

Relatório Analítico dos Investimentos

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

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2020)

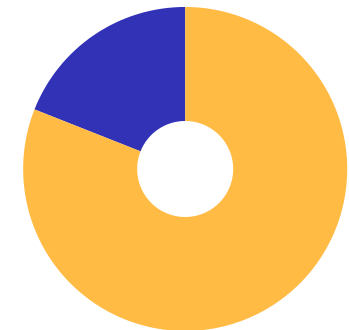
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	1.250.330,32	4,54%	600	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	1.446.449,05	5,25%	884	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	1.900.502,97	6,90%	670	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	2.774.925,76	10,07%	714	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	3.001.971,53	10,90%	763	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	1.209.595,00	4,39%	956	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	2.356.891,88	8,55%	912	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	1.925.346,42	6,99%	340	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	1.192.135,84	4,33%	901	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.050.760,26	3,81%	1.364	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	1.341.791,98	4,87%	367	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	D+0	Não há	1.863.033,75	6,76%	305	0,06%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	223.257,81	0,81%	742	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	665.476,67	2,42%	174	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se ...	Não se aplica	112.257,18	0,41%	98	0,13%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	D+4	Não há	500.218,55	1,82%	96	0,06%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	776.402,08	2,82%	556	0,20%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	401.748,03	1,46%	1.560	0,05%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+3	Não há	312.593,48	1,13%	7.875	0,20%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	299.387,50	1,09%	36.952	0,03%	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	Enquadramento
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	307.369,83	1,12%	2.513	0,04%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	D+4	Não há	177.975,03	0,65%	15.219	0,04%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	169.212,90	0,61%	9.429	0,04%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	653.861,15	2,37%	16.254	0,06%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	362.671,45	1,32%	203	0,08%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	1.119.237,56	4,06%	18.591	0,02%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	156.000,00	0,57%		0,06%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'
Total para cálculo dos limites da Resolução			27.551.403,98				

Enquadramento 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%	19.450.701,01	70,60%	20,00%	50,00%	90,00%	5.345.562,57
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	1.863.033,75	6,76%	0,00%	8,00%	40,00%	9.157.527,84
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	888.734,48	3,23%	0,00%	10,00%	40,00%	10.131.827,11
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	2.755.140,40
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	112.257,18	0,41%	0,00%	0,00%	3,00%	714.284,94
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.377.570,20
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.377.570,20
Total Renda Fixa	100,00%	22.314.726,42	80,99%	20,00%	68,00%	193,00%	

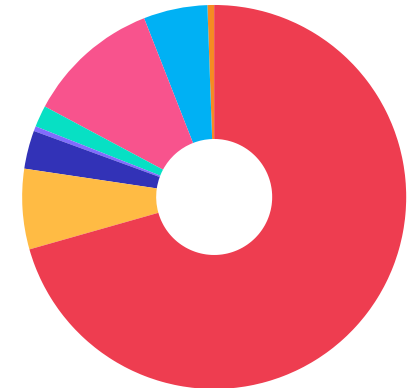


■ RENDA FIXA 22.314.726,42

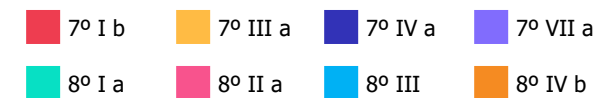
■ RENDA VARIÁVEL 5.236.677,56

Enquadramento e Política de Investimento (RENTA 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%	500.218,55	1,82%	0,00%	5,00%	10,00%	2.254.921,85
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'b'	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.377.570,20
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	3.098.550,00	11,25%	0,00%	10,00%	20,00%	2.411.730,80
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'b'	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.377.570,20
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	1.481.909,01	5,38%	0,00%	10,00%	10,00%	1.273.231,39
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	5,00%	156.000,00	0,57%	0,00%	4,00%	5,00%	1.221.570,20
Total Renda Variável	30,00%	5.236.677,56	19,01%	0,00%	29,00%	55,00%	



Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2020			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	5,00%	1.377.570,20
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	5,00%	



Enquadramento por Gestores - base (Junho / 2020)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	17.025.401,68	61,80	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	9.748.268,45	35,38	0,00
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	665.476,67	2,42	0,00
PETRA CAPITAL	112.257,18	0,41	0,00

Artigo 20º - 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) - (Resolução 4963)

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 '	0,00	0,00	20,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	40,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	3,00
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 I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso III	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
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	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%	0,81%	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%	0,86%	0,03%
IRF-M 1+ (Benchmark)	1,04%	6,03%	4,53%	6,03%	11,57%	33,23%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,02%	5,88%	4,41%	5,88%	11,53%	32,77%	1,75%	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%	4,98%	0,15%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,28%	2,60%	1,15%	2,60%	5,98%	13,67%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,26%	2,48%	1,09%	2,48%	5,78%	13,28%	0,05%	0,00%
IMA-B 5 (Benchmark)	1,12%	3,17%	3,77%	3,17%	8,73%	24,75%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,10%	3,04%	3,71%	3,04%	8,51%	24,21%	0,91%	0,04%
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%	2,98%	0,10%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	2,03%	-1,86%	4,83%	-1,86%	4,56%	34,21%	2,98%	0,10%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,03%	-1,88%	4,91%	-1,88%	4,52%	34,35%	2,99%	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
IRF-M (Benchmark)	0,79%	4,86%	3,39%	4,86%	9,64%	27,08%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,77%	4,68%	3,26%	4,68%	9,51%	26,49%	1,17%	0,02%
CDI (Benchmark)	0,21%	1,75%	0,73%	1,75%	4,58%	11,21%	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,21%	-1,55%	-0,59%	-1,55%	-8,44%	-12,07%	0,05%	0,06%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,13%	1,24%	0,49%	1,24%	3,50%	8,88%	0,01%	0,00%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,95%	1,75%	2,96%	1,75%	6,31%	23,30%	1,27%	0,04%
IPCA (Benchmark)	0,26%	0,10%	-0,43%	0,10%	2,12%	5,57%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,75%	4,63%	3,27%	4,63%	9,82%	28,20%	1,17%	0,03%
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,95%	1,78%	3,13%	1,78%	6,24%	22,63%	1,28%	0,04%

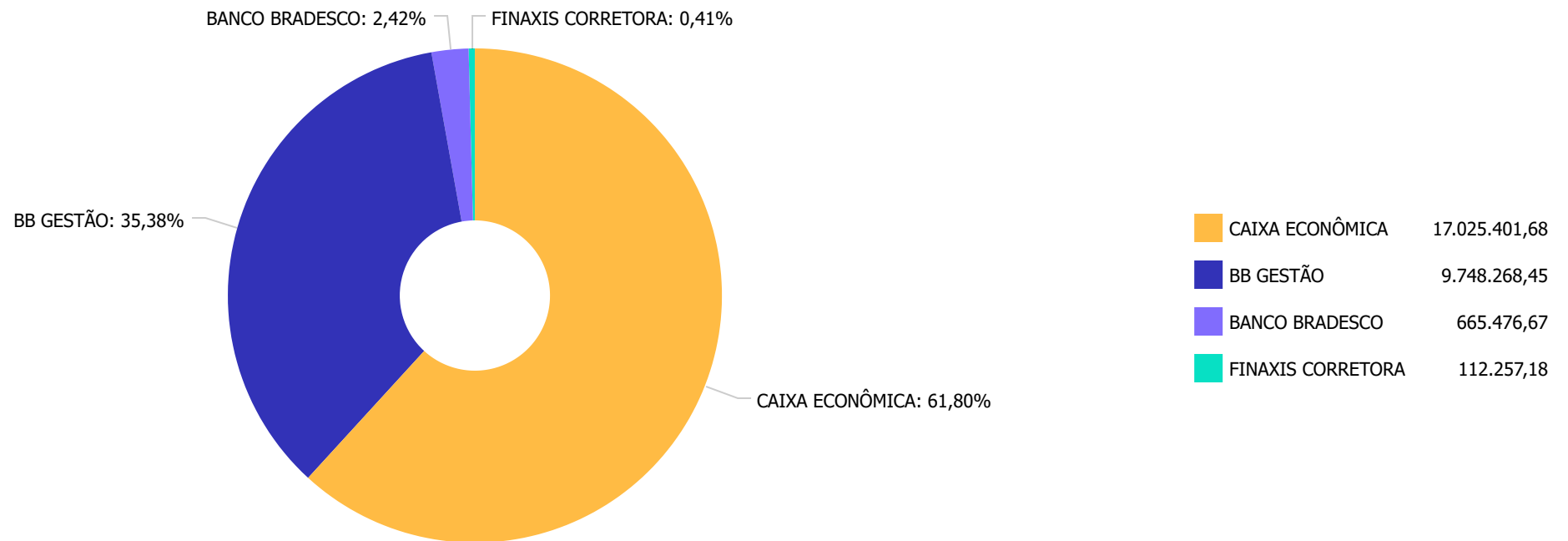
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
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%	13,11%	0,39%
Ibovespa (Benchmark)	8,76%	-17,80%	30,18%	-17,80%	-6,20%	30,64%	-	-
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	18,16%	-30,30%	27,88%	-30,30%	-5,62%	53,28%	22,35%	0,53%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	7,50%	-16,14%	31,89%	-16,14%	4,63%	60,37%	12,49%	0,40%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	9,07%	-21,11%	27,93%	-21,11%	-8,75%	24,85%	12,25%	0,39%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	9,24%	-13,61%	35,90%	-13,61%	2,99%	48,24%	10,72%	0,42%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	6,53%	-18,67%	23,92%	-18,67%	5,27%	45,78%	10,47%	0,37%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	7,44%	-18,07%	25,17%	-18,07%	-4,94%	52,01%	13,19%	0,34%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	9,88%	-14,67%	33,22%	-14,67%	5,17%	-	12,39%	0,41%
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%	16,18%	0,45%
CDI (Benchmark)	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%	0,86%	0,02%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,25%	-1,03%	5,40%	-1,03%	6,27%	25,21%	1,24%	0,07%
IFIX (Benchmark)	5,59%	-12,24%	12,52%	-12,24%	6,76%	32,05%	-	-

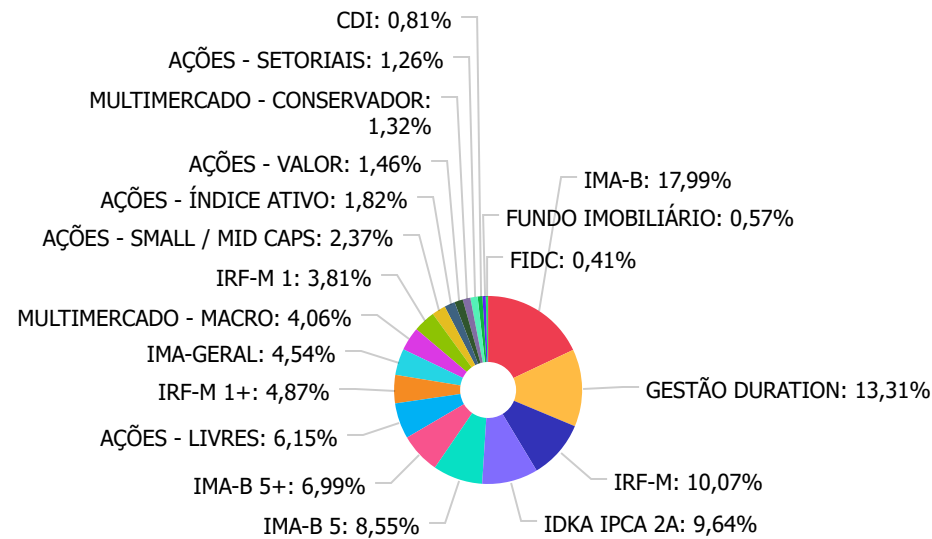
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	20,00%	4,71%	34,34%	4,71%	51,16%	-82,97%	15,34%	0,43%

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



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

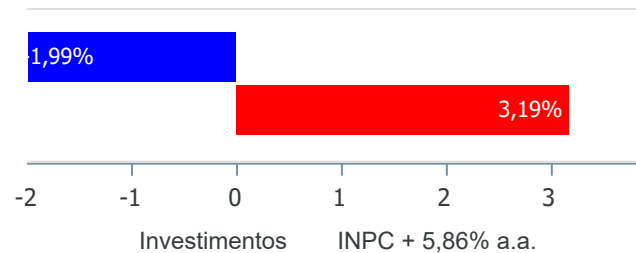


IMA-B	4.955.672,56	GESTÃO DURATION	3.667.448,20	IRF-M	2.774.925,76
IDKA IPCA 2A	2.656.044,05	IMA-B 5	2.356.891,88	IMA-B 5+	1.925.346,42
AÇÕES - LIVRES	1.695.752,89	IRF-M 1+	1.341.791,98	IMA-GERAL	1.250.330,32
MULTIMERCADO - MACRO	1.119.237,56	IRF-M 1	1.050.760,26	AÇÕES - SMALL / MID CAPS	653.861,15
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	500.218,55	AÇÕES - VALOR	401.748,03	MULTIMERCADO - CONSERVADOR	362.671,45
AÇÕES - SETORIAIS	347.187,93	CDI	223.257,81	FUNDO IMOBILIÁRIO	156.000,00
FIDC	112.257,18				

Retorno e Meta de Rentabilidade 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	27.748.654,49	618.826,85	339.158,44	28.164.595,04	136.272,14	136.272,14	0,49%	0,49%	0,69%	0,69%	70,53%	2,13%
Fevereiro	28.164.595,04	1.280.252,41	1.260.351,14	27.857.442,10	-327.054,21	-190.782,07	-1,16%	-0,68%	0,58%	1,27%	-53,46%	3,90%
Março	27.857.442,10	373.992,42	352.164,05	25.768.915,89	-2.110.354,58	-2.301.136,65	-7,57%	-8,20%	0,68%	1,96%	-418,36%	15,61%
Abril	25.768.915,89	463.813,88	429.400,65	26.344.456,16	541.127,04	-1.760.009,61	2,10%	-6,27%	0,22%	2,19%	-286,97%	8,03%
Mai	26.344.456,16	425.409,90	473.449,92	26.851.718,60	555.302,46	-1.204.707,15	2,11%	-4,30%	0,20%	2,39%	-179,64%	4,02%
Junho	26.851.718,60	486.746,33	436.505,44	27.551.403,98	649.444,49	-555.262,66	2,41%	-1,99%	0,78%	3,19%	-62,32%	3,37%

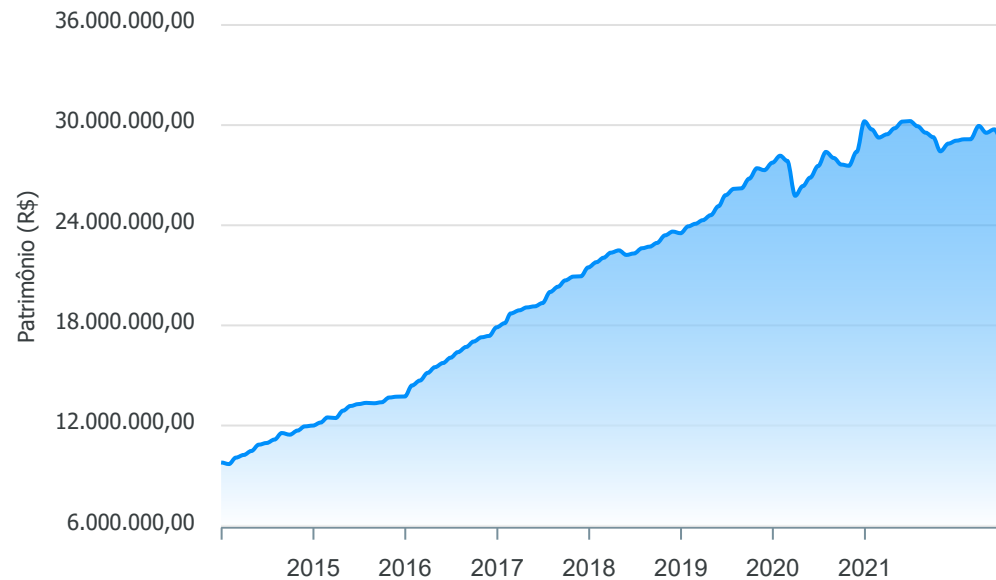
Investimentos x Meta de Rentabilidade



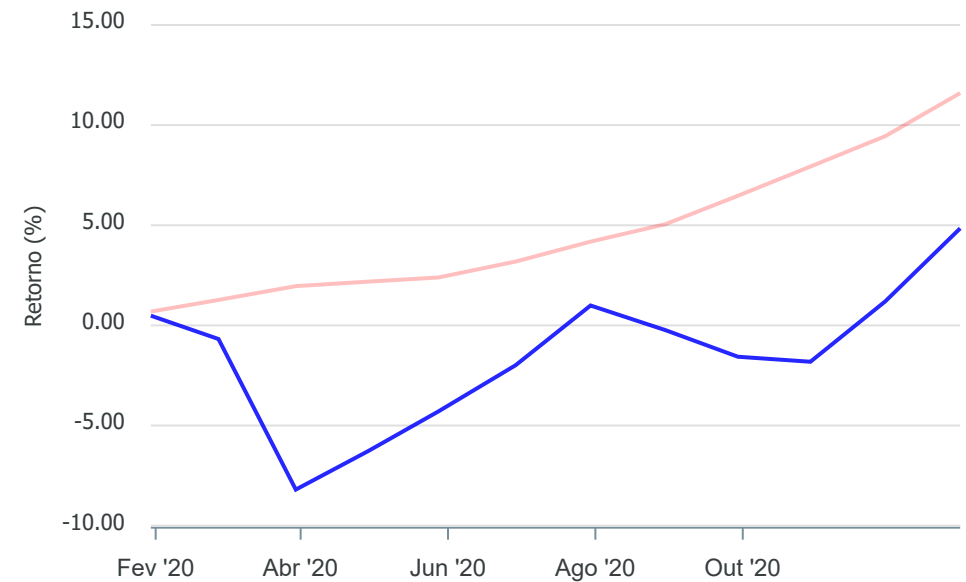
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

ANO 36M

Evolução do Patrimônio



Comparativo



Investimentos Meta de Rentabilidade ☐ 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 IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	1.872.408,88	0,00	0,00	1.925.346,42	52.937,54	2,83%	2,83%	4,98%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.168.472,00	0,00	0,00	1.192.135,84	23.663,84	2,03%	2,03%	2,99%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	1.826.056,24	0,00	0,00	1.863.033,75	36.977,51	2,02%	2,02%	2,98%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.830.263,15	32.764,21	0,00	1.900.502,97	37.475,61	2,01%	2,02%	2,98%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.429.113,72	0,00	0,00	1.446.449,05	17.335,33	1,21%	1,21%	0,81%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.195.544,06	0,00	0,00	1.209.595,00	14.050,94	1,18%	1,18%	0,86%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.331.280,03	0,00	0,00	2.356.891,88	25.611,85	1,10%	1,10%	0,91%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	1.328.285,08	0,00	0,00	1.341.791,98	13.506,90	1,02%	1,02%	1,75%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	659.213,63	0,00	0,00	665.476,67	6.263,04	0,95%	0,95%	1,28%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.238.580,01	0,00	0,00	1.250.330,32	11.750,31	0,95%	0,95%	1,27%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.753.668,13	0,00	0,00	2.774.925,76	21.257,63	0,77%	0,77%	1,17%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.979.635,87	0,00	0,00	3.001.971,53	22.335,66	0,75%	0,75%	1,17%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.078.643,34	15.060,14	45.751,40	1.050.760,26	2.808,18	0,26%	0,26%	0,05%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	174.756,59	438.921,98	390.754,04	223.257,81	333,28	0,05%	0,13%	0,01%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	112.496,02	0,00	0,00	112.257,18	-238,84	-0,21%	-0,21%	0,05%
Total Renda Fixa	21.978.416,75	486.746,33	436.505,44	22.314.726,42	286.068,78	1,30%		1,81%

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 RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	130.000,00	0,00	0,00	156.000,00	26.000,00	20,00%	20,00%	15,34%
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	150.617,53	0,00	0,00	177.975,03	27.357,50	18,16%	18,16%	22,35%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	579.185,13	0,00	0,00	653.861,15	74.676,02	12,89%	12,89%	16,18%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	279.739,46	0,00	0,00	307.369,83	27.630,37	9,88%	9,88%	12,39%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	457.011,19	0,00	0,00	500.218,55	43.207,36	9,45%	9,45%	13,11%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	286.148,05	0,00	0,00	312.593,48	26.445,43	9,24%	9,24%	10,72%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	711.829,40	0,00	0,00	776.402,08	64.572,68	9,07%	9,07%	12,25%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	157.405,44	0,00	0,00	169.212,90	11.807,46	7,50%	7,50%	12,49%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	373.933,75	0,00	0,00	401.748,03	27.814,28	7,44%	7,44%	13,19%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	281.044,43	0,00	0,00	299.387,50	18.343,07	6,53%	6,53%	10,47%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.105.386,73	0,00	0,00	1.119.237,56	13.850,83	1,25%	1,25%	1,24%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	361.000,74	0,00	0,00	362.671,45	1.670,71	0,46%	0,46%	0,86%
Total Renda Variável	4.873.301,85	0,00	0,00	5.236.677,56	363.375,71	7,46%		10,01%

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	1.818.494,46	0,00	0,00	1.925.346,42	106.851,96	5,88%	5,88%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	2.906.810,50	0,00	0,00	3.001.971,53	95.161,03	3,27%	3,27%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.780.081,65	32.764,21	0,00	1.900.502,97	87.657,11	4,84%	4,90%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.687.430,20	0,00	0,00	2.774.925,76	87.495,56	3,26%	3,26%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	1.777.142,20	0,00	0,00	1.863.033,75	85.891,55	4,83%	4,83%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.272.638,80	0,00	0,00	2.356.891,88	84.253,08	3,71%	3,71%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	1.285.113,42	0,00	0,00	1.341.791,98	56.678,56	4,41%	4,41%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.136.388,26	0,00	0,00	1.192.135,84	55.747,58	4,91%	4,91%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.396.562,88	0,00	0,00	1.446.449,05	49.886,17	3,57%	3,57%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.168.215,55	0,00	0,00	1.209.595,00	41.379,45	3,54%	3,54%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.214.359,30	0,00	0,00	1.250.330,32	35.971,02	2,96%	2,96%
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	645.289,93	0,00	0,00	665.476,67	20.186,74	3,13%	3,13%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.105.059,53	71.984,87	138.251,16	1.050.760,26	11.967,02	1,02%	1,09%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	151.675,65	1.271.221,03	1.201.104,85	223.257,81	1.465,98	0,10%	0,49%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	112.919,89	0,00	0,00	112.257,18	-662,71	-0,59%	-0,59%
Total Renda Fixa	21.458.182,22	1.375.970,11	1.339.356,01	22.314.726,42	819.930,10	3,81%	

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	606.884,87	0,00	0,00	776.402,08	169.517,21	27,93%	27,93%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	496.597,78	0,00	0,00	653.861,15	157.263,37	31,67%	31,67%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	381.123,62	0,00	0,00	500.218,55	119.094,93	31,25%	31,25%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	230.013,09	0,00	0,00	312.593,48	82.580,39	35,90%	35,90%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	320.975,67	0,00	0,00	401.748,03	80.772,36	25,16%	25,16%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	230.724,48	0,00	0,00	307.369,83	76.645,35	33,22%	33,22%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	241.592,24	0,00	0,00	299.387,50	57.795,26	23,92%	23,92%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.061.880,15	0,00	0,00	1.119.237,56	57.357,41	5,40%	5,40%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	128.298,42	0,00	0,00	169.212,90	40.914,48	31,89%	31,89%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	116.999,00	0,00	0,00	156.000,00	39.001,00	33,33%	34,34%
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	139.174,82	0,00	0,00	177.975,03	38.800,21	27,88%	27,88%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	356.469,53	0,00	0,00	362.671,45	6.201,92	1,74%	1,74%
Total Renda Variável	4.310.733,67	0,00	0,00	5.236.677,56	925.943,89	21,48%	

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 FIC RENDA FIXA	3.116.402,84	0,00	250.000,00	3.001.971,53	135.568,69	4,35%	4,63%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.650.847,63	0,00	0,00	2.774.925,76	124.078,13	4,68%	4,68%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	1.267.271,79	0,00	0,00	1.341.791,98	74.520,19	5,88%	5,88%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.287.305,21	0,00	0,00	2.356.891,88	69.586,67	3,04%	3,04%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.904.116,24	0,00	500.000,00	1.446.449,05	42.332,81	2,22%	2,88%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.172.998,57	0,00	0,00	1.209.595,00	36.596,43	3,12%	3,12%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.195.602,27	81.799,17	254.454,72	1.050.760,26	27.813,54	2,18%	2,48%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.228.823,03	0,00	0,00	1.250.330,32	21.507,29	1,75%	1,75%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	653.849,32	0,00	0,00	665.476,67	11.627,35	1,78%	1,78%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	173.053,65	2.332.576,18	2.286.574,92	223.257,81	4.202,90	0,17%	1,24%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	114.029,08	0,00	0,00	112.257,18	-1.771,90	-1,55%	-1,55%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.214.923,79	0,00	0,00	1.192.135,84	-22.787,95	-1,88%	-1,88%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.890.648,05	42.600,13	0,00	1.900.502,97	-32.745,21	-1,69%	-1,75%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	1.898.262,08	0,00	0,00	1.863.033,75	-35.228,33	-1,86%	-1,86%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	2.036.010,55	0,00	0,00	1.925.346,42	-110.664,13	-5,44%	-5,44%
Total Renda Fixa	22.804.144,10	2.456.975,48	3.291.029,64	22.314.726,42	344.636,48	1,36%	

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 RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	148.999,00	0,00	0,00	156.000,00	7.001,00	4,70%	4,71%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	359.328,08	0,00	0,00	362.671,45	3.343,37	0,93%	0,93%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.130.905,36	0,00	0,00	1.119.237,56	-11.667,80	-1,03%	-1,03%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	174.842,44	27.547,99	0,00	169.212,90	-33.177,53	-16,39%	-16,14%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	360.197,30	0,00	0,00	307.369,83	-52.827,47	-14,67%	-14,67%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	0,00	375.000,00	0,00	312.593,48	-62.406,52	-16,64%	-13,61%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	0,00	375.000,00	0,00	299.387,50	-75.612,50	-20,16%	-18,67%
CAIXA CONSTRUÇÃO CIVIL FI AÇÕES	0,00	264.518,32	0,00	177.975,03	-86.543,29	-32,72%	-30,30%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	340.403,48	150.000,00	0,00	401.748,03	-88.655,45	-18,08%	-18,07%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	613.294,61	0,00	0,00	500.218,55	-113.076,06	-18,44%	-18,44%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	832.445,39	0,00	0,00	653.861,15	-178.584,24	-21,45%	-21,45%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	984.094,73	0,00	0,00	776.402,08	-207.692,65	-21,10%	-21,10%
Total Renda Variável	4.944.510,39	1.192.066,31	0,00	5.236.677,56	-899.899,14	-14,66%	

Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da empresa. As informações aqui contidas são somente com o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos. As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre os produtos mencionados, entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas ao objetivo, aos riscos e à política de investimento dos produtos. Todas as informações podem ser obtidas com o responsável pela distribuição, gestão ou no site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários).

Sua elaboração buscou atender os objetivos de investimentos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas aos investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de consultoria de valores mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe a consultoria de valores mobiliários a prestação dos serviços de orientação, recomendação e aconselhamento, de forma profissional, independente e individualizada, sobre investimentos no mercado de valores mobiliários, cuja adoção e implementação sejam exclusivas do cliente.

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no art. 6º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria nº 402/2008, art. 15, inciso III, alínea "a".

Os RPPS devem estar adequados às normativas pertinentes e principalmente a Portaria nº 519, de 24 de agosto de 2011 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021 e suas alterações, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.