

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

Relatório Analítico dos Investimentos

em agosto de 2020

Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2020)

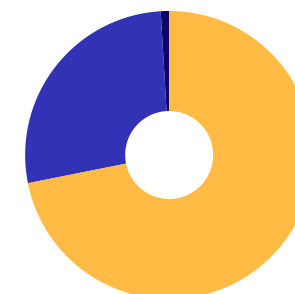
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
TÍTULOS PÚBLICOS			2.080.211,55	0,44%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	52.269.449,37	11,05%	852	0,39%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	229,12	0,00%	1.359	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	15.519.125,55	3,28%	339	0,83%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	76.852.326,28	16,25%	932	0,60%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	27.196.695,02	5,75%	970	0,31%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	12.288.696,01	2,60%	892	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	15.092.380,24	3,19%	600	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	84.658.416,44	17,90%	905	1,41%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	13.752.409,05	2,91%	627	0,32%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	137,76	0,00%	696	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	18.539.077,90	3,92%	100	3,14%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	13.436.668,39	2,84%	122	0,71%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	D+1009	Não há	746.858,00	0,16%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3 du	Não há	990.291,99	0,21%	361	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL	D+1260	Não há	2.377.834,92	0,50%	1	23.778.349.200,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	3.228.312,44	0,68%	33	2,07%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	801.899,36	0,17%		0,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	D+4	Não há	18.718.447,01	3,96%	1.633	1,99%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	16.488.337,18	3,49%	55	1,80%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	15.449.084,05	3,27%	1.800	5,51%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	D+4	Não há	14.062.669,41	2,97%	14.553	1,21%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	12.063.037,05	2,55%	3.533	0,73%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	16.488.337,18	3,49%	55	1,80%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	19.370.501,66	4,10%	47.653	0,47%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	9.803.322,89	2,07%	19.855	0,19%	Artigo 8º, Inciso III
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	4.679.736,35	0,99%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
ÁTICO FLORESTAL BRASIL FICFIP	Não se ...	Não se aplica	770.313,02	0,16%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRASIL FLORESTAL MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	774.392,75	0,16%	21	0,56%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	Não se ...	Não se aplica	2.432.688,08	0,51%		1,55%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
SANTANDER GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERI...	D+8 du	Não há	2.161.513,33	0,46%	2.975	0,32%	Artigo 9º - A, Inciso II
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	D+4	Não há	2.272.092,01	0,48%	137	0,14%	Artigo 9º - A, Inciso III
OSASCO PROPERTIES FII	Não se ...	Não se aplica	865.079,40	0,18%		0,46%	Desenquadrado - RV
Total para cálculo dos limites da Resolução			472.906.882,54				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			215,86	Artigo 6º			
PL Total			472.907.098,40				

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

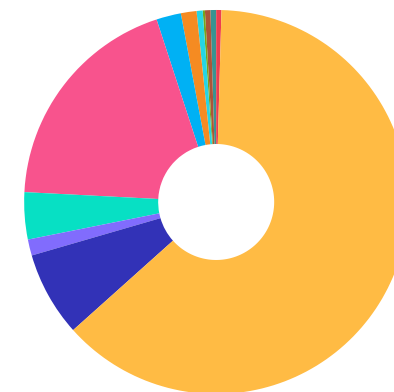
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	2.080.211,55	0,44%	0,00%	0,50%	50,00%	234.373.229,72
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	297.629.727,08	62,94%	15,00%	50,50%	90,00%	127.986.467,21
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	23.645.344,13
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	40,00%	33.713.034,04	7,13%	2,00%	8,00%	40,00%	155.449.718,98
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'	5,00%	6.408.046,72	1,36%	0,00%	2,00%	5,00%	17.237.297,41
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	23.645.344,13
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	23.645.344,13
Total Renda Fixa	100,00%	339.831.019,39	71,86%	17,00%	61,00%	200,00%	



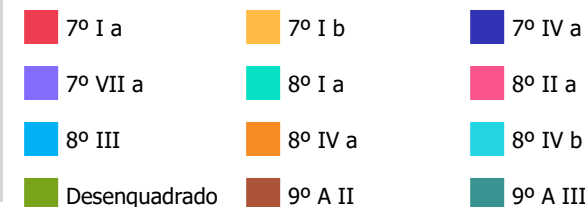
RENTA FIXA 339.831.019,39
RENTA VARIÁVEL 128.642.257,81
EXTERIOR 4.433.605,34

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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'a'	30,00%	18.718.447,01	3,96%	0,00%	5,00%	10,00%	28.572.241,24
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'b'	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	23.645.344,13
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	90.598.278,31	19,16%	7,00%	21,00%	30,00%	51.273.786,45
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'b'	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	47.290.688,25
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	9.803.322,89	2,07%	0,00%	3,00%	10,00%	37.487.365,36
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	5,00%	6.224.442,12	1,32%	0,00%	2,00%	5,00%	17.420.902,01
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	5,00%	2.432.688,08	0,51%	0,00%	1,00%	5,00%	21.212.656,05
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	23.645.344,13
Desenquadrado - RV	0,00%	865.079,40	0,18%	0,00%	0,00%	0,00%	-865.079,40
Total Renda Variável	30,00%	128.642.257,81	27,20%	7,00%	32,00%	80,00%	



Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2020			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	2.161.513,33	0,46%	0,00%	5,00%	10,00%	45.129.174,92
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	2.272.092,01	0,48%	0,00%	2,00%	5,00%	21.373.252,12
Total Exterior	10,00%	4.433.605,34	0,94%	0,00%	7,00%	15,00%	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	268.571.794,44	56,79	0,05
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	60.842.224,30	12,87	0,00
ITAÚ UNIBANCO	51.074.228,52	10,80	0,00
ITAÚ DTVM	16.488.337,18	3,49	0,00
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	15.449.084,05	3,27	1,00
SUL AMERICA INVESTIMENTOS GEST...	14.062.669,41	2,97	0,04
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	13.436.668,39	2,84	0,00
NAVI CAPITAL	12.063.037,05	2,55	0,74
A5 CAPITAL PARTNERS	4.679.736,35	0,99	-
GRAPHEN INVESTIMENTOS LTDA	3.981.445,44	0,84	7,59
AURORA CAPITAL	3.228.312,44	0,68	1,35
RJI CORRETORA DE VALORES	2.377.834,92	0,50	11,14
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	2.161.513,33	0,46	0,00
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	2.080.211,55	0,44	-
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	1.544.705,77	0,33	0,35
CADENCE GESTORA	865.079,40	0,18	-

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 '	2.080.211,55	0,44	0,00	50,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	297.629.727,08	62,94	15,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	33.713.034,04	7,13	2,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	6.408.046,72	1,36	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	18.718.447,01	3,96	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	90.598.278,31	19,16	7,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso III	9.803.322,89	2,07	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	6.224.442,12	1,32	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	2.432.688,08	0,51	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso II	2.161.513,33	0,46	0,00	10,00
Artigo 9º - A, Inciso III	2.272.092,01	0,48	0,00	5,00

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA Geral ex-C (Benchmark)	-0,68%	2,69%	1,88%	1,72%	6,16%	22,72%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,89%	2,63%	1,82%	1,67%	6,05%	23,16%	0,01%	0,04%

IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	1,03%	5,39%	2,99%	4,11%	9,71%	23,52%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,69%	4,43%	2,73%	3,38%	8,67%	21,54%	0,01%	0,03%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,79%	4,80%	2,82%	3,70%	8,84%	21,88%	0,01%	0,03%

IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	0,81%	5,32%	2,64%	3,71%	9,61%	21,21%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-	-	-	-	-	-	0,00%	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	-0,06%	-23,04%	-8,59%	-11,50%	-21,84%	-25,86%	0,02%	0,04%

IMA-B 5+ (Benchmark)	-3,62%	-2,01%	6,38%	-2,35%	4,71%	44,71%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-3,64%	-2,24%	6,31%	-2,48%	4,26%	43,30%	0,04%	0,17%

120% do CDI (Benchmark)	0,19%	2,54%	0,68%	1,72%	4,65%	12,58%	-	-
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL	-	-	-	-	-	-	-	-

IRF-M 1 (Benchmark)	0,12%	2,96%	0,64%	2,12%	5,06%	12,83%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,10%	2,83%	0,60%	2,03%	4,85%	12,44%	0,00%	0,01%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA-B 5 (Benchmark)	0,43%	4,63%	2,55%	3,39%	9,24%	25,01%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,39%	4,45%	2,48%	3,24%	8,93%	24,43%	0,01%	0,04%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,37%	4,46%	2,43%	3,21%	8,96%	24,42%	0,01%	0,04%

IMA-B (Benchmark)	-1,80%	0,80%	4,61%	0,09%	6,64%	36,00%	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	-1,83%	0,82%	4,70%	0,08%	6,70%	36,30%	0,02%	0,11%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,83%	0,54%	4,54%	-0,14%	6,20%	35,19%	0,02%	0,11%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	-1,92%	2,09%	4,48%	1,17%	8,22%	39,31%	0,02%	0,10%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	-	-	-	-	-	-	0,01%	-

CDI (Benchmark)	0,16%	2,12%	0,57%	1,43%	3,86%	10,38%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,15%	1,77%	0,64%	1,12%	3,36%	9,69%	0,00%	0,00%

IPCA (Benchmark)	0,24%	0,70%	0,86%	0,24%	2,44%	5,95%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	-0,56%	5,06%	1,17%	3,57%	9,21%	27,35%	0,01%	0,03%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,05%	-	1,81%	-	-	-	0,01%	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	1,08%	7,59%	3,49%	5,41%	13,19%	29,21%	-	-
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	-	-

IPCA + 9,00% ao ano (Benchmark)	0,96%	6,62%	3,13%	4,69%	11,66%	25,75%	-	-
BRASIL FLORESTAL MULTIESTRATÉGIA FIP	-0,14%	-	-0,42%	-	32,75%	-	0,00%	-

IGC (Benchmark)	-2,61%	-10,30%	15,64%	-2,60%	4,04%	44,08%	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	-3,27%	-13,42%	14,23%	-5,10%	-0,39%	35,87%	0,10%	0,40%

Ibovespa (Benchmark)	-3,44%	-14,07%	13,69%	-4,61%	-1,75%	29,59%	-	-
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	-3,01%	-12,28%	14,26%	-5,52%	0,98%	39,22%	0,09%	0,40%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	-2,03%	-19,01%	17,08%	-12,96%	-6,35%	36,28%	0,10%	0,47%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	-5,77%	-18,10%	10,83%	-10,38%	-4,54%	26,26%	0,09%	0,40%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-3,93%	-27,34%	13,94%	-21,07%	-17,17%	22,23%	0,12%	0,50%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-2,88%	-9,11%	14,42%	-0,74%	4,56%	52,97%	0,11%	0,37%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-0,20%	-16,55%	17,29%	-7,31%	-2,64%	42,50%	0,09%	0,41%

CDI (Benchmark)	0,16%	2,12%	0,57%	1,43%	3,86%	10,38%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	-0,14%	0,22%	2,54%	1,07%	5,57%	24,78%	0,01%	0,07%

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

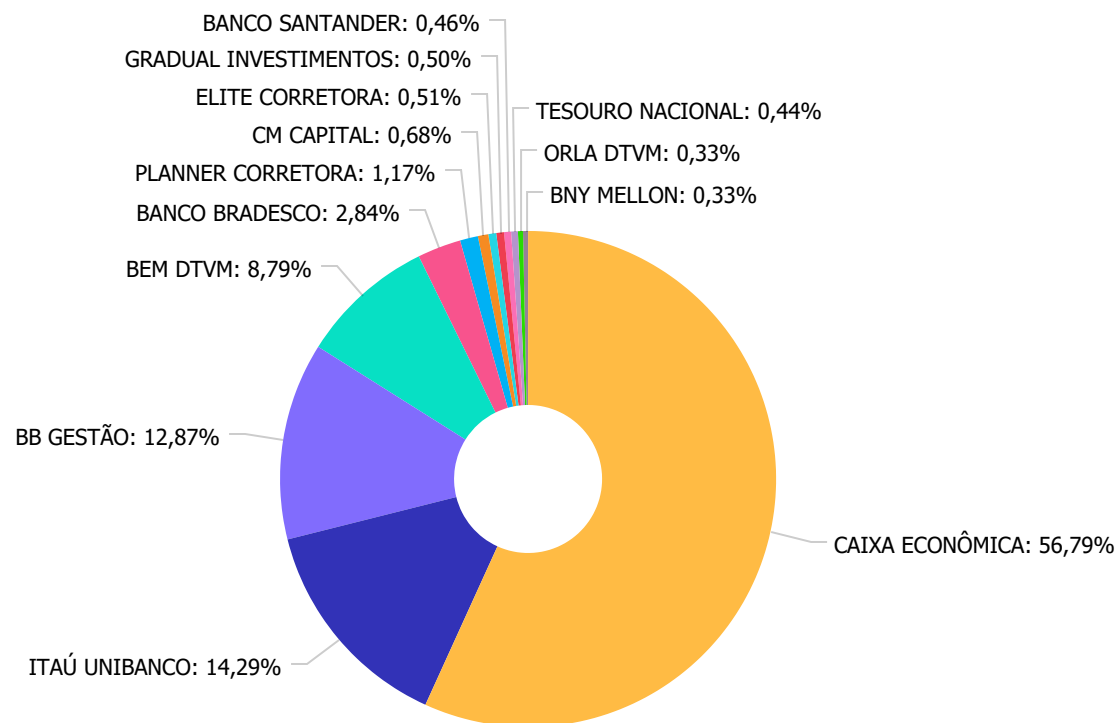
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	0,00%	-0,93%	-0,24%	-0,60%	-	-	0,00%	0,00%
OSASCO PROPERTIES FII	0,00%	-55,15%	-54,79%	-55,03%	199.250.032,49%	199.250.032,49%	-	-
ÁTICO FLORESTAL BRASIL FICFIP	-	-	-	-	32,55%	-	-	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	14,62%	54,49%	21,89%	53,88%	67,96%	72,96%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	15,16%	55,87%	22,45%	55,15%	68,87%	72,76%	0,09%	0,22%

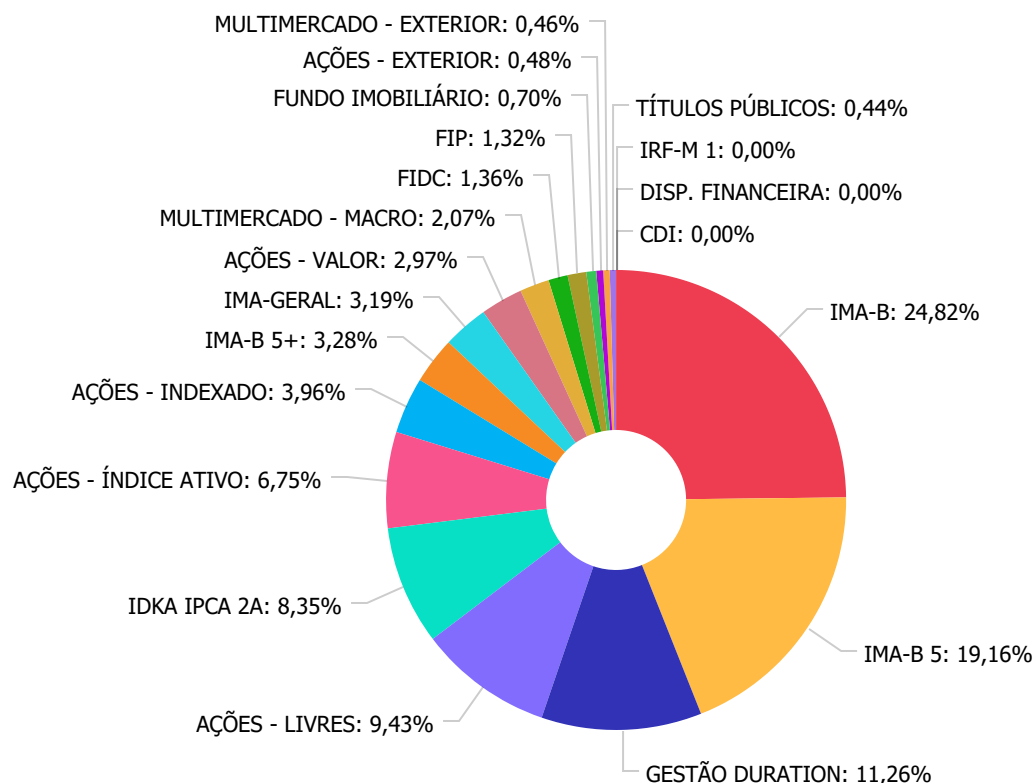
CDI (Benchmark)	0,16%	2,12%	0,57%	1,43%	3,86%	10,38%	-	-
SANTANDER GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCAD...	11,85%	53,98%	18,77%	48,85%	64,75%	61,35%	0,10%	0,21%

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



CAIXA ECONÔMICA	268.571.794,44
ITAÚ UNIBANCO	67.562.565,70
BB GESTÃO	60.842.224,30
BEM DTVM	41.574.790,51
BANCO BRADESCO	13.436.668,39
PLANNER CORRETORA	5.544.815,75
CM CAPITAL	3.228.312,44
ELITE CORRETORA	2.432.688,08
GRADUAL INVESTIMENTOS	2.377.834,92
BANCO SANTANDER	2.161.513,33
TESOURO NACIONAL	2.080.211,55
ORLA DTVM	1.548.757,36
BNY MELLON	1.544.705,77

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



IMA-B	117.381.020,73
IMA-B 5	90.604.735,33
GESTÃO DURATION	53.259.741,36
AÇÕES - LIVRES	44.598.187,67
IDKA IPCA 2A	39.485.391,03
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	31.937.421,23
AÇÕES - INDEXADO	18.718.447,01
IMA-B 5+	15.519.125,55
IMA-GERAL	15.092.380,24
AÇÕES - VALOR	14.062.669,41
MULTIMERCADO - MACRO	9.803.322,89
FIDC	6.408.046,72
FIP	6.224.442,12
FUNDO IMOBILIÁRIO	3.297.767,48
AÇÕES - EXTERIOR	2.272.092,01
MULTIMERCADO - EXTERIOR	2.161.513,33
TÍTULOS PÚBLICOS	2.080.211,55
IRF-M 1	229,12
DISP. FINANCEIRA	215,86

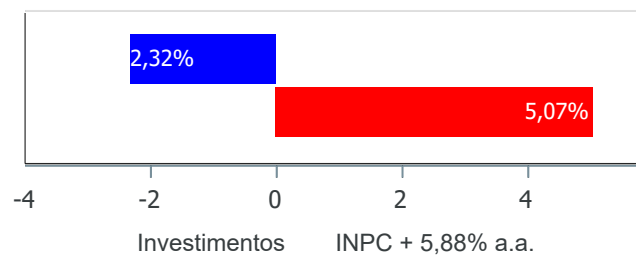
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Agosto / 2020)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	31/07/2019	414	4.824,512202	4.937,732851	1.997.348,05	2.044.221,40	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	18/11/2019	7	4.995,267412	5.141,450964	34.966,87	35.990,16	Curva

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

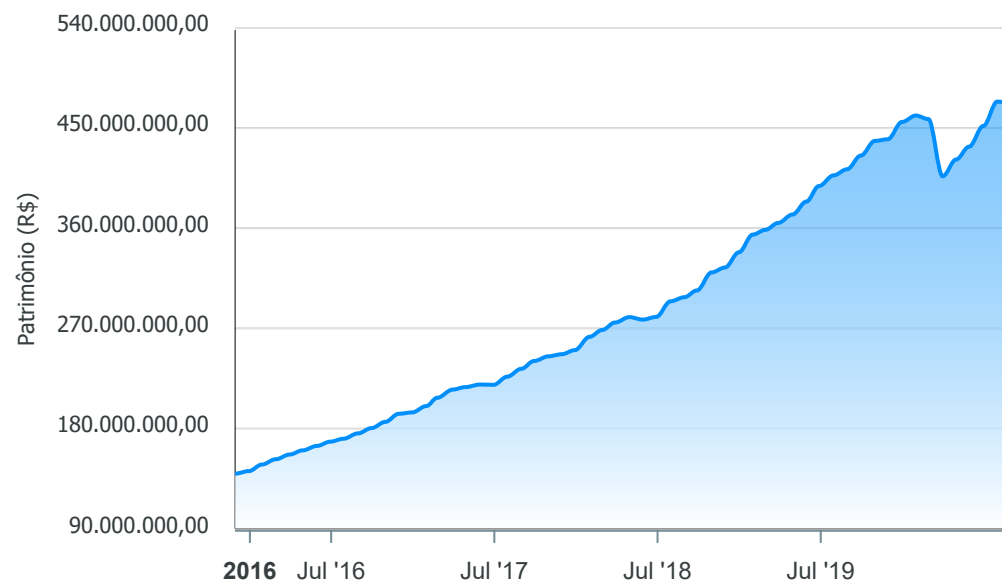
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	454.864.737,50	21.816.085,69	16.528.778,45	461.323.639,85	1.171.595,11	1.171.595,11	0,25%	0,25%	0,69%	0,69%	36,85%	3,25%
Fevereiro	461.323.639,85	10.707.825,40	6.130.332,45	457.995.410,88	-7.905.721,92	-6.734.126,81	-1,70%	-1,45%	0,58%	1,27%	-113,49%	4,88%
Março	457.995.410,88	28.820.410,36	32.625.991,25	406.736.215,22	-47.453.614,77	-54.187.741,58	-10,36%	-11,66%	0,68%	1,96%	-593,49%	19,18%
Abril	406.736.215,22	11.794.948,55	7.062.000,00	421.782.320,35	10.313.156,58	-43.874.585,00	2,51%	-9,44%	0,22%	2,19%	-430,80%	9,16%
Maio	421.782.320,35	645.611,92	226.784,81	433.326.657,26	11.125.509,80	-32.749.075,20	2,64%	-7,06%	0,20%	2,40%	-294,06%	4,98%
Junho	433.326.657,26	28.272.120,91	21.004.703,97	451.963.776,96	11.369.702,76	-21.379.372,44	2,58%	-4,66%	0,78%	3,20%	-145,71%	4,45%
Julho	451.963.776,96	8.017.610,89	2.808.912,54	473.812.023,06	16.639.547,75	-4.739.824,69	3,64%	-1,19%	0,97%	4,19%	-28,35%	3,64%
Agosto	473.812.023,06	6.081.362,53	1.504.502,69	472.906.882,54	-5.482.000,36	-10.221.825,05	-1,15%	-2,32%	0,84%	5,07%	-45,80%	3,53%

Investimentos x Meta Atuarial



Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

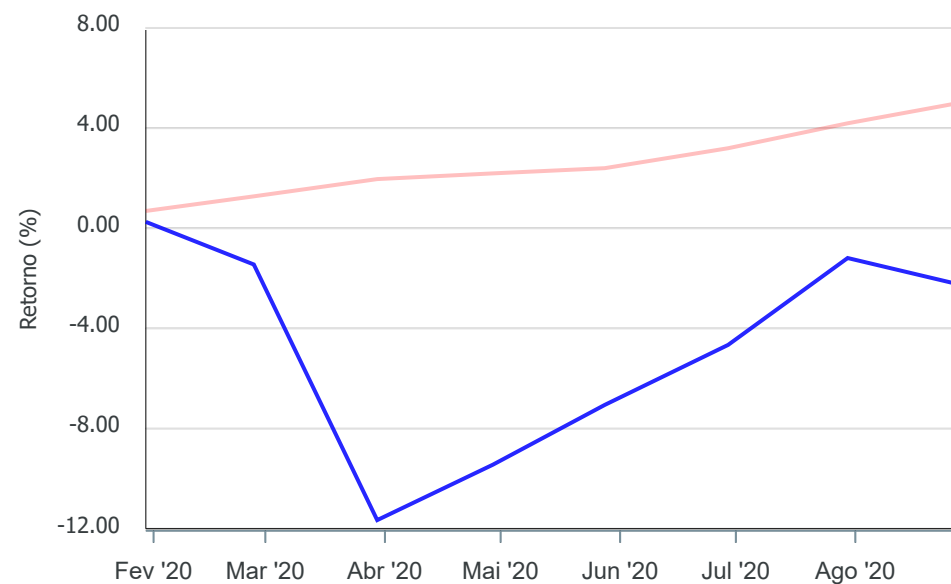
Evolução do Patrimônio



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 Agosto/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	12.204.954,85	0,00	0,00	12.288.696,01	83.741,16	0,69%	0,69%	0,74%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	24.594.447,99	3.414.431,44	1.000.000,00	27.196.695,02	187.815,59	0,67%	0,79%	0,77%
TÍTULOS PÚBLICOS	2.068.504,74	0,00	0,00	2.080.211,55	11.706,81	0,57%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	76.552.393,51	0,00	0,00	76.852.326,28	299.932,77	0,39%	0,39%	0,83%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	13.702.158,53	0,00	0,00	13.752.409,05	50.250,52	0,37%	0,37%	0,81%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	137,56	0,00	0,00	137,76	0,20	0,15%	0,14%	0,03%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	228,90	0,00	0,00	229,12	0,22	0,10%	0,10%	0,15%
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL	2.377.834,92	0,00	0,00	2.377.834,92	0,00	0,00%	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	3.231.895,57	0,00	0,00	3.228.312,44	-3.583,13	-0,11%	-0,06%	1,94%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	803.603,57	0,00	0,00	801.899,36	-1.704,21	-0,21%	-	0,24%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	750.938,17	0,00	0,00	746.858,00	-4.080,17	-0,54%	-	0,94%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	52.545.786,98	523.153,36	504.502,69	52.269.449,37	-294.988,28	-0,56%	-0,56%	0,92%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.227.716,60	0,00	0,00	15.092.380,24	-135.336,36	-0,89%	-0,89%	1,05%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	1.000.781,46	0,00	0,00	990.291,99	-10.489,47	-1,05%	-1,05%	1,19%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	86.236.887,21	0,00	0,00	84.658.416,44	-1.578.470,77	-1,83%	-1,83%	2,27%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	13.687.669,32	0,00	0,00	13.436.668,39	-251.000,93	-1,83%	-1,83%	2,33%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	18.758.764,36	142.319,71	0,00	18.539.077,90	-362.006,17	-1,92%	-1,92%	2,30%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	16.105.915,57	0,00	0,00	15.519.125,55	-586.790,02	-3,64%	-3,64%	3,79%
Total Renda Fixa	339.850.619,81	4.079.904,51	1.504.502,69	339.831.019,39	-2.595.002,24	-0,76%		1,50%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	2.435.816,10	0,00	0,00	2.432.688,08	-3.128,02	-0,13%	0,00%	0,00%
OSASCO PROPERTIES FII	866.260,06	0,00	0,00	865.079,40	-1.180,66	-0,14%	0,00%	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	9.816.734,29	0,00	0,00	9.803.322,89	-13.411,40	-0,14%	-0,14%	1,46%
BRASIL FLORESTAL MULTIESTRATÉGIA FIP	775.505,77	0,00	0,00	774.392,75	-1.113,02	-0,14%	-0,14%	0,01%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	19.408.559,71	0,00	0,00	19.370.501,66	-38.058,05	-0,20%	-0,20%	8,75%
ÁTICO FLORESTAL BRASIL FICFIP	772.063,75	0,00	0,00	770.313,02	-1.750,73	-0,23%	-	-
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	4.690.585,79	0,00	0,00	4.679.736,35	-10.849,44	-0,23%	-	-
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	14.353.877,38	0,00	0,00	14.062.669,41	-291.207,97	-2,03%	-2,03%	9,96%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	12.420.501,85	0,00	0,00	12.063.037,05	-357.464,80	-2,88%	-2,88%	11,00%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	17.000.649,29	0,00	0,00	16.488.337,18	-512.312,11	-3,01%	-3,01%	9,25%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	19.350.249,57	0,00	0,00	18.718.447,01	-631.802,56	-3,27%	-3,27%	9,81%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	13.702.465,21	0,00	0,00	13.164.648,96	-537.816,25	-3,92%	-3,92%	11,66%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	16.395.194,86	0,00	0,00	15.449.084,05	-946.110,81	-5,77%	-5,77%	9,03%
Total Renda Variável	131.988.463,63	0,00	0,00	128.642.257,81	-3.346.205,82	-2,54%		8,88%

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

MARINGÁ PREVIDÊNCIA - PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE MARINGÁ
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/08/2020

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	1.972.939,62	0,00	0,00	2.272.092,01	299.152,39	15,16%	15,16%	8,52%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	0,00	2.001.458,02	0,00	2.161.513,33	160.055,31	8,00%	11,85%	10,32%
Total Renda Variável	1.972.939,62	2.001.458,02	0,00	4.433.605,34	459.207,70	11,55%		9,40%