

Relatório Analítico dos Investimentos

em setembro e 3º trimestre de 2020

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TÍTULOS PÚBLICOS			1.931.806,48	1,85%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	10.265.970,64	9,83%	597	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	4.150.277,26	3,98%	95	0,82%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2024	533.569,98	0,51%	140	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	192.847,97	0,18%	165	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	15/08/2022	623.754,39	0,60%	45	0,32%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.416.837,74	3,27%	130	0,35%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+1	Não há	1.143.207,91	1,10%	114	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	10.629.256,86	10,18%	868	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	14.200.043,07	13,60%	982	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.775.082,35	2,66%	336	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	3.640.860,09	3,49%	98	0,32%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	D+2	Não há	1.364.020,23	1,31%	21.251	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMÓVEL	D+0	Não há	11.355.194,84	10,88%	304	0,40%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	10.308,32	0,01%	755	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO H NILO FI RENDA FIXA	D+4	Não há	1.955.145,55	1,87%	26	0,23%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	2.643.991,64	2,53%	16.114	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	D+1009	Não há	758.469,34	0,73%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.037.357,84	0,99%	128	0,09%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	900.221,00	0,86%	26	1,33%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2020)

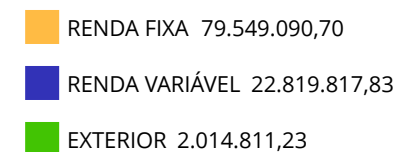
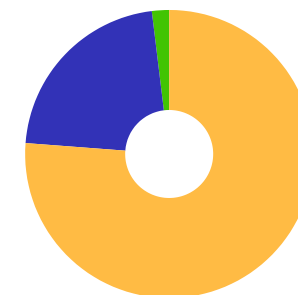
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	2.412.095,35	2,31%	31	0,92%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL	D+1260	Não há	0,01	0,00%	1	0,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	64.982,46	0,06%		0,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIV...	D+0	18/04/2018	3.543.789,38	3,39%	75	1,90%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.332.601,85	1,28%	1.637	0,15%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	D+4	Não há	578.984,78	0,55%	98	0,06%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+4	Não há	854.905,73	0,82%	43	0,11%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	1.859.237,97	1,78%	663	0,46%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BRASESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.032.696,69	1,95%	1.976	0,10%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	1.049.324,80	1,01%	2.486	0,13%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	1.218.159,82	1,17%	115	0,17%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	1.154.474,62	1,11%	155	0,04%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
MOAT CAPITAL FIC AÇÕES	D+17	Não há	3.862.754,40	3,70%	3.226	0,17%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	639.359,54	0,61%	19.995	0,01%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MUL...	D+2	01/10/2020	586.414,37	0,56%	956	0,12%	Artigo 8º, Inciso III
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	D+2	Não há	3.755.419,42	3,60%	76	0,69%	Artigo 8º, Inciso III
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	2.863.420,82	2,74%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
HAZ FII - ATCR11	Não se ...	Não se aplica	1.032.063,02	0,99%		1,43%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+4	Não há	2.014.811,23	1,93%	158	0,12%	Artigo 9º, Inciso III
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		13.246,27	0,01%		0,00%	DF - Artigo 6º

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
Total para cálculo dos limites da Resolução			104.383.719,76				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			13.246,27				Artigo 6º
PL Total			104.396.966,03				

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

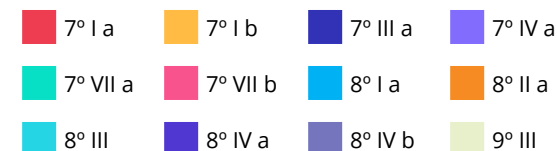
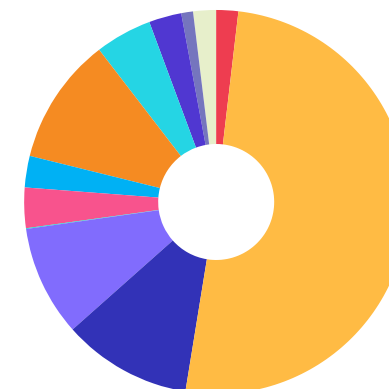
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	1.931.806,48	1,85%	0,00%	2,00%	4,00%	2.243.542,31
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	52.935.728,49	50,71%	20,00%	37,00%	100,00%	51.447.991,27
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	5.219.185,99
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	11.355.194,84	10,88%	0,00%	10,00%	40,00%	30.398.293,06
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	9.717.589,04	9,31%	10,00%	20,00%	40,00%	32.035.898,86
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	64.982,47	0,06%	0,00%	2,00%	5,00%	5.154.203,52
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	3.543.789,38	3,39%	0,00%	3,00%	5,00%	1.675.396,61
Total Renda Fixa	100,00%	79.549.090,70	76,21%	30,00%	74,00%	199,00%	



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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	30,00%	2.766.492,36	2,65%	0,00%	5,00%	10,00%	7.671.879,62
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	11.176.648,30	10,71%	5,00%	10,00%	15,00%	4.480.909,66
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	5.219.185,99
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	4.981.193,33	4,77%	0,00%	5,00%	10,00%	5.457.178,65
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	2.863.420,82	2,74%	0,00%	3,00%	5,00%	2.355.765,17
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	1.032.063,02	0,99%	0,00%	1,00%	3,00%	2.099.448,57
Total Renda Variável	30,00%	22.819.817,83	21,86%	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%	2.014.811,23	1,93%	0,00%	2,00%	5,00%	3.204.374,76
Total Exterior	10,00%	2.014.811,23	1,93%	0,00%	2,00%	5,00%	



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA PRÉ 2 ANOS (Benchmark)	-0,47%	6,67%	0,06%	3,38%	8,65%	26,43%	-	-
BRDESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	-0,55%	6,45%	-0,05%	3,09%	8,31%	25,84%	1,76%	0,03%
IMA Geral ex-C (Benchmark)	-0,71%	1,96%	0,25%	2,99%	3,90%	21,11%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,75%	1,86%	0,10%	3,07%	3,70%	21,50%	2,02%	0,04%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,02%	5,41%	1,99%	5,41%	8,00%	21,88%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,19%	5,23%	1,81%	5,65%	7,79%	27,37%	1,16%	0,03%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,04%	4,84%	1,67%	5,27%	7,35%	20,53%	1,38%	0,03%
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	1,21%	6,59%	3,03%	4,28%	10,35%	21,46%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-2,27%	-5,73%	-2,86%	-3,74%	-6,52%	-3,07%	-	-
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	1,13%	5,85%	2,78%	3,79%	9,32%	19,21%	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	-0,63%	4,58%	1,00%	6,07%	7,34%	25,93%	2,41%	0,06%
IMA Geral (Benchmark)	-0,60%	2,41%	0,53%	3,43%	4,35%	21,85%	-	-
BRDESCO H NILO FI RENDA FIXA	-1,61%	-0,49%	0,82%	6,66%	2,35%	36,71%	4,47%	0,11%
IMA-B 5+ (Benchmark)	-2,60%	-4,56%	0,75%	6,78%	-1,67%	42,42%	-	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-2,64%	-4,82%	0,65%	6,56%	-2,10%	40,98%	6,30%	0,17%
120% do CDI (Benchmark)	0,19%	2,74%	0,61%	1,50%	4,27%	12,16%	-	-
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL	0,00%	-	-	-	-	-	-	-
IMA-B 5 (Benchmark)	-0,12%	4,51%	1,30%	5,11%	7,24%	23,75%	-	-
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,01%	-19,44%	-1,67%	-3,54%	-18,88%	-16,67%	1,33%	0,17%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,32%	-34,60%	-4,89%	-7,71%	-33,21%	-29,98%	0,13%	0,27%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,20%	5,28%	1,82%	5,68%	7,86%	27,55%	1,16%	0,03%
IMA-B (Benchmark)	-1,51%	-0,72%	0,96%	5,97%	2,11%	34,14%	-	-
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	-	-3,53%	-0,38%	1,34%	-2,74%	14,77%	-	-
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	-2,12%	-0,22%	0,45%	5,97%	2,89%	38,19%	5,20%	0,11%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	-1,26%	-1,90%	1,07%	5,91%	1,30%	31,89%	3,87%	0,10%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,19%	2,64%	0,98%	3,41%	5,12%	17,74%	1,15%	0,02%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	-1,54%	-0,98%	0,88%	5,79%	1,77%	33,22%	4,13%	0,11%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-1,54%	-0,98%	0,89%	5,76%	1,73%	33,13%	4,12%	0,11%
CDI (Benchmark)	0,16%	2,28%	0,51%	1,25%	3,54%	10,04%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,00%	1,42%	0,18%	0,66%	2,40%	7,66%	0,03%	0,00%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,00%	0,11%	0,02%	0,05%	0,29%	1,39%	0,00%	0,00%
IPCA (Benchmark)	0,64%	1,34%	1,24%	0,81%	3,14%	6,12%	-	-
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	-0,23%	1,93%	-0,05%	1,22%	4,33%	18,61%	0,40%	0,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,10%	3,59%	1,05%	4,36%	6,19%	22,78%	1,55%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	-0,50%	4,53%	-0,09%	3,18%	6,41%	25,88%	1,68%	0,03%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	1,48%	9,18%	3,89%	5,97%	13,96%	29,52%	-	-
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,18%	-	-0,59%	-	-	-	-	-
Global BDRX (Benchmark)	-1,97%	51,44%	14,34%	43,02%	60,30%	70,28%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-1,99%	52,76%	14,98%	43,04%	61,21%	70,33%	15,53%	0,23%
IBX-50 (Benchmark)	-4,62%	-18,06%	-0,37%	31,30%	-10,02%	16,09%	-	-
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	-4,95%	-18,85%	-0,51%	30,59%	-10,27%	14,44%	10,91%	0,40%
IBX (Benchmark)	-4,58%	-17,42%	-0,04%	30,33%	-8,59%	23,26%	-	-
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	-5,04%	-14,61%	1,16%	33,49%	-1,67%	48,47%	10,54%	0,42%
Ibovespa (Benchmark)	-4,80%	-18,20%	-0,48%	29,56%	-9,68%	19,23%	-	-
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	-2,90%	-15,40%	0,62%	29,23%	-0,02%	56,46%	10,44%	0,41%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-5,38%	-14,86%	-0,22%	32,93%	-2,46%	-	9,30%	0,42%
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	-4,26%	-21,25%	1,01%	30,73%	-11,91%	16,72%	11,13%	0,42%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-8,03%	-33,17%	-6,52%	24,90%	-23,46%	13,87%	11,91%	0,51%
MOAT CAPITAL FIC AÇÕES	-7,68%	-11,33%	0,10%	54,04%	0,39%	59,97%	11,86%	0,52%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	-5,04%	-17,78%	-0,39%	30,27%	-8,20%	24,95%	10,36%	0,40%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	-4,38%	-21,59%	-0,62%	27,14%	-12,24%	12,08%	9,88%	0,40%

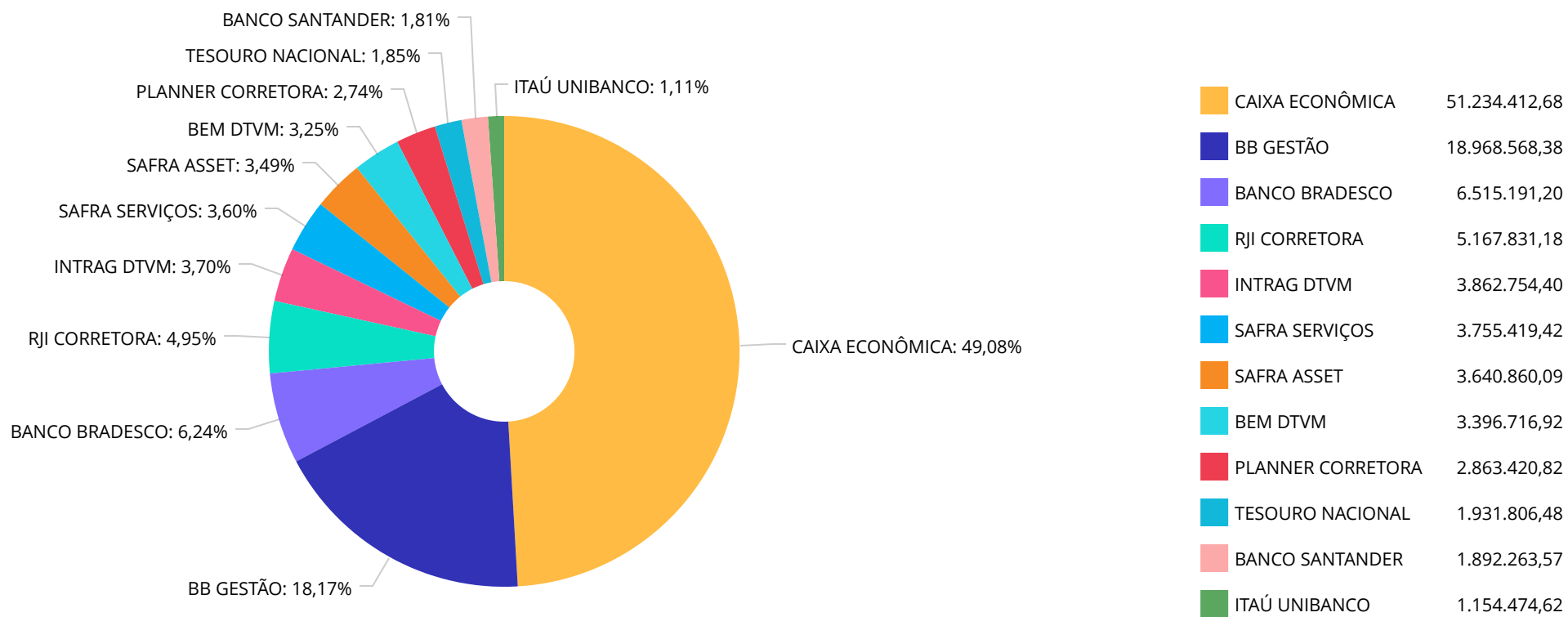
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	-0,45%	1,42%	-0,37%	0,25%	2,97%	15,39%	0,18%	0,01%
CDI (Benchmark)	0,16%	2,28%	0,51%	1,25%	3,54%	10,04%	-	-
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	-4,80%	1,10%	7,41%	27,36%	9,96%	16,39%	10,72%	0,24%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	-0,91%	-0,69%	0,35%	5,77%	3,05%	22,65%	1,88%	0,07%
IFIX (Benchmark)	0,46%	-12,59%	-0,41%	12,06%	4,12%	30,92%	-	-
HAZ FII - ATR11	0,12%	2,54%	0,18%	2,39%	386,15%	386,15%	-	-

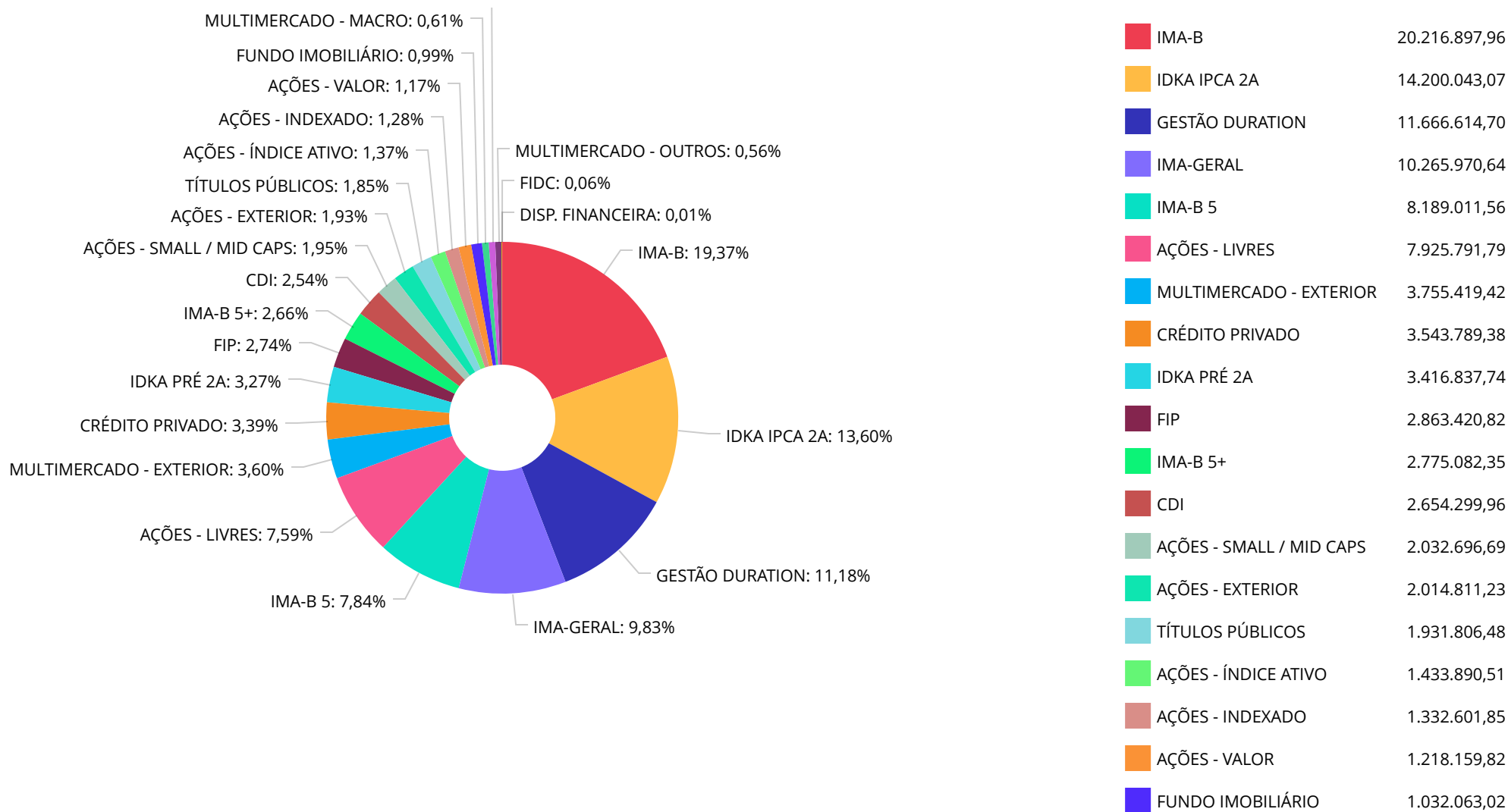
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2020 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	-1,97%	51,44%	14,34%	43,02%	60,30%	70,28%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-1,99%	52,76%	14,98%	43,04%	61,21%	70,33%	15,53%	0,23%

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



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



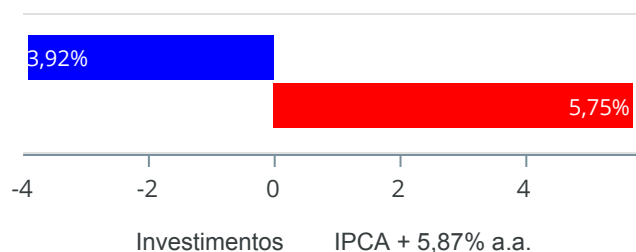
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Setembro / 2020)

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	3.863,612977	625.770,89	1.931.806,49	Mercado

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2020

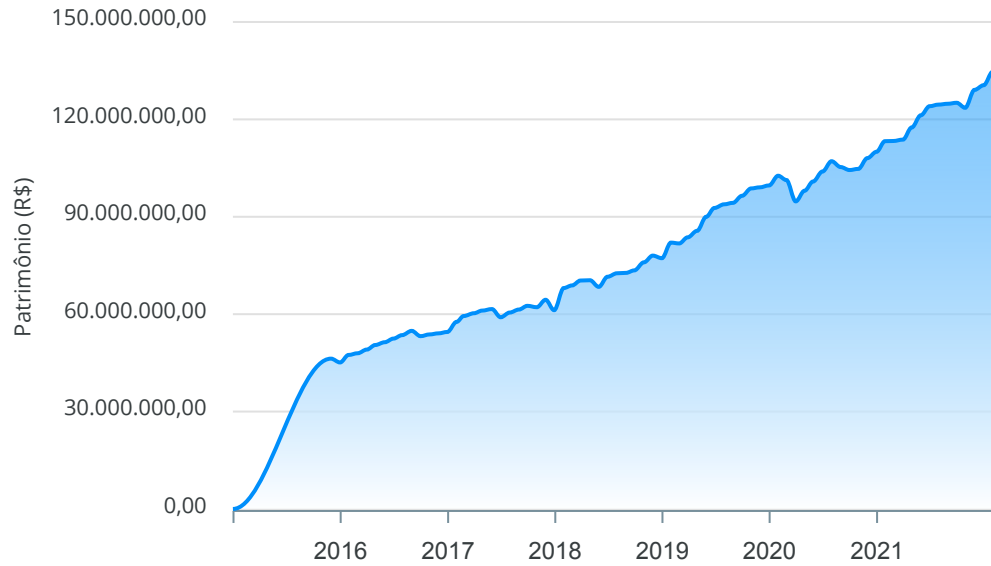
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	99.635.584,14	4.861.221,69	2.526.086,44	102.438.449,45	467.730,06	467.730,06	0,46%	0,46%	0,71%	0,71%	64,58%	2,32%
Fevereiro	102.438.449,45	6.314.175,40	6.165.312,69	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%
Mai	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%
Agosto	107.100.082,41	3.208.329,90	2.426.855,83	105.240.952,93	-2.640.603,55	-2.356.137,79	-2,45%	-2,36%	0,72%	4,58%	-51,52%	2,85%
Setembro	105.240.952,93	4.278.855,95	3.441.030,00	104.383.719,76	-1.695.059,12	-4.051.196,91	-1,60%	-3,92%	1,12%	5,75%	-68,17%	4,17%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



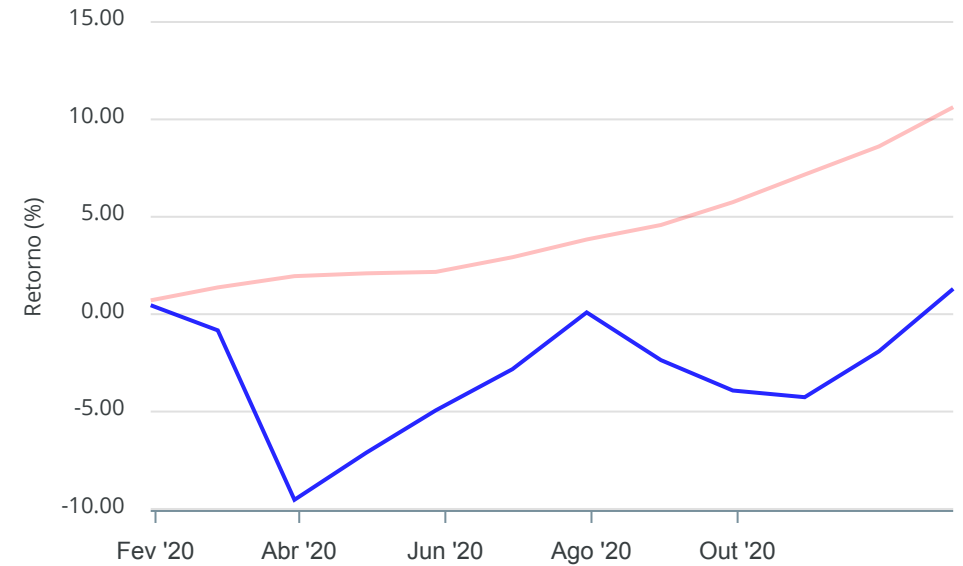
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
- 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 Setembro/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENC...	4.142.146,35	0,00	0,00	4.150.277,26	8.130,91	0,20%	0,20%	1,16%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRI...	622.558,46	0,00	0,00	623.754,39	1.195,93	0,19%	0,19%	1,16%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	192.480,42	0,00	0,00	192.847,97	367,55	0,19%	0,19%	1,15%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	14.140.609,56	54.465,71	0,00	14.200.043,07	4.967,80	0,03%	0,04%	1,38%
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	900.116,87	0,00	0,00	900.221,00	104,13	0,01%	0,01%	1,33%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	1.070.199,67	0,00	1.060.000,00	10.308,32	108,65	0,01%	0,00%	0,03%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	2.660.541,62	2.364.390,24	2.381.030,00	2.643.991,64	89,78	0,00%	0,00%	0,00%
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	534.127,34	0,00	0,00	533.569,98	-557,36	-0,10%	-0,10%	1,55%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	1.039.698,37	0,00	0,00	1.037.357,84	-2.340,53	-0,23%	-0,23%	0,40%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2.419.924,95	0,00	0,00	2.412.095,35	-7.829,60	-0,32%	-0,32%	0,13%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	9.884.967,04	800.000,00	0,00	10.629.256,86	-55.710,18	-0,52%	-0,50%	1,68%
BRASESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	3.435.747,10	0,00	0,00	3.416.837,74	-18.909,36	-0,55%	-0,55%	1,76%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	3.566.253,79	0,00	0,00	3.543.789,38	-22.464,41	-0,63%	-0,63%	2,41%
TÍTULOS PÚBLICOS	1.946.469,08	0,00	0,00	1.931.806,48	-14.662,60	-0,75%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.286.547,67	1.060.000,00	0,00	10.265.970,64	-80.577,03	-0,78%	-0,75%	2,02%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	1.381.475,59	0,00	0,00	1.364.020,23	-17.455,36	-1,26%	-1,26%	3,87%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	11.532.658,81	0,00	0,00	11.355.194,84	-177.463,97	-1,54%	-1,54%	4,12%
BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC ...	1.161.084,45	0,00	0,00	1.143.207,91	-17.876,54	-1,54%	-1,54%	4,13%
BRASESCO H NILO FI RENDA FIXA	1.987.202,39	0,00	0,00	1.955.145,55	-32.056,84	-1,61%	-1,61%	4,47%

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	771.894,67	0,00	0,00	758.469,34	-13.425,33	-1,74%	-	-
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	3.719.529,54	0,00	0,00	3.640.860,09	-78.669,45	-2,12%	-2,12%	5,20%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	2.850.418,98	0,00	0,00	2.775.082,35	-75.336,63	-2,64%	-2,64%	6,30%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	67.140,33	0,00	0,00	64.982,46	-2.157,87	-3,21%	-	-
Total Renda Fixa	79.313.793,06	4.278.855,95	3.441.030,00	79.549.090,70	-602.528,31	-0,75%		2,39%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
HAZ FII - ATCR11	1.030.781,24	0,00	0,00	1.032.063,02	1.281,78	0,12%	0,12%	-
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	2.868.494,07	0,00	0,00	2.863.420,82	-5.073,25	-0,18%	-	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTI...	589.046,05	0,00	0,00	586.414,37	-2.631,68	-0,45%	-0,45%	0,18%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	645.227,04	0,00	0,00	639.359,54	-5.867,50	-0,91%	-0,91%	1,88%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	1.254.485,77	0,00	0,00	1.218.159,82	-36.325,95	-2,90%	-2,90%	10,44%
SANTANDER IBOVSPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	892.900,02	0,00	0,00	854.905,73	-37.994,29	-4,26%	-4,26%	11,13%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	1.944.368,22	0,00	0,00	1.859.237,97	-85.130,25	-4,38%	-4,38%	9,88%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	3.944.602,05	0,00	0,00	3.755.419,42	-189.182,63	-4,80%	-4,80%	10,72%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	609.147,56	0,00	0,00	578.984,78	-30.162,78	-4,95%	-4,95%	10,91%
BRABESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	2.140.531,25	0,00	0,00	2.032.696,69	-107.834,56	-5,04%	-5,04%	10,54%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	1.403.396,08	0,00	0,00	1.332.601,85	-70.794,23	-5,04%	-5,04%	10,36%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	1.108.961,34	0,00	0,00	1.049.324,80	-59.636,54	-5,38%	-5,38%	9,30%
MOAT CAPITAL FIC AÇÕES	4.184.090,70	0,00	0,00	3.862.754,40	-321.336,30	-7,68%	-7,68%	11,86%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.255.318,54	0,00	0,00	1.154.474,62	-100.843,92	-8,03%	-8,03%	11,91%
Total Renda Variável	23.871.349,93	0,00	0,00	22.819.817,83	-1.051.532,10	-4,40%		10,20%

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2.055.809,94	0,00	0,00	2.014.811,23	-40.998,71	-1,99%	-1,99%	15,53%
Total Exterior	2.055.809,94	0,00	0,00	2.014.811,23	-40.998,71	-1,99%		15,53%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	13.806.236,70	163.397,13	0,00	14.200.043,07	230.409,24	1,65%	1,66%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA...	11.255.216,97	0,00	0,00	11.355.194,84	99.977,87	0,89%	0,89%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENC...	4.179.903,07	0,00	105.473,61	4.150.277,26	75.847,80	1,81%	1,82%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	3.508.862,88	0,00	0,00	3.543.789,38	34.926,50	1,00%	1,00%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	2.757.149,78	0,00	0,00	2.775.082,35	17.932,57	0,65%	0,65%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	3.624.436,05	0,00	0,00	3.640.860,09	16.424,04	0,45%	0,45%
BRADESCO H NILO FI RENDA FIXA	1.939.176,36	0,00	0,00	1.955.145,55	15.969,19	0,82%	0,82%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	1.349.601,87	0,00	0,00	1.364.020,23	14.418,36	1,07%	1,07%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRI...	628.093,95	0,00	15.639,76	623.754,39	11.300,20	1,80%	1,81%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC ...	1.133.222,37	0,00	0,00	1.143.207,91	9.985,54	0,88%	0,88%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	836.240,85	0,00	311.148,26	533.569,98	8.477,39	1,01%	1,05%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	551.816,87	0,00	363.094,20	192.847,97	4.125,30	0,75%	0,98%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	271.537,31	797.908,28	1.060.000,00	10.308,32	862,73	0,08%	0,18%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	4.452.639,66	7.092.472,09	8.901.530,00	2.643.991,64	409,89	0,00%	0,02%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	1.037.830,19	0,00	0,00	1.037.357,84	-472,35	-0,05%	-0,05%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.207.062,39	1.060.000,00	0,00	10.265.970,64	-1.091,75	-0,01%	0,10%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	67.562,65	0,00	0,00	64.982,46	-2.580,19	-3,82%	-2,86%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	1.914.532,82	1.505.000,00	0,00	3.416.837,74	-2.695,08	-0,08%	-0,05%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	761.349,38	0,00	0,00	758.469,34	-2.880,04	-0,38%	-0,38%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	9.844.143,53	800.000,00	0,00	10.629.256,86	-14.886,67	-0,14%	-0,09%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
TOWER II IMA-B 5 FI RENDA FIXA	915.551,28	0,00	0,00	900.221,00	-15.330,28	-1,67%	-1,67%
TÍTULOS PÚBLICOS	1.964.582,40	0,00	0,00	1.931.806,48	-32.775,92	-1,67%	-
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2.536.145,99	0,00	0,00	2.412.095,35	-124.050,64	-4,89%	-4,89%
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL	1.961.536,61	0,00	0,00	0,01	-1.961.536,60	-100,00%	-100,00%
				Total Renda Fixa	-1.617.232,90	-1,99%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre/2020

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.752.278,73	0,00	0,00	2.014.811,23	262.532,50	14,98%	14,98%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	2.543.603,90	1.000.474,97	0,00	3.755.419,42	211.340,55	5,96%	7,41%
BRDESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	2.009.476,93	0,00	0,00	2.032.696,69	23.219,76	1,16%	1,16%
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	846.379,67	0,00	0,00	854.905,73	8.526,06	1,01%	1,01%
CAIXA EXPERT VINCI VALOR RPPS FIC AÇÕES	1.210.660,96	0,00	0,00	1.218.159,82	7.498,86	0,62%	0,62%
MOAT CAPITAL FIC AÇÕES	3.858.930,10	0,00	0,00	3.862.754,40	3.824,30	0,10%	0,10%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	637.151,64	0,00	0,00	639.359,54	2.207,90	0,35%	0,35%
HAZ FII - ATCR11	1.030.205,16	0,00	0,00	1.032.063,02	1.857,86	0,18%	0,18%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTI...	588.590,04	0,00	0,00	586.414,37	-2.175,67	-0,37%	-0,37%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	1.051.650,43	0,00	0,00	1.049.324,80	-2.325,63	-0,22%	-0,22%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	581.924,48	0,00	0,00	578.984,78	-2.939,70	-0,51%	-0,51%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	1.337.822,73	0,00	0,00	1.332.601,85	-5.220,88	-0,39%	-0,39%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	1.870.785,43	0,00	0,00	1.859.237,97	-11.547,46	-0,62%	-0,62%
W7 FIP MULTIESTRATÉGIA	2.880.345,95	0,00	0,00	2.863.420,82	-16.925,13	-0,59%	-0,59%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.235.001,48	0,00	0,00	1.154.474,62	-80.526,86	-6,52%	-6,52%
				Total Renda Variável	399.346,46	1,63%	

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.