

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

Relatório Analítico dos Investimentos

em setembro e 3º trimestre de 2020

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2020)

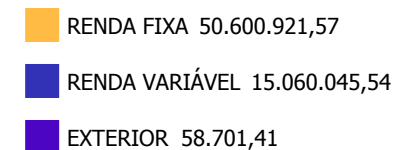
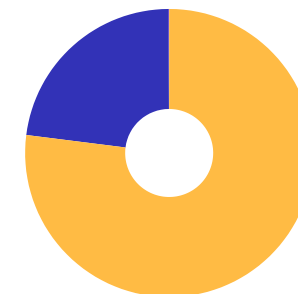
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	7.610.784,05	11,58%	868	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	1.325.877,38	2,02%	463	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	4.681.054,83	7,12%	953	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	3.063.542,88	4,66%	982	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	4.080.996,12	6,21%	903	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	4.413.162,11	6,72%	597	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	1.534.233,20	2,33%	1.239	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	1.727.821,11	2,63%	714	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	3.266.471,43	4,97%	1.361	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	3.087.440,84	4,70%	648	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	4.076.407,85	6,20%	290	0,09%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	346.026,41	0,53%	121	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	253.792,81	0,39%	586	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	175.309,28	0,27%	677	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAU IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	324.510,32	0,49%	104	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.534.026,18	2,33%	271	0,11%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1 du	Não há	371.634,82	0,57%	89	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3 du	Não há	3.590.879,05	5,46%	387	0,17%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	5.136.950,90	7,82%	194	0,37%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.260.389,12	1,92%	6.917	0,77%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BRADESCO PLUS IBOVESPA FI AÇÕES	D+3	Não há	793.772,13	1,21%	53	0,23%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	D+15	Não há	1.125.849,43	1,71%	61	0,46%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	D+4	Não há	581.662,36	0,89%	1.976	0,03%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	1.229.485,84	1,87%	155	0,04%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	2.030.190,62	3,09%	205	0,29%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	1.358.707,76	2,07%	1.630	0,16%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES	D+23	Não há	1.272.680,44	1,94%	37.510	0,07%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	192.776,39	0,29%	20.023	0,01%	Artigo 8º, Inciso III
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	1.353.342,03	2,06%	197	0,30%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	1.454.536,58	2,21%	85	0,18%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	2.406.652,84	3,66%	19.995	0,05%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	D+4	Não há	58.701,41	0,09%	158	0,00%	Artigo 9º - A, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			65.719.668,52				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Setembro / 2020)

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nível 1	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%	10,00%	6.571.966,85
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	34.791.383,95	52,94%	20,00%	50,00%	90,00%	24.356.317,72
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	65,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	60,00%	39.431.801,11
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	45,00%	15.809.537,62	24,06%	10,00%	15,00%	40,00%	10.478.329,79
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.285.983,43
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.285.983,43
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	3.285.983,43
Total Renda Fixa	100,00%	50.600.921,57	77,00%	30,00%	70,00%	215,00%	



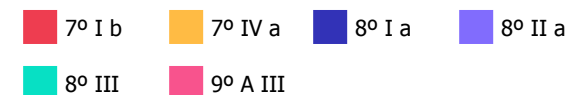
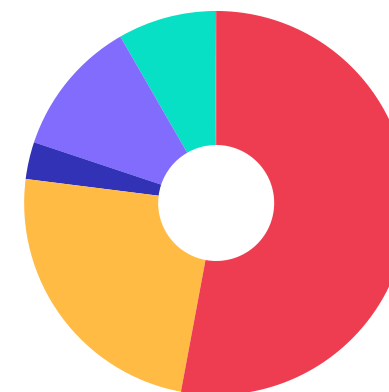
ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.695/18 em seus Artigo 7º § 10º e Artigo 8º § 10º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!



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

Artigos - Renda Variável	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	35,00%	2.054.161,25	3,13%	0,00%	3,00%	10,00%	4.517.805,60
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	25,00%	7.598.576,45	11,56%	5,00%	15,00%	20,00%	5.545.357,25
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	5.407.307,84	8,23%	3,00%	10,00%	10,00%	1.164.659,01
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	3.285.983,43
Total Renda Variável	35,00%	15.060.045,54	22,92%	8,00%	30,00%	45,00%	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2020			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	58.701,41	0,09%	0,00%	0,00%	1,00%	598.495,28
Total Exterior	10,00%	58.701,41	0,09%	0,00%	0,00%	1,00%	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	25.733.191,32	39,16	0,00
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	24.194.790,33	36,82	0,00
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	8.888.602,42	13,53	0,00
ITAÚ UNIBANCO	6.903.084,45	10,50	0,00

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

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2020		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	34.791.383,95	52,94	20,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	15.809.537,62	24,06	10,00	40,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	2.054.161,25	3,13	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	7.598.576,45	11,56	5,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	5.407.307,84	8,23	3,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso III	58.701,41	0,09	0,00	1,00

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
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%	0,02%	0,04%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,02%	5,41%	1,99%	5,41%	8,00%	21,88%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,11%	4,55%	1,61%	5,24%	7,28%	20,27%	0,01%	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%	0,01%	0,03%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,15%	3,12%	0,51%	1,66%	4,54%	12,32%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,04%	2,83%	0,36%	1,43%	4,17%	11,70%	0,00%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,13%	2,97%	0,47%	1,57%	4,34%	11,93%	0,00%	0,01%
IMA-B 5 (Benchmark)	-0,12%	4,51%	1,30%	5,11%	7,24%	23,75%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,16%	4,29%	1,21%	4,96%	6,91%	23,18%	0,02%	0,04%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	-0,15%	4,30%	1,18%	4,93%	6,95%	23,16%	0,02%	0,04%
IMA-B (Benchmark)	-1,51%	-0,72%	0,96%	5,97%	2,11%	34,14%	-	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,57%	-1,05%	0,91%	5,82%	1,71%	33,16%	0,04%	0,11%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	-1,60%	-0,80%	0,92%	6,12%	2,03%	34,42%	0,04%	0,11%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	-1,67%	0,38%	0,73%	5,96%	3,18%	37,20%	0,04%	0,10%

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
IRF-M (Benchmark)	-0,56%	4,62%	-0,24%	3,15%	6,56%	24,50%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,66%	4,32%	-0,35%	2,90%	6,21%	23,82%	0,02%	0,03%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,61%	4,41%	-0,30%	3,01%	6,31%	24,12%	0,02%	0,03%

CDI (Benchmark)	0,16%	2,28%	0,51%	1,25%	3,54%	10,04%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00%	1,77%	0,39%	0,97%	2,90%	9,20%	0,00%	0,00%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,02%	1,82%	0,44%	1,22%	2,98%	9,27%	0,00%	0,00%

IPCA (Benchmark)	0,64%	1,34%	1,24%	0,81%	3,14%	6,12%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,23%	2,47%	0,20%	1,32%	3,69%	17,87%	0,00%	0,01%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	-0,50%	4,53%	-0,09%	3,18%	6,41%	25,88%	0,02%	0,03%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,98%	1,62%	-0,16%	2,97%	3,46%	20,62%	0,02%	0,04%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,88%	-	-0,03%	2,85%	-	-	0,02%	-
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	-0,59%	-	-0,01%	-	-	-	0,02%	-

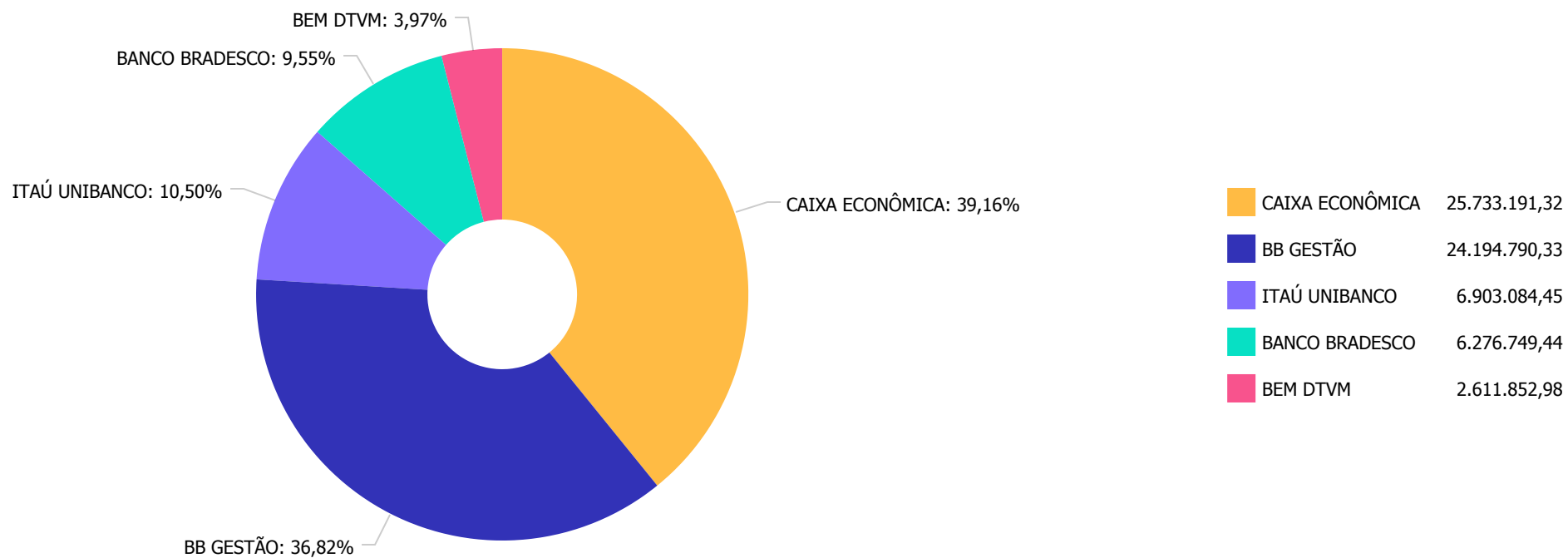
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Ibovespa (Benchmark)	-4,80%	-18,20%	-0,48%	29,56%	-9,68%	19,23%	-	-
BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	-4,50%	-15,72%	0,03%	31,28%	-7,57%	19,79%	0,10%	0,38%
BRADESCO PLUS IBOVESPA FI AÇÕES	-4,81%	-18,40%	-0,56%	29,33%	-9,91%	18,74%	0,11%	0,39%
ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES	-4,00%	-11,63%	3,54%	35,88%	-0,77%	43,28%	0,12%	0,40%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-8,03%	-33,17%	-6,52%	24,90%	-23,46%	13,87%	0,12%	0,51%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-4,77%	-19,95%	-2,30%	22,29%	-9,26%	41,30%	0,10%	0,36%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	-2,74%	-20,15%	5,81%	32,85%	-12,72%	15,23%	0,10%	0,40%
CDI (Benchmark)	0,16%	2,28%	0,51%	1,25%	3,54%	10,04%	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	-0,77%	0,10%	-0,82%	0,90%	2,47%	11,09%	0,01%	0,02%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	-2,05%	-3,54%	-0,45%	8,24%	0,88%	14,18%	0,03%	0,11%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	-0,91%	-0,69%	0,35%	5,77%	3,05%	22,65%	0,02%	0,07%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	-2,47%	-14,37%	-0,68%	29,13%	0,95%	-	0,12%	0,39%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	-1,61%	-1,00%	0,64%	9,72%	-	-	0,03%	-
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	-5,04%	-14,61%	1,16%	33,49%	-1,67%	48,47%	0,11%	0,42%

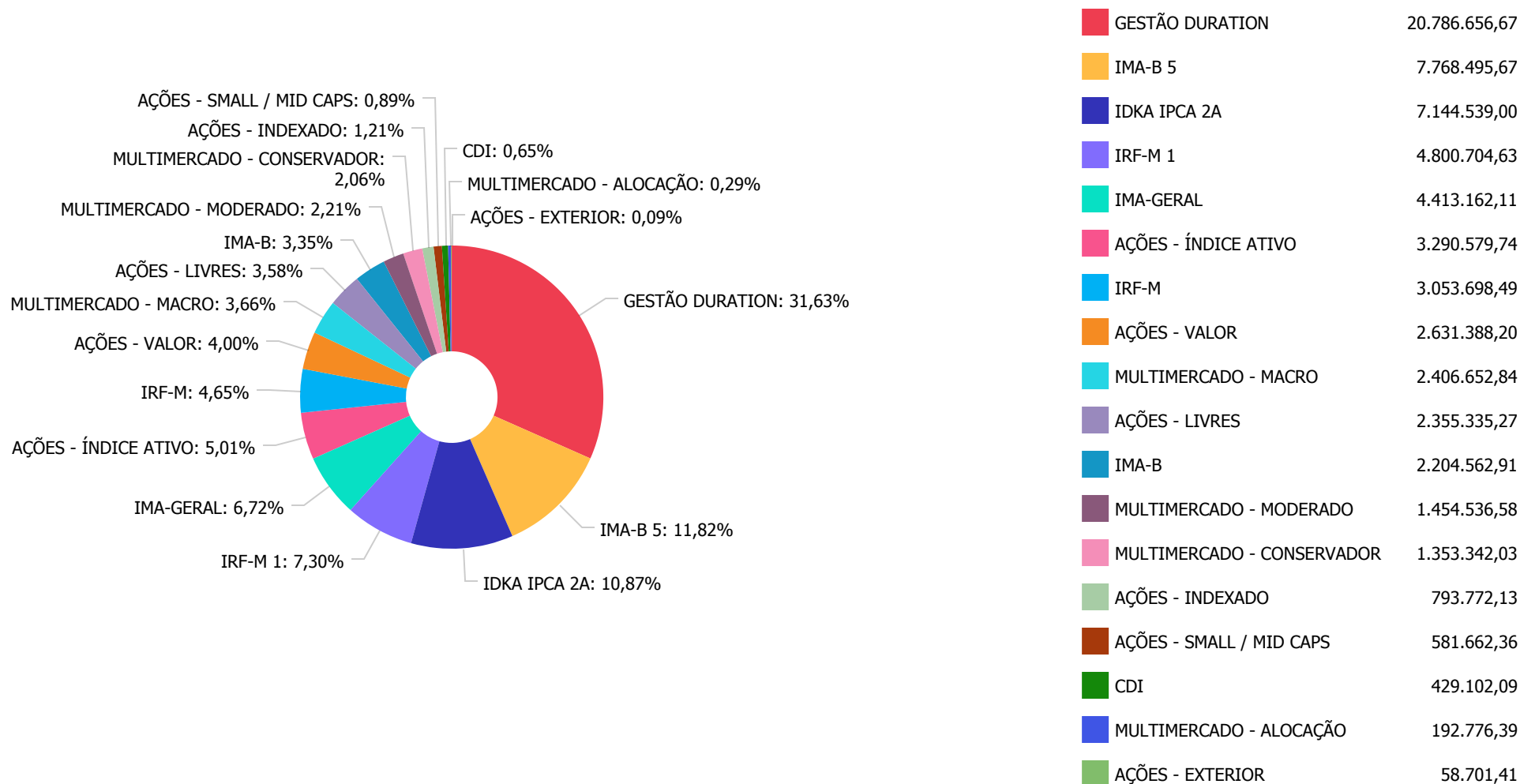
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2020 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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 BDR NÍVEL I FI AÇÕES	-1,99%	52,76%	14,98%	43,04%	61,21%	70,33%	0,16%	0,23%

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



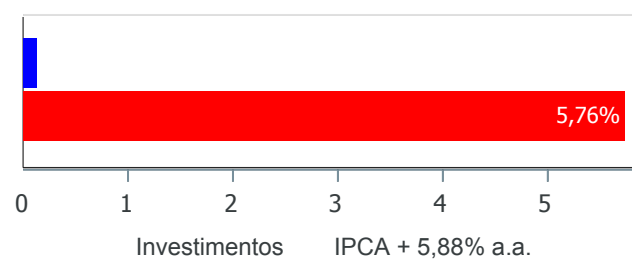
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Setembro / 2020)



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

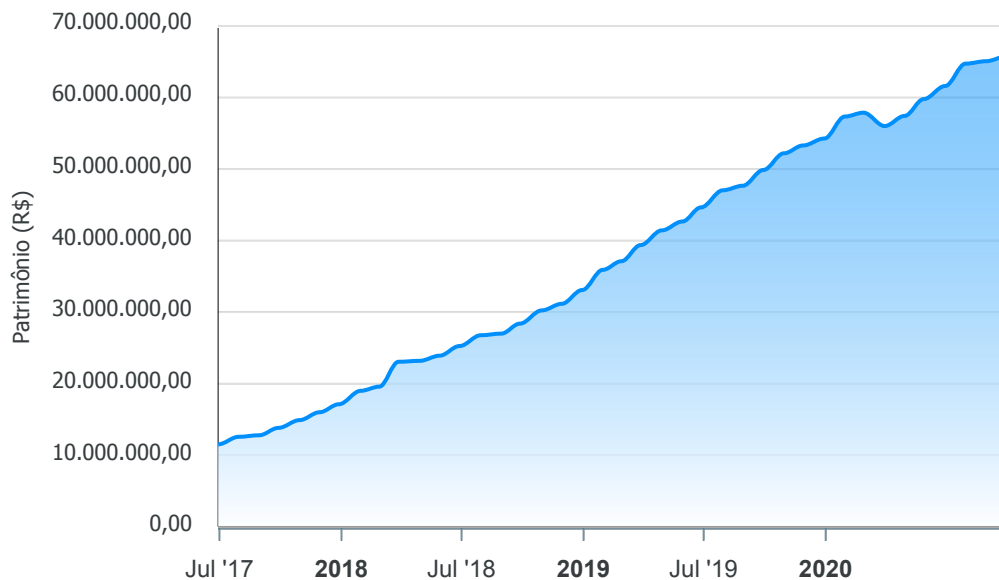
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	54.269.143,32	3.873.858,42	1.050.077,24	57.342.913,30	249.988,80	249.988,80	0,44%	0,44%	0,71%	0,71%	61,58%	1,57%
Fevereiro	57.342.913,30	3.585.545,94	2.597.355,99	57.839.541,87	-491.561,38	-241.572,58	-0,84%	-0,41%	0,66%	1,38%	-29,70%	2,88%
Março	57.839.541,87	1.452.002,00	107.308,09	56.010.479,82	-3.173.755,96	-3.415.328,54	-5,36%	-5,75%	0,57%	1,95%	-294,22%	11,37%
Abril	56.010.479,82	432.509,84	99.539,65	57.248.662,93	905.212,92	-2.510.115,62	1,61%	-4,23%	0,14%	2,10%	-201,67%	5,72%
Mai	57.248.662,93	2.438.209,30	1.135.517,06	59.787.400,05	1.236.044,88	-1.274.070,74	2,11%	-2,21%	0,07%	2,17%	-101,80%	3,17%
Junho	59.787.400,05	1.600.755,44	1.110.311,35	61.471.243,03	1.193.398,89	-80.671,85	1,98%	-0,28%	0,74%	2,93%	-9,47%	2,71%
Julho	61.471.243,03	1.677.544,06	183.618,44	64.332.265,33	1.367.096,68	1.286.424,83	2,17%	1,89%	0,88%	3,84%	49,17%	2,33%
Agosto	64.332.265,33	1.257.100,23	90.716,66	65.076.189,58	-422.459,32	863.965,51	-0,64%	1,23%	0,72%	4,59%	26,84%	2,31%
Setembro	65.076.189,58	1.453.773,28	87.159,66	65.719.668,52	-723.134,68	140.830,83	-1,09%	0,13%	1,12%	5,76%	2,24%	3,02%

Investimentos x Meta Atuarial



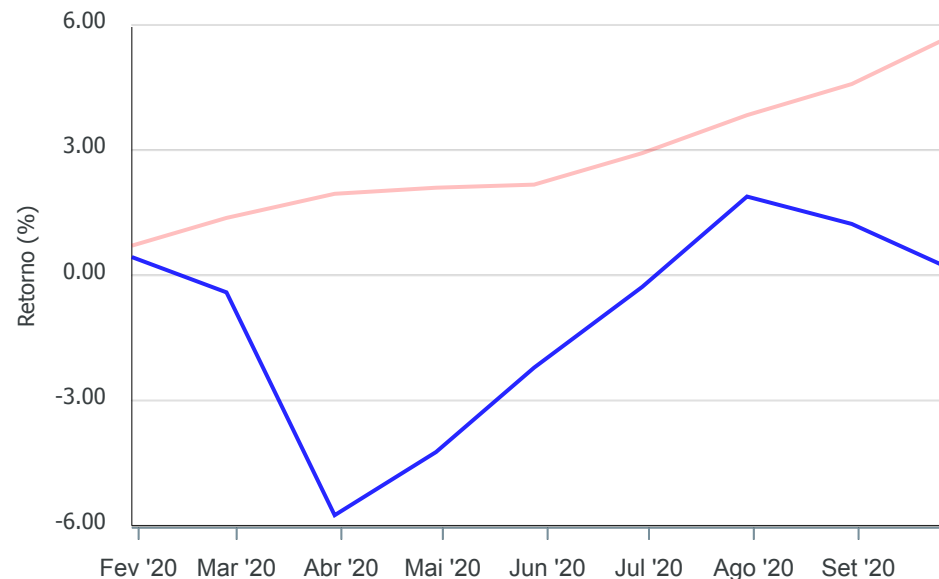
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



- Investimentos Meta Atuarial CDI IMA-B IMA-B 5
- IMA-B 5+ IMA Geral IRF-M IRF-M 1 IRF-M 1+
- Ibovespa IBX SMLL IDIV

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

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.262.122,02	0,00	0,00	3.266.471,43	4.349,41	0,13%	0,13%	0,12%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	4.076.344,58	0,00	0,00	4.080.996,12	4.651,54	0,11%	0,11%	1,35%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.533.577,56	0,00	0,00	1.534.233,20	655,64	0,04%	0,04%	0,15%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	3.062.418,22	0,00	0,00	3.063.542,88	1.124,66	0,04%	0,04%	1,38%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	286.481,10	4.255,60	37.021,47	253.792,81	77,58	0,03%	0,02%	0,06%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	53.328,71	172.217,46	50.138,19	175.309,28	-98,70	-0,04%	0,00%	0,10%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.092.191,79	0,00	0,00	3.087.440,84	-4.750,95	-0,15%	-0,15%	1,65%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.686.085,01	2.434,32	0,00	4.681.054,83	-7.464,50	-0,16%	-0,16%	1,65%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	4.085.774,50	0,00	0,00	4.076.407,85	-9.366,65	-0,23%	-0,23%	0,49%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	7.649.272,03	0,00	0,00	7.610.784,05	-38.487,98	-0,50%	-0,50%	1,68%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	368.638,65	5.154,96	0,00	371.634,82	-2.158,79	-0,58%	-0,59%	1,65%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.334.051,20	0,00	0,00	1.325.877,38	-8.173,82	-0,61%	-0,61%	1,79%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.739.255,11	0,00	0,00	1.727.821,11	-11.434,00	-0,66%	-0,66%	1,79%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	2.347.032,47	1.269.710,94	0,00	3.590.879,05	-25.864,36	-0,72%	-0,88%	2,33%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.446.625,17	0,00	0,00	4.413.162,11	-33.463,06	-0,75%	-0,75%	2,02%
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	5.187.960,34	0,00	0,00	5.136.950,90	-51.009,44	-0,98%	-0,98%	2,28%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.558.444,33	0,00	0,00	1.534.026,18	-24.418,15	-1,57%	-1,57%	4,15%
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	351.659,93	0,00	0,00	346.026,41	-5.633,52	-1,60%	-1,60%	4,24%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	330.015,14	0,00	0,00	324.510,32	-5.504,82	-1,67%	-1,67%	4,50%
Total Renda Fixa	49.451.277,86	1.453.773,28	87.159,66	50.600.921,57	-216.969,91	-0,43%		1,63%

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
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1.363.837,41	0,00	0,00	1.353.342,03	-10.495,38	-0,77%	-0,77%	0,96%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	2.428.739,05	0,00	0,00	2.406.652,84	-22.086,21	-0,91%	-0,91%	1,88%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	1.478.379,97	0,00	0,00	1.454.536,58	-23.843,39	-1,61%	-1,61%	2,75%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	196.819,41	0,00	0,00	192.776,39	-4.043,02	-2,05%	-2,05%	3,06%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	1.154.378,82	0,00	0,00	1.125.849,43	-28.529,39	-2,47%	-2,47%	11,70%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	2.087.322,30	0,00	0,00	2.030.190,62	-57.131,68	-2,74%	-2,74%	10,29%
ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES	1.325.714,18	0,00	0,00	1.272.680,44	-53.033,74	-4,00%	-4,00%	11,90%
BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	1.319.803,84	0,00	0,00	1.260.389,12	-59.414,72	-4,50%	-4,50%	10,47%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.426.770,98	0,00	0,00	1.358.707,76	-68.063,22	-4,77%	-4,77%	9,73%
BRADESCO PLUS IBOVESPA FI AÇÕES	833.848,29	0,00	0,00	793.772,13	-40.076,16	-4,81%	-4,81%	10,62%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	612.519,54	0,00	0,00	581.662,36	-30.857,18	-5,04%	-5,04%	10,54%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.336.882,02	0,00	0,00	1.229.485,84	-107.396,18	-8,03%	-8,03%	11,91%
Total Renda Variável	15.565.015,81	0,00	0,00	15.060.045,54	-504.970,27	-3,24%		7,65%

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DOS SERVIDORES MUNICIPAIS DE ITUPEVA
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/09/2020

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 BDR NÍVEL I FI AÇÕES	59.895,91	0,00	0,00	58.701,41	-1.194,50	-1,99%	-1,99%	15,53%
Total Renda Variável	59.895,91	0,00	0,00	58.701,41	-1.194,50	-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
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	4.016.169,98	0,00	0,00	4.080.996,12	64.826,14	1,61%	1,61%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.620.388,07	4.868,64	0,00	4.681.054,83	55.798,12	1,21%	1,21%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	3.013.382,08	0,00	0,00	3.063.542,88	50.160,80	1,66%	1,66%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2.970.597,61	81.880,03	0,00	3.087.440,84	34.963,20	1,15%	1,18%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.248.712,56	2.434,32	0,00	3.266.471,43	15.324,55	0,47%	0,47%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.459.689,04	62.584,25	0,00	1.534.026,18	11.752,89	0,77%	0,91%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	4.068.439,37	0,00	0,00	4.076.407,85	7.968,48	0,20%	0,20%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.528.664,42	0,00	0,00	1.534.233,20	5.568,78	0,36%	0,36%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.408.565,68	0,00	0,00	4.413.162,11	4.596,43	0,10%	0,10%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	342.885,76	0,00	0,00	346.026,41	3.140,65	0,92%	0,92%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	322.174,92	0,00	0,00	324.510,32	2.335,40	0,72%	0,72%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	366.520,65	12.766,80	126.941,39	253.792,81	1.446,75	0,38%	0,44%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	237.041,42	172.217,46	234.553,37	175.309,28	603,77	0,15%	0,39%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	356.283,28	15.464,88	0,00	371.634,82	-113,34	-0,03%	-0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.329.919,52	0,00	0,00	1.325.877,38	-4.042,14	-0,30%	-0,30%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.733.809,45	0,00	0,00	1.727.821,11	-5.988,34	-0,35%	-0,35%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	7.617.681,63	0,00	0,00	7.610.784,05	-6.897,58	-0,09%	-0,09%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	5.145.037,30	0,00	0,00	5.136.950,90	-8.086,40	-0,16%	-0,16%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	262.024,72	3.354.371,90	0,00	3.590.879,05	-25.517,57	-0,71%	-0,03%
				Total Renda Fixa	207.840,59	0,41%	

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
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	1.918.756,30	0,00	0,00	2.030.190,62	111.434,32	5,81%	5,81%
ITAÚ MOMENTO 30 FIC AÇÕES	1.229.188,39	0,00	0,00	1.272.680,44	43.492,05	3,54%	3,54%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	1.445.354,09	0,00	0,00	1.454.536,58	9.182,49	0,64%	0,64%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	2.398.341,93	0,00	0,00	2.406.652,84	8.310,91	0,35%	0,35%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	507.252,49	70.000,00	0,00	581.662,36	4.409,87	0,76%	1,16%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	193.639,07	0,00	0,00	192.776,39	-862,68	-0,45%	-0,45%
BB IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	1.102.503,99	165.433,63	0,00	1.260.389,12	-7.548,50	-0,60%	0,03%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	1.133.567,24	0,00	0,00	1.125.849,43	-7.717,81	-0,68%	-0,68%
BRADESCO PLUS IBOVESPA FI AÇÕES	731.699,03	70.000,00	0,00	793.772,13	-7.926,90	-0,99%	-0,56%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1.364.586,71	0,00	0,00	1.353.342,03	-11.244,68	-0,82%	-0,82%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.083.121,45	322.198,50	0,00	1.358.707,76	-46.612,19	-3,32%	-2,30%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.315.244,88	0,00	0,00	1.229.485,84	-85.759,04	-6,52%	-6,52%
				Total Renda Variável	9.157,84	0,06%	

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	0,00	54.197,16	0,00	58.701,41	4.504,25	8,31%	14,98%
				Total Exterior	4.504,25	8,31%	