

Relatório Analítico dos Investimentos

em julho de 2020

Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			1.999.745,94	1,87%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	9.369.821,98	8,75%	593	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+0	15/08/2022	4.212.825,29	3,93%	95	0,82%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVI...	D+0	15/08/2024	842.298,14	0,79%	140	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	15/08/2022	553.583,18	0,52%	165	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	D+0	15/08/2022	633.008,89	0,59%	45	0,32%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.449.241,46	3,22%	122	0,40%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI...	D+1	Não há	1.182.546,89	1,10%	113	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	9.940.350,50	9,28%	791	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	13.975.427,43	13,05%	959	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	2.958.195,50	2,76%	342	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	3.797.579,13	3,55%	95	0,31%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	D+2	Não há	1.406.806,91	1,31%	23.039	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	D+0	Não há	11.750.029,81	10,97%	305	0,39%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	274.368,50	0,26%	751	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO H NILO FI RENDA FIXA	D+4	Não há	2.028.796,38	1,89%	25	0,23%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	1.933.417,15	1,81%	16.043	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	D+1009	Não há	771.894,70	0,72%	28	1,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.043.378,52	0,97%	114	0,11%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	921.207,26	0,86%	26	1,33%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2020)

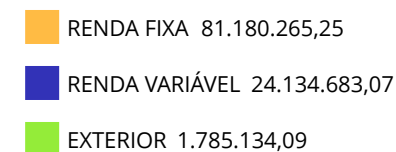
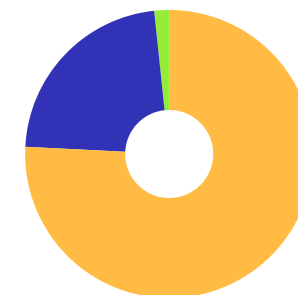
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	2.535.040,71	2,37%	31	0,92%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL	D+1260	Não há	1.959.436,86	1,83%	19	3,46%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	67.283,02	0,06%	70	0,09%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIV...	D+0	18/04/2018	3.573.981,10	3,34%	71	1,94%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.450.764,82	1,35%	1.610	0,16%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	D+4	Não há	629.617,13	0,59%	97	0,06%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+4	Não há	919.628,12	0,86%	46	0,11%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	2.010.393,42	1,88%	656	0,47%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BRDESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.174.852,75	2,03%	2.060	0,10%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	1.148.616,64	1,07%	2.501	0,13%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	1.317.975,34	1,23%	111	0,18%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	1.306.602,14	1,22%	160	0,03%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
MOAT CAPITAL FIC AÇÕES	D+17	Não há	4.344.147,22	4,06%	3.130	0,18%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	646.109,74	0,60%	19.189	0,01%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MUL...	D+2	01/10/2020	588.912,25	0,55%	956	0,12%	Artigo 8º, Inciso III
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	D+2	Não há	3.691.408,73	3,45%	62	0,76%	Artigo 8º, Inciso III
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	2.875.144,35	2,68%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
HAZ FII - ATCR11	Não se ...	Não se aplica	1.030.510,42	0,96%		1,43%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	1.785.134,09	1,67%	115	0,14%	Artigo 9º, Inciso III
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		9.902,75	0,01%		0,00%	DF - Artigo 6º

Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
Total para cálculo dos limites da Resolução			107.100.082,41				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			9.902,75				Artigo 6º
PL Total			107.109.985,16				

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Julho / 2020)

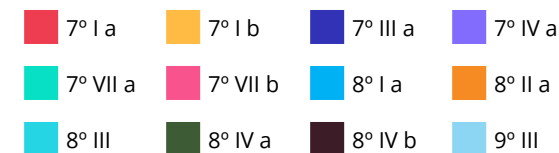
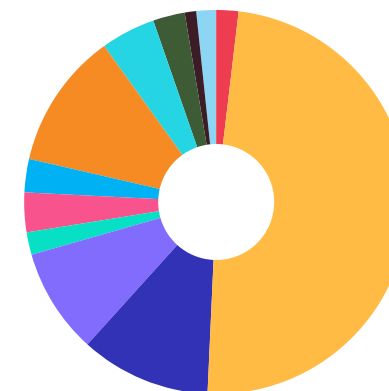
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	1.999.745,94	1,87%	0,00%	2,00%	4,00%	2.284.257,36
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	52.321.685,30	48,85%	20,00%	37,00%	100,00%	54.778.397,11
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	5.355.004,12
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	11.750.029,81	10,97%	0,00%	10,00%	40,00%	31.090.003,15
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	9.508.103,22	8,88%	10,00%	20,00%	40,00%	33.331.929,74
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	2.026.719,88	1,89%	0,00%	2,00%	5,00%	3.328.284,24
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	3.573.981,10	3,34%	0,00%	3,00%	5,00%	1.781.023,02
Total Renda Fixa	100,00%	81.180.265,25	75,80%	30,00%	74,00%	199,00%	



Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Julho / 2020)

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	30,00%	3.000.010,07	2,80%	0,00%	5,00%	10,00%	7.709.998,17
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	12.302.587,51	11,49%	5,00%	10,00%	15,00%	3.762.424,85
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	5.355.004,12
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	4.926.430,72	4,60%	0,00%	5,00%	10,00%	5.783.577,52
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	2.875.144,35	2,68%	0,00%	3,00%	5,00%	2.479.859,77
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	1.030.510,42	0,96%	0,00%	1,00%	3,00%	2.182.492,05
Total Renda Variável	30,00%	24.134.683,07	22,53%	5,00%	24,00%	48,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2020			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	1.785.134,09	1,67%	0,00%	2,00%	5,00%	3.569.870,03
Total Exterior	10,00%	1.785.134,09	1,67%	0,00%	2,00%	5,00%	



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA PRÉ 2 ANOS (Benchmark)	0,89%	7,55%	2,91%	6,54%	11,53%	28,08%	-	-
BRDESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	0,90%	7,46%	2,83%	6,45%	11,23%	27,43%	1,06%	0,02%
IMA Geral ex-C (Benchmark)	1,66%	3,39%	3,57%	2,88%	7,07%	23,27%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,77%	3,55%	3,84%	3,05%	7,10%	23,78%	1,05%	0,04%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,94%	4,31%	3,72%	3,76%	8,68%	22,37%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,78%	4,17%	4,11%	3,52%	8,70%	26,28%	0,76%	0,04%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,83%	3,98%	3,96%	3,50%	8,10%	20,93%	0,77%	0,03%
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	0,98%	4,47%	1,98%	3,64%	9,50%	20,87%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-0,41%	-3,36%	-1,06%	-3,26%	-5,02%	1.788,12%	0,24%	0,01%
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	0,90%	3,91%	1,73%	3,16%	8,47%	18,63%	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,86%	5,47%	6,05%	4,62%	10,69%	28,48%	1,42%	0,06%
IMA Geral (Benchmark)	1,74%	3,64%	3,79%	3,07%	7,33%	23,84%	-	-
BRDESCO H NILO FI RENDA FIXA	4,62%	3,26%	8,88%	2,88%	8,89%	40,64%	2,40%	0,11%
IMA-B 5+ (Benchmark)	7,32%	1,68%	11,51%	1,64%	7,81%	49,37%	-	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7,29%	1,46%	11,43%	1,50%	7,35%	47,92%	3,79%	0,16%
120% do CDI (Benchmark)	0,23%	2,35%	0,77%	1,89%	5,08%	13,13%	-	-
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL	-0,11%	-0,67%	-0,26%	-0,61%	-0,30%	-	-	-
IMA-B 5 (Benchmark)	0,99%	4,19%	4,28%	3,61%	8,83%	24,16%	-	-
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,62%	-17,57%	-1,68%	-17,59%	-16,54%	-14,71%	1,69%	0,17%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,04%	-31,27%	-3,22%	-31,50%	-29,49%	-26,66%	0,16%	0,27%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,79%	4,21%	4,12%	3,55%	8,77%	26,46%	0,76%	0,04%
IMA-B (Benchmark)	4,39%	2,65%	8,14%	2,38%	8,16%	37,86%	-	-
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	1,39%	-1,82%	2,78%	-2,06%	0,43%	-13,57%	0,94%	0,06%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	4,78%	4,07%	8,64%	3,74%	9,92%	42,84%	2,56%	0,11%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	4,24%	1,18%	8,01%	1,53%	7,14%	36,22%	2,15%	0,10%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,32%	1,97%	2,58%	1,77%	5,74%	18,19%	0,32%	0,02%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	4,35%	2,43%	8,05%	2,19%	7,79%	36,89%	2,27%	0,10%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	4,40%	2,46%	8,09%	2,22%	7,80%	36,97%	2,27%	0,10%
CDI (Benchmark)	0,19%	1,95%	0,64%	1,57%	4,21%	10,83%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,10%	1,35%	0,39%	1,06%	3,13%	8,50%	0,00%	0,00%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,01%	0,10%	0,03%	0,07%	0,39%	1,58%	0,00%	0,00%
IPCA (Benchmark)	0,36%	0,46%	0,24%	0,25%	2,31%	5,60%	-	-
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,54%	2,53%	1,36%	2,18%	6,41%	20,46%	0,33%	0,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,72%	3,26%	3,69%	2,82%	7,54%	23,01%	0,64%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,98%	5,65%	3,14%	4,79%	9,68%	28,24%	0,92%	0,03%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	1,28%	6,44%	2,81%	5,30%	13,09%	28,89%	-	-
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	-	-	-	-	-	-	-	-
Global BDRX (Benchmark)	1,77%	34,78%	9,44%	26,60%	55,42%	70,67%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1,88%	35,34%	9,28%	27,06%	55,47%	69,34%	8,52%	0,19%
IBX-50 (Benchmark)	8,15%	-11,06%	29,00%	-9,35%	0,23%	26,69%	-	-
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	8,20%	-11,75%	29,16%	-10,31%	0,13%	24,18%	10,67%	0,39%
IBX (Benchmark)	8,41%	-10,43%	28,20%	-9,30%	2,17%	33,69%	-	-
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	8,23%	-8,64%	24,69%	-10,09%	9,43%	58,19%	8,76%	0,41%
Ibovespa (Benchmark)	8,27%	-11,01%	27,83%	-9,54%	1,08%	29,91%	-	-
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	8,65%	-15,29%	26,32%	-14,45%	-2,38%	24,16%	9,85%	0,41%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	5,80%	-24,37%	29,49%	-25,46%	-12,43%	22,51%	11,66%	0,50%
MOAT CAPITAL FIC AÇÕES	12,57%	-0,28%	42,56%	0,39%	16,41%	68,44%	8,78%	0,51%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	8,44%	-10,49%	27,78%	-9,51%	3,49%	35,87%	9,81%	0,39%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	7,46%	-15,22%	25,57%	-14,03%	-2,29%	22,77%	9,10%	0,40%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	0,06%	1,85%	0,43%	1,53%	4,66%	-	0,02%	0,01%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	8,86%	-8,47%	27,39%	-10,22%	11,49%	61,50%	8,78%	0,40%

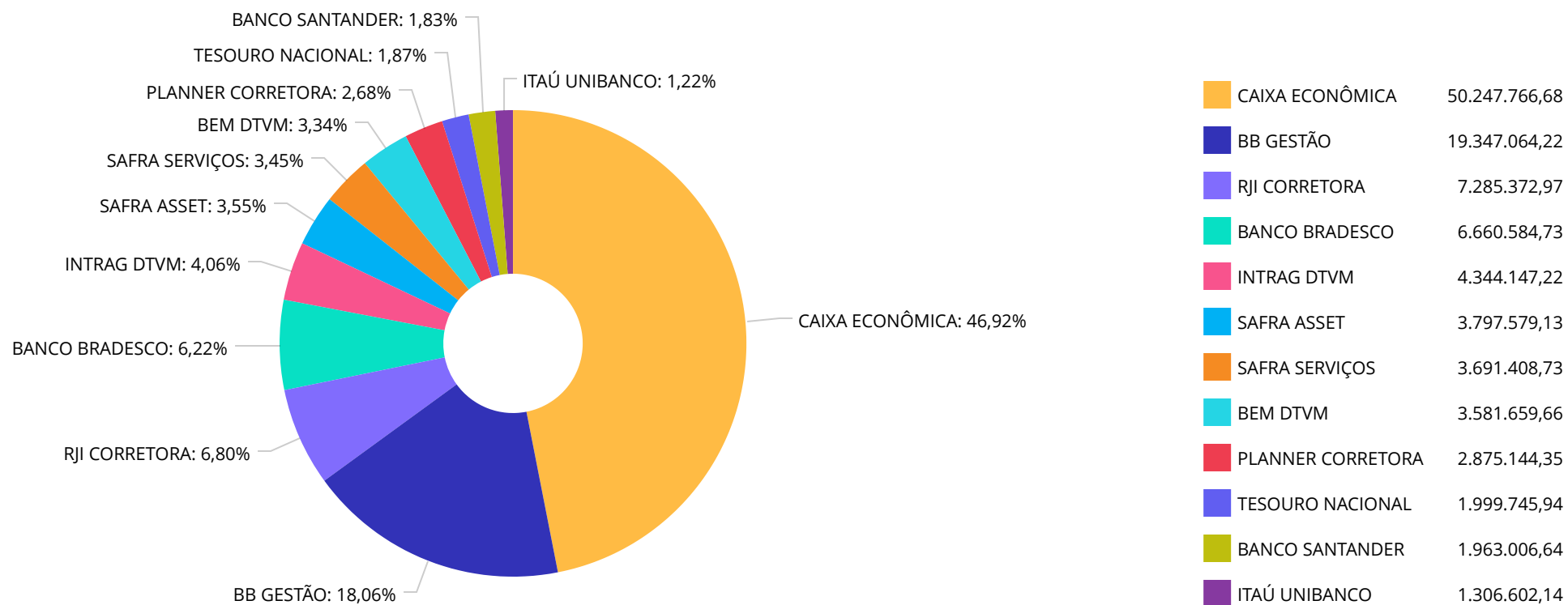
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	9,22%	-6,80%	29,18%	-9,67%	9,15%	-	8,79%	0,42%
CDI (Benchmark)	0,19%	1,95%	0,64%	1,57%	4,21%	10,83%	-	-
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	5,58%	-0,63%	12,07%	-0,99%	8,83%	19,18%	6,38%	0,23%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,41%	0,36%	4,15%	-0,32%	6,35%	24,98%	1,46%	0,07%
IFIX (Benchmark)	-2,61%	-14,53%	4,97%	-11,18%	2,77%	26,86%	-	-
HAZ FII - ATCR11	0,03%	2,39%	2,34%	2,47%	385,41%	385,41%	-	-

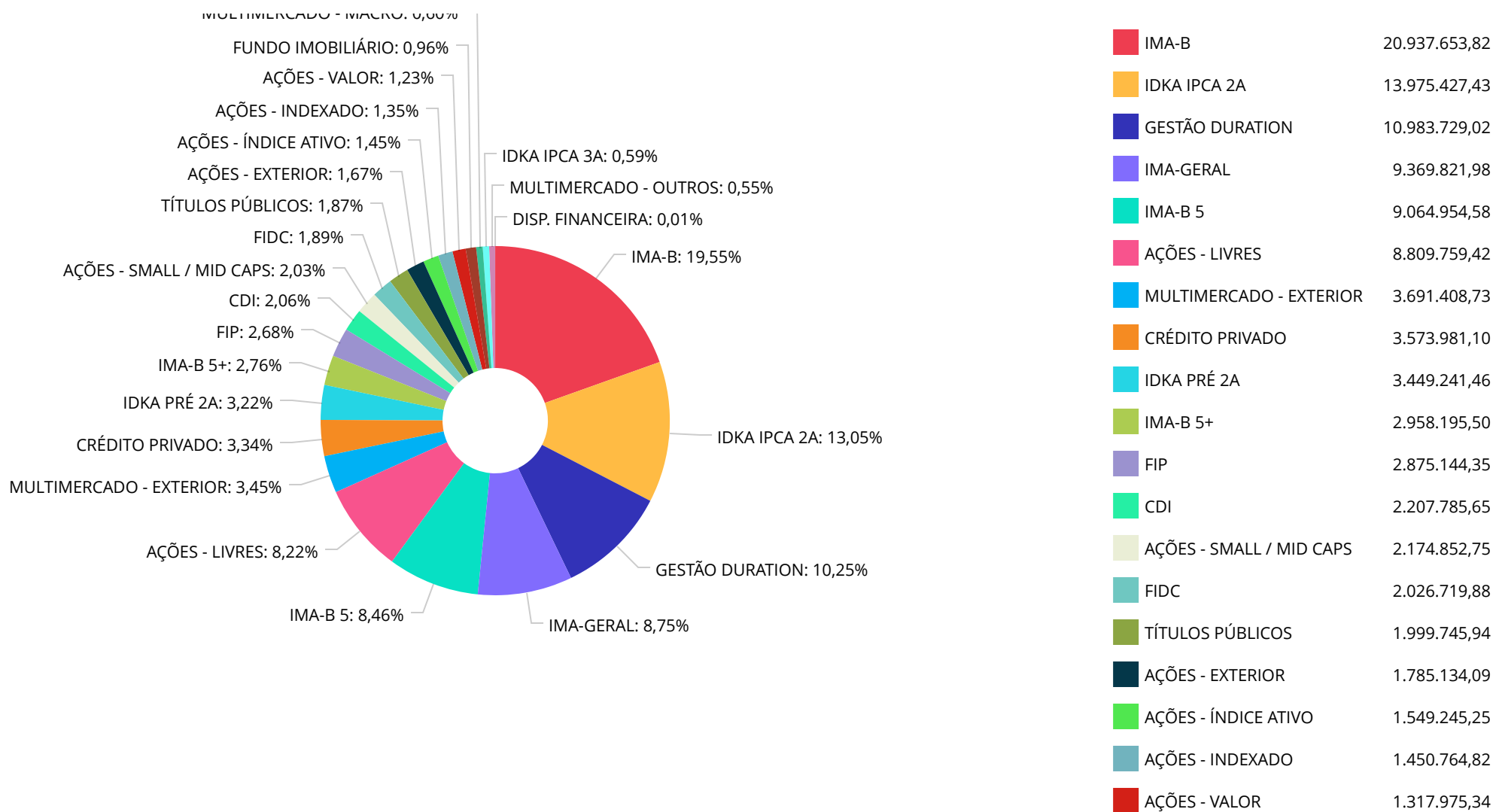
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2020 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	1,77%	34,78%	9,44%	26,60%	55,42%	70,67%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1,88%	35,34%	9,28%	27,06%	55,47%	69,34%	8,52%	0,19%

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



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



Carteira de Títulos Públicos no mês de (Julho / 2020)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	19/11/2004	500	1251,54178000	3.999,491892	625.770,89	1.999.745,95	Mercado

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	99.635.584,14	4.861.221,69	2.526.086,44	102.438.449,45	467.730,06	467.730,06	0,46%	0,46%	0,71%	0,71%	64,58%	2,32%
Fevereiro	102.438.449,45	6.314.175,40	6.165.312,69	101.269.990,09	-1.317.322,07	-849.592,01	-1,28%	-0,83%	0,66%	1,37%	-60,49%	4,50%
Março	101.269.990,09	4.333.768,86	1.816.132,29	94.684.594,25	-9.103.032,41	-9.952.624,42	-8,77%	-9,53%	0,57%	1,95%	-488,26%	18,11%
Abril	94.684.594,25	2.322.479,25	1.547.166,29	98.011.595,95	2.551.688,74	-7.400.935,68	2,67%	-7,11%	0,14%	2,10%	-339,14%	8,57%
Maio	98.011.595,95	2.362.978,29	1.824.098,35	100.855.974,91	2.305.499,02	-5.095.436,66	2,34%	-4,94%	0,07%	2,17%	-227,52%	4,50%
Junho	100.855.974,91	2.455.361,55	1.634.223,09	103.939.239,56	2.262.126,19	-2.833.310,47	2,22%	-2,82%	0,74%	2,92%	-96,54%	4,22%
Julho	103.939.239,56	4.932.066,62	4.889.000,00	107.100.082,41	3.117.776,23	284.465,76	3,00%	0,09%	0,88%	3,83%	2,37%	2,88%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



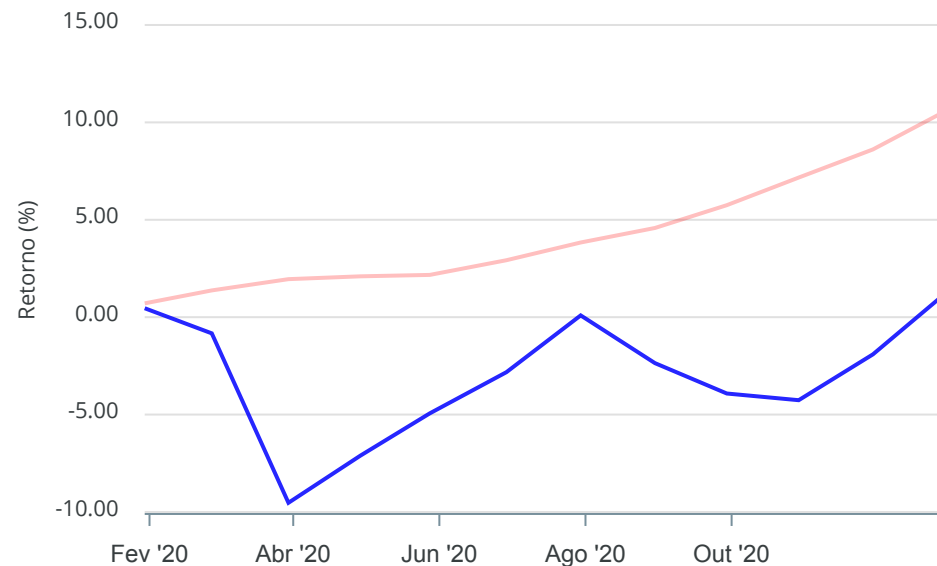
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



- 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 Julho/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...	2.757.149,78	0,00	0,00	2.958.195,50	201.045,72	7,29%	7,29%	3,79%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	3.624.436,05	0,00	0,00	3.797.579,13	173.143,08	4,78%	4,78%	2,56%
BRDESCO H NILO FI RENDA FIXA	1.939.176,36	0,00	0,00	2.028.796,38	89.620,02	4,62%	4,62%	2,40%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA...	11.255.216,97	0,00	0,00	11.750.029,81	494.812,84	4,40%	4,40%	2,27%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC ...	1.133.222,37	0,00	0,00	1.182.546,89	49.324,52	4,35%	4,35%	2,27%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	1.349.601,87	0,00	0,00	1.406.806,91	57.205,04	4,24%	4,24%	2,15%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	3.508.862,88	0,00	0,00	3.573.981,10	65.118,22	1,86%	1,86%	1,42%
TÍTULOS PÚBLICOS	1.964.582,40	0,00	0,00	1.999.745,94	35.163,54	1,79%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.207.062,39	0,00	0,00	9.369.821,98	162.759,59	1,77%	1,77%	1,05%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	761.349,38	0,00	0,00	771.894,70	10.545,32	1,39%	1,39%	0,94%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	9.844.143,53	0,00	0,00	9.940.350,50	96.206,97	0,98%	0,98%	0,92%
BRDESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	1.914.532,82	1.505.000,00	0,00	3.449.241,46	29.708,64	0,87%	0,90%	1,06%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	13.806.236,70	54.465,71	0,00	13.975.427,43	114.725,02	0,83%	0,83%	0,77%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENC...	4.179.903,07	0,00	0,00	4.212.825,29	32.922,22	0,79%	0,79%	0,76%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO...	628.093,95	0,00	0,00	633.008,89	4.914,94	0,78%	0,78%	0,76%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	836.240,85	0,00	0,00	842.298,14	6.057,29	0,72%	0,72%	0,64%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	915.551,28	0,00	0,00	921.207,26	5.655,98	0,62%	0,62%	1,69%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	1.037.830,19	0,00	0,00	1.043.378,52	5.548,33	0,53%	0,53%	0,33%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO...	551.816,87	0,00	0,00	553.583,18	1.766,31	0,32%	0,32%	0,32%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	271.537,31	2.552,45	0,00	274.368,50	278,74	0,10%	0,10%	0,00%

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	4.452.639,66	2.369.573,49	4.889.000,00	1.933.417,15	204,00	0,00%	0,01%	0,00%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2.536.145,99	0,00	0,00	2.535.040,71	-1.105,28	-0,04%	-0,04%	0,16%
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL	1.961.536,61	0,00	0,00	1.959.436,86	-2.099,75	-0,11%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	67.562,65	0,00	0,00	67.283,02	-279,63	-0,41%	-0,41%	0,24%
Total Renda Fixa	80.504.431,93	3.931.591,65	4.889.000,00	81.180.265,25	1.633.241,67	2,03%		1,35%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
MOAT CAPITAL FIC AÇÕES	3.858.930,10	0,00	0,00	4.344.147,22	485.217,12	12,57%	12,57%	8,78%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	1.051.650,43	0,00	0,00	1.148.616,64	96.966,21	9,22%	9,22%	8,79%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	1.210.660,96	0,00	0,00	1.317.975,34	107.314,38	8,86%	8,86%	8,78%
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	846.379,67	0,00	0,00	919.628,12	73.248,45	8,65%	8,65%	9,85%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	1.337.822,73	0,00	0,00	1.450.764,82	112.942,09	8,44%	8,44%	9,81%
BRDESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	2.009.476,93	0,00	0,00	2.174.852,75	165.375,82	8,23%	8,23%	8,76%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	581.924,48	0,00	0,00	629.617,13	47.692,65	8,20%	8,20%	10,67%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	1.870.785,43	0,00	0,00	2.010.393,42	139.607,99	7,46%	7,46%	9,10%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.235.001,48	0,00	0,00	1.306.602,14	71.600,66	5,80%	5,80%	11,66%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	2.543.603,90	1.000.474,97	0,00	3.691.408,73	147.329,86	4,16%	5,58%	6,38%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	637.151,64	0,00	0,00	646.109,74	8.958,10	1,41%	1,41%	1,46%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTI...	588.590,04	0,00	0,00	588.912,25	322,21	0,05%	0,05%	0,02%
HAZ FII - ATR11	1.030.205,16	0,00	0,00	1.030.510,42	305,26	0,03%	0,03%	-
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	2.880.345,95	0,00	0,00	2.875.144,35	-5.201,60	-0,18%	-	-
Total Renda Variável	21.682.528,90	1.000.474,97	0,00	24.134.683,07	1.451.679,20	6,40%		8,25%

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.752.278,73	0,00	0,00	1.785.134,09	32.855,36	1,88%	1,88%	8,52%
Total Exterior	1.752.278,73	0,00	0,00	1.785.134,09	32.855,36	1,88%		8,52%

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.