

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

Relatório Analítico dos Investimentos

em setembro e 3º trimestre de 2020

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2020)

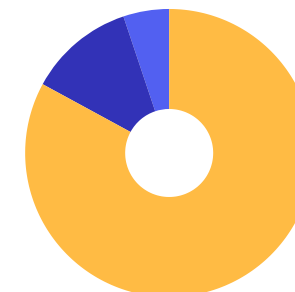
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	44.389.557,30	14,39%	868	0,33%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	7.897.316,65	2,56%	37	2,74%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	9.558.856,25	3,10%	74	0,68%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	7.112.880,13	2,31%	1.361	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2024	8.471.205,00	2,75%	104	1,87%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	19.576.140,96	6,35%	463	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	24.421,92	0,01%	953	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	15/08/2022	530.676,73	0,17%	165	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+1	Não há	18.349.066,95	5,95%	23	9,46%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	15.671.616,80	5,08%	714	0,31%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2030	8.953.355,00	2,90%	18	13,58%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+0	15/08/2022	4.972.502,10	1,61%	95	0,99%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVI...	D+0	15/08/2024	6.882.206,41	2,23%	140	1,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	D+0	Não há	1.576.436,05	0,51%	304	0,06%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CUR...	D+0	Não há	834.247,83	0,27%	12.178	0,09%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3 du	Não há	46.060.089,28	14,93%	387	2,22%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	D+2	Não há	14.740.699,64	4,78%	425	8,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	19.654.588,24	6,37%	135	0,98%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	10.092.379,98	3,27%	586	0,40%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO...	D+30 ou...	Não há	10.486.829,51	3,40%	74	1,74%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC ...	D+34	Não há	8.605.842,05	2,79%	305	0,35%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	2.514.097,00	0,81%	115	0,35%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	6.408.365,90	2,08%	663	1,58%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	23/08/2017	1.349.453,18	0,44%	155	0,17%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	3.855.817,49	1,25%	85	0,47%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MUL...	D+2	01/10/2020	9.433.428,83	3,06%	956	1,87%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	4.624.750,00	1,50%		1,59%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	D+4	Não há	15.882.667,91	5,15%	158	0,95%	Artigo 9º - A, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			308.509.495,09				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			25.891,20	Artigo 6º			
PL Total			308.535.386,29				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nível 3	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	152.389.802,20	49,40%	40,00%	66,50%	90,00%	125.268.743,38
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	75,00%	1.576.436,05	0,51%	0,00%	1,00%	10,00%	29.274.513,46
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	75,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	30.850.949,51
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	55,00%	91.382.004,97	29,62%	10,00%	16,50%	38,00%	25.851.603,16
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	55,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	6.170.189,90
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	1,00%	3.085.094,95
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	46.276.424,26
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	20,00%	10.486.829,51	3,40%	0,00%	0,00%	20,00%	51.215.069,51
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	46.276.424,26
Total Renda Fixa	100,00%	255.835.072,73	82,93%	50,00%	84,00%	201,00%	



REDA FIXA 255.835.072,73
REDA VARIÁVEL 36.791.754,45
EXTERIOR 15.882.667,91

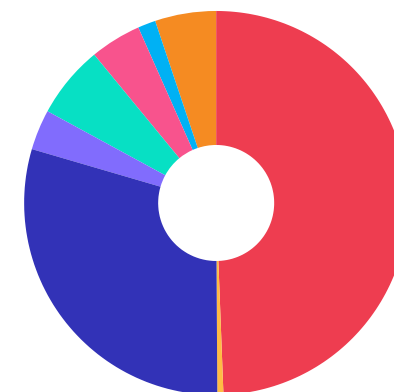
ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.695/18 em seus Artigo 7º § 10º e Artigo 8º § 10º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!



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

Artigos - Renda Variável	Resolução Pró Gestão - Nível 3	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	35,00%	18.877.758,13	6,12%	2,00%	25,00%	35,00%	89.100.565,15
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	13.289.246,32	4,31%	2,00%	5,00%	10,00%	17.561.703,19
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	30.850.949,51
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	15,00%	4.624.750,00	1,50%	0,00%	5,00%	10,00%	26.226.199,51
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'c'	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	46.276.424,26
Total Renda Variável	45,00%	36.791.754,45	11,93%	4,00%	40,00%	80,00%	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nível 3	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2020			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	30.850.949,51
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	15.882.667,91	5,15%	0,00%	0,00%	5,00%	-457.193,16
Total Exterior	10,00%	15.882.667,91	5,15%	0,00%	0,00%	15,00%	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	133.459.516,84	43,26	0,02
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	101.104.666,71	32,77	0,01
BANESTES DTVM	70.081.761,36	22,72	1,10
VINCI PARTNERS	3.863.550,18	1,25	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 ' b '	152.389.802,20	49,40	40,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	1.576.436,05	0,51	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	91.382.004,97	29,62	10,00	38,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	10.486.829,51	3,40	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	18.877.758,13	6,12	2,00	35,00
Artigo 8º, Inciso III	13.289.246,32	4,31	2,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	4.624.750,00	1,50	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 9º - A, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º - A, Inciso III	15.882.667,91	5,15	0,00	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
IRF-M 1 (Benchmark)	0,15%	3,12%	0,51%	1,66%	4,54%	12,32%	-	-
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%
BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	-0,23%	5,12%	0,26%	2,49%	6,68%	19,43%	0,01%	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%
IMA-B (Benchmark)	-1,51%	-0,72%	0,96%	5,97%	2,11%	34,14%	-	-
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-1,54%	-0,98%	0,89%	5,76%	1,73%	33,13%	0,04%	0,11%
BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-5,05%	-9,84%	-1,55%	3,14%	-7,24%	33,89%	0,07%	0,19%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,77%	-0,12%	-1,53%	3,55%	2,77%	20,76%	0,03%	0,07%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-1,92%	-3,22%	-1,89%	4,24%	-1,54%	27,10%	0,05%	0,11%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,77%	-0,15%	-1,55%	3,53%	2,74%	20,75%	0,03%	0,07%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,19%	2,64%	0,98%	3,41%	5,12%	17,74%	0,01%	0,02%
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%	-	-

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
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%
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,15%	-0,40%	1,16%	0,24%	0,64%	7,39%	0,00%	0,02%
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,02%	0,44%	0,06%	0,16%	0,93%	4,14%	0,00%	0,00%

IPCA (Benchmark)	0,64%	1,34%	1,24%	0,81%	3,14%	6,12%	-	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	-0,08%	4,11%	1,40%	5,06%	6,65%	21,92%	0,01%	0,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,20%	5,28%	1,82%	5,68%	7,86%	27,55%	0,01%	0,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,10%	3,59%	1,05%	4,36%	6,19%	22,78%	0,02%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	-0,50%	4,53%	-0,09%	3,18%	6,41%	25,88%	0,02%	0,03%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,88%	-	-0,03%	2,85%	-	-	0,02%	-

Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	-1,52%	-1,63%	-0,33%	-0,92%	1,86%	22,52%	0,02%	0,05%

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
IDIV (Benchmark)	-4,63%	-21,08%	-3,31%	14,78%	-9,81%	37,85%	-	-
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	-4,93%	-17,58%	-0,96%	19,42%	-6,98%	43,54%	0,09%	0,35%

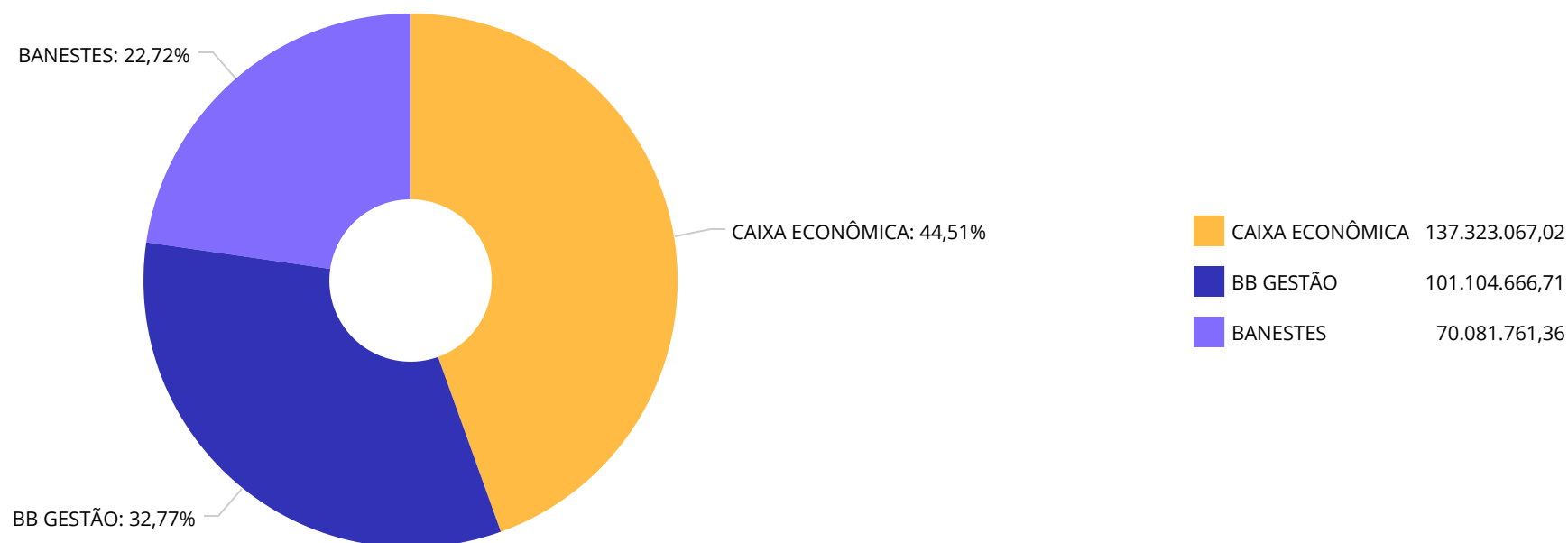
Ibovespa (Benchmark)	-4,80%	-18,20%	-0,48%	29,56%	-9,68%	19,23%	-	-
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	-4,38%	-21,59%	-0,62%	27,14%	-12,24%	12,08%	0,10%	0,40%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	-0,45%	1,42%	-0,37%	0,25%	2,97%	15,39%	0,00%	0,01%

Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	-2,90%	-15,40%	0,62%	29,23%	-0,02%	56,46%	0,10%	0,41%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	-88,07%	-87,58%	-88,14%	-84,07%	-83,34%	-80,63%	0,16%	0,49%
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-2,96%	-4,05%	4,70%	48,11%	5,50%	60,57%	0,11%	0,42%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	-1,61%	-1,00%	0,64%	9,72%	-	-	0,03%	-

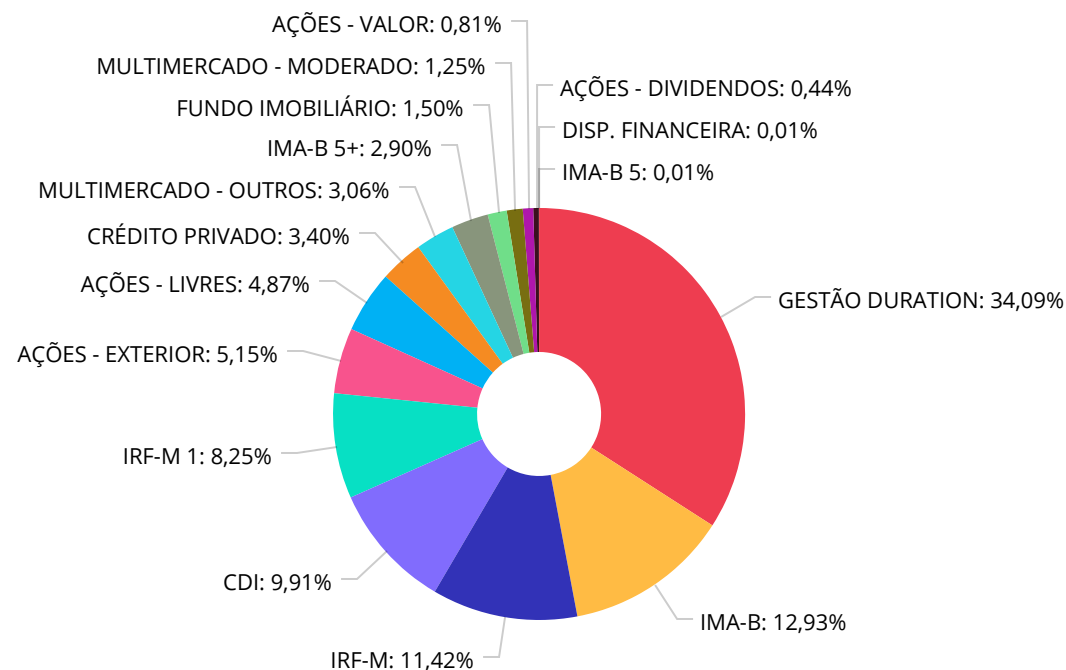
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2020 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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)

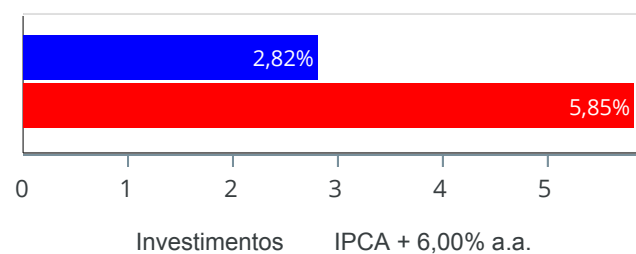


GESTÃO DURATION	105.190.346,22
IMA-B	39.889.199,19
IRF-M	35.247.757,76
CDI	30.581.216,05
IRF-M 1	25.461.947,08
AÇÕES - EXTERIOR	15.882.667,91
AÇÕES - LIVRES	15.014.207,95
CRÉDITO PRIVADO	10.486.829,51
MULTIMERCADO - OUTROS	9.433.428,83
IMA-B 5+	8.953.355,00
FUNDO IMOBILIÁRIO	4.624.750,00
MULTIMERCADO - MODERADO	3.855.817,49
AÇÕES - VALOR	2.514.097,00
AÇÕES - DIVIDENDOS	1.349.453,18
DISP. FINANCEIRA	25.891,20
IMA-B 5	24.421,92

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

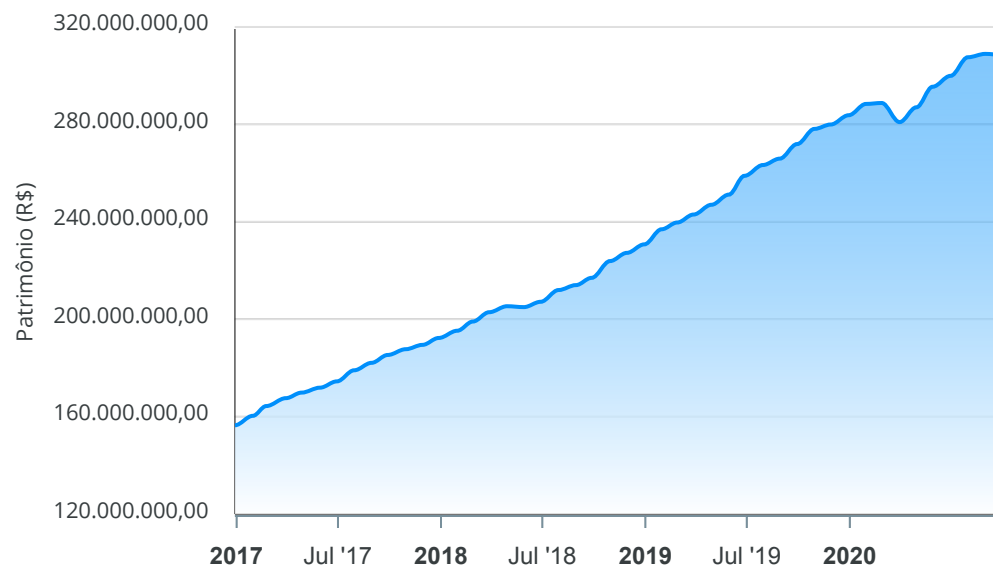
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	283.697.129,90	12.896.031,99	11.142.958,27	288.307.192,72	2.856.989,10	2.856.989,10	1,00%	1,00%	0,72%	0,72%	138,80%	1,65%
Fevereiro	288.307.192,72	7.204.074,12	4.802.321,61	288.665.248,30	-2.043.696,93	813.292,17	-0,70%	0,29%	0,67%	1,39%	20,86%	2,96%
Março	288.665.248,30	6.282.886,41	4.470.359,46	280.794.566,70	-9.683.208,55	-8.869.916,38	-3,33%	-3,05%	0,58%	1,98%	-153,97%	10,18%
Abril	280.794.566,70	5.910.606,75	4.419.743,79	286.884.207,66	4.598.778,00	-4.271.138,38	1,63%	-1,47%	0,15%	2,14%	-68,91%	5,71%
Maio	286.884.207,66	5.731.155,16	4.422.575,55	292.907.550,66	4.714.763,39	443.625,01	1,64%	0,14%	0,08%	2,22%	6,25%	2,73%
Junho	292.907.550,66	6.511.679,32	4.377.647,10	299.812.638,20	4.771.055,32	5.214.680,33	1,62%	1,76%	0,75%	2,99%	58,89%	2,28%
Julho	299.812.638,20	46.697.371,47	44.864.740,12	307.420.522,83	5.775.253,28	10.989.933,61	1,91%	3,71%	0,90%	3,91%	94,85%	1,89%
Agosto	307.420.522,83	14.494.964,53	12.704.003,35	308.735.112,17	-476.371,84	10.513.561,77	-0,15%	3,55%	0,73%	4,66%	76,04%	2,03%
Setembro	308.735.112,17	6.206.175,66	4.420.868,55	308.338.697,23	-2.181.722,05	8.331.839,72	-0,70%	2,82%	1,13%	5,85%	48,22%	3,29%

Investimentos x Meta Atuarial



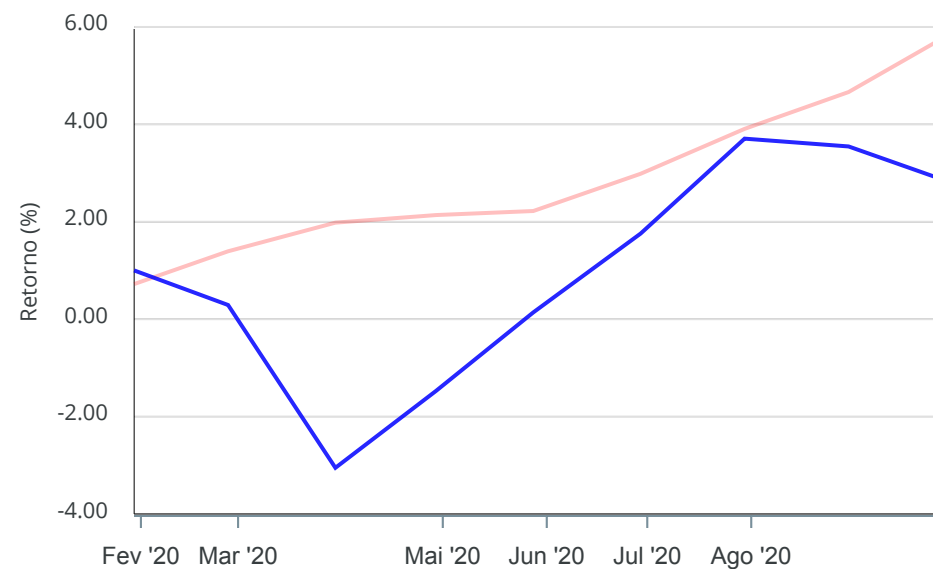
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENC...	4.962.760,35	0,00	0,00	4.972.502,10	9.741,75	0,20%	0,20%	1,16%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	529.665,31	0,00	0,00	530.676,73	1.011,42	0,19%	0,19%	1,15%
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	18.914.229,40	1.042.866,58	332.804,41	19.654.588,24	30.296,67	0,15%	0,15%	0,10%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.103.409,19	0,00	0,00	7.112.880,13	9.470,94	0,13%	0,13%	0,12%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	10.107.679,02	0,00	17.731,75	10.092.379,98	2.432,71	0,02%	0,02%	0,06%
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO...	763.732,33	4.281.475,33	4.211.118,76	834.247,83	158,93	0,00%	0,02%	0,00%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	10.495.205,84	0,00	0,00	10.486.829,51	-8.376,33	-0,08%	-0,08%	1,24%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	6.889.395,39	0,00	0,00	6.882.206,41	-7.188,98	-0,10%	-0,10%	1,55%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	24.460,88	0,00	0,00	24.421,92	-38,96	-0,16%	-0,16%	1,65%
BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	18.390.494,38	0,00	0,00	18.349.066,95	-41.427,43	-0,23%	-0,23%	1,08%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	44.596.558,95	17.500,00	0,00	44.389.557,30	-224.501,65	-0,50%	-0,50%	1,68%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	19.696.824,61	0,00	0,00	19.576.140,96	-120.683,65	-0,61%	-0,61%	1,79%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	15.775.325,02	0,00	0,00	15.671.616,80	-103.708,22	-0,66%	-0,66%	1,79%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	9.633.018,75	0,00	0,00	9.558.856,25	-74.162,50	-0,77%	-0,77%	2,55%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.536.950,00	0,00	0,00	8.471.205,00	-65.745,00	-0,77%	-0,77%	2,55%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	46.468.220,73	0,00	0,00	46.060.089,28	-408.131,45	-0,88%	-0,88%	2,33%
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	14.968.151,37	0,00	0,00	14.740.699,64	-227.451,73	-1,52%	-1,52%	2,16%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	1.601.073,28	0,00	0,00	1.576.436,05	-24.637,23	-1,54%	-1,54%	4,12%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	9.128.310,00	0,00	0,00	8.953.355,00	-174.955,00	-1,92%	-1,92%	4,56%
BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.317.165,22	0,00	0,00	7.897.316,65	-419.848,57	-5,05%	-5,05%	7,39%

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
Total Renda Fixa	256.902.630,02	5.341.841,91	4.561.654,92	255.835.072,73	-1.847.744,28	-0,72%		1,88%

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
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	3.875.000,00	0,00	17.500,00	4.624.750,00	767.250,00	19,80%	-88,07%	16,02%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTI...	9.475.763,69	0,00	0,00	9.433.428,83	-42.334,86	-0,45%	-0,45%	0,18%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	3.919.023,69	0,00	0,00	3.855.817,49	-63.206,20	-1,61%	-1,61%	2,75%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	2.589.068,26	0,00	0,00	2.514.097,00	-74.971,26	-2,90%	-2,90%	10,44%
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇ...	8.354.906,80	516.992,12	0,00	8.605.842,05	-266.056,87	-3,00%	-2,96%	11,40%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	6.701.790,31	0,00	0,00	6.408.365,90	-293.424,41	-4,38%	-4,38%	9,88%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.419.384,64	0,00	0,00	1.349.453,18	-69.931,46	-4,93%	-4,93%	8,81%
Total Renda Variável	36.334.937,39	516.992,12	17.500,00	36.791.754,45	-42.675,06	-0,12%		7,77%

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE CARIACICA
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	15.656.952,08	516.992,11	0,00	15.882.667,91	-291.276,28	-1,80%	-1,99%	15,53%
Total Renda Variável	15.656.952,08	516.992,11	0,00	15.882.667,91	-291.276,28	-1,80%		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
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	19.059.692,81	1.042.866,58	670.474,32	19.654.588,24	222.503,17	1,11%	1,16%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	40.319.564,00	0,00	40.475.005,47	0,00	155.441,47	0,39%	0,10%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	10.342.275,04	0,00	0,00	10.486.829,51	144.554,47	1,40%	1,40%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	10.786.180,39	0,00	4.013.318,98	6.882.206,41	109.345,00	1,01%	1,05%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENC...	5.007.997,16	0,00	126.369,32	4.972.502,10	90.874,26	1,81%	1,82%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	9.709.512,50	0,00	224.899,45	9.558.856,25	74.243,20	0,76%	-1,55%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.602.480,00	0,00	196.940,67	8.471.205,00	65.665,67	0,76%	-1,53%
BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	18.301.063,41	0,00	0,00	18.349.066,95	48.003,54	0,26%	0,26%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	10.404.476,69	0,00	357.284,26	10.092.379,98	45.187,55	0,43%	0,44%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.079.497,59	0,00	0,00	7.112.880,13	33.382,54	0,47%	0,47%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	9.125.555,00	0,00	196.602,70	8.953.355,00	24.402,70	0,27%	-1,89%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA...	1.562.556,17	0,00	0,00	1.576.436,05	13.879,88	0,89%	0,89%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	1.518.483,05	0,00	999.158,26	530.676,73	11.351,94	0,75%	0,98%
CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.422.688,77	0,00	1.425.218,95	0,00	2.530,18	0,18%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDEN...	1.095.896,71	0,00	1.098.020,68	0,00	2.123,97	0,19%	-
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO...	619.093,19	12.810.312,69	12.595.683,48	834.247,83	525,43	0,00%	0,06%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	24.130,49	0,00	0,00	24.421,92	291,43	1,21%	1,21%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	43.843.592,33	587.691,73	0,00	44.389.557,30	-41.726,76	-0,09%	-0,09%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	15.725.932,00	0,00	0,00	15.671.616,80	-54.315,20	-0,35%	-0,35%
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	14.257.487,20	541.243,12	0,00	14.740.699,64	-58.030,68	-0,39%	-0,33%

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 IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	19.635.821,92	0,00	0,00	19.576.140,96	-59.680,96	-0,30%	-0,30%
BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.021.749,64	0,00	0,00	7.897.316,65	-124.432,99	-1,55%	-1,55%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	0,00	46.281.324,60	0,00	46.060.089,28	-221.235,32	-0,48%	-0,03%
			Total Renda Fixa		484.884,49	0,15%	

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 RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	3.900.000,00	0,00	35.000,00	4.624.750,00	759.750,00	19,48%	-88,14%
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇ...	6.758.524,66	1.551.727,81	0,00	8.605.842,05	295.589,58	3,56%	4,70%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	3.304.702,10	532.341,73	0,00	3.855.817,49	18.773,66	0,49%	0,64%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	2.498.620,50	0,00	0,00	2.514.097,00	15.476,50	0,62%	0,62%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.362.483,51	0,00	0,00	1.349.453,18	-13.030,33	-0,96%	-0,96%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTI...	9.468.428,01	0,00	0,00	9.433.428,83	-34.999,18	-0,37%	-0,37%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	4.560.948,19	2.000.000,00	0,00	6.408.365,90	-152.582,29	-2,33%	-0,62%
				Total Renda Variável	888.977,94	2,48%	

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	11.578.584,72	2.560.653,88	0,00	15.882.667,91	1.743.429,31	12,33%	14,98%
			Total Exterior		1.743.429,31	12,33%	