

# 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			271.094.216,66	31,52%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	18/08/2020	7.077.335,00	0,82%	19	5,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2022	10.715.190,00	1,25%	17	12,91%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.957.874,33	0,23%	1.364	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+0	15/08/2022	16.719.612,34	1,94%	95	3,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	15.295.870,36	1,78%	622	0,38%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	10.719.825,00	1,25%	38	5,58%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	104.576.215,52	12,16%	763	0,86%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	10.526.774,10	1,22%	670	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	15.302.134,40	1,78%	1.262	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3 du	Não há	10.580.788,39	1,23%	186	1,36%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA L...	D+1	Não há	1.055.362,16	0,12%	30	1,69%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	63.756.485,32	7,41%	174	5,38%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	10.608.871,24	1,23%	91	2,45%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	23.454.953,46	2,73%	287	0,45%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	69.700.234,50	8,10%	119	8,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se ...	Não se aplica	26.826,80	0,00%		3,01%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	8.912.833,62	1,04%	12.843	1,11%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
OCCAM FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	10.860.056,74	1,26%	2.861	1,59%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	24.266.230,32	2,82%	556	6,29%	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
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	9.043.942,13	1,05%	6.693	0,78%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	14.511.883,56	1,69%	820	5,36%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	D+13	Não há	5.053.508,60	0,59%	108	5,07%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	D+3	Não há	6.744.733,76	0,78%	946	8,11%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	7.136.911,31	0,83%	107	1,35%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	9.752.409,38	1,13%	162	0,55%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	10.378.526,05	1,21%	49.451	0,32%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	D+4	Não há	2.458.244,26	0,29%	15.538	0,23%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
OCCAM FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	10.860.056,74	1,26%	2.861	1,59%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+29	Não há	1.890.008,05	0,22%	30	0,74%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	8.912.833,62	1,04%	12.843	1,11%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	D+5 du	Não há	2.002.875,71	0,23%	25	7,09%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	12.487.626,08	1,45%	20.627	0,52%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	13.939.166,59	1,62%	18.591	0,31%	Artigo 8º, Inciso III
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	22.742.189,10	2,64%	203	4,77%	Artigo 8º, Inciso III
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	6.126.826,94	0,71%	44	11,85%	Artigo 8º, Inciso III
AZ QUEST EQUITY HEDGE FIC MULTIMERCADO	D+6	Não há	8.051.935,60	0,94%	4.936	3,60%	Artigo 8º, Inciso III
MULTINVEST FORTUNA FI MULTIMERCADO	D+11	Não há	1.684.572,37	0,20%	165	5,65%	Artigo 8º, Inciso III
LA SHOPPING CENTERS MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	10.961.798,49	1,27%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	S/Info	Não se aplica	12.210.539,43	1,42%		25,28%	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
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	Não se ...	Não se aplica	3.655.554,17	0,43%		0,15%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII ...	Não se ...	Não se aplica	4.057.142,35	0,47%		3,27%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>860.064.890,64</b>				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			<b>422.378,31</b>				Artigo 6º
<b>PL Total</b>			<b>860.487.268,95</b>				

**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%	271.094.216,66	31,52%	0,00%	0,00%	40,00%	72.931.739,60
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	192.890.831,05	22,43%	20,00%	30,00%	90,00%	581.167.570,53
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	516.038.934,38
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	179.156.695,07	20,83%	10,00%	25,00%	40,00%	164.869.261,19
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	129.009.733,60
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	26.826,80	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	42.976.417,73
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	43.003.244,53
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	43.003.244,53
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>643.168.569,58</b>	<b>74,78%</b>	<b>30,00%</b>	<b>65,00%</b>	<b>260,00%</b>	

**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%	118.976.094,23	13,83%	7,00%	15,00%	20,00%	53.036.883,90
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	67.035.192,39	7,79%	7,00%	10,00%	10,00%	18.971.296,67
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	10.961.798,49	1,27%	0,00%	5,00%	5,00%	32.041.446,04
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	19.923.235,95	2,32%	0,00%	5,00%	5,00%	23.080.008,58
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>216.896.321,06</b>	<b>25,22%</b>	<b>14,00%</b>	<b>35,00%</b>	<b>40,00%</b>	

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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	271.094.216,66	31,52	-
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	161.473.232,52	18,77	0,03
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	133.456.719,82	15,52	0,02
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	117.436.474,72	13,65	0,01
ITAU UNIBANCO	59.497.673,36	6,92	0,00
AZ QUEST INVESTIMENTOS	27.898.719,40	3,24	0,10
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	17.264.048,03	2,01	3,91
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	14.511.883,56	1,69	1,02
LEGATUS ASSET MANAGEMENT	10.961.798,49	1,27	5,48
OCCAM BRASIL	10.860.056,74	1,26	0,15
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	9.408.626,98	1,09	0,01
INFINITY ASSET MANAGEMENT	7.182.189,10	0,84	1,43
VINCI PARTNERS	7.136.911,31	0,83	0,01
ZION INVEST	4.057.142,35	0,47	0,83
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	3.655.554,17	0,43	0,99
SUL AMERICA INVESTIMENTOS GEST...	2.458.244,26	0,29	0,01
MULTINVEST CAPITAL	1.684.572,37	0,20	0,45
BRASIL PLURAL	26.826,80	0,00	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 '	271.094.216,66	31,52	0,00	40,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	192.890.831,05	22,43	20,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	179.156.695,07	20,83	10,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	26.826,80	0,00	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 '	118.976.094,23	13,83	7,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	67.035.192,39	7,79	7,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	10.961.798,49	1,27	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	19.923.235,95	2,32	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
<b>CDI + 3,50% ao ano (Benchmark)</b>	0,50%	3,48%	1,58%	3,48%	8,24%	19,10%	-	-
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-5,42%	-42,97%	-11,22%	-42,97%	236,31%	-18,12%	0,04%	6,38%
<b>IMA-B 5+ (Benchmark)</b>	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%
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	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%
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	1,12%	3,17%	3,77%	3,17%	8,73%	24,75%	-	-
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%
BRANCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	1,09%	3,23%	3,84%	3,23%	8,75%	24,57%	0,01%	0,04%
<b>IMA-B (Benchmark)</b>	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%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	1,99%	-0,34%	5,20%	-0,34%	6,72%	38,42%	0,03%	0,09%
<b>IPCA (Benchmark)</b>	0,26%	0,10%	-0,43%	0,10%	2,12%	5,57%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,19%	3,40%	3,79%	3,40%	9,01%	27,95%	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
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,48%	0,69%	0,90%	0,69%	2,46%	6,65%	0,00%	0,04%
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,48%	0,73%	0,90%	0,73%	2,54%	6,80%	0,00%	0,04%
CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,47%	0,69%	0,88%	0,69%	2,44%	6,59%	0,00%	0,04%
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%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,95%	1,78%	3,13%	1,78%	6,24%	22,63%	0,01%	0,04%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,95%	-	2,88%	-	-	-	0,01%	-

**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
<b>IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)</b>	0,91%	3,93%	1,44%	3,93%	10,29%	23,06%	-	-
LA SHOPPING CENTERS MULTIESTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>IDIV (Benchmark)</b>	8,95%	-18,38%	18,70%	-18,38%	0,08%	47,52%	-	-
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	6,85%	-14,25%	25,30%	-14,25%	-0,72%	40,37%	0,11%	0,34%
<b>IBX (Benchmark)</b>	8,97%	-17,39%	30,39%	-17,39%	-4,94%	34,21%	-	-
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	7,50%	-21,02%	26,32%	-21,02%	-8,28%	26,59%	0,11%	0,37%
<b>Ibovespa (Benchmark)</b>	8,76%	-17,80%	30,18%	-17,80%	-6,20%	30,64%	-	-
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	10,27%	-8,33%	41,67%	-8,33%	8,82%	58,71%	0,10%	0,42%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	7,94%	-25,33%	30,81%	-25,33%	-8,45%	27,44%	0,14%	0,46%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	9,88%	-17,76%	33,78%	-17,76%	-3,83%	27,38%	0,12%	0,43%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	9,07%	-21,11%	27,93%	-21,11%	-8,75%	24,85%	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%
OCCAM FIC AÇÕES	8,97%	-13,29%	30,06%	-13,29%	3,73%	44,34%	0,11%	0,36%
ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES	11,47%	-14,65%	31,23%	-14,65%	0,85%	42,00%	0,11%	0,39%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	12,10%	-28,51%	33,61%	-28,51%	-13,13%	23,01%	0,15%	0,50%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	9,28%	-22,25%	27,83%	-22,25%	-4,41%	36,54%	0,13%	0,40%

**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
<b>SMLL (Benchmark)</b>	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%

<b>CDI (Benchmark)</b>	0,21%	1,75%	0,73%	1,75%	4,58%	11,21%	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,46%	0,93%	1,74%	0,93%	5,64%	14,07%	0,01%	0,02%
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%
AZ QUEST EQUITY HEDGE FIC MULTIMERCADO	-0,47%	-0,97%	-0,39%	-0,97%	3,77%	-	0,01%	0,04%
MULTINVEST FORTUNA FI MULTIMERCADO	2,48%	-1,54%	4,99%	-1,54%	3,65%	32,45%	0,03%	0,08%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	0,50%	-	1,17%	-	-	-	0,01%	-

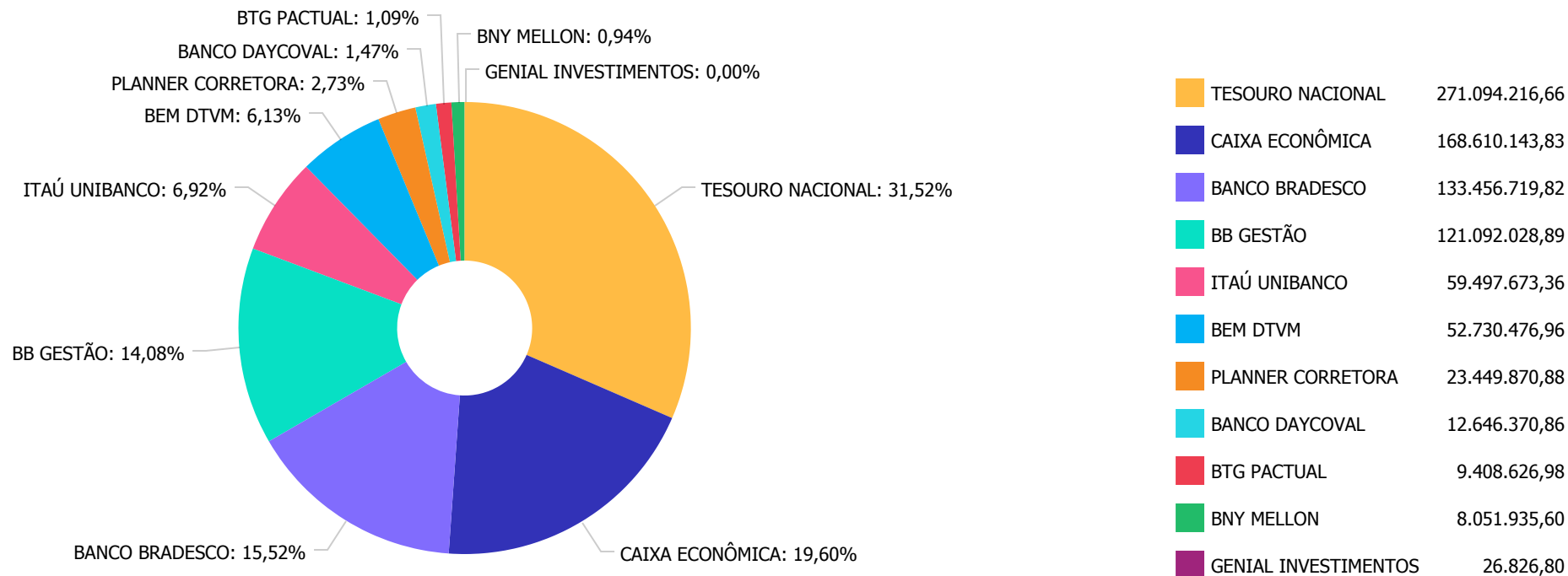
<b>Não Informado (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	9,33%	-15,92%	28,43%	-15,92%	5,63%	56,90%	0,12%	0,39%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	0,00%	-16,05%	2,33%	-16,05%	72,96%	-	-	-
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	-0,02%	-0,02%	-	-0,02%	-0,02%	-0,02%	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	2,90%	-44,96%	-33,65%	-44,96%	-60,34%	-71,02%	0,16%	0,44%

<b>Não definido (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8,54%	-20,90%	27,92%	-20,90%	-	-	0,13%	-

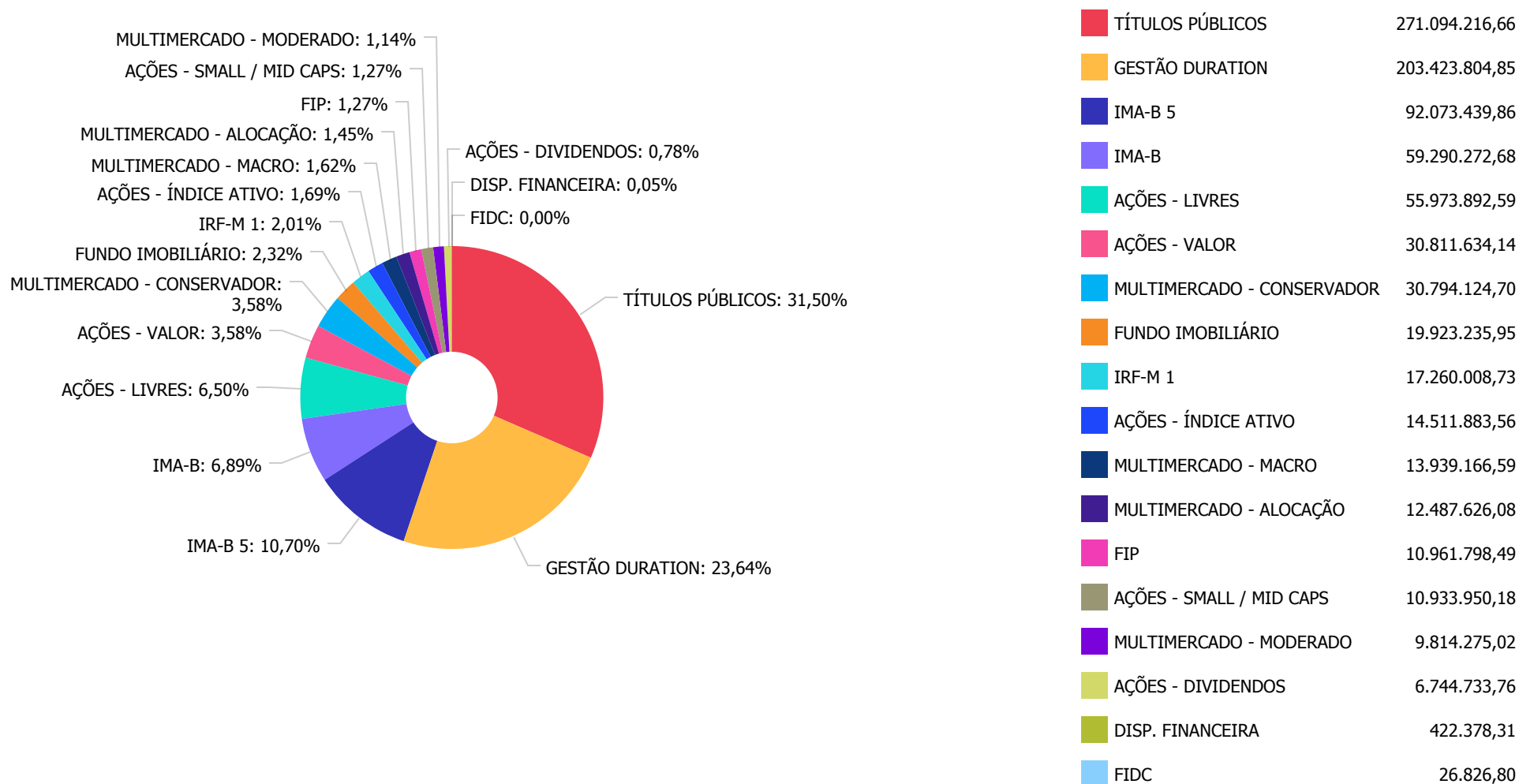
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2020 - RENDA VARIÁVEL

	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)



**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	10/11/2016	7.000	3.029,485123	3.504,547637	21.206.395,86	24.531.833,46	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2021	29/08/2016	10.000	2.967,972738	3.504,547637	29.679.727,38	35.045.476,37	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2021	12/09/2016	10.000	2.980,886631	3.504,547637	29.808.866,31	35.045.476,37	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2021	14/09/2016	10.000	2.971,010111	3.504,547637	29.710.101,11	35.045.476,37	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2022	27/07/2016	15.000	2.963,303079	3.741,427357	44.449.546,19	56.121.410,36	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2022	04/08/2016	13.000	2.979,58205	3.741,427357	38.734.566,65	48.638.555,64	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2022	30/06/2016	9.800	2.911,042410	3.741,427357	28.528.215,62	36.665.988,10	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	841.489.656,98	13.395.744,39	6.459.719,31	852.633.893,16	4.208.211,10	4.208.211,10	0,50%	0,50%	0,71%	0,71%	69,91%	2,65%
Fevereiro	852.633.893,16	11.921.667,01	6.935.221,48	850.771.448,94	-6.848.889,75	-2.640.678,65	-0,80%	-0,31%	0,66%	1,37%	-22,33%	4,32%
Março	850.771.448,94	38.112.919,70	35.151.693,77	804.973.430,50	-48.759.244,37	-51.399.923,02	-5,71%	-6,00%	0,57%	1,95%	-307,82%	16,17%
Abril	804.973.430,50	16.539.414,86	13.950.000,00	819.399.665,71	11.836.820,35	-39.563.102,67	1,47%	-4,62%	0,14%	2,09%	-220,79%	7,77%
Mai	819.399.665,71	8.071.421,48	5.582.125,70	839.558.121,50	17.669.160,01	-21.893.942,66	2,15%	-2,57%	0,07%	2,17%	-118,73%	4,37%
Junho	839.558.121,50	17.507.238,30	15.022.817,54	860.064.890,64	18.022.348,38	-3.871.594,28	2,14%	-0,49%	0,74%	2,92%	-16,68%	3,59%

**Investimentos x Meta Atuarial**





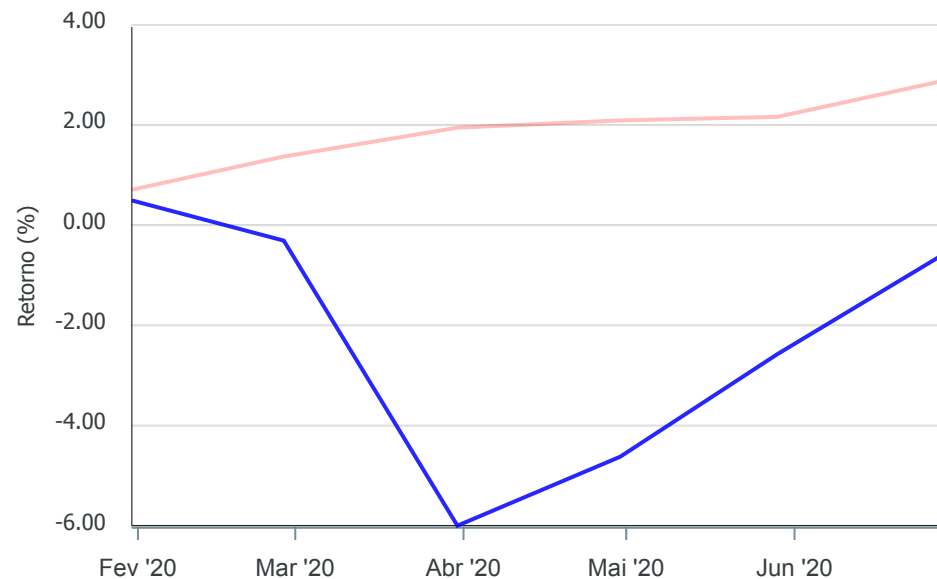
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	10.401.517,57	0,00	0,00	10.608.871,24	207.353,67	1,99%	1,99%	3,03%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	20.730.077,81	0,00	10.539.103,62	10.526.774,10	335.799,91	1,62%	2,02%	2,98%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENC...	16.523.427,89	0,00	0,00	16.719.612,34	196.184,45	1,19%	1,19%	0,85%
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	1.043.544,41	0,00	0,00	1.055.362,16	11.817,75	1,13%	1,13%	3,03%
BRDESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	68.948.316,00	0,00	0,00	69.700.234,50	751.918,50	1,09%	1,09%	0,94%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	15.133.072,86	0,00	0,00	15.295.870,36	162.797,50	1,08%	1,08%	0,89%
TÍTULOS PÚBLICOS	268.252.857,40	0,00	0,00	271.094.216,66	2.841.359,26	1,06%	-	-
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	62.740.480,99	415.911,74	0,00	63.756.485,32	600.092,59	0,95%	0,95%	1,28%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	101.949.916,33	3.828.983,30	1.978.000,00	104.576.215,52	775.315,89	0,73%	0,75%	1,17%
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.043.715,00	0,00	0,00	7.077.335,00	33.620,00	0,48%	0,48%	0,15%
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	10.669.012,50	0,00	0,00	10.719.825,00	50.812,50	0,48%	0,48%	0,15%
CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.665.090,00	0,00	0,00	10.715.190,00	50.100,00	0,47%	0,47%	0,15%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	23.353.172,08	0,00	0,00	23.454.953,46	101.781,38	0,44%	0,44%	0,38%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	0,00	10.539.103,62	0,00	10.580.788,39	41.684,77	0,40%	0,95%	1,34%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	15.243.983,83	19.000,00	0,00	15.302.134,40	39.150,57	0,26%	0,26%	0,05%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.754.351,58	704.239,64	505.713,92	1.957.874,33	4.997,03	0,20%	0,26%	0,05%
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	28.363,00	0,00	0,00	26.826,80	-1.536,20	-5,42%	-5,42%	3,91%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>634.480.899,25</b>	<b>15.507.238,30</b>	<b>13.022.817,54</b>	<b>643.168.569,58</b>	<b>6.203.249,57</b>	<b>0,97%</b>		<b>1,06%</b>

**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	8.699.890,48	0,00	0,00	9.752.409,38	1.052.518,90	12,10%	12,10%	14,62%
ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES	4.757.445,51	0,00	0,00	5.302.913,23	545.467,72	11,47%	11,47%	10,81%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.415.756,60	0,00	0,00	2.663.893,22	248.136,62	10,27%	10,27%	10,27%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	8.111.669,01	0,00	0,00	8.912.833,62	801.164,61	9,88%	9,88%	11,74%
LA SHOPPING CENTERS MULTISTRATÉGIA FIP	9.995.387,64	0,00	0,00	10.961.798,49	966.410,85	9,67%	-	-
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	6.527.813,41	0,00	0,00	7.136.911,31	609.097,90	9,33%	9,33%	12,08%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	9.497.183,33	0,00	0,00	10.378.526,05	881.342,72	9,28%	9,28%	13,00%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	22.248.029,28	0,00	0,00	24.266.230,32	2.018.201,04	9,07%	9,07%	12,25%
OCCAM FIC AÇÕES	9.966.026,23	0,00	0,00	10.860.056,74	894.030,51	8,97%	8,97%	11,12%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	13.358.457,02	0,00	0,00	14.511.883,56	1.153.426,54	8,63%	8,63%	12,10%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	8.325.128,11	0,00	0,00	9.043.942,13	718.814,02	8,63%	8,63%	12,99%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.741.322,05	0,00	0,00	1.890.008,05	148.686,00	8,54%	8,54%	12,93%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	2.277.413,59	0,00	0,00	2.458.244,26	180.830,67	7,94%	7,94%	13,71%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	4.701.057,20	0,00	0,00	5.053.508,60	352.451,40	7,50%	7,50%	11,44%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	6.312.130,17	0,00	0,00	6.744.733,76	432.603,59	6,85%	6,85%	11,01%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	3.942.856,65	0,00	0,00	4.057.142,35	114.285,70	2,90%	2,90%	16,11%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	12.171.177,94	0,00	0,00	12.487.626,08	316.448,14	2,60%	2,60%	3,49%
MULTINVEST FORTUNA FI MULTIMERCADO	1.643.825,29	0,00	0,00	1.684.572,37	40.747,08	2,48%	2,48%	2,94%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	13.766.666,09	0,00	0,00	13.939.166,59	172.500,50	1,25%	1,25%	1,24%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	6.073.304,33	0,00	0,00	6.126.826,94	53.522,61	0,88%	0,88%	1,73%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Junho/2020

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	24.623.932,20	0,00	2.000.000,00	22.742.189,10	118.256,90	0,48%	0,46%	0,86%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	12.175.288,82	0,00	0,00	12.210.539,43	35.250,61	0,29%	0,00%	-
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	0,00	2.000.000,00	0,00	2.002.875,71	2.875,71	0,14%	0,50%	0,53%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	3.655.319,56	0,00	0,00	3.655.554,17	234,61	0,01%	-0,02%	-
AZ QUEST EQUITY HEDGE FIC MULTIMERCADO	8.090.141,74	0,00	0,00	8.051.935,60	-38.206,14	-0,47%	-0,47%	0,84%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>205.077.222,25</b>	<b>2.000.000,00</b>	<b>2.000.000,00</b>	<b>216.896.321,06</b>	<b>11.819.098,81</b>	<b>5,71%</b>		<b>8,54%</b>

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
TÍTULOS PÚBLICOS	266.901.741,09	0,00	3.612.125,70	271.094.216,66	7.804.601,27	2,92%	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	93.885.126,70	15.340.098,36	7.873.000,00	104.576.215,52	3.223.990,46	2,95%	3,27%
BRASESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	67.120.972,11	0,00	0,00	69.700.234,50	2.579.262,39	3,84%	3,84%
BRASESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	60.589.954,26	1.244.267,54	0,00	63.756.485,32	1.922.263,52	3,11%	3,13%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	20.161.708,00	0,00	10.539.103,62	10.526.774,10	904.169,72	4,48%	4,90%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENC...	16.109.236,47	0,00	0,00	16.719.612,34	610.375,87	3,79%	3,79%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	0,00	10.000.000,00	0,00	10.608.871,24	608.871,24	6,09%	5,20%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	14.748.910,17	0,00	0,00	15.295.870,36	546.960,19	3,71%	3,71%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	33.198.066,23	0,00	10.000.000,00	23.454.953,46	256.887,23	0,77%	1,12%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	15.064.408,62	77.500,00	0,00	15.302.134,40	160.225,78	1,06%	1,06%
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	10.624.237,50	0,00	0,00	10.719.825,00	95.587,50	0,90%	0,90%
CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.621.650,00	0,00	0,00	10.715.190,00	93.540,00	0,88%	0,88%
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.013.990,00	0,00	0,00	7.077.335,00	63.345,00	0,90%	0,90%
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	997.858,74	0,00	0,00	1.055.362,16	57.503,42	5,76%	5,76%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	0,00	10.539.103,62	0,00	10.580.788,39	41.684,77	0,40%	2,88%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.552.396,46	917.105,12	530.713,92	1.957.874,33	19.086,67	0,77%	1,09%
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	30.215,42	0,00	0,00	26.826,80	-3.388,62	-11,21%	-11,21%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>18.984.966,41</b>	<b>3,04%</b>	

**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 AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	18.968.017,39	0,00	0,00	24.266.230,32	5.298.212,93	27,93%	27,93%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	11.372.833,22	0,00	0,00	14.511.883,56	3.139.050,34	27,60%	27,57%
OCCAM FIC AÇÕES	8.350.129,22	0,00	0,00	10.860.056,74	2.509.927,52	30,06%	30,06%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	7.299.086,72	0,00	0,00	9.752.409,38	2.453.322,66	33,61%	33,61%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	8.118.763,53	0,00	0,00	10.378.526,05	2.259.762,52	27,83%	27,83%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	6.662.299,46	0,00	0,00	8.912.833,62	2.250.534,16	33,78%	33,78%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	7.065.128,40	0,00	0,00	9.043.942,13	1.978.813,73	28,01%	28,01%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	5.556.956,72	0,00	0,00	7.136.911,31	1.579.954,59	28,43%	28,43%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	5.382.697,15	0,00	0,00	6.744.733,76	1.362.036,61	25,30%	25,30%
ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES	4.040.851,13	0,00	0,00	5.302.913,23	1.262.062,10	31,23%	31,23%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	4.000.445,53	0,00	0,00	5.053.508,60	1.053.063,07	26,32%	26,32%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	11.485.903,57	0,00	0,00	12.487.626,08	1.001.722,51	8,72%	8,72%
LA SHOPPING CENTERS MULTISTRATÉGIA FIP	10.021.011,29	0,00	0,00	10.961.798,49	940.787,20	9,39%	-
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.880.387,90	0,00	0,00	2.663.893,22	783.505,32	41,67%	41,67%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	13.224.828,04	0,00	0,00	13.939.166,59	714.338,55	5,40%	5,40%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	0,00	2.000.000,00	0,00	2.458.244,26	458.244,26	22,91%	30,81%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	24.314.857,79	0,00	2.000.000,00	22.742.189,10	427.331,31	1,76%	1,74%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	1.477.522,01	0,00	0,00	1.890.008,05	412.486,04	27,92%	27,92%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	11.899.875,96	0,00	0,00	12.210.539,43	310.663,47	2,61%	2,33%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	5.869.897,03	0,00	0,00	6.126.826,94	256.929,91	4,38%	4,38%

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 RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	3.559.108,79	0,00	0,00	3.655.554,17	96.445,38	2,71%	-
MULTINVEST FORTUNA FI MULTIMERCADO	1.604.530,81	0,00	0,00	1.684.572,37	80.041,56	4,99%	4,99%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	0,00	2.000.000,00	0,00	2.002.875,71	2.875,71	0,14%	1,17%
AZ QUEST EQUITY HEDGE FIC MULTIMERCADO	8.083.542,12	0,00	0,00	8.051.935,60	-31.606,52	-0,39%	-0,39%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	6.114.284,95	0,00	0,00	4.057.142,35	-2.057.142,60	-33,64%	-33,64%
				<b>Total Renda Variável</b>	<b>28.543.362,33</b>	<b>15,15%</b>	

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
TÍTULOS PÚBLICOS	271.095.431,13	0,00	7.302.012,28	271.094.216,66	7.300.797,81	2,69%	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	89.498.969,36	39.247.909,91	28.619.000,00	104.576.215,52	4.448.336,25	3,46%	4,63%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	59.750.382,01	7.794.693,77	0,00	69.700.234,50	2.155.158,72	3,19%	3,23%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	60.337.484,70	2.308.930,45	0,00	63.756.485,32	1.110.070,17	1,77%	1,78%
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	32.826.747,00	0,00	10.000.000,00	23.454.953,46	628.206,46	1,91%	2,27%
ITAU IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	0,00	10.000.000,00	0,00	10.608.871,24	608.871,24	6,09%	-0,34%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENC...	16.586.403,95	0,00	420.721,50	16.719.612,34	553.929,89	3,34%	3,40%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	24.751.362,97	77.500,00	10.000.000,00	15.302.134,40	473.271,43	1,91%	2,45%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	14.388.480,91	454.721,50	0,00	15.295.870,36	452.667,95	3,05%	3,08%
CAIXA BRASIL 2024 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	10.646.317,50	0,00	299.493,37	10.719.825,00	373.000,87	3,50%	0,69%
CAIXA BRASIL 2022 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	10.642.252,50	0,00	295.736,07	10.715.190,00	368.673,57	3,46%	0,69%
CAIXA BRASIL 2020 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.025.885,00	0,00	195.213,36	7.077.335,00	246.663,36	3,51%	0,73%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	7.706.819,39	0,00	7.794.693,77	0,00	87.874,38	1,14%	2,44%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	0,00	10.539.103,62	0,00	10.580.788,39	41.684,77	0,40%	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	274.426,69	2.667.659,91	1.012.713,92	1.957.874,33	28.501,65	0,97%	2,48%
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	47.036,11	0,00	22.252,29	26.826,80	2.042,98	4,34%	-42,97%
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	1.065.397,39	0,00	0,00	1.055.362,16	-10.035,23	-0,94%	-0,94%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	16.164.707,53	5.068.000,00	10.539.103,62	10.526.774,10	-166.829,81	-0,79%	-1,75%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>18.702.886,46</b>	<b>3,00%</b>	



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
LA SHOPPING CENTERS MULTISTRATÉGIA FIP	10.065.132,71	0,00	0,00	10.961.798,49	896.665,78	8,91%	-
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,00	2.000.000,00	0,00	2.663.893,22	663.893,22	33,19%	-8,33%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	0,00	2.000.000,00	0,00	2.458.244,26	458.244,26	22,91%	-25,33%
ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES	0,00	5.000.000,00	0,00	5.302.913,23	302.913,23	6,06%	-14,65%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	24.509.840,23	0,00	2.000.000,00	22.742.189,10	232.348,87	0,95%	0,93%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	12.088.416,08	0,00	0,00	12.210.539,43	122.123,35	1,01%	-16,05%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	6.028.035,50	0,00	0,00	6.126.826,94	98.791,44	1,64%	1,64%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MUL...	4.518.296,99	0,00	4.532.637,62	0,00	14.340,63	0,32%	-
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	3.716.168,31	0,00	68.000,00	3.655.554,17	7.385,86	0,20%	-0,02%
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	0,00	2.000.000,00	0,00	2.002.875,71	2.875,71	0,14%	-
MULTINVEST FORTUNA FI MULTIMERCADO	0,00	1.700.000,00	0,00	1.684.572,37	-15.427,63	-0,91%	-1,54%
AZ QUEST EQUITY HEDGE FIC MULTIMERCADO	8.130.960,42	0,00	0,00	8.051.935,60	-79.024,82	-0,97%	-0,97%
AZ QUEST SMALL MID CAPS INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,00	2.000.000,00	0,00	1.890.008,05	-109.991,95	-5,50%	-20,89%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	14.084.479,30	0,00	0,00	13.939.166,59	-145.312,71	-1,03%	-1,03%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	3.255.421,51	2.000.000,00	0,00	5.053.508,60	-201.912,91	-3,84%	-21,02%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	12.887.559,75	0,00	0,00	12.487.626,08	-399.933,67	-3,10%	-3,10%
BTG PACTUAL DIVIDENDOS FIC AÇÕES	7.865.245,12	0,00	0,00	6.744.733,76	-1.120.511,36	-14,25%	-14,25%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	8.488.222,69	0,00	0,00	7.136.911,31	-1.351.311,38	-15,92%	-15,92%
OCCAM FIC AÇÕES	8.925.404,91	3.689.886,58	0,00	10.860.056,74	-1.755.234,75	-13,91%	-13,29%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	10.837.979,77	0,00	0,00	8.912.833,62	-1.925.146,15	-17,76%	-17,76%

**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
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	11.341.186,57	0,00	0,00	9.043.942,13	-2.297.244,44	-20,26%	-20,26%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	21.977.080,73	5.000.000,00	0,00	24.266.230,32	-2.710.850,41	-10,05%	-21,10%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	13.347.769,31	0,00	0,00	10.378.526,05	-2.969.243,26	-22,25%	-22,25%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	15.601.055,09	2.000.000,00	0,00	14.511.883,56	-3.089.171,53	-17,55%	-19,72%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	7.371.427,65	0,00	0,00	4.057.142,35	-3.314.285,30	-44,96%	-44,96%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	13.641.870,20	0,00	0,00	9.752.409,38	-3.889.460,82	-28,51%	-28,51%
<b>Total Renda Variável</b>					<b>-22.574.480,74</b>	<b>-9,43%</b>	