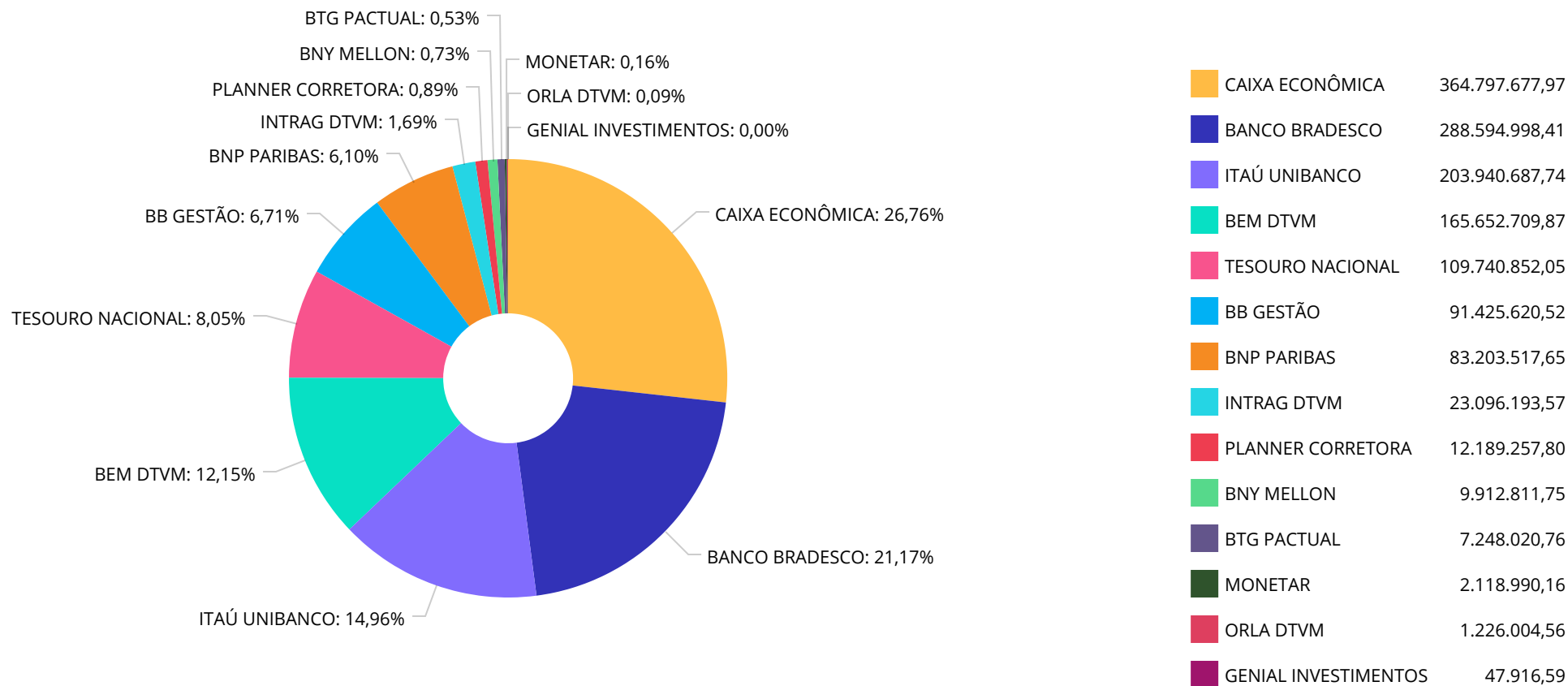
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2020 - RENDA VARIÁVEL

	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	-	-	-	-	-	-	-	-
S&P 500 (Benchmark)	1,84%	-4,04%	19,95%	-4,04%	4,59%	14,05%	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	0,85%	-6,40%	18,78%	-6,40%	4,13%	17,08%	0,13%	0,23%
IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	0,91%	3,93%	1,44%	3,93%	10,29%	23,06%	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	-	-	-	-	-	-	-	-
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	0,83%	3,46%	1,21%	3,46%	9,27%	20,80%	-	-
REAG RENDA IMOBILIÁRIA FII - DOMC11	-3,81%	-15,13%	-18,42%	-15,13%	11,48%	1,00%	0,22%	0,29%
IDIV (Benchmark)	8,95%	-18,38%	18,70%	-18,38%	0,08%	47,52%	-	-
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	6,45%	-24,11%	14,89%	-24,11%	-6,24%	45,41%	0,15%	0,35%
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%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	8,63%	-19,72%	27,57%	-19,72%	-6,09%	31,08%	0,12%	0,38%
VINCI SELECTION EQUITIES FI AÇÕES	8,34%	-8,91%	29,37%	-8,91%	6,61%	46,06%	0,11%	0,33%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8,30%	-13,97%	30,24%	-13,97%	3,76%	48,79%	0,13%	0,36%

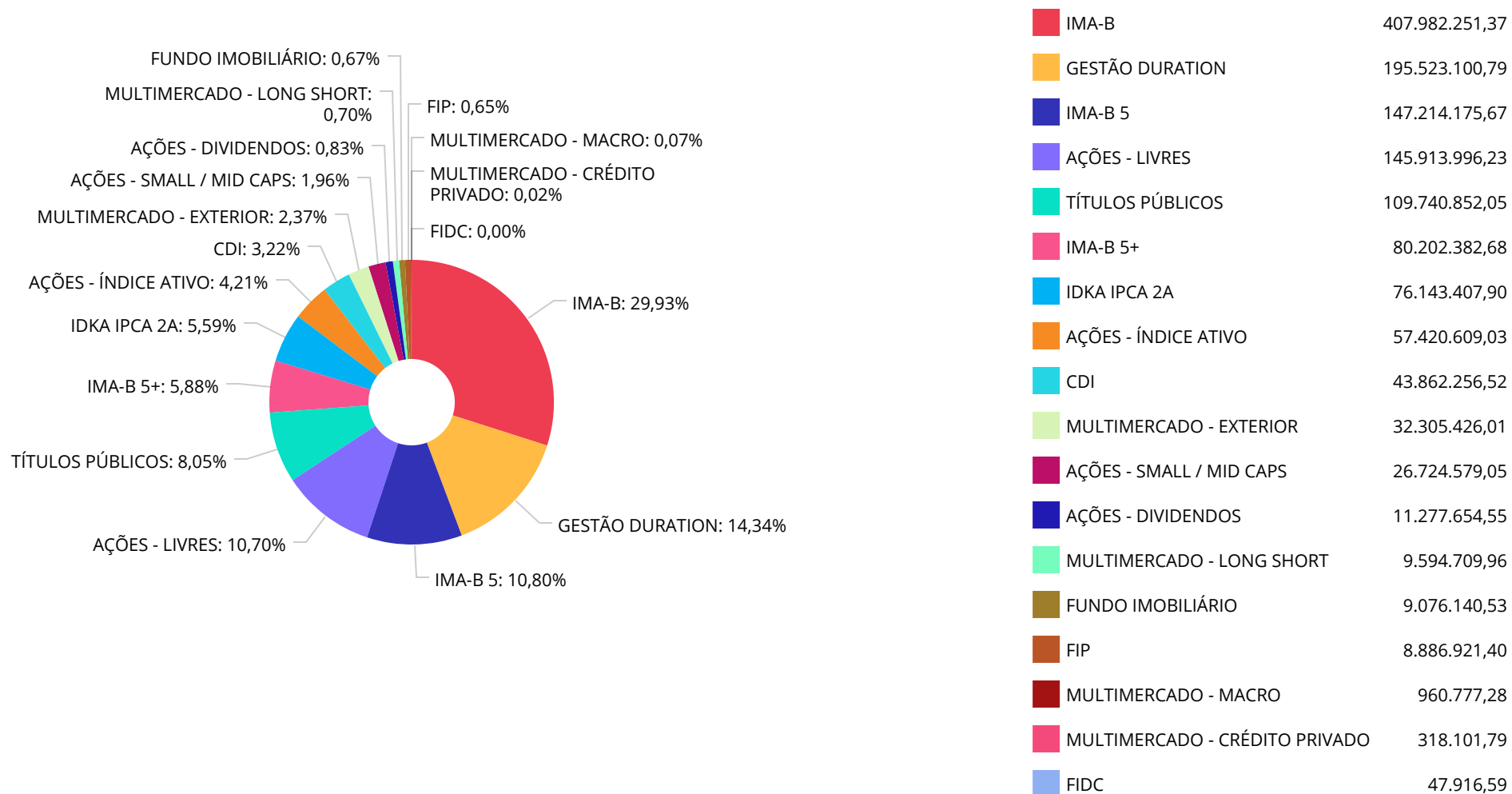
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	9,28%	-22,25%	27,83%	-22,25%	-4,41%	36,54%	0,13%	0,40%
VINCI MOSAICO FI AÇÕES	9,36%	-15,32%	28,90%	-15,32%	6,44%	57,37%	0,12%	0,40%
SMLL (Benchmark)	14,43%	-20,73%	32,49%	-20,73%	5,76%	49,01%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	8,63%	-20,26%	28,01%	-20,26%	7,24%	45,66%	0,13%	0,46%
CDI (Benchmark)	0,21%	1,75%	0,73%	1,75%	4,58%	11,21%	-	-
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-1,13%	-47,58%	-45,04%	-47,58%	-53,98%	-60,21%	0,02%	0,44%
XP LONG SHORT 60 FIC MULTIMERCADO	-2,10%	-1,01%	1,51%	-1,01%	-1,61%	2,39%	0,04%	0,06%
ITAÚ VISION INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	-0,03%	-5,86%	2,00%	-5,86%	-2,46%	-	0,01%	0,07%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	0,29%	-15,80%	2,63%	-15,80%	73,46%	-	-	-
BRASIL ENERGIA RENOVÁVEL MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-36,78%	-37,26%	-	-
LSH FIP	-0,04%	-	-	-	-0,53%	-	0,00%	0,00%
XP DIVIDENDOS 30 FIC AÇÕES	6,24%	-24,15%	14,09%	-24,15%	-6,40%	43,61%	0,14%	0,35%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8,54%	-20,90%	27,92%	-20,90%	-	-	0,13%	-

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



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



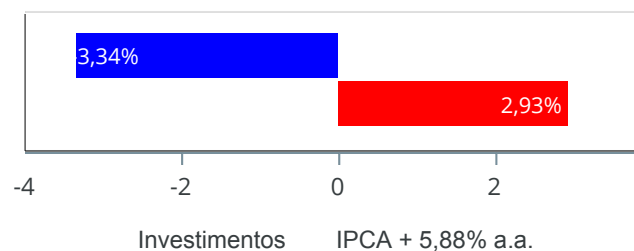
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Junho / 2020)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2021	17/08/2016	4.750	2.964,257204	3.504,547637	14.080.221,72	16.646.601,28	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2023	03/09/2015	6.730	2.515,509771	3.791,953176	16.929.380,76	25.519.844,87	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	14/03/2014	6.185	2.315,991673	3.929,164803	14.324.408,50	24.301.884,31	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2026	27/04/2016	2.200	2.838,144079	4.017,728283	6.243.916,97	8.839.002,22	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2035	21/12/2015	8.310	2.412,107871	4.143,624473	20.044.616,41	34.433.519,37	Mercado

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

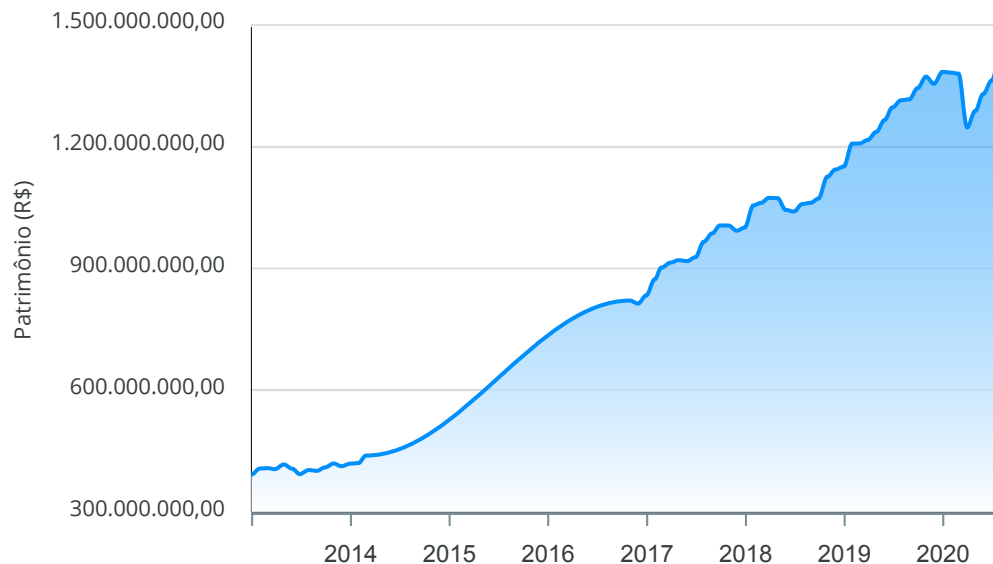
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	1.373.686.132,44	33.835.716,37	42.059.233,95	1.372.103.025,60	6.640.410,74	6.640.410,74	0,48%	0,48%	0,71%	0,71%	67,98%	3,08%
Fevereiro	1.372.103.025,60	55.461.648,94	39.561.380,36	1.369.766.496,11	-18.236.798,07	-11.596.387,33	-1,31%	-0,84%	0,66%	1,38%	-60,83%	5,03%
Março	1.369.766.496,11	38.601.161,25	35.299.178,06	1.237.776.682,01	-135.291.797,29	-146.888.184,62	-9,85%	-10,61%	0,57%	1,95%	-542,86%	20,13%
Abril	1.237.776.682,01	11.329.780,82	4.603.296,18	1.278.194.251,02	33.691.084,37	-113.197.100,25	2,71%	-8,19%	0,14%	2,10%	-389,90%	10,24%
Mai	1.278.194.251,02	16.698.547,64	7.534.716,96	1.319.878.399,31	32.520.317,61	-80.676.782,64	2,53%	-5,87%	0,07%	2,17%	-269,91%	5,23%
Junho	1.319.878.399,31	19.098.681,43	20.347.182,08	1.354.012.530,12	35.382.631,46	-45.294.151,18	2,68%	-3,34%	0,74%	2,93%	-114,21%	4,40%

Investimentos x Meta Atuarial



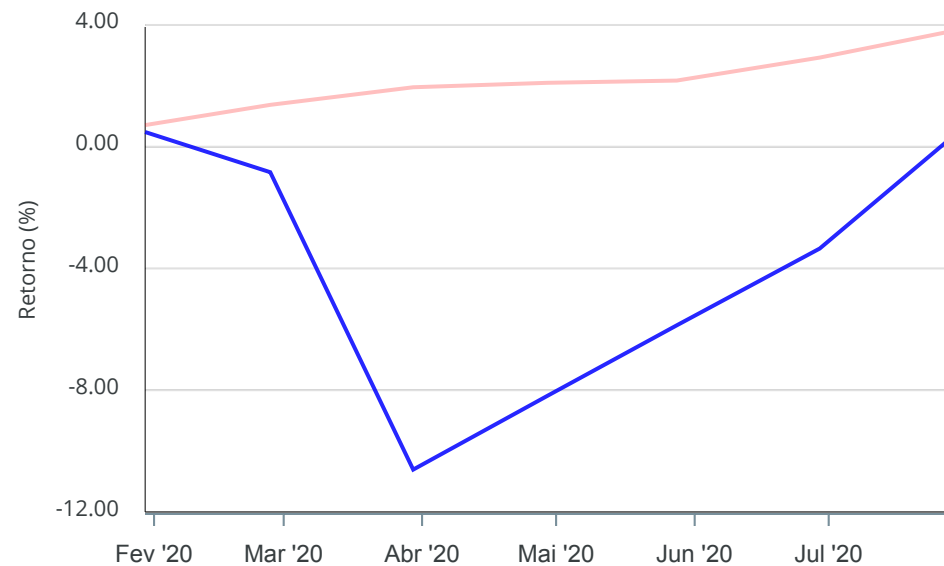
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	15.851.535,52	0,00	0,00	16.306.749,76	455.214,24	2,87%	2,87%	2,99%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	62.138.818,09	0,00	0,00	63.895.632,92	1.756.814,83	2,83%	2,83%	4,98%
BRASESCO H NILO FI RENDA FIXA	106.541.704,01	0,00	0,00	108.969.125,73	2.427.421,72	2,28%	2,28%	3,31%
BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	166.957.346,93	0,00	0,00	170.443.143,40	3.485.796,47	2,09%	2,09%	3,04%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	49.901.434,93	0,00	0,00	50.912.036,46	1.010.601,53	2,03%	2,03%	2,99%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	43.836.054,32	0,00	0,00	44.709.923,59	873.869,27	1,99%	1,99%	3,03%
TÍTULOS PÚBLICOS	107.988.564,31	0,00	0,00	109.740.852,05	1.752.287,74	1,62%	-	-
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	11.649.410,67	0,00	0,00	11.818.539,02	169.128,35	1,45%	1,45%	1,34%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	50.188.996,98	0,00	0,00	50.898.091,64	709.094,66	1,41%	1,41%	1,70%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	14.923.216,81	0,00	0,00	15.107.893,24	184.676,43	1,24%	1,24%	1,72%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.162.031,85	0,00	0,00	7.248.020,76	85.988,91	1,20%	1,20%	0,89%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	85.197.983,87	0,00	10.000.000,00	76.143.407,90	945.424,03	1,11%	1,18%	0,86%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	79.909.584,89	0,00	0,00	80.769.230,58	859.645,69	1,08%	1,08%	0,89%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	10.488.035,23	0,00	0,00	10.592.108,19	104.072,96	0,99%	0,99%	0,45%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.695.387,46	0,00	0,00	3.728.314,43	32.926,97	0,89%	0,89%	0,40%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	100.903.206,99	0,00	0,00	101.659.588,36	756.381,37	0,75%	0,75%	1,17%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	93.456.197,33	0,00	0,00	93.863.512,43	407.315,10	0,44%	0,44%	0,38%
BRASESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	9.583.111,17	0,00	418.771,54	9.182.729,28	18.389,65	0,19%	0,20%	0,01%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	25.780.144,17	18.922.485,43	10.150.525,89	34.615.245,49	63.141,78	0,14%	0,22%	0,03%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	84.639,24	176.196,00	196.656,19	64.281,75	102,70	0,04%	0,13%	0,01%

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
SILVERADO MAXIMUM II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	49.835,74	0,00	0,00	47.916,59	-1.919,15	-3,85%	-	-
Total Renda Fixa	1.046.287.240,51	19.098.681,43	20.765.953,62	1.060.716.343,57	16.096.375,25	1,51%		2,07%

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
VINCI MOSAICO FI AÇÕES	29.900.376,37	0,00	0,00	32.697.439,41	2.797.063,04	9,35%	9,35%	12,28%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	31.521.891,28	0,00	0,00	34.447.136,40	2.925.245,12	9,28%	9,28%	13,00%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	25.278.607,49	0,00	0,00	27.461.270,99	2.182.663,50	8,63%	8,63%	12,10%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	20.297.093,56	0,00	0,00	22.049.599,38	1.752.505,82	8,63%	8,63%	12,99%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	27.582.185,02	0,00	0,00	29.959.338,04	2.377.153,02	8,62%	8,62%	11,52%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	4.307.201,33	0,00	0,00	4.674.979,67	367.778,34	8,54%	8,54%	12,93%
VINCI SELECTION EQUITIES FI AÇÕES	30.057.757,95	0,00	0,00	32.564.101,20	2.506.343,25	8,34%	8,34%	11,28%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	42.663.165,11	0,00	0,00	46.205.319,22	3.542.154,11	8,30%	8,30%	12,56%
REAG RENDA IMOBILIÁRIA FII - DOMC11	1.977.044,89	0,00	0,00	2.118.990,16	141.945,27	7,18%	-3,81%	21,80%
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	3.933.180,01	0,00	0,00	4.186.705,35	253.525,34	6,45%	6,45%	14,88%
XP DIVIDENDOS 30 FIC AÇÕES	6.674.555,60	0,00	0,00	7.090.949,20	416.393,60	6,24%	6,24%	14,08%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	32.034.117,20	0,00	0,00	32.305.426,01	271.308,81	0,85%	0,85%	12,81%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	6.937.065,78	0,00	0,00	6.957.150,37	20.084,59	0,29%	0,29%	-
LSH FIP	1.226.004,56	0,00	0,00	1.226.004,56	0,00	0,00%	-0,04%	0,01%
ITAÚ VISION INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	961.023,94	0,00	0,00	960.777,28	-246,66	-0,03%	-0,03%	1,12%
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	5.240.749,34	0,00	0,00	5.232.107,43	-8.641,91	-0,16%	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	2.129.574,65	0,00	0,00	2.124.367,38	-5.207,27	-0,24%	-	-
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	321.725,06	0,00	0,00	318.101,79	-3.623,27	-1,13%	-1,13%	1,58%
XP LONG SHORT 60 FIC MULTIMERCADO	9.800.257,72	0,00	0,00	9.594.709,96	-205.547,76	-2,10%	-2,10%	4,14%
BRASIL ENERGIA RENOVÁVEL MULTIESTRATÉGIA FIP	330.693,11	0,00	0,00	304.442,03	-26.251,08	-7,94%	-	-

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
Total Renda Variável	283.174.269,97	0,00	0,00	302.478.915,83	19.304.645,86	6,82%		12,11%

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
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	162.083.773,92	0,00	0,00	170.443.143,40	8.359.369,48	5,16%	5,16%
BRADESCO H NILO FI RENDA FIXA	103.006.536,58	0,00	0,00	108.969.125,73	5.962.589,15	5,79%	5,79%
TÍTULOS PÚBLICOS	106.496.924,86	0,00	1.931.999,11	109.740.852,05	5.175.926,30	4,86%	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	60.349.584,41	0,00	0,00	63.895.632,92	3.546.048,51	5,88%	5,88%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	98.437.028,62	0,00	0,00	101.659.588,36	3.222.559,74	3,27%	3,27%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	83.250.474,17	0,00	10.000.000,00	76.143.407,90	2.892.933,73	3,47%	3,54%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	77.881.029,20	0,00	0,00	80.769.230,58	2.888.201,38	3,71%	3,71%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	48.342.264,62	0,00	0,00	50.898.091,64	2.555.827,02	5,29%	5,29%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	48.531.248,23	0,00	0,00	50.912.036,46	2.380.788,23	4,91%	4,91%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	42.499.806,97	0,00	0,00	44.709.923,59	2.210.116,62	5,20%	5,20%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	92.820.815,90	0,00	0,00	93.863.512,43	1.042.696,53	1,12%	1,12%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	15.347.356,80	0,00	0,00	16.306.749,76	959.392,96	6,25%	6,25%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	14.366.639,60	0,00	0,00	15.107.893,24	741.253,64	5,16%	5,16%
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	11.354.559,60	0,00	0,00	11.818.539,02	463.979,42	4,09%	4,09%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	6.977.000,81	0,00	0,00	7.248.020,76	271.019,95	3,88%	3,88%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	10.343.957,75	0,00	0,00	10.592.108,19	248.150,44	2,40%	2,40%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7.930.650,73	45.605.679,75	19.072.356,81	34.615.245,49	151.271,82	0,28%	0,78%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	9.884.014,95	0,00	767.020,73	9.182.729,28	65.735,06	0,67%	0,69%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.666.880,54	0,00	0,00	3.728.314,43	61.433,89	1,68%	1,68%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	55.632,21	1.489.152,41	1.480.839,30	64.281,75	336,43	0,02%	0,49%

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
SILVERADO MAXIMUM II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	52.201,36	0,00	0,00	47.916,59	-4.284,77	-8,21%	-8,21%
				Total Renda Fixa	43.195.345,53	4,25%	

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
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	35.476.178,02	0,00	0,00	46.205.319,22	10.729.141,20	30,24%	30,24%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	26.946.808,62	0,00	0,00	34.447.136,40	7.500.327,78	27,83%	27,83%
VINCI SELECTION EQUITIES FI AÇÕES	25.171.094,74	0,00	0,00	32.564.101,20	7.393.006,46	29,37%	29,37%
VINCI MOSAICO FI AÇÕES	25.366.086,27	0,00	0,00	32.697.439,41	7.331.353,14	28,90%	28,90%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	22.903.117,27	0,00	0,00	29.959.338,04	7.056.220,77	30,81%	30,81%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	21.527.267,23	0,00	0,00	27.461.270,99	5.934.003,76	27,57%	27,57%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	27.198.782,95	0,00	0,00	32.305.426,01	5.106.643,06	18,78%	18,78%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	17.225.149,03	0,00	0,00	22.049.599,38	4.824.450,35	28,01%	28,01%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3.654.685,68	0,00	0,00	4.674.979,67	1.020.293,99	27,92%	27,92%
XP DIVIDENDOS 30 FIC AÇÕES	6.215.056,99	0,00	0,00	7.090.949,20	875.892,21	14,09%	14,09%
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	3.643.962,91	0,00	0,00	4.186.705,35	542.742,44	14,89%	14,89%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	6.780.144,90	0,00	0,00	6.957.150,37	177.005,47	2,61%	2,63%
XP LONG SHORT 60 FIC MULTIMERCADO	9.451.780,38	0,00	0,00	9.594.709,96	142.929,58	1,51%	1,51%
REAG RENDA IMOBILIÁRIA FII - DOMC11	1.983.489,89	0,00	0,00	2.118.990,16	135.500,27	6,83%	-18,42%
ITAÚ VISION INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	941.980,17	0,00	0,00	960.777,28	18.797,11	2,00%	2,00%
LSH FIP	1.226.004,56	0,00	0,00	1.226.004,56	0,00	0,00%	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	2.103.194,54	32.177,73	0,00	2.124.367,38	-11.004,89	-0,52%	-
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	5.257.249,69	0,00	0,00	5.232.107,43	-25.142,26	-0,48%	-
BRASIL ENERGIA RENOVÁVEL MULTISTRATÉGIA FIP	331.512,86	0,00	0,00	304.442,03	-27.070,83	-8,17%	-
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	578.768,43	0,00	0,00	318.101,79	-260.666,64	-45,04%	-45,04%

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
				Total Renda Variável	58.464.422,97	23,96%	

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	62.264.776,82	35.380.000,00	0,00	101.659.588,36	4.014.811,54	4,11%	4,63%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	95.866.034,09	0,00	22.400.000,00	76.143.407,90	2.677.373,81	2,79%	3,12%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	78.353.347,45	2.800,65	2.800,65	80.769.230,58	2.415.883,13	3,08%	3,08%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	48.563.596,93	0,00	0,00	50.898.091,64	2.334.494,71	4,81%	4,81%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	91.782.618,26	0,00	0,00	93.863.512,43	2.080.894,17	2,27%	2,27%
TÍTULOS PÚBLICOS	111.016.950,56	0,00	2.750.509,66	109.740.852,05	1.474.411,15	1,33%	-
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	14.895.520,21	0,00	355.810,23	15.107.893,24	568.183,26	3,81%	1,43%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	16.965.678,89	119.356.915,58	102.094.827,78	34.615.245,49	387.478,80	0,28%	1,83%
XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP	11.573.600,55	0,00	0,00	11.818.539,02	244.938,47	2,12%	2,12%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.234.674,86	0,00	182.881,48	7.248.020,76	196.227,38	2,71%	0,18%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	10.701.319,78	0,00	281.742,04	10.592.108,19	172.530,45	1,61%	1,64%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	10.795.471,00	0,00	1.778.312,74	9.182.729,28	165.571,02	1,53%	1,65%
CAIXA BRASIL 2030 III TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	16.531.416,22	0,00	361.153,48	16.306.749,76	136.487,02	0,83%	-1,36%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.802.893,82	0,00	102.080,66	3.728.314,43	27.501,27	0,72%	-1,96%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	16.315,03	1.843.749,56	1.796.549,84	64.281,75	767,00	0,04%	1,24%
SILVERADO MAXIMUM II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	55.028,51	0,00	0,00	47.916,59	-7.111,92	-12,92%	-12,92%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	44.862.080,60	0,00	0,00	44.709.923,59	-152.157,01	-0,34%	-0,34%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	51.885.231,46	0,00	0,00	50.912.036,46	-973.195,00	-1,88%	-1,88%
BRADESCO H NILO FI RENDA FIXA	110.404.223,35	0,00	0,00	108.969.125,73	-1.435.097,62	-1,30%	-1,30%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	173.389.365,68	0,00	0,00	170.443.143,40	-2.946.222,28	-1,70%	-1,70%

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 IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	67.568.195,97	0,00	0,00	63.895.632,92	-3.672.563,05	-5,44%	-5,44%
				Total Renda Fixa	7.711.206,30	0,73%	

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
REAG RENDA IMOBILIÁRIA FII - DOMC11	1.963.189,24	0,00	0,00	2.118.990,16	155.800,92	7,94%	-15,12%
WESTERN ASSET LONG & SHORT FI MULTIMERCADO	18.256.357,67	0,00	18.409.892,93	0,00	153.535,26	0,84%	-0,54%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	7.576.188,91	0,00	666.738,84	6.957.150,37	47.700,30	0,63%	-15,80%
LSH FIP	1.227.135,58	0,00	0,00	1.226.004,56	-1.131,02	-0,09%	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	2.119.099,90	32.177,73	0,00	2.124.367,38	-26.910,25	-1,25%	-
BRASIL ENERGIA RENOVÁVEL MULTISTRATÉGIA FIP	332.018,50	0,00	0,00	304.442,03	-27.576,47	-8,31%	-
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	5.282.927,92	0,00	0,00	5.232.107,43	-50.820,49	-0,96%	-
ITAÚ VISION INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	1.020.620,25	0,00	0,00	960.777,28	-59.842,97	-5,86%	-5,86%
XP LONG SHORT 60 FIC MULTIMERCADO	9.692.257,21	0,00	0,00	9.594.709,96	-97.547,25	-1,01%	-1,01%
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	606.790,98	0,00	0,00	318.101,79	-288.689,19	-47,58%	-47,58%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	5.909.831,29	0,00	0,00	4.674.979,67	-1.234.851,62	-20,89%	-20,89%
XP DIVIDENDOS FI AÇÕES	5.517.115,32	0,00	0,00	4.186.705,35	-1.330.409,97	-24,11%	-24,11%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	34.515.330,45	0,00	0,00	32.305.426,01	-2.209.904,44	-6,40%	-6,40%
XP DIVIDENDOS 30 FIC AÇÕES	9.348.964,54	0,00	0,00	7.090.949,20	-2.258.015,34	-24,15%	-24,15%
VINCI SELECTION EQUITIES FI AÇÕES	35.750.032,28	0,00	0,00	32.564.101,20	-3.185.931,08	-8,91%	-8,91%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	27.650.400,32	0,00	0,00	22.049.599,38	-5.600.800,94	-20,26%	-20,26%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	35.927.843,85	0,00	0,00	29.959.338,04	-5.968.505,81	-16,61%	-16,61%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	34.207.205,37	0,00	0,00	27.461.270,99	-6.745.934,38	-19,72%	-19,72%
VINCI MOSAICO FI AÇÕES	21.041.266,24	18.409.892,93	0,00	32.697.439,41	-6.753.719,76	-17,12%	-15,32%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	53.706.401,48	0,00	0,00	46.205.319,22	-7.501.082,26	-13,97%	-13,97%

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 (%)	(%) Instit
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	44.302.286,10	0,00	0,00	34.447.136,40	-9.855.149,70	-22,25%	-22,25%
				Total Renda Variável	-52.839.786,46	-14,11%	