

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos
Relatório Analítico dos Investimentos

em julho de 2020



Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2020)

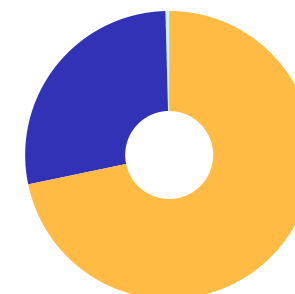
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
TÍTULOS PÚBLICOS			2.068.504,74	0,44%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	52.545.786,98	11,09%	791	0,42%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	86.236.887,21	18,20%	905	1,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	228,90	0,00%	1.366	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	16.105.915,57	3,40%	342	0,78%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	76.552.393,51	16,16%	918	0,64%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	24.594.447,99	5,19%	959	0,31%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	12.204.954,85	2,58%	885	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	15.227.716,60	3,21%	593	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	13.702.158,53	2,89%	626	0,33%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	13.687.669,32	2,89%	123	0,70%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3 du	Não há	1.000.781,46	0,21%	263	0,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	137,56	0,00%	707	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	18.758.764,36	3,96%	97	3,24%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	D+1009	Não há	750.938,17	0,16%	28	1,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	3.231.895,57	0,68%	33	2,07%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	803.603,57	0,17%	70	1,09%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL	D+1260	Não há	2.377.834,92	0,50%	19	4,20%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	D+4	Não há	19.350.249,57	4,08%	1.610	2,12%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'a'
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	17.000.649,29	3,59%	53	1,84%	Artigo 8º, Inciso II, 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
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	19.408.559,71	4,10%	48.524	0,47%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	13.702.465,21	2,89%	160	0,35%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	16.395.194,86	3,46%	915	5,57%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	D+4	Não há	14.353.877,38	3,03%	15.136	1,22%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	12.420.501,85	2,62%	3.633	0,73%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	9.816.734,29	2,07%	19.189	0,21%	Artigo 8º, Inciso III
ÁTICO FLORESTAL BRASIL FICFIP	Não se ...	Não se aplica	772.063,75	0,16%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRASIL FLORESTAL MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	775.505,77	0,16%	21	0,56%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	4.690.585,79	0,99%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	Não se ...	Não se aplica	2.435.816,10	0,51%		1,55%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	D+4	Não há	1.972.939,62	0,42%	115	0,15%	Artigo 9º - A, Inciso III
OSASCO PROPERTIES FII	Não se ...	Não se aplica	866.260,06	0,18%		0,46%	Desenquadrado - RV
Total para cálculo dos limites da Resolução			473.812.023,06				

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

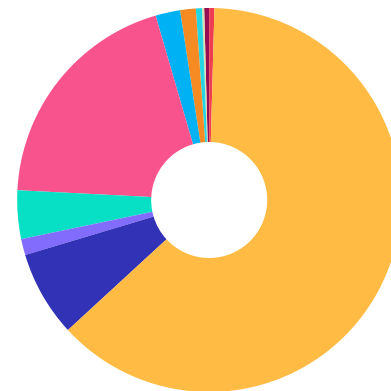
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	2.068.504,74	0,44%	0,00%	0,50%	50,00%	234.837.506,79
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	297.170.490,14	62,72%	15,00%	50,50%	90,00%	129.260.330,61
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	23.690.601,15
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	40,00%	34.198.290,87	7,22%	2,00%	8,00%	40,00%	155.326.518,35
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'	5,00%	6.413.334,06	1,35%	0,00%	2,00%	5,00%	17.277.267,09
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	23.690.601,15
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	23.690.601,15
Total Renda Fixa	100,00%	339.850.619,81	71,73%	17,00%	61,00%	200,00%	



RENTA FIXA	339.850.619,81
RENTA VARIÁVEL	131.988.463,63
EXTERIOR	1.972.939,62

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 I, Alínea 'a'	30,00%	19.350.249,57	4,08%	0,00%	5,00%	10,00%	28.030.952,74
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'b'	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	23.690.601,15
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	93.281.248,30	19,69%	7,00%	21,00%	30,00%	48.862.358,62
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'b'	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	47.381.202,31
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	9.816.734,29	2,07%	0,00%	3,00%	10,00%	37.564.468,02
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	5,00%	6.238.155,31	1,32%	0,00%	2,00%	5,00%	17.452.445,84
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	5,00%	2.435.816,10	0,51%	0,00%	1,00%	5,00%	21.254.785,05
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	23.690.601,15
Desenquadrado - RV	0,00%	866.260,06	0,18%	0,00%	0,00%	0,00%	-866.260,06
Total Renda Variável	30,00%	131.988.463,63	27,86%	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%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	47.381.202,31
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	1.972.939,62	0,42%	0,00%	2,00%	5,00%	21.717.661,53
Total Exterior	10,00%	1.972.939,62	0,42%	0,00%	7,00%	15,00%	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	267.825.471,63	56,53	0,05
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	61.485.861,01	12,98	0,00
ITAÚ UNIBANCO	51.869.789,28	10,95	0,00
ITAÚ DTVM	17.000.649,29	3,59	0,00
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	16.395.194,86	3,46	1,04
SUL AMERICA INVESTIMENTOS GEST...	14.353.877,38	3,03	0,04
BRANCO ASSET MANAGEMENT	13.687.669,32	2,89	0,00
NAVI CAPITAL	12.420.501,85	2,62	0,76
A5 CAPITAL PARTNERS	4.690.585,79	0,99	-
GRAPHEN INVESTIMENTOS LTDA	3.990.357,84	0,84	2,99
AURORA CAPITAL	3.231.895,57	0,68	3,83
RJI CORRETORA DE VALORES	2.377.834,92	0,50	11,13
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	2.068.504,74	0,44	-
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	1.547.569,52	0,33	0,35
CADENCE GESTORA	866.260,06	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'	2.068.504,74	0,44	0,00	50,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	297.170.490,14	62,72	15,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	34.198.290,87	7,22	2,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'	6.413.334,06	1,35	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'	19.350.249,57	4,08	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'b'	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	93.281.248,30	19,69	7,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'b'	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso III	9.816.734,29	2,07	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	6.238.155,31	1,32	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	2.435.816,10	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	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º - A, Inciso III	1.972.939,62	0,42	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
IMA Geral ex-C (Benchmark)	1,66%	3,39%	3,57%	2,88%	7,07%	23,27%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,77%	3,55%	3,84%	3,05%	7,10%	23,78%	0,01%	0,04%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,94%	4,31%	3,72%	3,76%	8,68%	22,37%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,81%	3,71%	4,07%	3,32%	7,99%	20,62%	0,01%	0,03%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,83%	3,98%	3,96%	3,50%	8,10%	20,93%	0,01%	0,03%
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	0,98%	4,47%	1,98%	3,64%	9,50%	20,87%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-0,41%	-3,36%	-1,06%	-3,26%	-5,02%	1.788,12%	0,00%	0,01%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	-8,75%	-22,99%	-8,26%	-18,85%	-26,20%	-28,70%	0,15%	0,10%
IMA-B 5+ (Benchmark)	7,32%	1,68%	11,51%	1,64%	7,81%	49,37%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	7,29%	1,46%	11,43%	1,50%	7,35%	47,92%	0,04%	0,16%
120% do CDI (Benchmark)	0,23%	2,35%	0,77%	1,89%	5,08%	13,13%	-	-
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL	-0,11%	-0,67%	-0,26%	-0,61%	-0,30%	-	-	-
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%

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
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%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,97%	4,08%	4,21%	3,51%	8,59%	23,64%	0,01%	0,04%

IMA-B (Benchmark)	4,39%	2,65%	8,14%	2,38%	8,16%	37,86%	-	-
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	4,48%	2,70%	8,39%	2,42%	8,21%	37,96%	0,02%	0,11%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	4,38%	2,42%	8,09%	2,17%	7,73%	37,07%	0,02%	0,11%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	4,43%	4,08%	8,21%	3,87%	9,85%	41,29%	0,02%	0,10%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	1,39%	-1,82%	2,78%	-2,06%	0,43%	-13,57%	0,01%	0,06%

CDI (Benchmark)	0,19%	1,95%	0,64%	1,57%	4,21%	10,83%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,25%	1,62%	0,82%	1,25%	3,72%	10,14%	0,00%	0,00%

IPCA (Benchmark)	0,36%	0,46%	0,24%	0,25%	2,31%	5,60%	-	-
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%	-

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
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	1,28%	6,44%	2,81%	5,30%	13,09%	28,89%	-	-
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	-	-

IPCA + 9,00% ao ano (Benchmark)	1,15%	5,60%	2,46%	4,59%	11,55%	25,42%	-	-
BRASIL FLORESTAL MULTIESTRATÉGIA FIP	-0,14%	-	-0,40%	-	32,76%	-	0,00%	-

IGC (Benchmark)	8,69%	-7,90%	29,18%	-7,96%	7,89%	44,17%	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	8,44%	-10,49%	27,78%	-9,51%	3,49%	35,87%	0,10%	0,39%

Ibovespa (Benchmark)	8,27%	-11,01%	27,83%	-9,54%	1,08%	29,91%	-	-
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	8,46%	-9,56%	27,16%	-10,16%	4,36%	37,47%	0,09%	0,40%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	10,71%	-17,33%	32,03%	-18,89%	-3,34%	33,11%	0,10%	0,47%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	8,27%	-13,09%	26,06%	-12,49%	0,94%	30,01%	0,09%	0,39%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	5,80%	-24,37%	29,49%	-25,46%	-12,43%	22,51%	0,12%	0,50%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8,78%	-6,42%	26,25%	-4,22%	10,38%	49,87%	0,11%	0,37%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	7,54%	-16,38%	23,82%	-16,23%	-0,92%	38,66%	0,09%	0,41%

CDI (Benchmark)	0,19%	1,95%	0,64%	1,57%	4,21%	10,83%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,41%	0,36%	4,15%	-0,32%	6,35%	24,98%	0,01%	0,07%

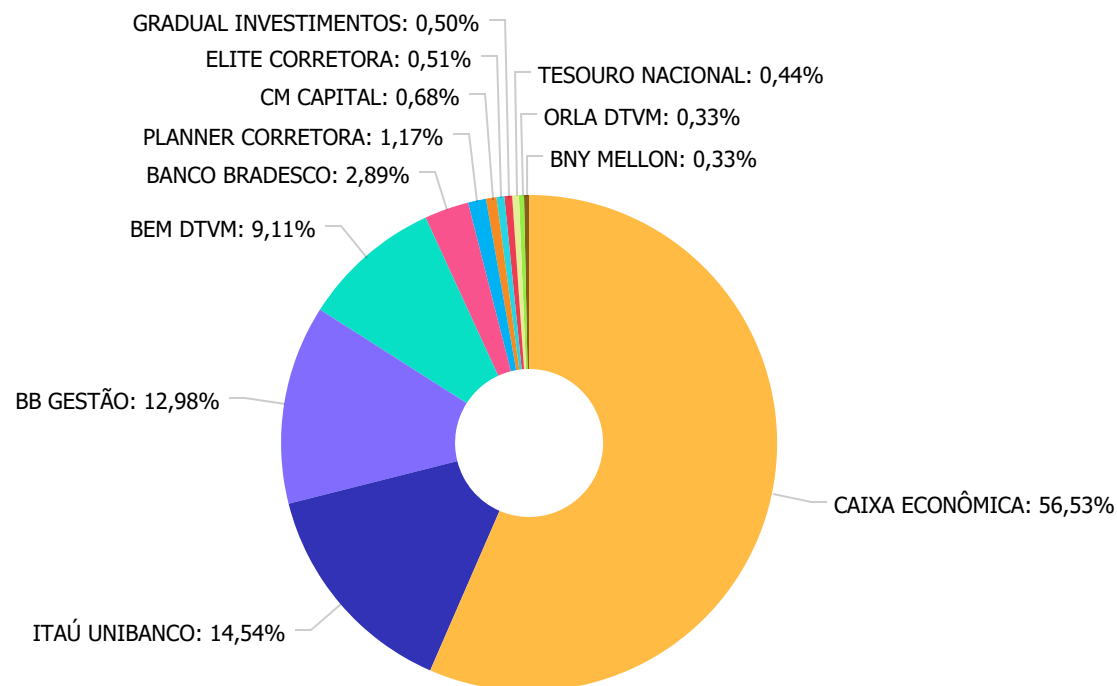
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	0,00%	-0,81%	-0,22%	-0,60%	-	-	0,00%	0,00%
OSASCO PROPERTIES FII	0,00%	-55,09%	-54,78%	-55,02%	199.547.886,84%	199.547.886,84%	-	-
ÁTICO FLORESTAL BRASIL FICFIP	-	-	-	-	-	-	-	-

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

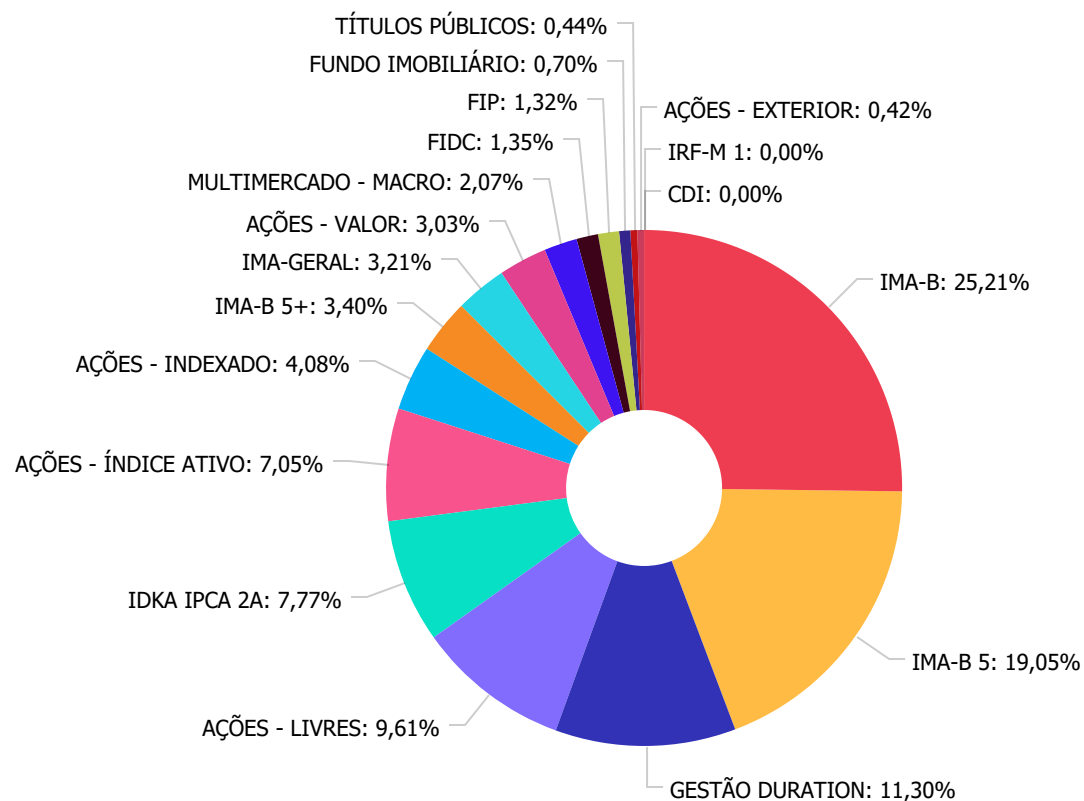
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	1,77%	34,78%	9,44%	26,60%	55,42%	70,67%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	1,88%	35,34%	9,28%	27,06%	55,47%	69,34%	0,09%	0,19%

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



CAIXA ECONÔMICA	267.825.471,63
ITAÚ UNIBANCO	68.870.438,57
BB GESTÃO	61.485.861,01
BEM DTVM	43.169.574,09
BANCO BRADESCO	13.687.669,32
PLANNER CORRETORA	5.556.845,85
CM CAPITAL	3.231.895,57
ELITE CORRETORA	2.435.816,10
GRADUAL INVESTIMENTOS	2.377.834,92
TESOURO NACIONAL	2.068.504,74
ORLA DTVM	1.554.541,74
BNY MELLON	1.547.569,52

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



IMA-B	119.434.259,06
IMA-B 5	90.254.552,04
GESTÃO DURATION	53.546.568,44
AÇÕES - LIVRES	45.531.526,77
IDKA IPCA 2A	36.799.402,84
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	33.395.844,15
AÇÕES - INDEXADO	19.350.249,57
IMA-B 5+	16.105.915,57
IMA-GERAL	15.227.716,60
AÇÕES - VALOR	14.353.877,38
MULTIMERCADO - MACRO	9.816.734,29
FIDC	6.413.334,06
FIP	6.238.155,31
FUNDO IMOBILIÁRIO	3.302.076,16
TÍTULOS PÚBLICOS	2.068.504,74
AÇÕES - EXTERIOR	1.972.939,62
IRF-M 1	228,90
CDI	137,56

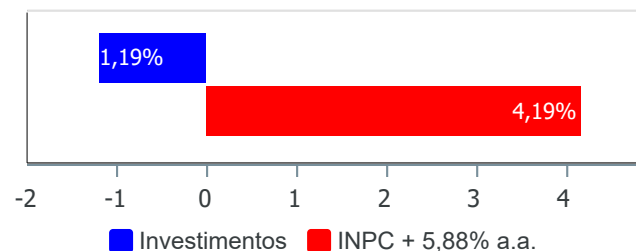
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Julho / 2020)

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	4.909,929023	1.997.348,05	2.032.710,62	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	18/11/2019	7	4.995,267412	5.113,448336	34.966,87	35.794,14	Curva

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

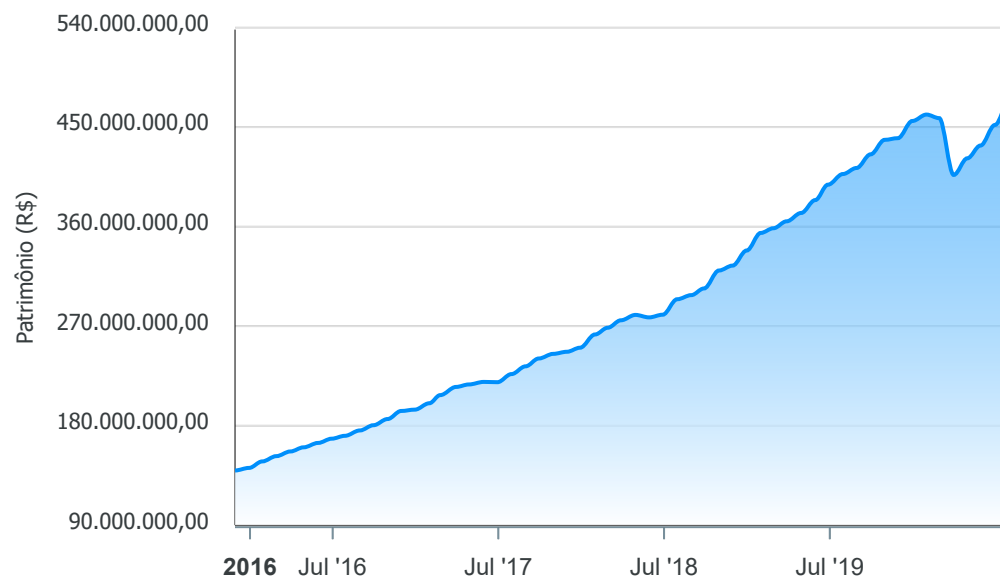
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	454.864.737,50	21.816.085,69	16.528.778,45	461.323.639,85	1.171.595,11	1.171.595,11	0,25%	0,25%	0,69%	0,69%	36,85%	3,25%
Fevereiro	461.323.639,85	10.707.825,40	6.130.332,45	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%
Mai	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%

Investimentos x Meta Atuarial



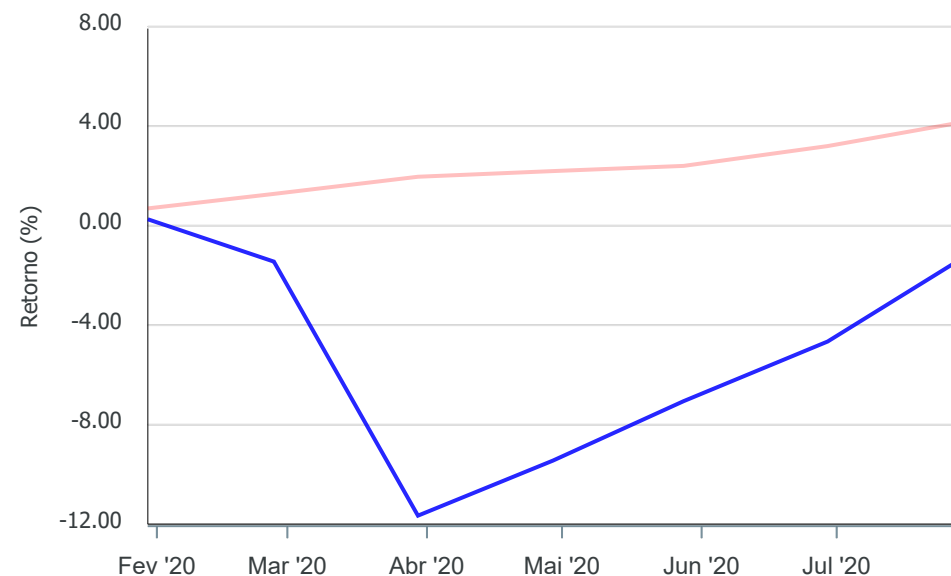
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	15.011.320,78	0,00	0,00	16.105.915,57	1.094.594,79	7,29%	7,29%	3,79%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	13.101.413,61	0,00	0,00	13.687.669,32	586.255,71	4,47%	4,47%	2,33%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	82.581.317,98	42.000,00	0,00	86.236.887,21	3.613.569,23	4,37%	4,38%	2,27%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	15.699.416,08	2.361.514,36	0,00	18.758.764,36	697.833,92	3,86%	4,43%	2,30%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.953.781,04	0,00	1.000.000,00	15.227.716,60	273.935,56	1,72%	1,77%	1,05%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	740.679,14	0,00	0,00	750.938,17	10.259,03	1,39%	1,39%	0,94%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	75.814.273,04	0,00	0,00	76.552.393,51	738.120,47	0,97%	0,97%	0,83%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	51.433.456,10	971.393,20	366.979,58	52.545.786,98	507.917,26	0,97%	0,98%	0,92%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	13.515.493,37	55.741,69	0,00	13.702.158,53	130.923,47	0,96%	0,97%	0,81%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	25.386.050,91	0,00	1.000.000,00	24.594.447,99	208.397,08	0,82%	0,83%	0,77%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	12.107.291,52	0,00	0,00	12.204.954,85	97.663,33	0,81%	0,81%	0,74%
TÍTULOS PÚBLICOS	2.055.345,63	0,00	0,00	2.068.504,74	13.159,11	0,64%	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	3.541.764,08	0,00	331.335,88	3.231.895,57	21.467,37	0,61%	-8,75%	14,75%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	12.816,02	0,00	12.855,39	0,00	39,37	0,31%	0,55%	0,26%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	137,22	0,00	0,00	137,56	0,34	0,25%	0,25%	0,03%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	42.193,29	0,00	42.000,00	228,90	35,61	0,08%	0,24%	0,15%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	55.697,15	0,00	55.741,69	0,00	44,54	0,08%	0,23%	0,15%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	0,00	1.000.290,99	0,00	1.000.781,46	490,47	0,05%	1,92%	1,19%
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL	2.380.383,04	0,00	0,00	2.377.834,92	-2.548,12	-0,11%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	806.943,43	0,00	0,00	803.603,57	-3.339,86	-0,41%	-0,41%	0,24%

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
Total Renda Fixa	330.239.773,43	4.430.940,24	2.808.912,54	339.850.619,81	7.988.818,68	2,41%		1,64%

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
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	11.408.317,87	1.586.670,65	0,00	14.353.877,38	1.358.888,86	10,46%	10,71%	9,96%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	11.418.359,68	0,00	0,00	12.420.501,85	1.002.142,17	8,78%	8,78%	11,00%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	15.674.132,37	0,00	0,00	17.000.649,29	1.326.516,92	8,46%	8,46%	9,25%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	17.843.832,06	0,00	0,00	19.350.249,57	1.506.417,51	8,44%	8,44%	9,81%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	15.143.471,17	0,00	0,00	16.395.194,86	1.251.723,69	8,27%	8,27%	9,03%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	18.048.181,54	0,00	0,00	19.408.559,71	1.360.378,17	7,54%	7,54%	8,75%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	12.951.582,04	0,00	0,00	13.702.465,21	750.883,17	5,80%	5,80%	11,66%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	9.680.628,50	0,00	0,00	9.816.734,29	136.105,79	1,41%	1,41%	1,46%
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	2.438.814,13	0,00	0,00	2.435.816,10	-2.998,03	-0,12%	0,00%	0,00%
BRASIL FLORESTAL MULTIESTRATÉGIA FIP	776.626,28	0,00	0,00	775.505,77	-1.120,51	-0,14%	-0,14%	0,01%
OSASCO PROPERTIES FII	867.555,02	0,00	0,00	866.260,06	-1.294,96	-0,15%	0,00%	-
ÁTICO FLORESTAL BRASIL FICFIP	773.431,06	0,00	0,00	772.063,75	-1.367,31	-0,18%	-	-
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	4.699.071,81	0,00	0,00	4.690.585,79	-8.486,02	-0,18%	-	-
Total Renda Variável	121.724.003,53	1.586.670,65	0,00	131.988.463,63	8.677.789,45	7,04%		8,90%

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

MARINGÁ PREVIDÊNCIA - PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE MARINGÁ
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	0,00	2.000.000,00	0,00	1.972.939,62	-27.060,38	-1,35%	1,88%	8,52%
Total Renda Variável	0,00	2.000.000,00	0,00	1.972.939,62	-27.060,38	-1,35%		8,52%