

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
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	27.288.115,85	3,95%	13.023	1,75%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	D+4	Não há	4.801.708,18	0,69%	23.108	1,30%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	12.307.403,03	1,78%	36.952	1,15%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	18.745.623,19	2,71%	9.851	2,09%	Artigo 8º, Inciso III
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE...	Não se ...	Não se aplica	9.637,88	0,00%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	91.389,80	0,01%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	S/Info	Não se aplica	998.008,86	0,14%		2,07%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se ...	Não se aplica	1.078.049,94	0,16%		2,20%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO...	D+5	Não há	1.010.421,15	0,15%	2.438	0,33%	Artigo 9º - A, Inciso II
SANTANDER GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERI...	D+8 du	Não há	8.962.881,16	1,30%	538	2,36%	Artigo 9º - A, Inciso II
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	20.464.194,08	2,96%	23.961	2,22%	Artigo 9º - A, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			691.051.160,58				

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%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	691.051.160,58
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	310.252.466,90	44,90%	10,00%	40,95%	100,00%	380.798.693,68
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	691.051.160,58
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	34.552.558,03
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	414.630.696,35
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	414.630.696,35
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	197.756.819,29	28,62%	0,00%	23,00%	40,00%	78.663.644,94
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	276.420.464,23
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	138.210.232,12
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	103.657.674,09
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	103.657.674,09
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	15.640,77	0,00%	0,00%	0,05%	5,00%	34.536.917,26
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	9.422.838,37	1,36%	0,00%	1,00%	5,00%	25.129.719,66
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	34.552.558,03
Total Renda Fixa	100,00%	517.447.765,33	74,88%	10,00%	65,00%	570,00%	

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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	30,00%	17.483.302,58	2,53%	0,00%	4,00%	30,00%	189.832.045,59
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	207.315.348,17
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	104.759.886,61	15,16%	2,00%	20,00%	20,00%	33.450.345,51
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	138.210.232,12
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	18.745.623,19	2,71%	0,00%	4,00%	10,00%	50.359.492,87
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	101.027,68	0,01%	0,00%	1,00%	5,00%	34.451.530,35
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	2.076.058,80	0,30%	0,00%	1,00%	5,00%	32.476.499,23
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	34.552.558,03
Total Renda Variável	30,00%	143.165.898,86	20,72%	2,00%	30,00%	125,00%	

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%	10,00%	69.105.116,06
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	9.973.302,31	1,44%	0,00%	2,00%	10,00%	59.131.813,75
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	20.464.194,08	2,96%	0,00%	3,00%	10,00%	48.640.921,98
Total Exterior	10,00%	30.437.496,39	4,40%	0,00%	5,00%	30,00%	

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
CDI + 3,50% ao ano (Benchmark)	0,50%	3,48%	1,58%	3,48%	8,24%	19,10%	-	-
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	13,78%	-19,52%	-24,79%	-19,52%	-39,59%	-51,90%	-	-
IRF-M 1+ (Benchmark)	1,04%	6,03%	4,53%	6,03%	11,57%	33,23%	-	-
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	1,32%	6,30%	5,26%	6,30%	12,47%	40,81%	0,03%	0,04%
IMA-B 5+ (Benchmark)	2,84%	-5,26%	5,99%	-5,26%	1,68%	43,55%	-	-
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	2,75%	-5,91%	5,83%	-5,91%	1,12%	41,71%	0,05%	0,15%
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%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,28%	2,60%	1,15%	2,60%	5,98%	13,67%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,26%	2,45%	1,06%	2,45%	5,71%	13,15%	0,00%	0,00%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,26%	2,48%	1,09%	2,48%	5,78%	13,28%	0,00%	0,00%
110% do CDI (Benchmark)	0,23%	1,93%	0,81%	1,93%	5,05%	12,40%	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	-	-	-	-	-	-	-	-
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%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	2,09%	-1,70%	5,16%	-1,70%	4,85%	35,14%	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
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	2,37%	-0,04%	6,42%	-0,04%	7,01%	43,94%	0,04%	0,11%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,13%	2,90%	3,75%	2,90%	8,41%	26,50%	0,01%	0,04%
IPCA (Benchmark)	0,26%	0,10%	-0,43%	0,10%	2,12%	5,57%	-	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,98%	2,68%	3,62%	2,68%	7,94%	24,05%	0,01%	0,04%
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)	-	-	-	-	-	-	-	-
WESTERN ASSET ATIVO MAX FI RENDA FIXA	0,97%	6,40%	4,76%	6,40%	10,76%	27,49%	0,02%	0,04%

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%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA 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%
IBX-50 (Benchmark)	9,33%	-17,76%	31,79%	-17,76%	-7,36%	27,59%	-	-
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	9,45%	-18,44%	31,25%	-18,44%	-6,86%	25,17%	0,13%	0,39%
IMOB (Benchmark)	18,56%	-29,78%	28,75%	-29,78%	-2,83%	59,13%	-	-
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	18,35%	-30,02%	28,41%	-30,02%	-4,63%	56,94%	0,22%	0,53%
ICON (Benchmark)	10,08%	-10,90%	39,45%	-10,90%	13,72%	52,93%	-	-
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	9,80%	-11,31%	38,68%	-11,31%	14,47%	49,71%	0,11%	0,43%
IDIV (Benchmark)	8,95%	-18,38%	18,70%	-18,38%	0,08%	47,52%	-	-
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	7,89%	-20,06%	21,11%	-20,06%	-6,28%	44,97%	0,11%	0,35%
Ibovespa (Benchmark)	8,76%	-17,80%	30,18%	-17,80%	-6,20%	30,64%	-	-
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	7,71%	-22,03%	29,43%	-22,03%	-9,48%	24,10%	0,12%	0,41%

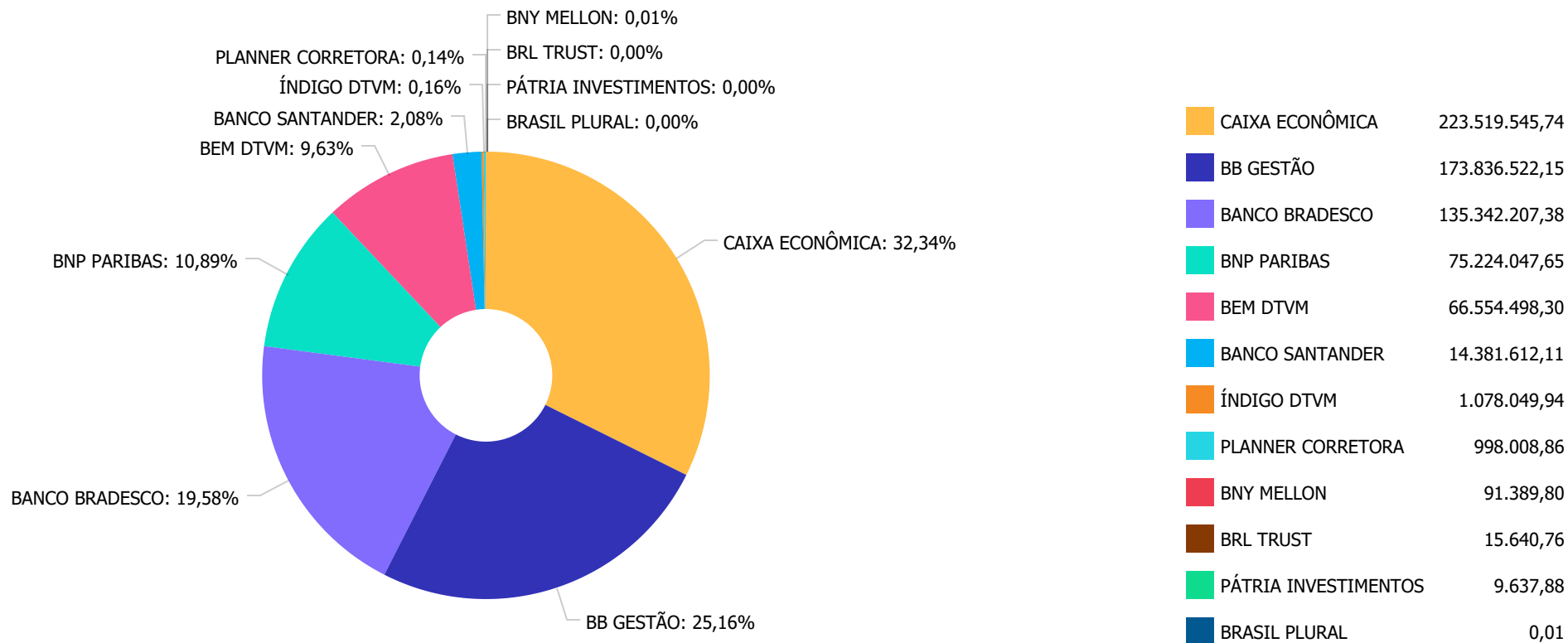
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	9,88%	-17,76%	33,78%	-17,76%	-3,83%	27,38%	0,12%	0,43%
SMLL (Benchmark)	14,43%	-20,73%	32,49%	-20,73%	5,76%	49,01%	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	12,89%	-21,45%	31,67%	-21,45%	3,57%	42,14%	0,16%	0,45%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	38,49%	38,89%	38,49%	38,89%	4,17%	23,45%	0,63%	0,45%
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	-99,55%	-	-	-	-99,73%	-	-	-
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	0,00%	-16,05%	2,33%	-16,05%	72,96%	-	-	-
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	6,53%	-18,67%	23,92%	-18,67%	5,27%	45,78%	0,10%	0,37%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	9,24%	-13,61%	35,90%	-13,61%	2,99%	48,24%	0,11%	0,42%

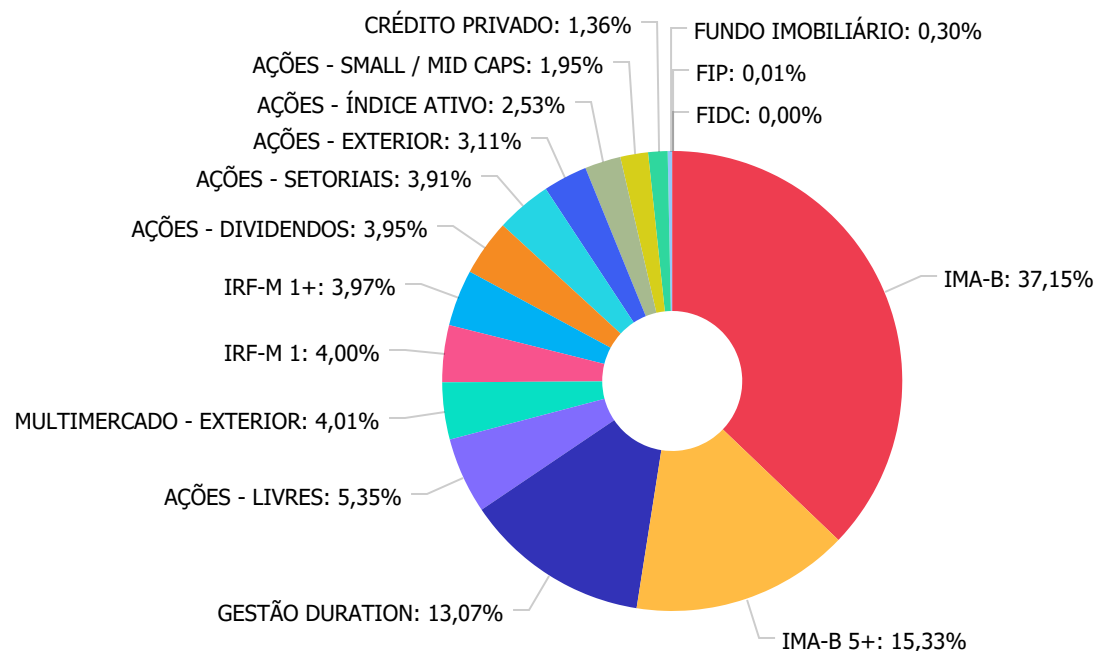
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2020 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	4,50%	32,44%	25,08%	32,44%	52,91%	68,50%	-	-
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	4,31%	40,57%	30,39%	40,57%	61,27%	80,05%	0,11%	0,21%
CDI (Benchmark)	0,21%	1,75%	0,73%	1,75%	4,58%	11,21%	-	-
SANTANDER GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCAD...	4,43%	35,38%	27,56%	35,38%	51,38%	54,43%	0,12%	0,20%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕ...	7,69%	51,88%	33,90%	51,88%	-	-	0,15%	-

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



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

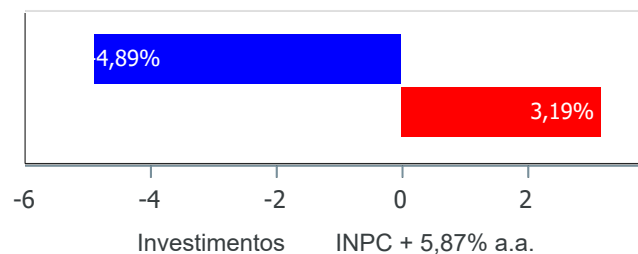


IMA-B	256.705.797,43
IMA-B 5+	105.938.024,29
GESTÃO DURATION	90.299.444,69
AÇÕES - LIVRES	36.996.272,56
MULTIMERCADO - EXTERIOR	27.708.504,35
IRF-M 1	27.655.217,10
IRF-M 1+	27.410.802,68
AÇÕES - DIVIDENDOS	27.288.115,85
AÇÕES - SETORIAIS	27.008.739,31
AÇÕES - EXTERIOR	21.474.615,23
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	17.483.302,58
AÇÕES - SMALL / MID CAPS	13.466.758,89
CRÉDITO PRIVADO	9.422.838,37
FUNDO IMOBILIÁRIO	2.076.058,80
FIP	101.027,68
FIDC	15.640,77

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

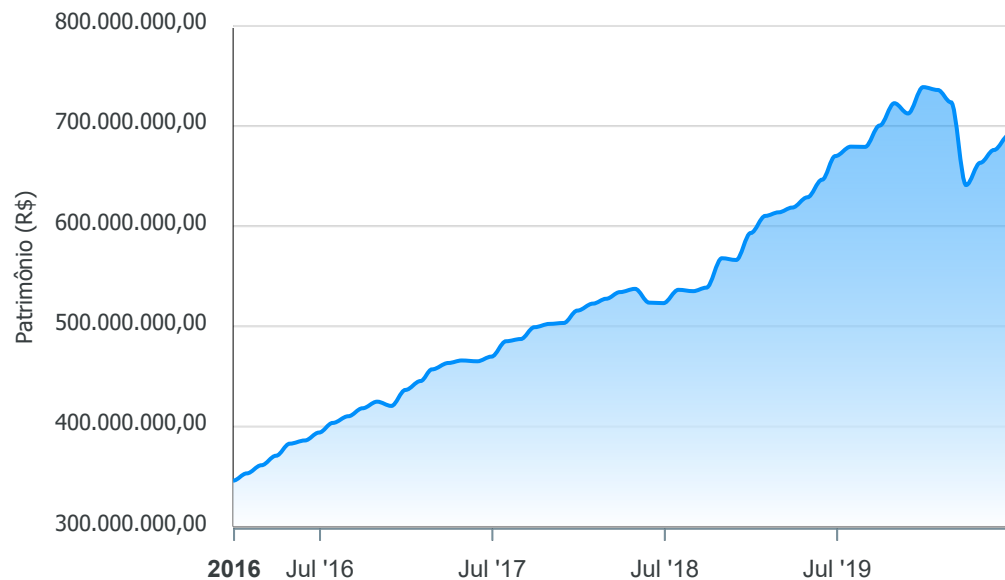
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	738.948.979,87	43.219.308,10	49.983.272,64	736.089.095,98	3.904.080,65	3.904.080,65	0,53%	0,53%	0,69%	0,69%	76,55%	3,62%
Fevereiro	736.089.095,98	8.085.665,26	7.963.323,56	723.797.162,06	-12.414.275,62	-8.510.194,97	-1,69%	-1,17%	0,58%	1,27%	-91,65%	5,75%
Março	723.797.162,06	10.150.834,34	8.531.768,26	641.154.532,77	-84.261.695,37	-92.771.890,34	-11,62%	-12,65%	0,68%	1,96%	-644,62%	24,39%
Abril	641.154.532,77	23.706.289,22	22.986.242,51	663.408.450,64	21.533.871,16	-71.238.019,18	3,35%	-9,72%	0,22%	2,19%	-443,88%	12,30%
Mai	663.408.450,64	59.719.928,86	63.565.028,56	676.172.154,28	16.608.803,34	-54.629.215,84	2,50%	-7,46%	0,20%	2,40%	-311,18%	6,15%
Junho	676.172.154,28	6.277.187,29	10.112.884,72	691.051.160,58	18.714.703,73	-35.914.512,11	2,77%	-4,89%	0,78%	3,19%	-153,31%	5,33%

Investimentos x Meta Atuarial



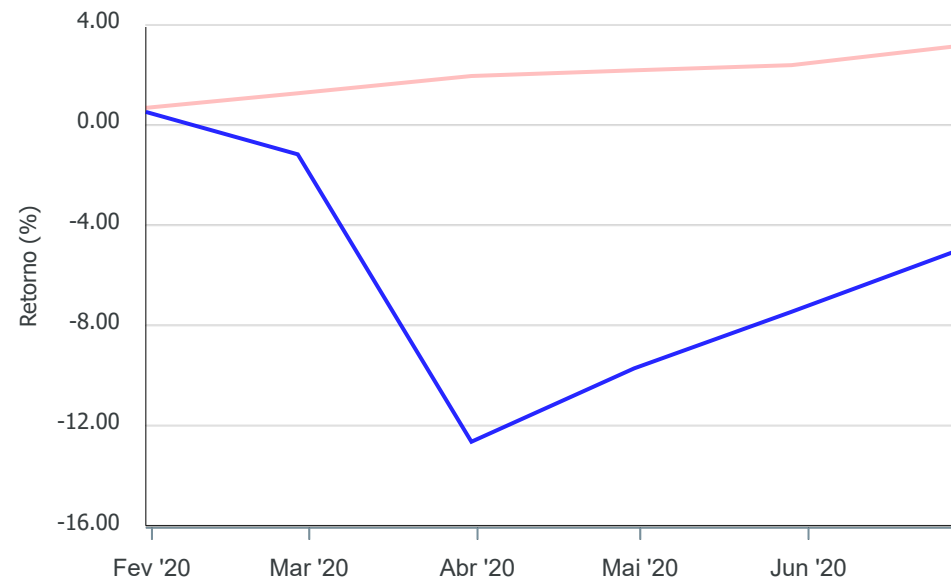
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	13.746,09	0,00	0,00	15.640,76	1.894,67	13,78%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	69.884.518,15	0,00	0,00	71.860.322,65	1.975.804,50	2,83%	2,83%	4,98%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	35.137.378,27	0,00	2.000.000,00	34.077.701,64	940.323,37	2,68%	2,75%	4,98%
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	20.531.576,65	0,00	0,00	21.019.021,12	487.444,47	2,37%	2,37%	3,80%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	99.193.507,45	0,00	0,00	101.264.505,74	2.070.998,29	2,09%	2,09%	3,04%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	124.962.330,07	0,00	0,00	127.486.004,38	2.523.674,31	2,02%	2,02%	2,98%
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	27.053.405,03	0,00	0,00	27.410.802,68	357.397,65	1,32%	1,32%	2,66%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.858.659,17	0,00	0,00	6.936.266,19	77.607,02	1,13%	1,13%	0,94%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	9.331.671,07	0,00	0,00	9.422.838,37	91.167,30	0,98%	0,98%	0,82%
WESTERN ASSET ATIVO MAX FI RENDA FIXA	12.828.279,43	1.027.936,56	0,00	13.984.788,11	128.572,12	0,93%	0,97%	2,04%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	75.746.849,97	0,00	0,00	76.314.656,58	567.806,61	0,75%	0,75%	1,17%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	48.886,74	0,00	0,00	49.012,24	125,50	0,26%	0,26%	0,05%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	31.385.925,80	4.249.250,73	8.112.884,72	27.606.204,86	83.913,05	0,24%	0,26%	0,05%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
Total Renda Fixa	512.976.733,90	5.277.187,29	10.112.884,72	517.447.765,33	9.306.728,86	1,80%		2,90%

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 CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	4.057.275,56	0,00	0,00	4.801.708,18	744.432,62	18,35%	18,35%	22,44%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	11.928.750,52	0,00	0,00	13.466.758,89	1.538.008,37	12,89%	12,89%	16,18%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	10.789.895,01	0,00	0,00	11.855.579,77	1.065.684,76	9,88%	9,88%	11,74%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	20.224.424,23	0,00	0,00	22.207.031,13	1.982.606,90	9,80%	9,80%	11,28%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	11.022.470,32	0,00	0,00	12.064.571,63	1.042.101,31	9,45%	9,45%	13,11%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	11.747.592,84	0,00	0,00	12.833.289,76	1.085.696,92	9,24%	9,24%	10,72%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	25.292.132,85	0,00	0,00	27.288.115,85	1.995.983,00	7,89%	7,89%	11,50%
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	5.031.096,09	0,00	0,00	5.418.730,95	387.634,86	7,70%	7,70%	11,80%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	11.553.344,82	0,00	0,00	12.307.403,03	754.058,21	6,53%	6,53%	10,47%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	18.588.192,90	0,00	0,00	18.745.623,19	157.430,29	0,85%	0,85%	12,81%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	995.127,71	0,00	0,00	998.008,86	2.881,15	0,29%	0,00%	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	1.079.723,56	0,00	0,00	1.078.049,94	-1.673,62	-0,16%	38,49%	63,32%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	550.794,74	0,00	0,00	91.389,80	-459.404,94	-83,41%	-	-
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE F...	2.132.273,49	0,00	0,00	9.637,88	-2.122.635,61	-99,55%	-	-
Total Renda Variável	134.993.094,64	0,00	0,00	143.165.898,86	8.172.804,22	6,05%		12,85%

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
SANTANDER GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	8.582.922,04	0,00	0,00	8.962.881,16	379.959,12	4,43%	4,43%	11,82%
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	19.619.403,70	0,00	0,00	20.464.194,08	844.790,38	4,31%	4,31%	11,23%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO E...	0,00	1.000.000,00	0,00	1.010.421,15	10.421,15	1,04%	7,69%	14,88%
Total Renda Variável	28.202.325,74	1.000.000,00	0,00	30.437.496,39	1.235.170,65	4,23%		11,53%

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
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	121.536.157,88	0,00	0,00	127.486.004,38	5.949.846,50	4,90%	4,90%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	120.863.314,71	0,00	25.000.000,00	101.264.505,74	5.401.191,03	4,47%	5,16%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	94.282.418,29	0,00	27.000.000,00	71.860.322,65	4.577.904,36	4,86%	5,88%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	49.260.539,90	25.000.000,00	0,00	76.314.656,58	2.054.116,68	2,77%	3,27%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	38.046.578,88	0,00	6.000.000,00	34.077.701,64	2.031.122,76	5,34%	5,83%
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	26.040.213,68	0,00	0,00	27.410.802,68	1.370.589,00	5,26%	5,26%
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	19.751.748,50	0,00	0,00	21.019.021,12	1.267.272,62	6,42%	6,42%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	9.094.081,22	0,00	0,00	9.422.838,37	328.757,15	3,62%	3,62%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	12.438.735,03	0,00	12.710.641,13	0,00	271.906,10	2,19%	5,29%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.685.863,06	0,00	0,00	6.936.266,19	250.403,13	3,75%	3,75%
WESTERN ASSET ATIVO MAX FI RENDA FIXA	0,00	13.738.577,69	0,00	13.984.788,11	246.210,42	1,79%	4,76%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	0,00	41.646.672,77	14.251.303,25	27.606.204,86	210.835,34	0,51%	1,09%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	3.399.233,27	8.269.343,38	11.694.400,60	0,00	25.823,95	0,22%	0,78%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	20.795,15	0,00	7.810,81	15.640,76	2.656,42	12,77%	-24,79%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	0,00	48.811,53	0,00	49.012,24	200,71	0,41%	1,06%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-
				Total Renda Fixa	23.988.836,17	4,07%	

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
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	16.013.443,73	0,00	0,00	22.207.031,13	6.193.587,40	38,68%	38,68%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	22.531.985,69	0,00	0,00	27.288.115,85	4.756.130,16	21,11%	21,11%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	9.443.014,37	0,00	0,00	12.833.289,76	3.390.275,39	35,90%	35,90%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	10.227.802,18	0,00	0,00	13.466.758,89	3.238.956,71	31,67%	31,67%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	8.861.987,79	0,00	0,00	11.855.579,77	2.993.591,98	33,78%	33,78%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	15.782.430,37	0,00	0,00	18.745.623,19	2.963.192,82	18,78%	18,78%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	9.192.168,21	0,00	0,00	12.064.571,63	2.872.403,42	31,25%	31,25%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	9.931.520,30	0,00	0,00	12.307.403,03	2.375.882,73	23,92%	23,92%
SANTANDER IBOVSPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	4.186.725,34	0,00	0,00	5.418.730,95	1.232.005,61	29,43%	29,43%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	3.739.408,77	0,00	0,00	4.801.708,18	1.062.299,41	28,41%	28,41%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	972.617,28	0,00	0,00	998.008,86	25.391,58	2,61%	2,33%
ÁQUILLA FII - AQLL11	1.082.926,94	0,00	0,00	1.078.049,94	-4.877,00	-0,45%	38,49%
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE F...	2.138.608,92	0,00	0,00	9.637,88	-2.128.971,04	-99,55%	-
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	2.909.286,58	0,00	0,00	91.389,80	-2.817.896,78	-96,86%	-
				Total Renda Variável	26.151.972,39	22,35%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2020

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	15.694.288,34	0,00	0,00	20.464.194,08	4.769.905,74	30,39%	30,39%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	7.026.638,38	0,00	0,00	8.962.881,16	1.936.242,78	27,56%	27,56%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO E...	0,00	1.000.000,00	0,00	1.010.421,15	10.421,15	1,04%	33,90%
				Total Exterior	6.716.569,67	28,31%	

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	54.584.691,50	25.000.000,00	6.000.000,00	76.314.656,58	2.729.965,08	3,43%	4,63%
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	25.786.886,57	0,00	0,00	27.410.802,68	1.623.916,11	6,30%	6,30%
WESTERN ASSET IMA-B 5 ATIVO FI RENDA FIXA	33.320.279,41	0,00	33.710.641,13	0,00	390.361,72	1,17%	4,81%
WESTERN ASSET ATIVO MAX FI RENDA FIXA	0,00	13.738.577,69	0,00	13.984.788,11	246.210,42	1,79%	6,40%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	9.177.130,83	0,00	0,00	9.422.838,37	245.707,54	2,68%	2,68%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	0,00	41.646.672,77	14.251.303,25	27.606.204,86	210.835,34	0,51%	2,48%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.912.924,96	0,00	173.888,45	6.936.266,19	197.229,68	2,85%	2,90%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	1.870.424,87	26.744.234,63	28.649.775,44	0,00	35.115,94	0,12%	1,37%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	19.433,76	0,00	7.810,81	15.640,76	4.017,81	20,67%	-19,52%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	0,00	48.811,53	0,00	49.012,24	200,71	0,41%	2,45%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	879,98	0,00	0,00	0,01	-879,97	-100,00%	-
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	21.027.462,70	0,00	0,00	21.019.021,12	-8.441,58	-0,04%	-0,04%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	129.754.467,11	0,00	0,00	127.486.004,38	-2.268.462,73	-1,75%	-1,75%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	42.794.870,80	0,00	6.000.000,00	34.077.701,64	-2.717.169,16	-6,35%	-5,91%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	129.293.716,22	0,00	25.000.000,00	101.264.505,74	-3.029.210,48	-2,34%	-1,70%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	105.559.847,34	0,00	27.000.000,00	71.860.322,65	-6.699.524,69	-6,35%	-5,44%
Total Renda Fixa					-9.040.128,26	-1,35%	

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
ÁQUILLA FII - AQLL11	1.087.907,00	0,00	0,00	1.078.049,94	-9.857,06	-0,91%	38,89%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	1.619.954,59	0,00	611.847,34	998.008,86	-10.098,39	-0,62%	-16,05%
BRDESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	22.082.480,61	0,00	21.737.253,83	0,00	-345.226,78	-1,56%	-22,26%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	13.166.404,34	7.000.000,00	0,00	18.745.623,19	-1.420.781,15	-7,05%	-6,40%
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	0,00	7.000.000,00	0,00	5.418.730,95	-1.581.269,05	-22,59%	-22,03%
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE F...	2.147.964,57	0,00	0,00	9.637,88	-2.138.326,69	-99,55%	-
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	7.903.932,61	7.245.751,28	0,00	12.833.289,76	-2.316.394,13	-15,29%	-13,61%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	0,00	7.245.751,27	0,00	4.801.708,18	-2.444.043,09	-33,73%	-30,02%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	14.416.350,52	0,00	0,00	11.855.579,77	-2.560.770,75	-17,76%	-17,76%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	14.791.807,74	0,00	0,00	12.064.571,63	-2.727.236,11	-18,44%	-18,44%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	2.910.216,86	0,00	0,00	91.389,80	-2.818.827,06	-96,86%	-
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	25.038.338,74	0,00	0,00	22.207.031,13	-2.831.307,61	-11,31%	-11,31%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	7.842.787,67	7.489.413,90	0,00	12.307.403,03	-3.024.798,54	-19,73%	-18,67%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	17.144.834,59	0,00	0,00	13.466.758,89	-3.678.075,70	-21,45%	-21,45%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	34.134.539,88	0,00	0,00	27.288.115,85	-6.846.424,03	-20,06%	-20,06%
				Total Renda Variável	-34.753.436,14	-19,53%	

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	14.558.444,10	0,00	0,00	20.464.194,08	5.905.749,98	40,57%	40,57%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	0,00	7.000.000,00	0,00	8.962.881,16	1.962.881,16	28,04%	35,38%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO E...	0,00	1.000.000,00	0,00	1.010.421,15	10.421,15	1,04%	51,88%
				Total Exterior	7.879.052,29	34,93%	