

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

Relatório Analítico dos Investimentos

em julho de 2020

Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2020)

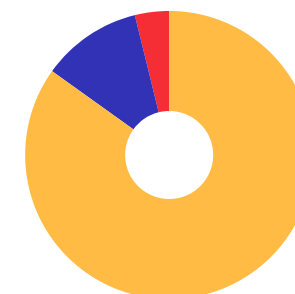
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+0	15/08/2022	5.047.441,71	1,64%	95	0,99%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	44.846.424,32	14,58%	791	0,36%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	24.365,42	0,01%	918	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVID...	D+0	15/08/2020	1.096.700,02	0,36%	119	0,50%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	15/08/2022	1.523.343,56	0,50%	165	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	15.903.037,33	5,17%	718	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2020	1.423.671,53	0,46%	45	0,55%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	8.622.917,39	2,80%	37	2,56%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+1	Não há	18.424.339,61	5,99%	21	10,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2030	9.510.005,00	3,09%	18	13,58%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	7.096.562,82	2,31%	1.366	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2024	8.754.525,00	2,85%	104	1,87%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	19.849.695,73	6,45%	460	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	9.881.162,50	3,21%	74	0,68%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVI...	D+0	15/08/2024	10.864.309,90	3,53%	140	1,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	D+0	Não há	1.631.250,79	0,53%	305	0,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CUR...	D+0	Não há	688.472,41	0,22%	11.376	0,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3 du	Não há	41.626.019,50	13,54%	263	3,46%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	D+2	Não há	14.544.942,96	4,73%	392	7,98%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	19.176.006,78	6,24%	114	0,98%	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	RESOLUÇÃO - 3.922
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	10.089.396,11	3,28%	600	0,42%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO...	D+30 ou...	Não há	10.444.028,96	3,40%	74	1,72%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b'
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC ...	D+34	Não há	7.868.402,20	2,56%	288	0,33%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	23/08/2017	1.475.788,87	0,48%	154	0,17%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	2.720.101,11	0,88%	111	0,36%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	4.901.310,48	1,59%	656	1,14%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	3.910.546,04	1,27%	74	0,48%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MUL...	D+2	01/10/2020	9.473.611,41	3,08%	956	1,87%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	4.325.000,00	1,41%		1,59%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	D+4	Não há	11.795.684,03	3,84%	115	0,92%	Artigo 9º - A, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			307.539.063,49				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			33.588,09	Artigo 6º			
PL Total			307.572.651,58				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	162.868.501,84	52,96%	40,00%	66,50%	90,00%	113.916.655,30
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	1.631.250,79	0,53%	0,00%	1,00%	10,00%	29.122.655,56
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	30.753.906,35
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	86.124.837,76	28,00%	10,00%	16,50%	38,00%	30.740.006,37
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	6.150.781,27
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	1,00%	3.075.390,63
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	46.130.859,52
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	10.444.028,96	3,40%	0,00%	0,00%	20,00%	51.063.783,74
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	46.130.859,52
Total Renda Fixa	100,00%	261.068.619,35	84,89%	50,00%	84,00%	201,00%	



RENTA FIXA 261.068.619,35

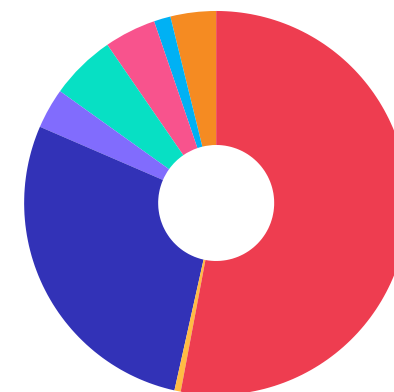
RENTA VARIÁVEL 34.674.760,11

EXTERIOR 11.795.684,03

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 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 II, Alínea 'a'	20,00%	16.965.602,66	5,52%	2,00%	25,00%	35,00%	90.673.069,56
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	13.384.157,45	4,35%	2,00%	5,00%	10,00%	17.369.748,90
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	30.753.906,35
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	5,00%	4.325.000,00	1,41%	0,00%	5,00%	10,00%	26.428.906,35
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	46.130.859,52
Total Renda Variável	30,00%	34.674.760,11	11,27%	4,00%	40,00%	80,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	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%	30.753.906,35
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	11.795.684,03	3,84%	0,00%	0,00%	5,00%	3.581.269,14
Total Exterior	10,00%	11.795.684,03	3,84%	0,00%	0,00%	15,00%	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	132.522.504,59	43,09	0,03
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	101.495.587,57	33,00	0,01
BANESTES DTVM	69.325.081,35	22,54	1,14
VINCI PARTNERS	4.195.889,98	1,36	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 '	162.868.501,84	52,96	40,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	1.631.250,79	0,53	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	86.124.837,76	28,00	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 '	10.444.028,96	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 '	16.965.602,66	5,52	2,00	35,00
Artigo 8º, Inciso III	13.384.157,45	4,35	2,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	4.325.000,00	1,41	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	11.795.684,03	3,84	0,00	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
IRF-M 1 (Benchmark)	0,24%	2,84%	0,94%	2,39%	5,51%	13,20%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,24%	2,73%	0,90%	2,30%	5,30%	12,79%	0,00%	0,00%
BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,67%	5,55%	1,97%	4,80%	8,68%	21,03%	0,01%	0,01%

IMA-B 5 (Benchmark)	0,99%	4,19%	4,28%	3,61%	8,83%	24,16%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,97%	4,05%	4,23%	3,48%	8,54%	23,61%	0,01%	0,04%

IMA-B (Benchmark)	4,39%	2,65%	8,14%	2,38%	8,16%	37,86%	-	-
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	4,40%	2,46%	8,09%	2,22%	7,80%	36,97%	0,02%	0,10%
BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7,49%	-1,55%	10,74%	-2,09%	4,09%	44,21%	0,04%	0,18%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,77%	3,22%	6,28%	2,41%	5,98%	20,30%	0,02%	0,07%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	4,21%	2,80%	9,10%	1,63%	5,57%	30,16%	0,03%	0,11%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,77%	3,22%	6,28%	2,40%	5,61%	20,43%	0,02%	0,07%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,32%	1,97%	2,58%	1,77%	5,74%	18,19%	0,00%	0,02%
CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,07%	-1,89%	1,77%	-1,86%	-1,27%	2,32%	0,00%	0,04%

IRF-M (Benchmark)	1,08%	6,00%	3,32%	5,08%	9,81%	26,59%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,13%	5,86%	3,31%	4,96%	9,57%	26,04%	0,01%	0,02%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,09%	5,87%	3,29%	4,99%	9,54%	25,97%	0,01%	0,02%

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
CDI (Benchmark)	0,19%	1,95%	0,64%	1,57%	4,21%	10,83%	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,24%	1,61%	0,75%	1,26%	3,74%	10,19%	0,00%	0,00%
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,61%	-0,94%	1,32%	-1,33%	1,09%	7,99%	0,00%	0,03%
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,02%	0,40%	0,07%	0,28%	1,35%	4,66%	0,00%	0,00%

IPCA (Benchmark)	0,36%	0,46%	0,24%	0,25%	2,31%	5,60%	-	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,98%	3,69%	4,19%	2,83%	8,10%	22,05%	0,01%	0,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,79%	4,21%	4,12%	3,55%	8,77%	26,46%	0,01%	0,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,72%	3,26%	3,69%	2,82%	7,54%	23,01%	0,01%	0,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,07%	0,82%	1,77%	0,85%	4,23%	14,18%	0,00%	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,98%	5,65%	3,14%	4,79%	9,68%	28,24%	0,01%	0,03%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,92%	-	4,10%	-	-	-	0,01%	-

Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	1,86%	0,53%	2,86%	-0,08%	6,90%	26,22%	0,01%	0,04%

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
IDIV (Benchmark)	6,53%	-13,05%	21,87%	-11,65%	3,50%	46,49%	-	-
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	8,32%	-9,87%	21,78%	-11,23%	4,70%	50,50%	0,09%	0,34%

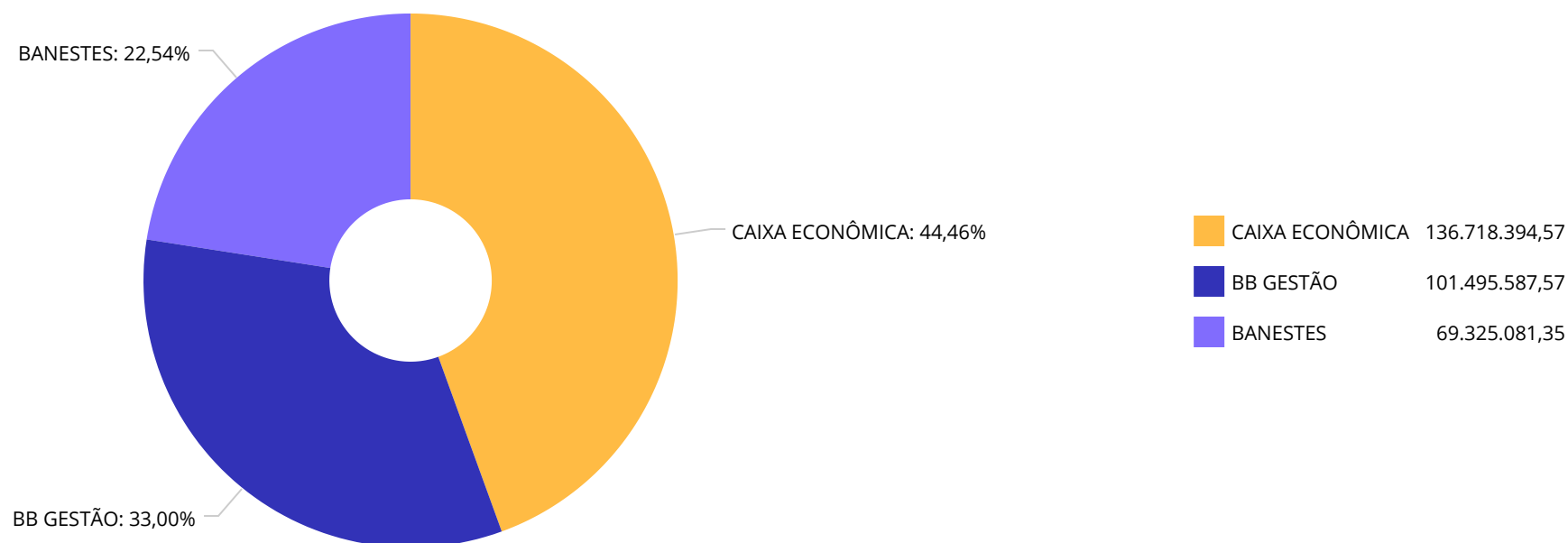
Ibovespa (Benchmark)	8,27%	-11,01%	27,83%	-9,54%	1,08%	29,91%	-	-
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	7,46%	-15,22%	25,57%	-14,03%	-2,29%	22,77%	0,09%	0,40%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	0,06%	1,85%	0,43%	1,53%	4,66%	-	0,00%	0,01%

Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	8,86%	-8,47%	27,39%	-10,22%	11,49%	61,50%	0,09%	0,40%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	10,90%	16,11%	38,23%	-1,14%	60,62%	76,55%	0,11%	0,44%
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8,36%	-0,70%	31,68%	-2,67%	12,67%	62,04%	0,09%	0,42%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	2,52%	0,86%	7,32%	0,59%	-	-	0,03%	-

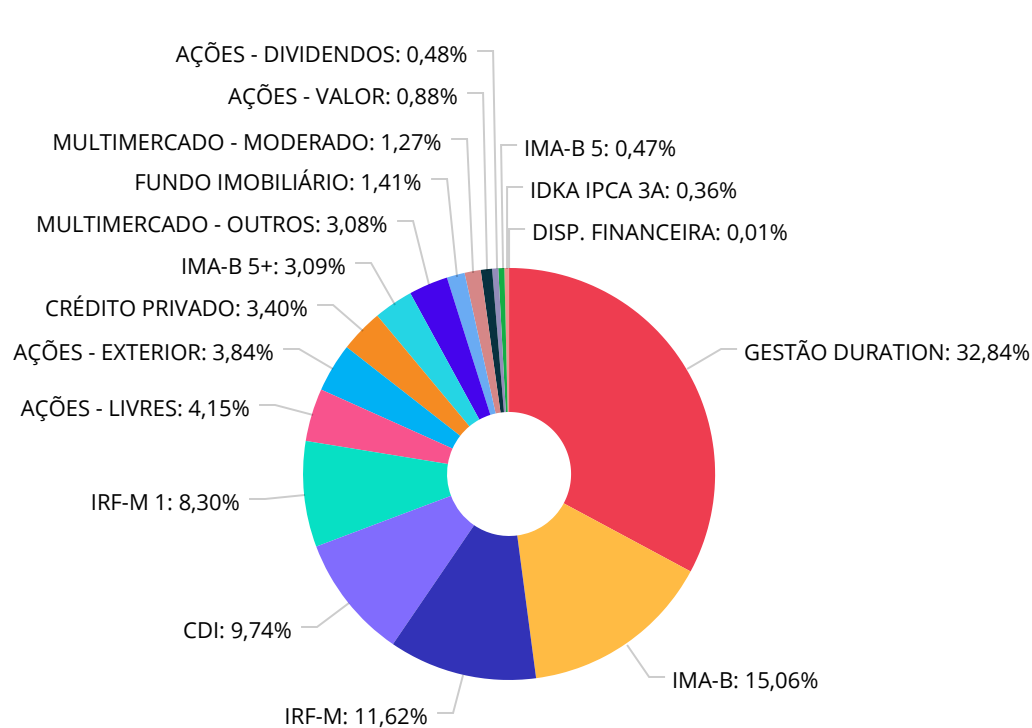
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2020 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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 BDR NÍVEL I FI AÇÕES	1,88%	35,34%	9,28%	27,06%	55,47%	69,34%	0,09%	0,19%

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



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

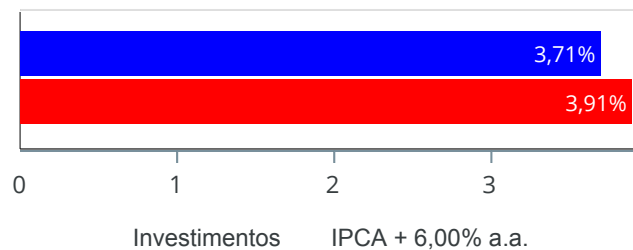


GESTÃO DURATION	101.017.386,78
IMA-B	46.324.950,85
IRF-M	35.752.733,06
CDI	29.953.875,30
IRF-M 1	25.520.902,43
AÇÕES - LIVRES	12.769.712,68
AÇÕES - EXTERIOR	11.795.684,03
CRÉDITO PRIVADO	10.444.028,96
IMA-B 5+	9.510.005,00
MULTIMERCADO - OUTROS	9.473.611,41
FUNDO IMOBILIÁRIO	4.325.000,00
MULTIMERCADO - MODERADO	3.910.546,04
AÇÕES - VALOR	2.720.101,11
AÇÕES - DIVIDENDOS	1.475.788,87
IMA-B 5	1.448.036,95
IDKA IPCA 3A	1.096.700,02
DISP. FINANCEIRA	33.588,09

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

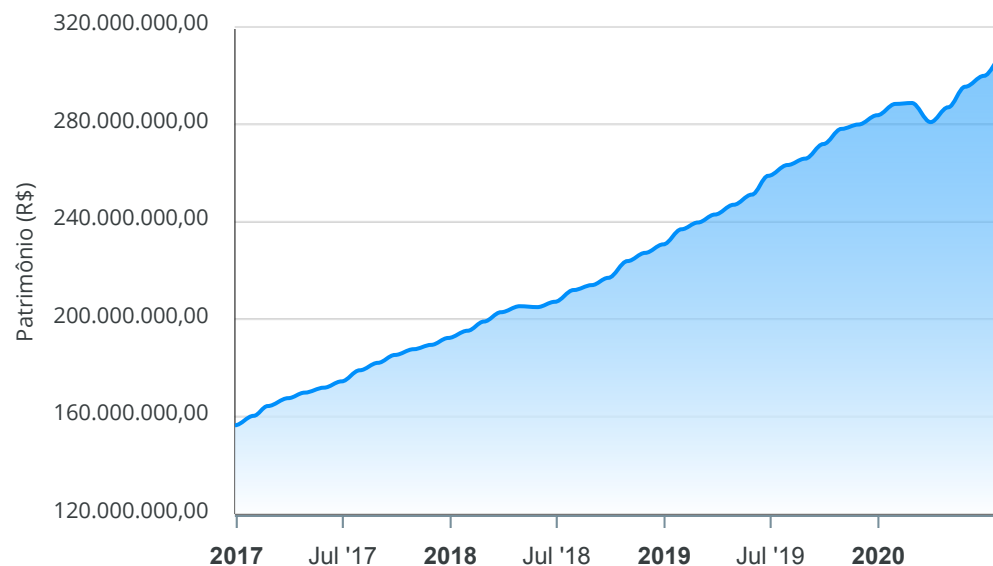
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	283.697.129,90	12.896.031,99	11.142.958,27	288.307.192,72	2.856.989,10	2.856.989,10	1,00%	1,00%	0,72%	0,72%	138,80%	1,65%
Fevereiro	288.307.192,72	7.204.074,12	4.802.321,61	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%

Investimentos x Meta Atuarial



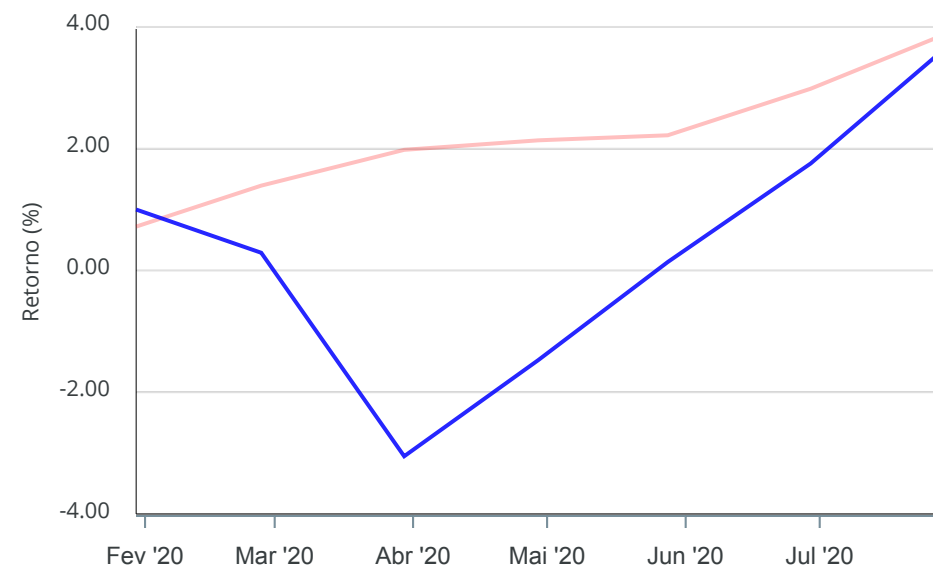
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Julho/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.021.749,64	0,00	0,00	8.622.917,39	601.167,75	7,49%	7,49%	3,82%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA...	1.562.556,17	0,00	0,00	1.631.250,79	68.694,62	4,40%	4,40%	2,27%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	9.125.555,00	0,00	0,00	9.510.005,00	384.450,00	4,21%	4,21%	2,81%
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	14.257.487,20	21.349,16	0,00	14.544.942,96	266.106,60	1,86%	1,86%	0,84%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	9.709.512,50	0,00	0,00	9.881.162,50	171.650,00	1,77%	1,77%	1,64%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.602.480,00	0,00	0,00	8.754.525,00	152.045,00	1,77%	1,77%	1,64%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	0,00	40.989.847,20	0,00	41.626.019,50	636.172,30	1,55%	1,92%	1,19%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	15.725.932,00	0,00	0,00	15.903.037,33	177.105,33	1,13%	1,13%	1,03%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	19.635.821,92	0,00	0,00	19.849.695,73	213.873,81	1,09%	1,09%	1,04%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	10.342.275,04	0,00	0,00	10.444.028,96	101.753,92	0,98%	0,98%	0,97%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	43.843.592,33	570.191,73	0,00	44.846.424,32	432.640,26	0,97%	0,98%	0,92%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	24.130,49	0,00	0,00	24.365,42	234,93	0,97%	0,97%	0,83%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENC...	5.007.997,16	0,00	0,00	5.047.441,71	39.444,55	0,79%	0,79%	0,76%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	10.786.180,39	0,00	0,00	10.864.309,90	78.129,51	0,72%	0,72%	0,64%
BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	18.301.063,41	0,00	0,00	18.424.339,61	123.276,20	0,67%	0,67%	0,62%
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	19.059.692,81	0,00	0,00	19.176.006,78	116.313,97	0,61%	0,61%	0,07%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	40.319.564,00	0,00	40.475.005,47	0,00	155.441,47	0,39%	1,77%	1,05%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	1.518.483,05	0,00	0,00	1.523.343,56	4.860,51	0,32%	0,32%	0,32%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.079.497,59	0,00	0,00	7.096.562,82	17.065,23	0,24%	0,24%	0,15%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	10.404.476,69	0,00	339.552,51	10.089.396,11	24.471,93	0,24%	0,24%	0,03%

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
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDEN...	1.095.896,71	0,00	0,00	1.096.700,02	803,31	0,07%	0,07%	0,18%
CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.422.688,77	0,00	0,00	1.423.671,53	982,76	0,07%	0,07%	0,18%
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO...	619.093,19	4.256.299,92	4.187.072,18	688.472,41	151,48	0,00%	0,02%	0,00%
Total Renda Fixa	256.465.726,06	45.837.688,01	45.001.630,16	261.068.619,35	3.766.835,44	1,46%		1,03%

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
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	3.900.000,00	0,00	0,00	4.325.000,00	425.000,00	10,90%	10,90%	11,49%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	2.498.620,50	0,00	0,00	2.720.101,11	221.480,61	8,86%	8,86%	8,78%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.362.483,51	0,00	0,00	1.475.788,87	113.305,36	8,32%	8,32%	9,12%
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇ...	6.758.524,66	514.841,73	0,00	7.868.402,20	595.035,81	8,18%	8,36%	8,95%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	4.560.948,19	0,00	0,00	4.901.310,48	340.362,29	7,46%	7,46%	9,10%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	3.304.702,10	514.841,73	0,00	3.910.546,04	91.002,21	2,38%	2,52%	2,59%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTI...	9.468.428,01	0,00	0,00	9.473.611,41	5.183,40	0,05%	0,05%	0,02%
Total Renda Variável	31.853.706,97	1.029.683,46	0,00	34.674.760,11	1.791.369,68	5,45%		6,13%

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE CARIACICA
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/07/2020

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 BDR NÍVEL I FI AÇÕES	11.578.584,72	0,00	0,00	11.795.684,03	217.099,31	1,88%	1,88%	8,52%
Total Renda Variável	11.578.584,72	0,00	0,00	11.795.684,03	217.099,31	1,88%		8,52%