

# Relatório Analítico dos Investimentos

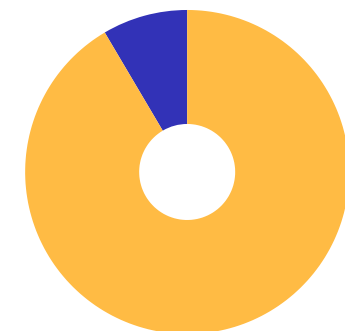
em junho, 2º trimestre e 1º semestre de 2020

**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        | 1.650.604,88         | 10,63%             | 600      | 0,02%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '  |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE... | D+1        | Não há        | 760.322,08           | 4,90%              | 884      | 0,01%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '  |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN... | D+1        | Não há        | 2.329.836,00         | 15,00%             | 670      | 0,04%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '  |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN... | D+1        | Não há        | 48.441,19            | 0,31%              | 714      | 0,00%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '  |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA      | D+0        | Não há        | 2.307.126,71         | 14,86%             | 763      | 0,02%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '  |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F... | D+0        | Não há        | 1.115.504,43         | 7,18%              | 912      | 0,01%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '  |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ... | D+0        | Não há        | 1.112.569,83         | 7,16%              | 340      | 0,06%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '  |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | D+0        | Não há        | 560.055,18           | 3,61%              | 901      | 0,01%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '  |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F... | D+0        | Não há        | 2.545.545,39         | 16,39%             | 1.364    | 0,02%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '  |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO      | D+0        | Não há        | 200.540,35           | 1,29%              | 742      | 0,01%            | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA        | D+0        | Não há        | 1.578.829,66         | 10,17%             | 318      | 0,30%            | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' |
| CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕ... | D+33       | Não há        | 518.755,92           | 3,34%              | 154      | 0,06%            | Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' |
| BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP                | D+4        | Não há        | 488.270,91           | 3,14%              | 203      | 0,10%            | Artigo 8º, Inciso III              |
| CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11        | Não se ... | Não se aplica | 312.000,00           | 2,01%              |          | 0,13%            | Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b ' |
| DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS                        | D+0        |               | 26.562,82            | 0,17%              |          | 0,00%            | DF - Artigo 6º                     |
| <b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>  |            |               | <b>15.528.402,53</b> |                    |          |                  |                                    |
| DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS                        |            |               | <b>26.562,82</b>     | Artigo 6º          |          |                  |                                    |
| <b>PL Total</b>                                     |            |               | <b>15.554.965,35</b> |                    |          |                  |                                    |

**Enquadramento e Política de Investimento (RENTA FIXA) - base (Junho / 2020)**

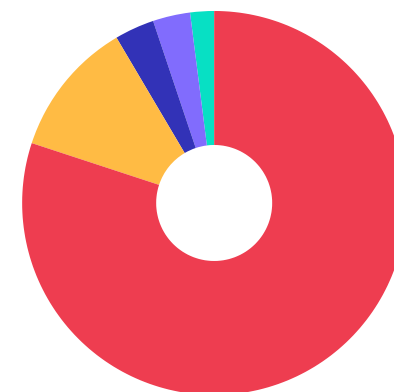
| Artigos - Renda Fixa              | Resolução      | Carteira \$          | Carteira      | Estratégia de Alocação - 2020 |               |                | GAP Superior  |
|-----------------------------------|----------------|----------------------|---------------|-------------------------------|---------------|----------------|---------------|
|                                   |                |                      |               | Inf                           | Alvo          | Sup            |               |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'   | 100,00%        | 0,00                 | 0,00%         | 0,00%                         | 0,00%         | 100,00%        | 15.528.402,53 |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'   | 100,00%        | 12.430.005,69        | 80,05%        | 40,00%                        | 65,00%        | 100,00%        | 3.098.396,84  |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'   | 100,00%        | 0,00                 | 0,00%         | 0,00%                         | 1,00%         | 100,00%        | 15.528.402,53 |
| Artigo 7º, Inciso II              | 5,00%          | 0,00                 | 0,00%         | 0,00%                         | 0,00%         | 5,00%          | 776.420,13    |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a' | 60,00%         | 0,00                 | 0,00%         | 0,00%                         | 1,00%         | 60,00%         | 9.317.041,52  |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b' | 60,00%         | 0,00                 | 0,00%         | 0,00%                         | 0,00%         | 60,00%         | 9.317.041,52  |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'  | 40,00%         | 1.779.370,01         | 11,46%        | 0,00%                         | 15,00%        | 40,00%         | 4.431.991,00  |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'b'  | 40,00%         | 0,00                 | 0,00%         | 0,00%                         | 1,00%         | 40,00%         | 6.211.361,01  |
| Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'   | 20,00%         | 0,00                 | 0,00%         | 0,00%                         | 0,00%         | 20,00%         | 3.105.680,51  |
| Artigo 7º, Inciso VI, Alínea 'a'  | 15,00%         | 0,00                 | 0,00%         | 0,00%                         | 0,00%         | 15,00%         | 2.329.260,38  |
| Artigo 7º, Inciso VI, Alínea 'b'  | 15,00%         | 0,00                 | 0,00%         | 0,00%                         | 0,00%         | 15,00%         | 2.329.260,38  |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a' | 5,00%          | 0,00                 | 0,00%         | 0,00%                         | 1,00%         | 5,00%          | 776.420,13    |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b' | 5,00%          | 0,00                 | 0,00%         | 0,00%                         | 1,00%         | 5,00%          | 776.420,13    |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'c' | 5,00%          | 0,00                 | 0,00%         | 0,00%                         | 0,00%         | 5,00%          | 776.420,13    |
| <b>Total Renda Fixa</b>           | <b>100,00%</b> | <b>14.209.375,70</b> | <b>91,51%</b> | <b>40,00%</b>                 | <b>85,00%</b> | <b>570,00%</b> |               |



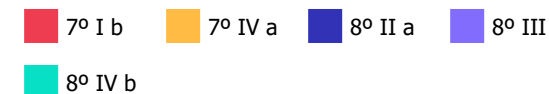
RENTA FIXA 14.209.375,70  
RENTA VARIÁVEL 1.319.026,83

**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%        | 0,00                | 0,00%        | 0,00%                         | 1,00%         | 30,00%         | 4.658.520,76 |
| Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'b'  | 30,00%        | 0,00                | 0,00%        | 0,00%                         | 2,00%         | 30,00%         | 4.658.520,76 |
| Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a' | 20,00%        | 518.755,92          | 3,34%        | 0,00%                         | 1,00%         | 20,00%         | 2.586.924,59 |
| Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'b' | 20,00%        | 0,00                | 0,00%        | 0,00%                         | 2,00%         | 20,00%         | 3.105.680,51 |
| Artigo 8º, Inciso III            | 10,00%        | 488.270,91          | 3,14%        | 0,00%                         | 5,00%         | 10,00%         | 1.064.569,34 |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a' | 5,00%         | 0,00                | 0,00%        | 0,00%                         | 0,00%         | 5,00%          | 776.420,13   |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b' | 5,00%         | 312.000,00          | 2,01%        | 0,00%                         | 1,00%         | 5,00%          | 464.420,13   |
| <b>Total Renda Variável</b>      | <b>30,00%</b> | <b>1.319.026,83</b> | <b>8,49%</b> | <b>0,00%</b>                  | <b>12,00%</b> | <b>120,00%</b> |              |



| Artigos - Exterior    | Resolução     | Carteira \$ | Carteira     | Estratégia de Alocação - Limite - 2020 |              |               | GAP Superior |
|-----------------------|---------------|-------------|--------------|----------------------------------------|--------------|---------------|--------------|
|                       |               |             |              | Inferior                               | Alvo         | Superior      |              |
| Artigo 9º, Inciso I   | 10,00%        | 0,00        | 0,00%        | 0,00%                                  | 0,00%        | 10,00%        | 1.552.840,25 |
| Artigo 9º, Inciso II  | 10,00%        | 0,00        | 0,00%        | 0,00%                                  | 1,00%        | 10,00%        | 1.552.840,25 |
| Artigo 9º, Inciso III | 10,00%        | 0,00        | 0,00%        | 0,00%                                  | 2,00%        | 10,00%        | 1.552.840,25 |
| <b>Total Exterior</b> | <b>10,00%</b> | <b>0,00</b> | <b>0,00%</b> | <b>0,00%</b>                           | <b>3,00%</b> | <b>30,00%</b> |              |



**Enquadramento por Gestores - base (Junho / 2020)**

| Gestão                     | Valor         | % S/ Carteira | % S/ PL Gestão |
|----------------------------|---------------|---------------|----------------|
| CAIXA DTVM                 | 10.050.387,12 | 64,72         | -              |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM | 5.478.015,41  | 35,28         | 0,00           |

**Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos**

| Artigos | Estratégia de Alocação - 2020 |            | Limite Inferior (%) | Limite Superior (%) |
|---------|-------------------------------|------------|---------------------|---------------------|
|         | Carteira \$                   | Carteira % |                     |                     |

**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)

**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>IMA Geral ex-C (Benchmark)</b>                       | 0,90% | 1,71%  | 2,74% | 1,71%  | 6,19% | 22,95% | -       | -                |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO         | 0,95% | 1,75%  | 2,96% | 1,75%  | 6,31% | 23,30% | 1,27%   | 0,04%            |
| <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% | 0,81%   | 0,03%            |
| <b>IMA-B 5+ (Benchmark)</b>                             | 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%            |
| <b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>                              | 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%            |
| <b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>                              | 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%            |
| <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% | 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%            |
| <b>IRF-M (Benchmark)</b>                                | 0,79% | 4,86%  | 3,39% | 4,86%  | 9,64% | 27,08% | -       | -                |

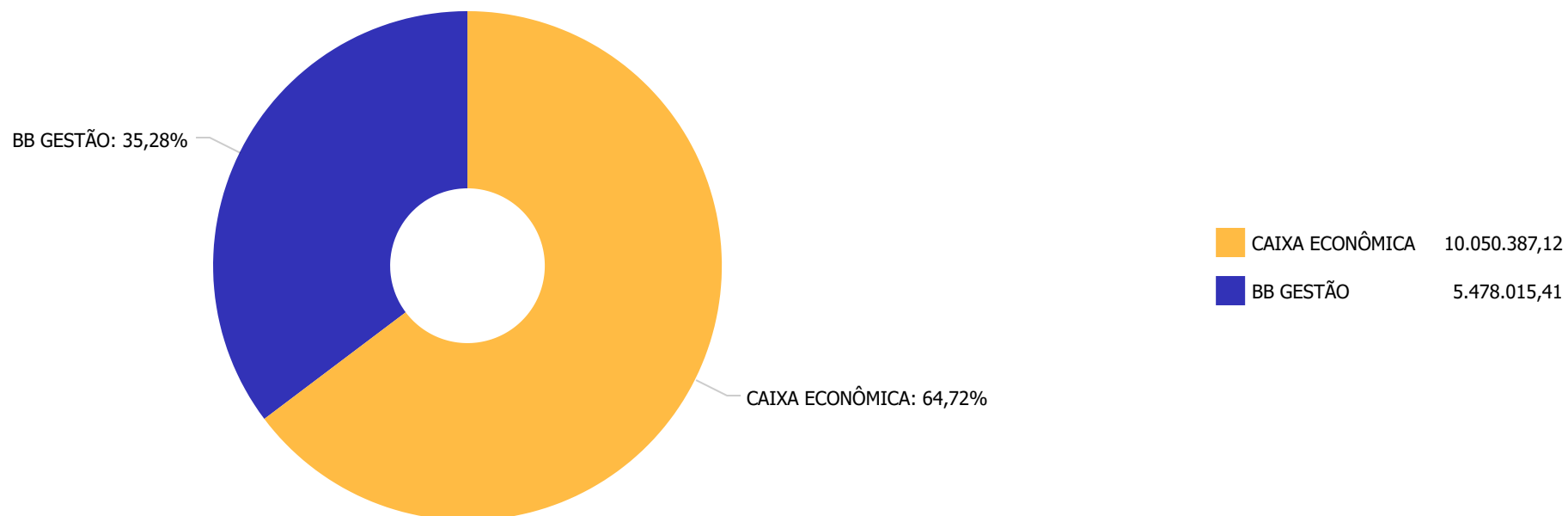
**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2020 - RENDA FIXA**

|                                                        | Mês   | Ano   | 3M     | 6M    | 12M   | 24M    | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|--------------------------------------------------------|-------|-------|--------|-------|-------|--------|---------|------------------|
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,77% | 4,68% | 3,26%  | 4,68% | 9,51% | 26,49% | 1,17%   | 0,02%            |
| <b>CDI (Benchmark)</b>                                 | 0,21% | 1,75% | 0,73%  | 1,75% | 4,58% | 11,21% | -       | -                |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO         | 0,13% | 1,24% | 0,49%  | 1,24% | 3,50% | 8,88%  | 0,01%   | 0,00%            |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA           | 0,15% | 1,34% | 0,54%  | 1,34% | 3,73% | 9,38%  | 0,01%   | 0,00%            |
| <b>IPCA (Benchmark)</b>                                | 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%            |

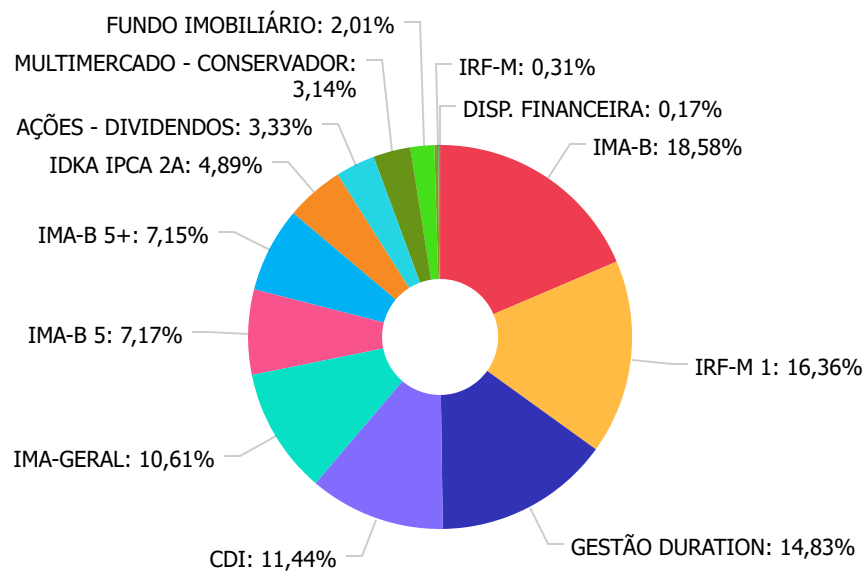
**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2020 - RENDA VARIÁVEL**

|                                                    | Mês    | Ano     | 3M     | 6M      | 12M    | 24M     | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|----------------------------------------------------|--------|---------|--------|---------|--------|---------|---------|------------------|
| <b>IDIV (Benchmark)</b>                            | 8,95%  | -18,38% | 18,70% | -18,38% | 0,08%  | 47,52%  | -       | -                |
| CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES | 4,58%  | -16,79% | 20,57% | -16,79% | -2,34% | 45,79%  | 12,48%  | 0,33%            |
| <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%  | 0,86%   | 0,02%            |
| <b>IFIX (Benchmark)</b>                            | 5,59%  | -12,24% | 12,52% | -12,24% | 6,76%  | 32,05%  | -       | -                |
| 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)

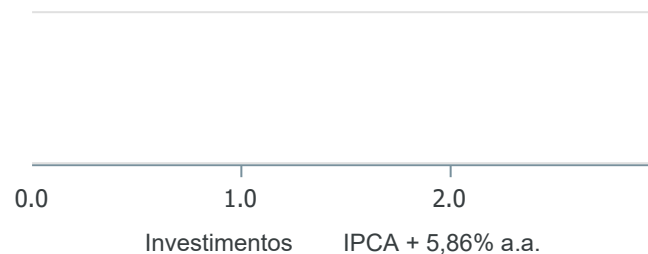


|                            |              |
|----------------------------|--------------|
| IMA-B                      | 2.889.891,18 |
| IRF-M 1                    | 2.545.545,39 |
| GESTÃO DURATION            | 2.307.126,71 |
| CDI                        | 1.779.370,01 |
| IMA-GERAL                  | 1.650.604,88 |
| IMA-B 5                    | 1.115.504,43 |
| IMA-B 5+                   | 1.112.569,83 |
| IDKA IPCA 2A               | 760.322,08   |
| AÇÕES - DIVIDENDOS         | 518.755,92   |
| MULTIMERCADO - CONSERVADOR | 488.270,91   |
| FUNDO IMOBILIÁRIO          | 312.000,00   |
| IRF-M                      | 48.441,19    |
| DISP. FINANCEIRA           | 26.562,82    |

**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   | 16.229.616,55  | 246.698,29 | 268.048,28 | 16.332.298,43 | 124.031,87  | 124.031,87   | 0,76%       | 0,76%        | 0,71%    | 0,71%     | 107,72%  | 1,56% |
| Fevereiro | 16.332.298,43  | 184.885,64 | 350.726,70 | 16.136.321,71 | -30.135,66  | 93.896,21    | -0,18%      | 0,58%        | 0,66%    | 1,37%     | 42,13%   | 2,27% |
| Março     | 16.136.321,71  | 371.591,93 | 352.528,53 | 15.542.541,37 | -612.843,74 | -518.947,53  | -3,79%      | -3,24%       | 0,57%    | 1,95%     | -166,06% | 9,46% |
| Abril     | 15.542.541,37  | 160.375,83 | 543.638,79 | 15.329.161,40 | 169.882,99  | -349.064,54  | 1,09%       | -2,18%       | 0,14%    | 2,09%     | -104,10% | 5,51% |
| Mai       | 15.329.161,40  | 281.579,80 | 402.126,59 | 15.408.783,35 | 200.168,74  | -148.895,80  | 1,31%       | -0,90%       | 0,07%    | 2,17%     | -41,64%  | 2,46% |
| Junho     | 15.408.783,35  | 210.692,59 | 319.171,54 | 15.528.402,53 | 228.098,13  | 79.202,33    | 1,48%       | 0,56%        | 0,74%    | 2,92%     | 19,35%   | 2,09% |

Investimentos x Meta de Rentabilidade



Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

☐ 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

☐ 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

ANO

36M

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... | 1.081.979,65         | 0,00              | 0,00              | 1.112.569,83         | 30.590,18         | 2,83%        | 2,83%      | 4,98%        |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ... | 548.938,11           | 0,00              | 0,00              | 560.055,18           | 11.117,07         | 2,03%        | 2,03%      | 2,99%        |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI... | 2.283.715,27         | 0,00              | 0,00              | 2.329.836,00         | 46.120,73         | 2,02%        | 2,02%      | 2,98%        |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC... | 751.209,81           | 0,00              | 0,00              | 760.322,08           | 9.112,27          | 1,21%        | 1,21%      | 0,81%        |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 1.103.382,48         | 0,00              | 0,00              | 1.115.504,43         | 12.121,95         | 1,10%        | 1,10%      | 0,91%        |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO       | 1.635.092,89         | 0,00              | 0,00              | 1.650.604,88         | 15.511,99         | 0,95%        | 0,95%      | 1,27%        |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI... | 48.070,10            | 0,00              | 0,00              | 48.441,19            | 371,09            | 0,77%        | 0,77%      | 1,17%        |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA        | 2.289.960,91         | 0,00              | 0,00              | 2.307.126,71         | 17.165,80         | 0,75%        | 0,75%      | 1,17%        |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 2.538.964,07         | 0,00              | 0,00              | 2.545.545,39         | 6.581,32          | 0,26%        | 0,26%      | 0,05%        |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA          | 1.864.236,75         | 2.000,00          | 290.059,00        | 1.578.829,66         | 2.651,91          | 0,14%        | 0,14%      | 0,01%        |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO        | 20.788,29            | 208.692,59        | 29.112,54         | 200.540,35           | 172,01            | 0,07%        | 0,13%      | 0,01%        |
| <b>Total Renda Fixa</b>                               | <b>14.166.338,33</b> | <b>210.692,59</b> | <b>319.171,54</b> | <b>14.209.375,70</b> | <b>151.516,32</b> | <b>1,07%</b> |            | <b>1,46%</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 RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11       | 260.400,00          | 0,00        | 0,00        | 312.000,00          | 51.600,00        | 19,82%       | 20,00%     | 15,34%       |
| CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES | 496.023,42          | 0,00        | 0,00        | 518.755,92          | 22.732,50        | 4,58%        | 4,58%      | 12,48%       |
| BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP               | 486.021,60          | 0,00        | 0,00        | 488.270,91          | 2.249,31         | 0,46%        | 0,46%      | 0,86%        |
| <b>Total Renda Variável</b>                        | <b>1.242.445,02</b> | <b>0,00</b> | <b>0,00</b> | <b>1.319.026,83</b> | <b>76.581,81</b> | <b>6,16%</b> |            | <b>8,86%</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... | 2.221.101,19   | 0,00       | 0,00                    | 2.329.836,00 | 108.734,81        | 4,90%        | 4,90%      |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA        | 2.233.991,91   | 0,00       | 0,00                    | 2.307.126,71 | 73.134,80         | 3,27%        | 3,27%      |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI... | 1.050.824,98   | 0,00       | 0,00                    | 1.112.569,83 | 61.744,85         | 5,88%        | 5,88%      |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO       | 1.603.118,27   | 0,00       | 0,00                    | 1.650.604,88 | 47.486,61         | 2,96%        | 2,96%      |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 1.075.627,89   | 0,00       | 0,00                    | 1.115.504,43 | 39.876,54         | 3,71%        | 3,71%      |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 2.518.114,82   | 0,00       | 0,00                    | 2.545.545,39 | 27.430,57         | 1,09%        | 1,09%      |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC... | 734.099,55     | 0,00       | 0,00                    | 760.322,08   | 26.222,53         | 3,57%        | 3,57%      |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ... | 533.865,44     | 0,00       | 0,00                    | 560.055,18   | 26.189,74         | 4,91%        | 4,91%      |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA          | 2.322.706,91   | 5.363,50   | 760.183,00              | 1.578.829,66 | 10.942,25         | 0,47%        | 0,54%      |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI... | 97.291,60      | 0,00       | 50.000,00               | 48.441,19    | 1.149,59          | 1,18%        | 3,26%      |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO        | 7.626,44       | 647.284,72 | 454.753,92              | 200.540,35   | 383,11            | 0,06%        | 0,49%      |
|                                                       |                |            | <b>Total Renda Fixa</b> |              | <b>423.295,40</b> | <b>2,81%</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 EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES | 430.253,21     | 0,00       | 0,00     | 518.755,92                  | 88.502,71         | 20,57%        | 20,57%     |
| CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11       | 233.998,00     | 0,00       | 0,00     | 312.000,00                  | 78.002,00         | 33,33%        | 34,34%     |
| BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP               | 479.921,16     | 0,00       | 0,00     | 488.270,91                  | 8.349,75          | 1,74%         | 1,74%      |
|                                                    |                |            |          | <b>Total Renda Variável</b> | <b>174.854,46</b> | <b>15,28%</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 FIC RENDA FIXA        | 2.205.129,07   | 0,00         | 0,00                    | 2.307.126,71 | 101.997,64        | 4,63%        | 4,63%      |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 2.483.842,88   | 0,00         | 0,00                    | 2.545.545,39 | 61.702,51         | 2,48%        | 2,48%      |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 1.082.569,43   | 0,00         | 0,00                    | 1.115.504,43 | 32.935,00         | 3,04%        | 3,04%      |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA          | 2.217.646,35   | 92.371,22    | 760.267,00              | 1.578.829,66 | 29.079,09         | 1,26%        | 1,34%      |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO       | 1.622.212,35   | 0,00         | 0,00                    | 1.650.604,88 | 28.392,53         | 1,75%        | 1,75%      |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC... | 739.006,23     | 0,00         | 0,00                    | 760.322,08   | 21.315,85         | 2,88%        | 2,88%      |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI... | 294.256,94     | 0,00         | 250.000,00              | 48.441,19    | 4.184,25          | 1,42%        | 4,68%      |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO        | 61.198,05      | 1.363.452,86 | 1.225.973,43            | 200.540,35   | 1.862,87          | 0,13%        | 1,24%      |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ... | 570.760,77     | 0,00         | 0,00                    | 560.055,18   | -10.705,59        | -1,88%       | -1,88%     |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI... | 2.371.292,68   | 0,00         | 0,00                    | 2.329.836,00 | -41.456,68        | -1,75%       | -1,75%     |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI... | 1.176.517,59   | 0,00         | 0,00                    | 1.112.569,83 | -63.947,76        | -5,44%       | -5,44%     |
|                                                       |                |              | <b>Total Renda Fixa</b> |              | <b>165.359,71</b> | <b>1,02%</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 RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11       | 297.998,00     | 0,00       | 0,00     | 312.000,00                  | 14.002,00         | 4,70%         | 4,71%      |
| BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP               | 483.769,68     | 0,00       | 0,00     | 488.270,91                  | 4.501,23          | 0,93%         | 0,93%      |
| CAIXA EXPERT VINCI VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES | 623.416,53     | 0,00       | 0,00     | 518.755,92                  | -104.660,61       | -16,79%       | -16,79%    |
|                                                    |                |            |          | <b>Total Renda Variável</b> | <b>-86.157,38</b> | <b>-6,13%</b> |            |

## 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.