

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

Relatório Analítico dos Investimentos

em outubro de 2020

Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 2020)

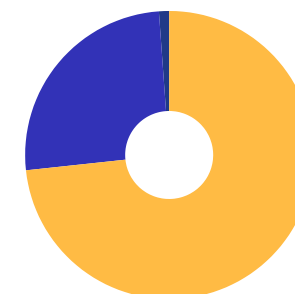
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
TÍTULOS PÚBLICOS			2.117.592,60	0,45%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	53.120.454,54	11,30%	874	0,39%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	15.141.867,76	3,22%	331	0,85%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	80.024.048,02	17,02%	954	0,44%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	32.534.710,95	6,92%	988	0,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	12.343.143,81	2,62%	910	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	14.968.281,88	3,18%	590	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	83.521.657,36	17,76%	902	1,44%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	229,75	0,00%	1.366	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	13.756.911,62	2,93%	653	0,31%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	137,92	0,00%	664	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	18.229.746,09	3,88%	104	2,85%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	D+1009	Não há	736.496,94	0,16%	28	1,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	13.234.257,04	2,81%	121	0,68%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3 du	Não há	980.886,62	0,21%	397	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	3.227.307,30	0,69%	33	2,07%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	786.150,21	0,17%	70	1,08%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL	D+1260	Não há	0,01	0,00%		0,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	D+4	Não há	17.629.076,94	3,75%	1.618	1,97%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'a'
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	15.575.523,58	3,31%	56	1,77%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'

Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 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	18.501.151,24	3,93%	45.375	0,48%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	11.602.282,28	2,47%	153	0,45%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	10.879.741,35	2,31%	3.347	0,74%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	14.363.886,10	3,05%	3.605	5,67%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	D+4	Não há	12.481.331,71	2,65%	13.414	1,22%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	9.681.227,23	2,06%	19.825	0,19%	Artigo 8º, Inciso III
ÁTICO FLORESTAL BRASIL FICFIP	Não se ...	Não se aplica	767.906,17	0,16%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'
BRASIL FLORESTAL MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	772.375,56	0,16%	21	0,56%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	4.663.212,89	0,99%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	Não se ...	Não se aplica	2.426.515,65	0,52%		1,55%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO...	D+5	Não há	1.008.969,35	0,21%	9.693	0,10%	Artigo 9º - A, Inciso II
SANTANDER GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERI...	D+8 du	Não há	2.159.941,04	0,46%	5.376	0,24%	Artigo 9º - A, Inciso II
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	D+4	Não há	2.187.325,39	0,47%	176	0,13%	Artigo 9º - A, Inciso III
OSASCO PROPERTIES FII	Não se ...	Não se aplica	862.722,91	0,18%		0,46%	Desenquadrado - RV
Total para cálculo dos limites da Resolução			470.287.069,81				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			566,47	Artigo 6º			
PL Total			470.287.636,28				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	2.117.592,60	0,45%	0,00%	0,50%	50,00%	233.025.942,31
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	305.411.305,69	64,94%	15,00%	50,50%	90,00%	117.847.057,14
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	70,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	23.514.353,49
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	50,00%	33.181.524,61	7,06%	2,00%	8,00%	40,00%	154.933.303,31
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'	10,00%	4.013.457,52	0,85%	0,00%	2,00%	5,00%	19.500.895,97
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b'	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	23.514.353,49
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'c'	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	23.514.353,49
Total Renda Fixa	100,00%	344.723.880,42	73,30%	17,00%	61,00%	200,00%	



RENTA FIXA 344.723.880,42

RENTA VARIÁVEL 120.206.953,61

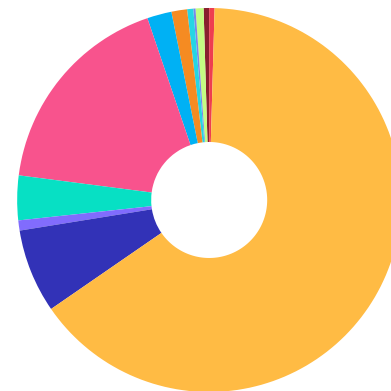
EXTERIOR 5.356.235,78

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!

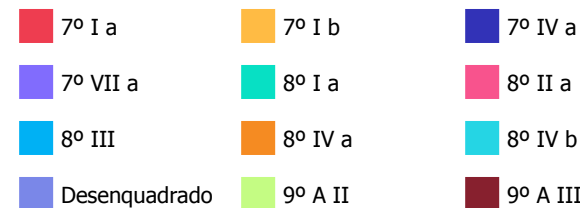


Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Outubro / 2020)

Artigos - Renda Variável	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'a'	40,00%	17.629.076,94	3,75%	0,00%	5,00%	10,00%	29.399.630,04
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'b'	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	23.514.353,49
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	30,00%	83.403.916,26	17,73%	7,00%	21,00%	30,00%	57.682.204,68
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'b'	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	47.028.706,98
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	9.681.227,23	2,06%	0,00%	3,00%	10,00%	37.347.479,75
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	5,00%	6.203.494,62	1,32%	0,00%	2,00%	5,00%	17.310.858,87
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	10,00%	2.426.515,65	0,52%	0,00%	1,00%	5,00%	21.087.837,84
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	23.514.353,49
Desenquadrado - RV	0,00%	862.722,91	0,18%	0,00%	0,00%	0,00%	-862.722,91
Total Renda Variável	40,00%	120.206.953,61	25,56%	7,00%	32,00%	80,00%	



Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2020			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	3.168.910,39	0,67%	0,00%	5,00%	10,00%	43.859.796,59
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	2.187.325,39	0,47%	0,00%	2,00%	5,00%	21.327.028,10
Total Exterior	10,00%	5.356.235,78	1,14%	0,00%	7,00%	15,00%	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	276.211.658,92	58,73	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	59.678.300,87	12,69	-
ITAÚ UNIBANCO	48.333.179,61	10,28	-
ITAÚ DTVM	15.575.523,58	3,31	-
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	14.363.886,10	3,05	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	13.234.257,04	2,81	-
SUL AMERICA INVESTIMENTOS GEST...	12.481.331,71	2,65	-
NAVI CAPITAL	10.879.741,35	2,31	-
A5 CAPITAL PARTNERS	4.663.212,89	0,99	-
GRAPHEN INVESTIMENTOS LTDA	3.949.162,80	0,84	-
AURORA CAPITAL	3.227.307,30	0,69	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	2.159.941,04	0,46	-
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	2.117.592,60	0,45	-
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	1.540.281,73	0,33	-
XP VISTA ASSET MANAGEMENT	1.008.969,35	0,21	-
CADENCE GESTORA	862.722,91	0,18	-
RJI CORRETORA DE VALORES	0,01	0,00	-

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 '	2.117.592,60	0,45	0,00	50,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	305.411.305,69	64,94	15,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	33.181.524,61	7,06	2,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	4.013.457,52	0,85	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 '	17.629.076,94	3,75	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	83.403.916,26	17,73	7,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso III	9.681.227,23	2,06	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	6.203.494,62	1,32	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	2.426.515,65	0,52	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso II	3.168.910,39	0,67	0,00	10,00
Artigo 9º - A, Inciso III	2.187.325,39	0,47	0,00	5,00

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA Geral ex-C (Benchmark)	0,00%	1,96%	-1,39%	2,13%	2,16%	17,10%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,07%	1,79%	-1,70%	2,07%	1,80%	17,32%	0,01%	0,04%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,04%	5,45%	1,09%	4,85%	6,73%	19,60%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,33%	4,89%	1,13%	5,25%	6,32%	18,19%	0,01%	0,03%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,15%	5,00%	0,98%	4,98%	6,16%	18,25%	0,01%	0,03%
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	1,43%	8,12%	3,48%	5,53%	11,13%	21,93%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1,00%	-4,79%	-1,48%	-2,53%	-5,37%	-2,10%	-	0,03%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	0,10%	-23,10%	-0,14%	-8,39%	-23,00%	-29,74%	-	0,03%
IMA-B 5+ (Benchmark)	0,22%	-4,35%	-5,92%	4,90%	-5,85%	28,98%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,22%	-4,61%	-5,99%	4,76%	-6,25%	27,85%	0,03%	0,16%
120% do CDI (Benchmark)	0,19%	2,93%	0,57%	1,35%	3,87%	11,65%	-	-
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL	0,00%	-	-	-	-	-	-	-
IRF-M 1 (Benchmark)	0,16%	3,29%	0,43%	1,38%	4,06%	11,49%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,14%	3,12%	0,37%	1,27%	3,86%	11,05%	0,00%	0,01%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA-B 5 (Benchmark)	0,20%	4,72%	0,50%	4,81%	5,71%	20,28%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,18%	4,48%	0,41%	4,66%	5,38%	19,69%	0,01%	0,03%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,19%	4,50%	0,40%	4,62%	5,42%	19,71%	0,01%	0,03%

IMA-B (Benchmark)	0,21%	-0,51%	-3,08%	4,81%	-1,00%	25,47%	-	-
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	0,10%	-0,70%	-3,31%	4,80%	-1,30%	25,25%	0,02%	0,10%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,19%	-0,81%	-3,15%	4,68%	-1,41%	24,69%	0,02%	0,10%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	0,00%	0,38%	-3,55%	4,37%	-0,42%	28,07%	0,03%	0,10%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	-0,19%	-3,71%	-1,92%	0,80%	-4,22%	9,20%	0,01%	0,06%

CDI (Benchmark)	0,16%	2,44%	0,47%	1,12%	3,21%	9,62%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,12%	1,89%	0,26%	1,09%	2,56%	8,75%	0,00%	0,00%

IPCA (Benchmark)	0,86%	2,22%	1,75%	1,99%	3,92%	6,55%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	-0,11%	4,42%	-1,16%	1,94%	4,51%	23,65%	0,01%	0,02%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,07%	-	-1,99%	2,03%	-	-	0,01%	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	1,70%	11,04%	4,32%	7,26%	14,74%	30,00%	-	-
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	-	-

IPCA + 9,00% ao ano (Benchmark)	1,59%	9,79%	3,97%	6,52%	13,19%	26,51%	-	-
BRASIL FLORESTAL MULTISTRATÉGIA FIP	-0,13%	-	-0,40%	-0,80%	32,95%	-	0,00%	-

IGC (Benchmark)	-1,00%	-15,47%	-8,22%	18,56%	-7,28%	18,78%	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	-0,82%	-18,46%	-8,90%	16,42%	-11,42%	11,13%	0,12%	0,40%

Ibovespa (Benchmark)	-0,69%	-18,76%	-8,71%	16,70%	-12,37%	7,47%	-	-
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	-1,33%	-17,14%	-8,38%	16,50%	-9,12%	15,39%	0,11%	0,40%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	-3,59%	-28,12%	-13,05%	14,81%	-20,07%	8,28%	0,13%	0,48%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	-0,94%	-23,85%	-12,39%	10,44%	-15,40%	2,66%	0,11%	0,40%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-4,17%	-35,96%	-15,33%	9,64%	-27,31%	-4,47%	0,12%	0,51%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-2,89%	-18,03%	-12,41%	10,59%	-10,48%	21,24%	0,11%	0,38%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	0,50%	-20,29%	-4,68%	18,03%	-12,18%	19,23%	0,11%	0,41%

CDI (Benchmark)	0,16%	2,44%	0,47%	1,12%	3,21%	9,62%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	-0,34%	-1,03%	-1,38%	2,71%	1,82%	18,95%	0,02%	0,07%

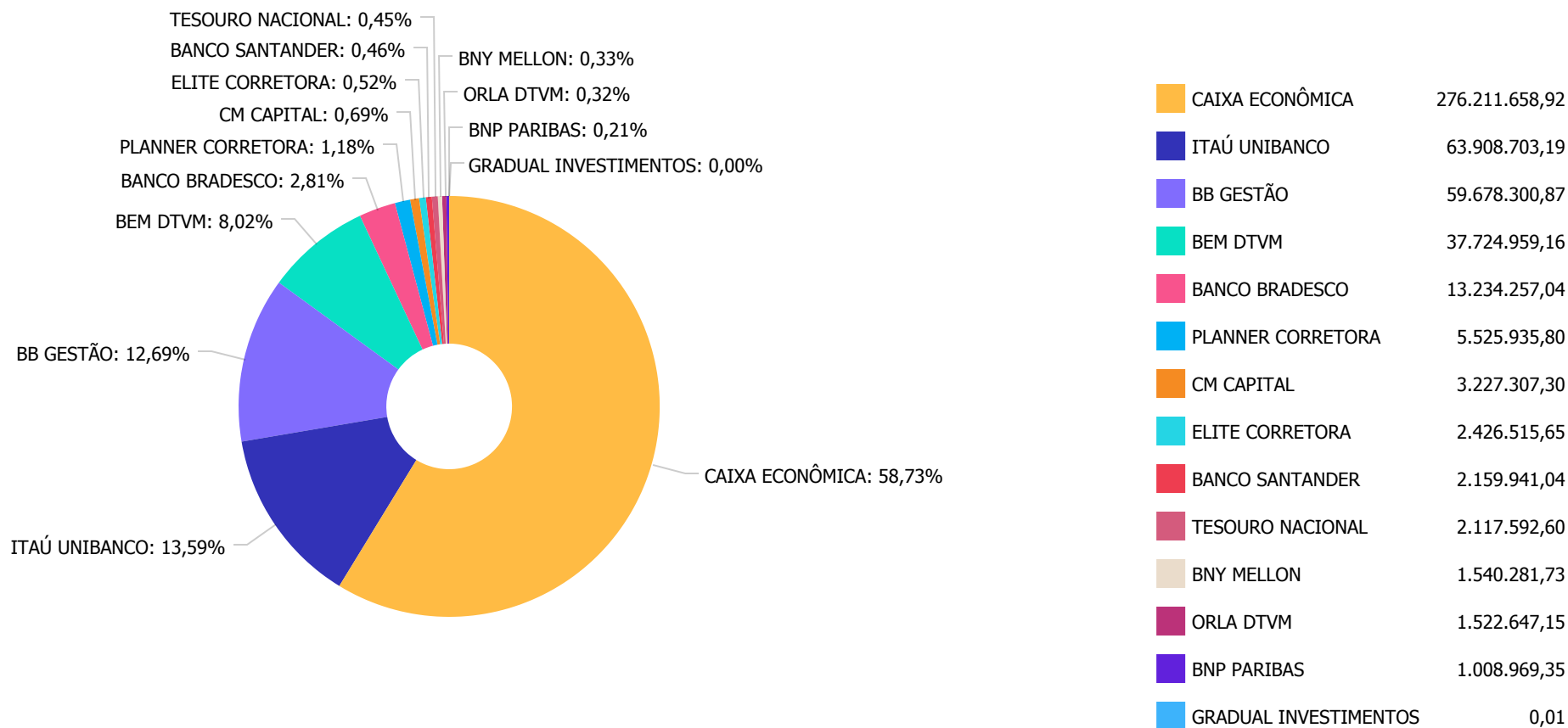
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Outubro/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	0,00%	-1,18%	-0,25%	-0,60%	-1,28%	-	0,00%	0,00%
OSASCO PROPERTIES FII	0,00%	-55,28%	-0,27%	-54,97%	-55,33%	198.707.271,31%	-	-
ÁTICO FLORESTAL BRASIL FICFIP	-	-	-	-	-	-	-	-

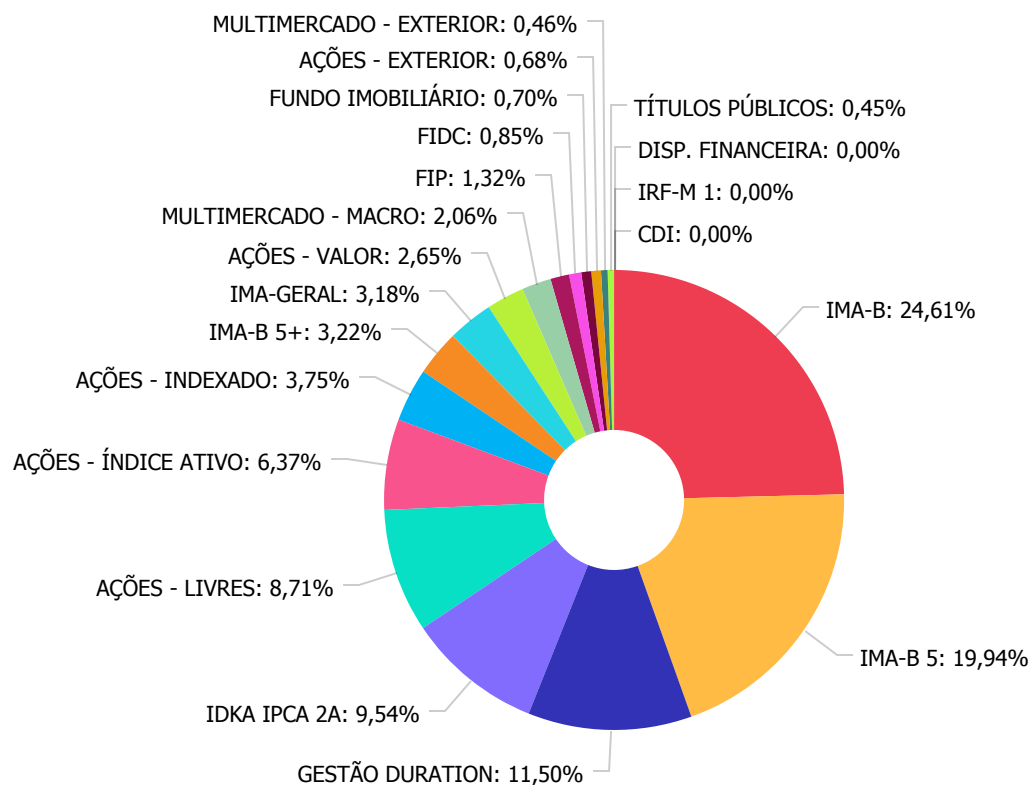
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Outubro/2020 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	-1,75%	48,79%	10,39%	20,81%	59,76%	95,14%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	-1,77%	50,05%	10,87%	21,16%	60,56%	94,90%	0,13%	0,23%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕ...	-1,03%	84,34%	17,49%	37,99%	-	-	0,10%	-
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
SANTANDER GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCAD...	-0,61%	53,87%	11,77%	22,82%	61,96%	88,99%	0,08%	0,21%

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



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



IMA-B	115.722.157,43
IMA-B 5	93.780.959,64
GESTÃO DURATION	54.101.341,16
IDKA IPCA 2A	44.877.854,76
AÇÕES - LIVRES	40.983.174,87
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	29.939.409,68
AÇÕES - INDEXADO	17.629.076,94
IMA-B 5+	15.141.867,76
IMA-GERAL	14.968.281,88
AÇÕES - VALOR	12.481.331,71
MULTIMERCADO - MACRO	9.681.227,23
FIP	6.203.494,62
FIDC	4.013.457,52
FUNDO IMOBILIÁRIO	3.289.238,56
AÇÕES - EXTERIOR	3.196.294,74
MULTIMERCADO - EXTERIOR	2.159.941,04
TÍTULOS PÚBLICOS	2.117.592,60
DISP. FINANCEIRA	566,47
IRF-M 1	229,75

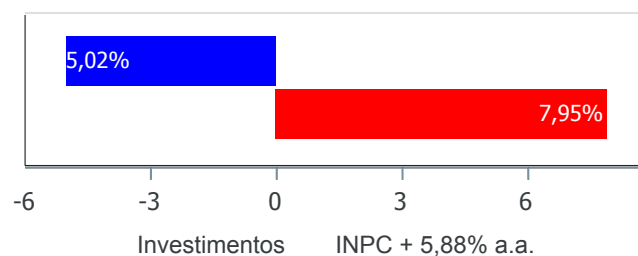
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Outubro / 2020)

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	5.026,495259	1.997.348,05	2.080.969,04	Curva
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2055	18/11/2019	7	4.995,267412	5.231,938996	34.966,87	36.623,57	Curva

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

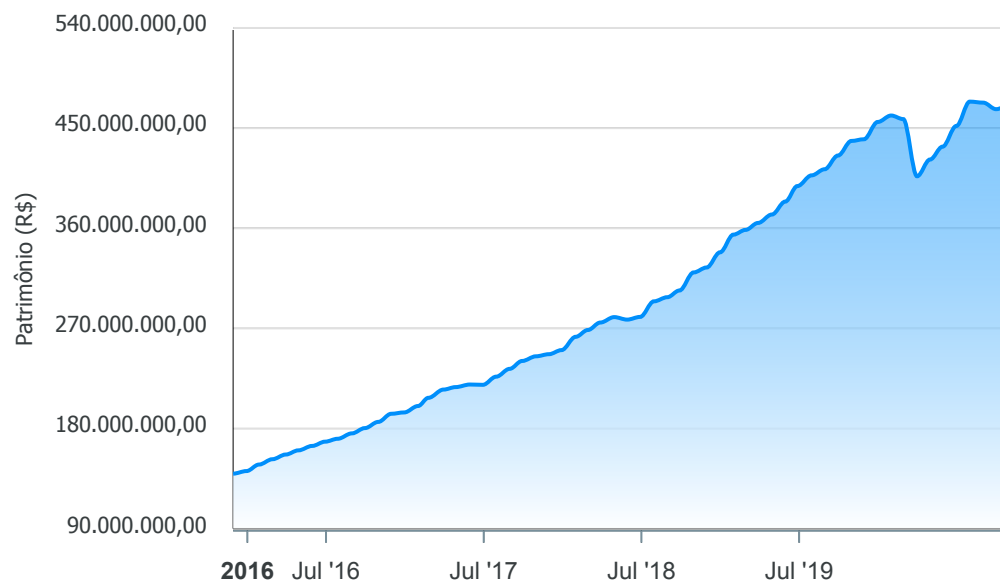
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	454.864.737,50	21.816.085,69	16.528.778,45	461.323.639,85	1.171.595,11	1.171.595,11	0,25%	0,25%	0,69%	0,69%	36,85%	3,25%
Fevereiro	461.323.639,85	10.707.825,40	6.130.332,45	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%
Setembro	472.906.882,54	6.975.863,10	1.000.000,00	467.031.632,12	-11.851.113,52	-22.072.938,57	-2,47%	-4,74%	1,35%	6,49%	-73,04%	4,56%
Outubro	467.031.632,12	4.761.985,03	125.134,25	470.287.069,81	-1.381.413,09	-23.454.351,66	-0,29%	-5,02%	1,37%	7,95%	-63,13%	3,89%

Investimentos x Meta Atuarial



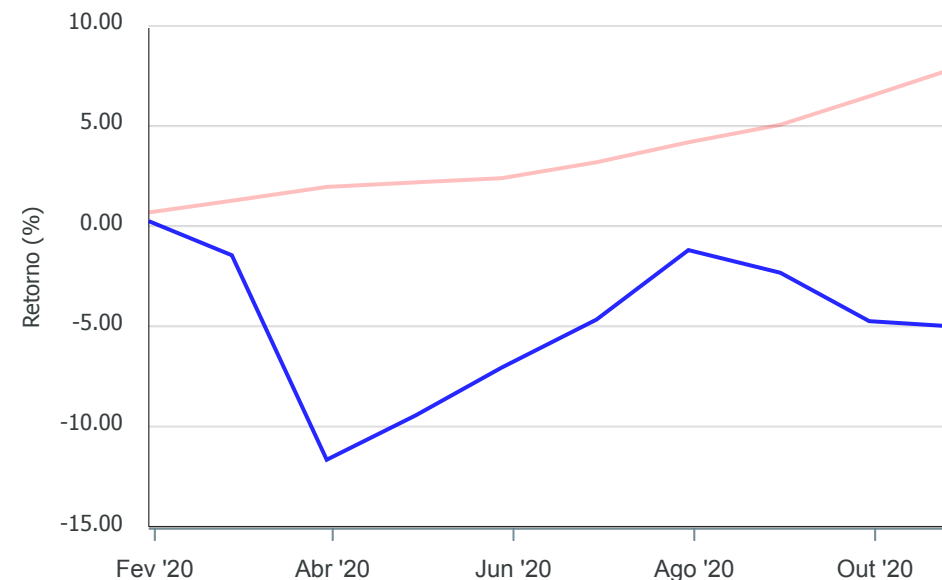
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Outubro/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	776.126,60	0,00	0,00	786.150,21	10.023,61	1,29%	-	-
TÍTULOS PÚBLICOS	2.094.482,62	0,00	0,00	2.117.592,60	23.109,98	1,10%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	12.302.718,72	0,00	0,00	12.343.143,81	40.425,09	0,33%	0,33%	1,02%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	15.108.954,76	0,00	0,00	15.141.867,76	32.913,00	0,22%	0,22%	3,31%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	83.360.333,83	0,00	0,00	83.521.657,36	161.323,53	0,19%	0,19%	2,25%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	13.731.279,34	0,00	0,00	13.756.911,62	25.632,28	0,19%	0,19%	1,12%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	75.732.232,13	4.159.857,62	0,00	80.024.048,02	131.958,27	0,17%	0,18%	1,10%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	32.379.407,96	105.776,14	200,69	32.534.710,95	49.727,54	0,15%	0,15%	1,15%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	229,43	0,00	0,00	229,75	0,32	0,14%	0,14%	0,24%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	137,76	0,00	0,00	137,92	0,16	0,12%	0,12%	0,34%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	13.221.415,42	0,00	0,00	13.234.257,04	12.841,62	0,10%	0,10%	2,31%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	3.224.207,50	0,00	0,00	3.227.307,30	3.099,80	0,10%	-	-
INCENTIVO II FIDC MULTISSETORIAL	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	18.229.837,08	0,00	0,00	18.229.746,09	-90,99	0,00%	0,00%	2,67%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	14.978.802,59	0,00	0,00	14.968.281,88	-10.520,71	-0,07%	-0,07%	1,35%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	981.594,24	0,00	0,00	980.886,62	-707,62	-0,07%	-0,07%	1,48%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	52.804.975,54	496.351,27	124.933,56	53.120.454,54	-55.938,71	-0,10%	-0,11%	1,18%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	737.877,29	0,00	0,00	736.496,94	-1.380,35	-0,19%	-0,19%	1,30%
Total Renda Fixa	339.664.612,82	4.761.985,03	125.134,25	344.723.880,42	422.416,82	0,12%		1,64%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	18.409.487,21	0,00	0,00	18.501.151,24	91.664,03	0,50%	0,50%	10,68%
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	2.429.688,80	0,00	0,00	2.426.515,65	-3.173,15	-0,13%	0,00%	0,00%
BRASIL FLORESTAL MULTIESTRATÉGIA FIP	773.399,38	0,00	0,00	772.375,56	-1.023,82	-0,13%	-0,13%	0,01%
OSASCO PROPERTIES FII	863.900,35	0,00	0,00	862.722,91	-1.177,44	-0,14%	0,00%	-
ÁTICO FLORESTAL BRASIL FICFIP	769.115,23	0,00	0,00	767.906,17	-1.209,06	-0,16%	-	-
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	4.671.459,71	0,00	0,00	4.663.212,89	-8.246,82	-0,18%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	9.714.174,51	0,00	0,00	9.681.227,23	-32.947,28	-0,34%	-0,34%	2,29%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	17.774.196,19	0,00	0,00	17.629.076,94	-145.119,25	-0,82%	-0,82%	11,99%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	14.499.701,71	0,00	0,00	14.363.886,10	-135.815,61	-0,94%	-0,94%	10,84%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	15.785.216,41	0,00	0,00	15.575.523,58	-209.692,83	-1,33%	-1,33%	10,90%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	11.203.990,04	0,00	0,00	10.879.741,35	-324.248,69	-2,89%	-2,89%	10,92%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	12.946.090,03	0,00	0,00	12.481.331,71	-464.758,32	-3,59%	-3,59%	12,60%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	12.107.088,92	0,00	0,00	11.602.282,28	-504.806,64	-4,17%	-4,17%	11,82%
Total Renda Variável	121.947.508,49	0,00	0,00	120.206.953,61	-1.740.554,88	-1,43%		10,27%

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

MARINGÁ PREVIDÊNCIA - PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS DE MARINGÁ
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/10/2020

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
SANTANDER GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	2.173.221,12	0,00	0,00	2.159.941,04	-13.280,08	-0,61%	-0,61%	7,89%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO E...	1.019.509,67	0,00	0,00	1.008.969,35	-10.540,32	-1,03%	-1,03%	9,62%
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	2.226.780,02	0,00	0,00	2.187.325,39	-39.454,63	-1,77%	-1,77%	13,32%
Total Renda Variável	5.419.510,81	0,00	0,00	5.356.235,78	-63.275,03	-1,17%		10,43%