



Ata nº 008/2020/CARMOPREV

## ATA DE REUNIÃO DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS

Ao vigésimo sétimo dia do mês de Julho de 2020, atendendo a convocação, extraordinária, reuniu-se na sede do Carmoprev, os membros do Comitê de Investimento, a Diretora Executiva, senhora Maria do Carmo Ramos Gomes, o senhor Rafael Horácio Macharete da Silva, Gerente de Finanças e o senhor Alcides de Jesus Gonçalves Neto. A diretora executiva, iniciou a reunião, lendo a ata anterior. A reunião foi iniciada as dezesseis horas, para tratar de algumas realocações na carteira de investimento, conforme apresentação do relatório de Análise de Portfolio e e – mail conforme documentos em anexo, enviados pela consultora Crédito & Mercado, o Senhor Rafael Horácio, diretor de Finanças, explicou o motivo das realocações dos recursos, que foram aprovadas por unanimidade pelos membros do comitê.

Assim eu Maria do Carmo Ramos Gomes, diretora executiva, membro deste conselho, lavrei a presente ata que segue assinada por mim e demais membros deste comitê.

*Mergomes*  
*[Signature]*  
*[Signature]*

**Re: RELATÓRIO JUNHO 2020**

De: Thiago Norte Natario (thiago.norte@creditoemercado.com.br)

Para: carmoprev@yahoo.com.br

Data: quinta-feira, 23 de julho de 2020 09:55 BRT

Bom dia, Rafael!

Tendo em vista o fechamento do primeiro semestre do ano e analisando o retorno e os enquadramentos da carteira de investimentos do RPPS, gostaria de sugerir algumas alterações visando aproximar os percentuais alocados em cada sub-segmento a nossa estratégia de longo prazo, observando a aderência aos limites impostos pela Resolução 3.922/2010 e aos limites aprovados na Política de Investimentos 2020 deste instituto, conforme abaixo:

Resgatar R\$ 700.000,00 (Setecentos Mil Reais) do fundo BRADESCO SELECTION FI AÇÕES (CNPJ: 03.660.879/0001-96) e direcionar para o fundo BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA (CNPJ: 28.515.874/0001-09).

Resgatar R\$ 1.200.000,00 (Um Milhão e Duzentos Mil Reais) do fundo CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP (CNPJ: 08.070.841/0001-87) e direcionar para o fundo CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP (CNPJ: 34.660.276/0001-18).

Resgatar o valor total do fundo BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO (CNPJ: 13.322.205/0001-35) e direcionar para o fundo BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO (CNPJ: 35.292.588/0001-89).

Qualquer dúvida estou a disposição.

Atenciosamente,

Em qui., 23 de jul. de 2020 às 08:26, CARMOPREV CARMOPREV <carmoprev@yahoo.com.br> escreveu:

Bom dia Thiago, tudo bem?

Segue o relatório de Junho de 2020, para análise e sugestão de realocação devido ao desenquadramento, fazendo favor.

Att,

Rafael Macharete

# CRÉDITO E MERCADO

*Consultoria em Investimentos*  
Relatório Analítico dos Investimentos

em junho, 2º trimestre e 1º semestre de 2020

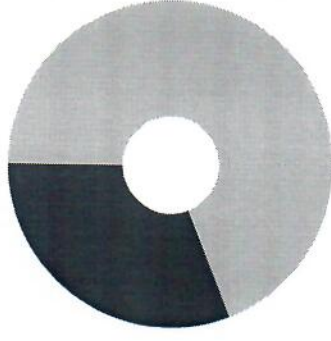


Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	1.516.673,17	5,24%	622	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	1.661.857,42	5,74%	1.262	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	3.087.488,51	10,66%	956	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	1.062.522,41	3,67%	884	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	3.861.446,86	13,33%	670	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	3.699.214,73	12,77%	763	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	D+0	Não há	89.392,95	0,31%	305	0,00%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'
BRADERCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	3.365.510,32	11,62%	174	0,28%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	712.471,53	2,46%	608	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se ...	Não se aplica	2.566,63	0,01%		0,29%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO P...	D+90 ou...	18 meses	295.744,02	1,02%		0,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b'
PIATÁ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVA...	D+1 ou ...	Não há	630.276,63	2,18%		0,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b'
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	1.006.388,81	3,48%	1.560	0,12%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
BRADERCO SELECTION FIC AÇÕES	D+4	Não há	2.170.573,03	7,50%	204	0,32%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	2.292.120,23	7,92%	2.513	0,30%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	D+15	Não há	903.291,08	3,12%	56	0,46%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	2.599.812,96	8,98%	18.591	0,06%	Artigo 8º, Inciso III
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>28.957.351,29</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 'b'	100,00%	14.889.203,10	51,42%	20,00%	30,00%	90,00%	11.172.413,06
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	89.392,95	0,31%	0,00%	10,00%	60,00%	17.285.017,82
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	40,00%	4.077.981,85	14,08%	10,00%	30,00%	40,00%	7.504.958,67
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea 'a'	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	4.343.602,69
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'	5,00%	2.566,63	0,01%	0,00%	0,00%	3,00%	866.153,91
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b'	5,00%	926.020,65	3,20%	0,00%	0,00%	5,00%	521.846,91
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.447.867,56
Total Renda Fixa	100,00%	19.985.165,18	69,02%	30,00%	70,00%	218,00%	



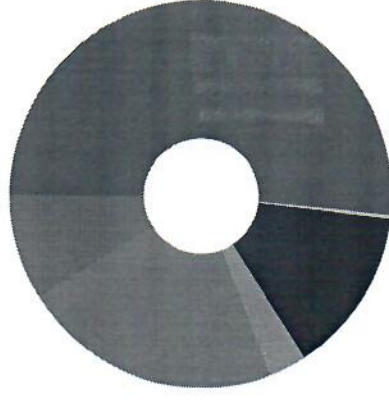
RENDA FIXA 19.985.165,18

RENDA VARIÁVEL 8.972.186,11



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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	6.372.373,15	22,01%	3,00%	15,00%	20,00%	-580.902,89
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	2.599.812,96	8,98%	7,00%	10,00%	10,00%	295.922,17
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	1.447.867,56
Total Renda Variável	30,00%	8.972.186,11	30,98%	10,00%	30,00%	35,00%	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	12.671.320,46	43,76	0,00
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	9.821.360,20	33,92	0,00
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	5.536.083,35	19,12	0,00
BRASIL PLURAL	632.843,26	2,19	0,01
SECURITY ADMINISTRADORA DE REC...	295.744,02	1,02	2,57

Artigo 14º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR)

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2020		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	14.889.203,10	51,42	20,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	89.392,95	0,31	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	4.077.981,85	14,08	10,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	2.566,63	0,01	0,00	3,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	926.020,65	3,20	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	6.372.373,15	22,01	3,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	2.599.812,96	8,98	7,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	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>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>	0,99%	3,35%	3,35%	3,35%	8,68%	23,17%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,21%	2,88%	3,57%	2,88%	8,18%	21,13%	0,01%	0,03%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,18%	3,12%	3,54%	3,12%	8,19%	21,36%	0,01%	0,03%
<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%
<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%
<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%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	2,03%	-1,86%	4,83%	-1,86%	4,56%	34,21%	0,03%	0,10%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,21%	1,75%	0,73%	1,75%	4,58%	11,21%	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,26%	1,37%	0,78%	1,37%	4,06%	10,51%	0,00%	0,01%
PIATÁ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO LP	0,71%	-5,81%	0,59%	-5,81%	-1,31%	-3,06%	-	-



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

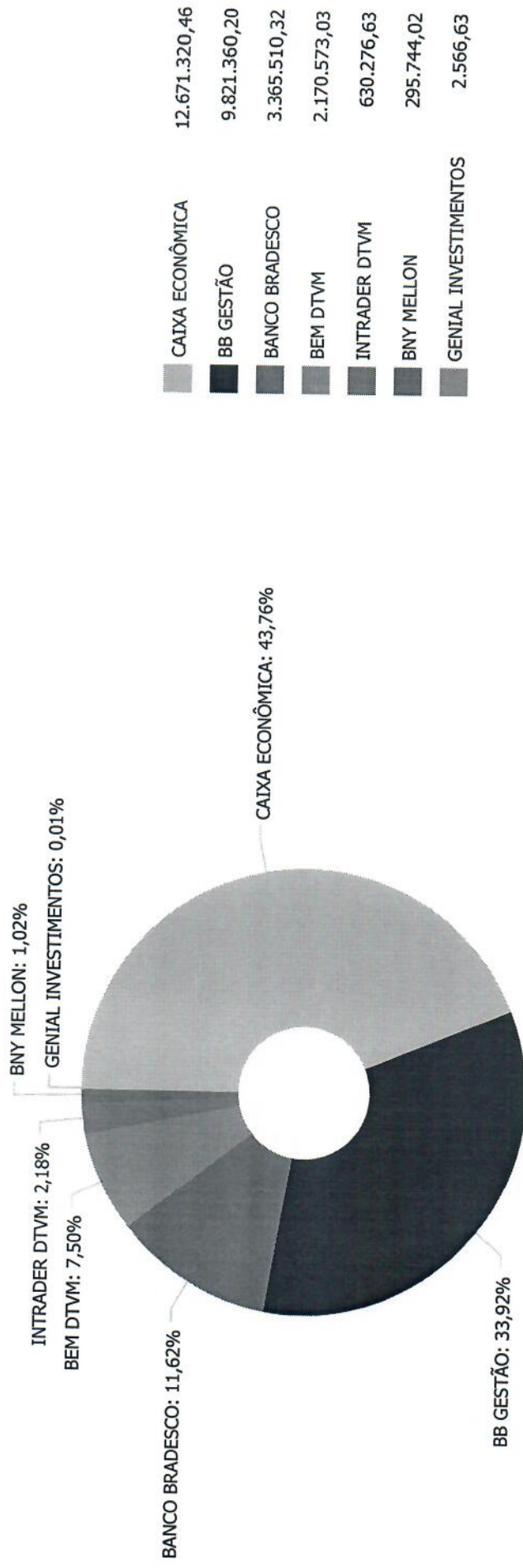
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	0,13%	0,81%	0,47%	0,81%	2,58%	-16,31%	-	-
IPCA (Benchmark)	0,26%	0,10%	-0,43%	0,10%	2,12%	5,57%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,75%	4,63%	3,27%	4,63%	9,82%	28,20%	0,01%	0,03%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,95%	1,78%	3,13%	1,78%	6,24%	22,63%	0,01%	0,04%

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

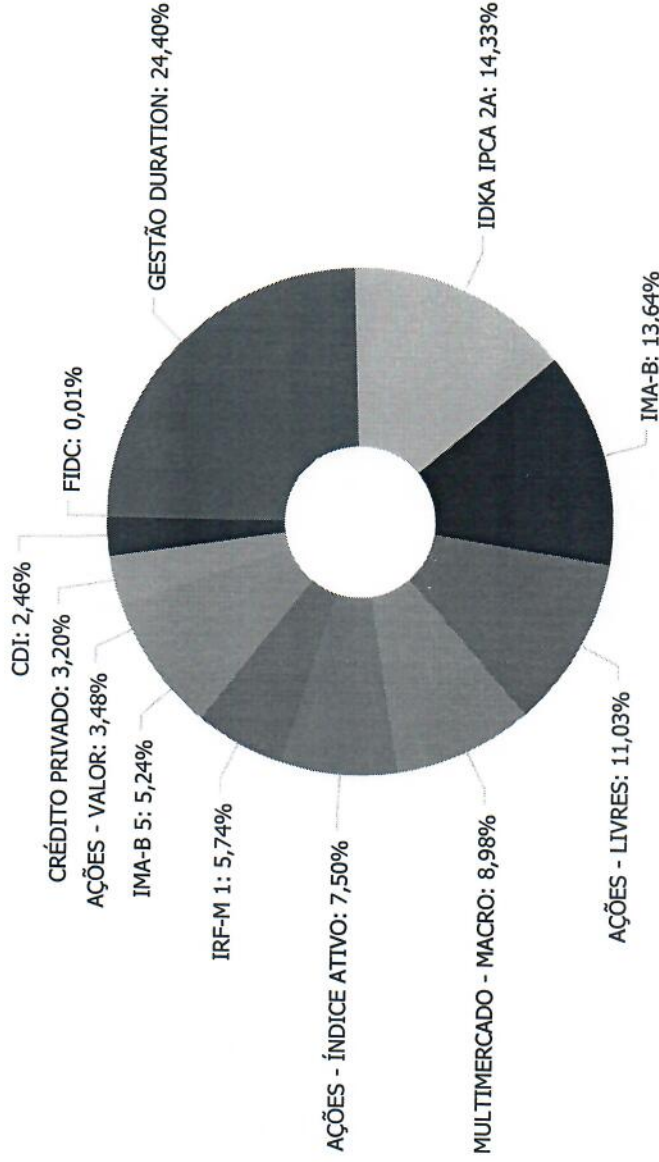
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>Ibovespa (Benchmark)</b>								
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	8,76%	-17,80%	30,18%	-17,80%	-6,20%	30,64%	-	-
BRADESCO SELECTION FIC AÇÕES	7,44%	-18,07%	25,17%	-18,07%	-4,94%	52,01%	0,13%	0,34%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	8,95%	-24,53%	25,56%	-24,53%	-13,48%	19,34%	0,12%	0,39%
	9,88%	-14,67%	33,22%	-14,67%	5,17%	-	0,12%	0,41%
<b>CDI (Benchmark)</b>								
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,21%	1,75%	0,73%	1,75%	4,58%	11,21%	-	-
	1,25%	-1,03%	5,40%	-1,03%	6,27%	25,21%	0,01%	0,07%
<b>Não Informado (Benchmark)</b>								
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	-	-	-	-	-	-	-	-
	8,58%	-13,79%	30,01%	-13,79%	-	-	0,12%	-



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



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



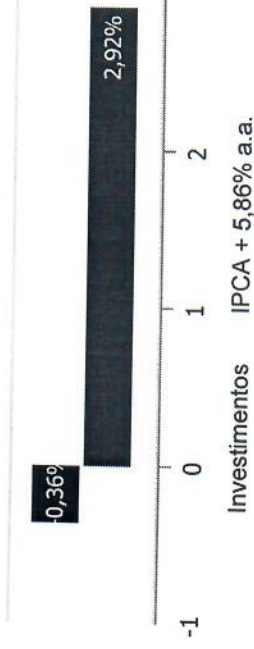
Sub-Segment	Value
GESTÃO DURATION	7.064.725,05
IDKA IPCA 2A	4.150.010,92
IMA-B	3.950.839,81
AÇÕES - LIVRES	3.195.411,31
MULTIMERCADO - MACRO	2.599.812,96
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	2.170.573,03
IRF-M 1	1.661.857,42
IMA-B 5	1.516.673,17
AÇÕES - VALOR	1.006.388,81
CRÉDITO PRIVADO	926.020,65
CDI	712.471,53
FIDC	2.566,63



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

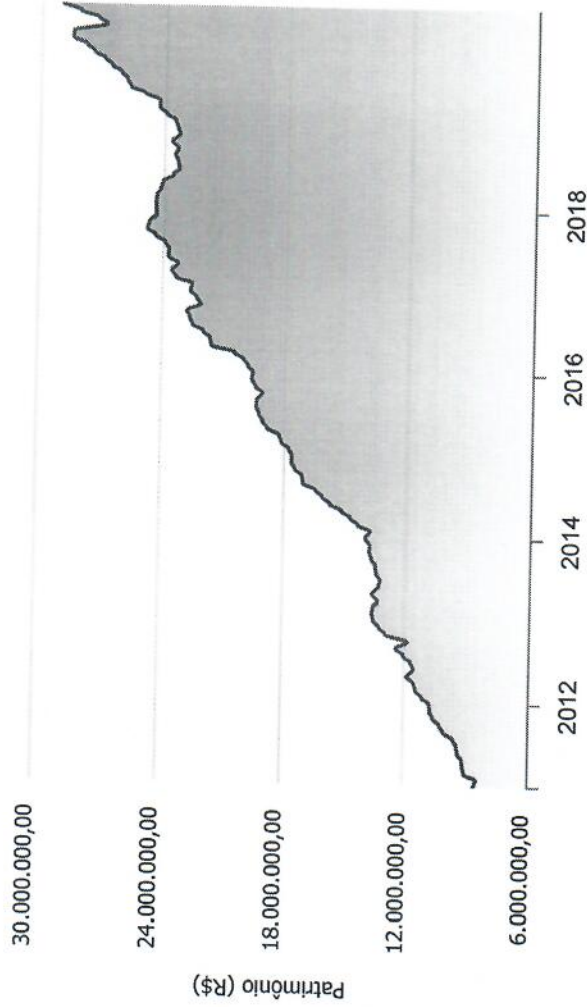
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	26.468.693,82	569.791,48	30.463,24	27.133.195,59	125.173,53	125.173,53	0,46%	0,46%	0,71%	0,71%	65,33%	2,42%
Fevereiro	27.133.195,59	404.098,35	4.174,81	27.108.315,05	-424.804,08	-299.630,55	-1,54%	-1,09%	0,66%	1,37%	-79,15%	3,44%
Março	27.108.315,05	319.053,22	144.431,68	25.452.169,08	-1.830.767,51	-2.130.398,06	-6,71%	-7,72%	0,57%	1,95%	-396,25%	12,28%
Abril	25.452.169,08	85.023,06	220.000,00	25.833.802,04	516.609,90	-1.613.788,16	2,03%	-5,85%	0,14%	2,09%	-279,47%	6,40%
Maior	25.833.802,04	5.054.013,03	4.990.000,00	26.644.892,17	747.077,10	-866.711,06	2,88%	-3,14%	0,07%	2,17%	-144,72%	4,41%
Junho	26.644.892,17	179.347,00	110.000,00	27.479.842,02	765.602,85	-101.108,21	2,87%	-0,36%	0,74%	2,92%	-12,30%	3,84%

Investimentos x Meta Atuarial



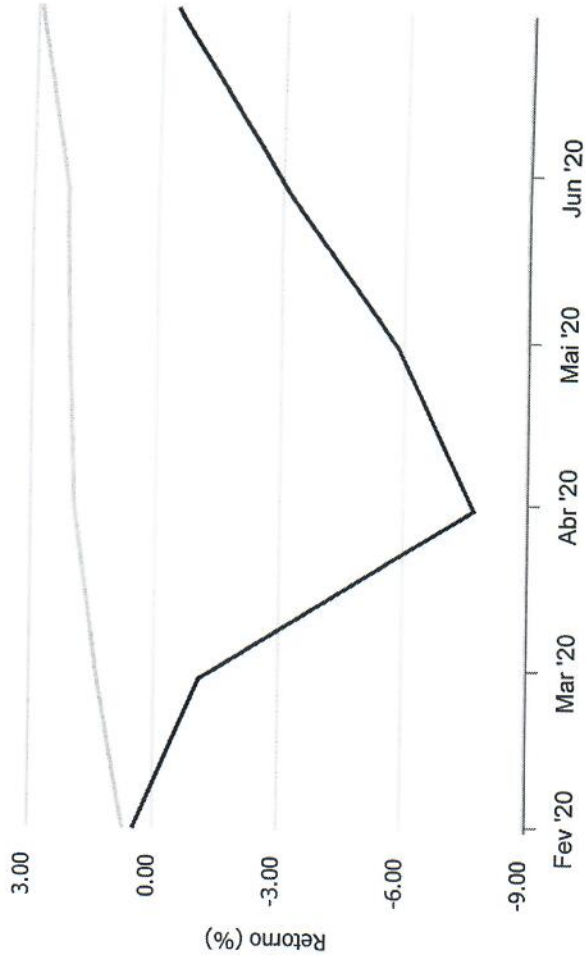
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



Investimentos  Meta Atuarial  CDI  IMA-B  IMA-B 5

IMA-B 5+  IMA Geral  IRF-M  IRF-M 1  IRF-M 1+

Ibovespa  IBX  SMLL  IDIV



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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	3.778.363,57	6.691,98	0,00	3.861.446,86	76.391,31	2,02%	2,02%	2,98%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.049.788,35	0,00	0,00	1.062.522,41	12.734,06	1,21%	1,21%	0,81%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	3.051.623,50	0,00	0,00	3.087.488,51	35.865,01	1,18%	1,18%	0,86%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.500.530,87	0,00	0,00	1.516.673,17	16.142,30	1,08%	1,08%	0,89%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	3.333.836,28	0,00	0,00	3.365.510,32	31.674,04	0,95%	0,95%	1,28%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA...	148.966,66	48.895,69	110.000,00	89.392,95	1.530,40	0,77%	2,02%	2,98%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	3.548.852,82	123.759,33	0,00	3.699.214,73	26.602,58	0,72%	0,75%	1,17%
PIATÁ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO...	625.807,75	0,00	0,00	630.276,63	4.468,88	0,71%	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	710.623,73	0,00	0,00	712.471,53	1.847,80	0,26%	0,26%	0,03%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.657.602,23	0,00	0,00	1.661.857,42	4.255,19	0,26%	0,26%	0,05%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRI...	295.370,73	0,00	0,00	295.744,02	373,29	0,13%	0,13%	-
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	2.713,60	0,00	0,00	2.566,63	-146,97	-5,42%	-5,42%	3,91%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>19.704.080,29</b>	<b>179.347,00</b>	<b>110.000,00</b>	<b>19.985.165,18</b>	<b>211.737,89</b>	<b>1,07%</b>		<b>1,33%</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
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	2.086.074,95	0,00	0,00	2.292.120,23	206.045,28	9,88%	9,88%	12,39%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	1.992.206,47	0,00	0,00	2.170.573,03	178.366,56	8,95%	8,95%	12,00%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	831.903,58	0,00	0,00	903.291,08	71.387,50	8,58%	8,58%	12,44%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	936.713,32	0,00	0,00	1.006.388,81	69.675,49	7,44%	7,44%	13,19%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	2.567.639,66	0,00	0,00	2.599.812,96	32.173,30	1,25%	1,25%	1,24%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>8.414.537,98</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>8.972.186,11</b>	<b>557.648,13</b>	<b>6,63%</b>		<b>9,16%</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
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.066.117,51	1.647.915,69	0,00	3.861.446,86	147.413,66	3,97%	4,90%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	4.650.016,75	123.759,33	1.200.000,00	3.699.214,73	125.438,65	2,63%	3,27%
BRADERCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	4.017.521,30	0,00	760.000,00	3.365.510,32	107.989,02	2,69%	3,13%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	2.981.867,55	0,00	0,00	3.087.488,51	105.620,96	3,54%	3,54%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.025.877,39	0,00	0,00	1.062.522,41	36.645,02	3,57%	3,57%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	3.688.535,48	42.349,03	2.100.000,00	1.661.857,42	30.972,91	0,83%	1,06%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,00	1.490.368,15	0,00	1.516.673,17	26.305,02	1,77%	3,71%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	1.642.889,78	0,00	940.000,00	712.471,53	9.581,75	0,58%	0,78%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	303.588,48	96.339,92	320.000,00	89.392,95	9.464,55	2,37%	4,83%
PIATÁ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO...	627.237,58	0,00	0,00	630.276,63	3.039,05	0,48%	0,59%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRI...	294.354,99	0,00	0,00	295.744,02	1.389,03	0,47%	0,47%
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	2.890,83	0,00	0,00	2.566,63	-324,20	-11,21%	-11,21%
			<b>Total Renda Fixa</b>		<b>603.535,42</b>	<b>2,44%</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
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	1.250.485,75	500.000,00	0,00	2.292.120,23	541.634,48	30,94%	33,22%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	1.050.132,79	760.000,00	0,00	2.170.573,03	360.440,24	19,91%	25,56%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	0,00	700.000,00	0,00	903.291,08	203.291,08	29,04%	30,01%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	804.052,04	0,00	0,00	1.006.388,81	202.336,77	25,16%	25,16%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	2.466.580,71	0,00	0,00	2.599.812,96	133.232,25	5,40%	5,40%
			<b>Total Renda Variável</b>		<b>1.440.934,82</b>	<b>19,13%</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
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	4.589.939,27	123.759,33	1.200.000,00	3.699.214,73	185.516,13	3,94%	4,63%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	2.753.642,74	239.132,10	0,00	3.087.488,51	94.713,67	3,16%	3,12%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	3.431.862,73	250.406,23	2.100.000,00	1.661.857,42	79.588,46	2,16%	2,45%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	3.675.165,37	398.892,23	760.000,00	3.365.510,32	51.452,72	1,26%	1,78%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.032.734,29	0,00	0,00	1.062.522,41	29.788,12	2,88%	2,88%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,00	1.490.368,15	0,00	1.516.673,17	26.305,02	1,77%	3,08%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	1.633.243,38	0,00	940.000,00	712.471,53	19.228,15	1,18%	1,37%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.205.828,96	1.647.915,69	0,00	3.861.446,86	7.702,21	0,20%	-1,75%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRI...	293.383,47	0,00	0,00	295.744,02	2.360,55	0,80%	0,80%
MASTER III FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	4.500,14	0,00	3.381,01	2.566,63	1.447,50	32,17%	-42,97%
PIATÁ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO...	669.153,38	0,00	35.688,72	630.276,63	-3.188,03	-0,48%	-5,81%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA...	128.693,79	440.725,59	460.000,00	89.392,95	-20.026,43	-3,52%	-1,86%
			<b>Total Renda Fixa</b>		<b>474.888,07</b>	<b>1,90%</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
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	0,00	700.000,00	0,00	903.291,08	203.291,08	29,04%	-13,79%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	2.626.915,43	0,00	0,00	2.599.812,96	-27.102,47	-1,03%	-1,03%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	1.790.137,39	662.049,49	0,00	2.292.120,23	-160.066,65	-6,53%	-14,67%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.228.328,35	0,00	0,00	1.006.388,81	-221.939,54	-18,07%	-18,07%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	1.747.106,25	760.000,00	0,00	2.170.573,03	-336.533,22	-13,42%	-24,53%
				<b>Total Renda Variável</b>	<b>-542.350,80</b>	<b>-5,70%</b>	