

Relatório Analítico dos Investimentos

em setembro e 3º trimestre de 2020

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2020)

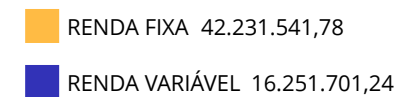
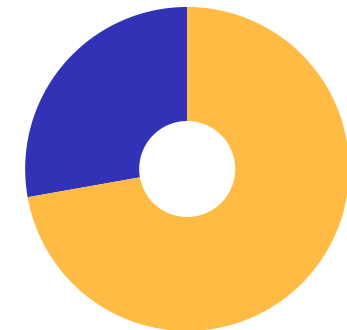
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	2.124.289,88	3,63%	903	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	2.282.332,00	3,90%	648	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	3.959.122,40	6,77%	676	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	3.612.211,75	6,18%	714	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	15/08/2022	548.732,39	0,94%	165	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	3.366.899,52	5,76%	130	0,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	10.041.105,92	17,17%	868	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	3.523.822,60	6,03%	982	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	6.078.724,14	10,39%	953	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	176.151,82	0,30%	463	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.038.823,26	1,78%	755	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	2.721.099,41	4,65%	121	0,14%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	D+0	Não há	222.317,11	0,38%	202	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	57.932,65	0,10%	301	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.477.703,37	2,53%	104	0,23%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	1.000.273,56	1,71%	290	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	3.884.559,36	6,64%	1.630	0,45%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+3	Não há	941.041,26	1,61%	9.414	0,34%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	2.425.467,89	4,15%	205	0,35%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	899.009,94	1,54%	46.574	0,02%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Enquadramento
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	1.949.160,37	3,33%	155	0,06%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
META VALOR FI AÇÕES	D+4	Não há	934.167,60	1,60%	188	0,33%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	2.273.089,15	3,89%	19.995	0,05%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	2.945.205,67	5,04%	20.023	0,13%	Artigo 8º, Inciso III
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		1,00	0,00%		0,00%	DF - Artigo 6º
Total para cálculo dos limites da Resolução			58.483.243,02				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			1,00				Artigo 6º
PL Total			58.483.244,02				

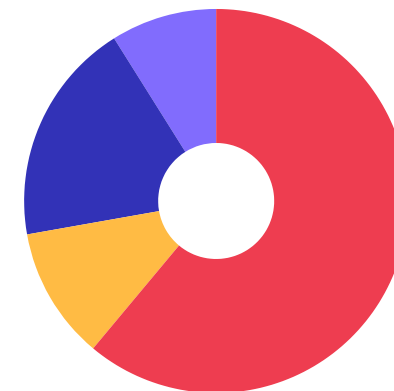
Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Setembro / 2020)

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	35.713.392,42	61,07%	20,00%	30,00%	90,00%	16.921.526,30
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	35.089.945,81
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	6.518.149,36	11,15%	10,00%	30,00%	40,00%	16.875.147,85
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	8.772.486,45
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.924.162,15
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.924.162,15
Total Renda Fixa	100,00%	42.231.541,78	72,21%	30,00%	70,00%	215,00%	



Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Setembro / 2020)

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	11.033.406,42	18,87%	7,00%	15,00%	20,00%	663.242,18
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	5.218.294,82	8,92%	7,00%	10,00%	10,00%	630.029,48
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	2.924.162,15
Total Renda Variável	30,00%	16.251.701,24	27,79%	14,00%	30,00%	35,00%	



■ 7º I b
 ■ 7º IV a
 ■ 8º II a
 ■ 8º III

Enquadramento por Gestores - base (Setembro / 2020)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA DTVM	25.096.031,95	42,91	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	18.391.112,30	31,45	0,00
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	8.735.783,93	14,94	0,00
ITAÚ UNIBANCO	3.426.863,74	5,86	0,00
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	1.000.273,56	1,71	-
META ASSET MANAGEMENT	934.167,60	1,60	0,33
ITAÚ DTVM	899.009,94	1,54	0,00

Artigo 20º - 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) - (Resolução 4963)

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 '	0,00	0,00	20,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	10,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	15,00
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 II, Alínea ' a '	0,00	0,00	7,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00	7,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	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
IDKA PRÉ 2 ANOS (Benchmark)	-0,47%	6,67%	0,06%	3,38%	8,65%	26,43%	-	-
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	-0,55%	6,45%	-0,05%	3,09%	8,31%	25,84%	1,76%	0,03%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,02%	5,41%	1,99%	5,41%	8,00%	21,88%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,11%	4,55%	1,61%	5,24%	7,28%	20,27%	1,35%	0,03%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,04%	4,84%	1,67%	5,27%	7,35%	20,53%	1,38%	0,03%
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%	1,65%	0,04%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	-0,15%	4,30%	1,18%	4,93%	6,95%	23,16%	1,65%	0,04%
IMA-B (Benchmark)	-1,51%	-0,72%	0,96%	5,97%	2,11%	34,14%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,56%	-0,93%	0,84%	5,77%	1,83%	33,39%	4,15%	0,11%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	-1,60%	-0,80%	0,92%	6,12%	2,03%	34,42%	4,24%	0,11%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	-1,67%	0,38%	0,73%	5,96%	3,18%	37,20%	4,50%	0,10%
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%	1,79%	0,03%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,61%	4,41%	-0,30%	3,01%	6,31%	24,12%	1,79%	0,03%

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
CDI (Benchmark)	0,16%	2,28%	0,51%	1,25%	3,54%	10,04%	-	-
BRADERCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	-0,11%	1,80%	0,20%	0,87%	3,00%	9,17%	0,09%	0,01%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,00%	1,42%	0,18%	0,66%	2,40%	7,66%	0,03%	0,00%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,09%	1,64%	0,29%	0,83%	2,68%	8,21%	0,00%	0,00%

IPCA (Benchmark)	0,64%	1,34%	1,24%	0,81%	3,14%	6,12%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,19%	2,64%	0,98%	3,41%	5,12%	17,74%	1,15%	0,02%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,23%	2,47%	0,20%	1,32%	3,69%	17,87%	0,49%	0,01%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	-0,50%	4,53%	-0,09%	3,18%	6,41%	25,88%	1,68%	0,03%

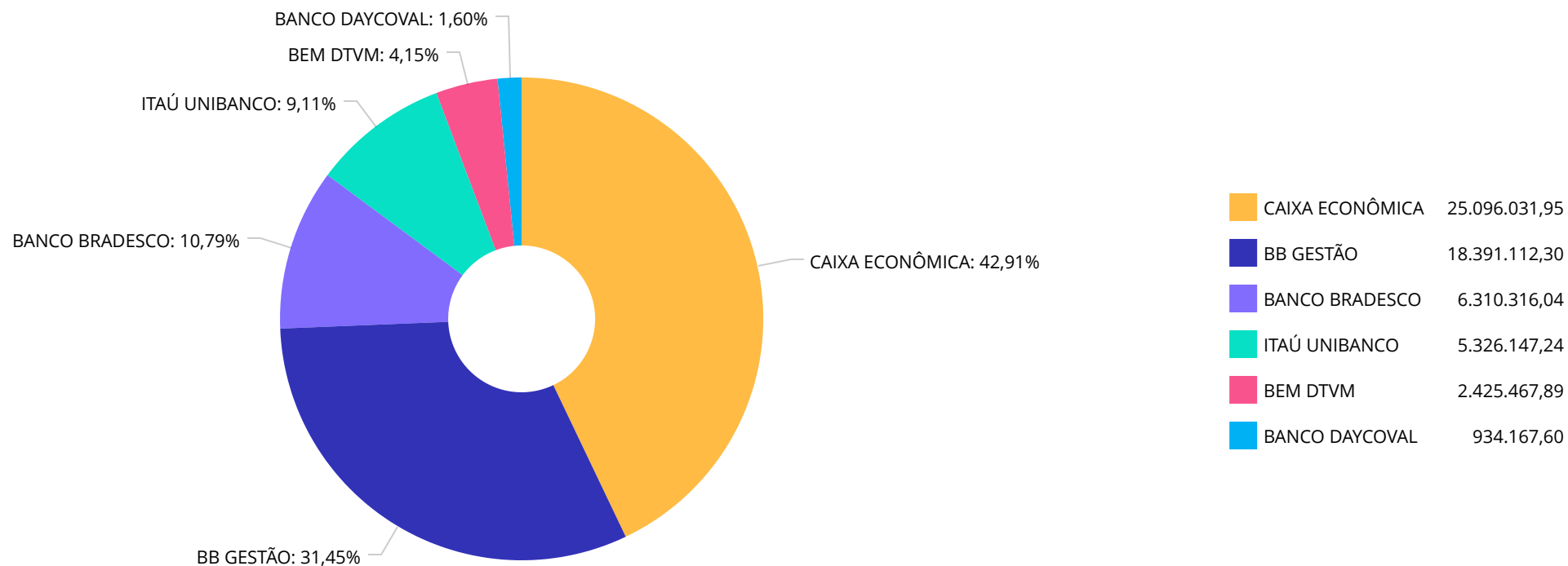
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IBX (Benchmark)	-4,58%	-17,42%	-0,04%	30,33%	-8,59%	23,26%	-	-
META VALOR FI AÇÕES	-5,43%	-11,33%	1,65%	50,70%	4,49%	40,19%	11,81%	0,51%

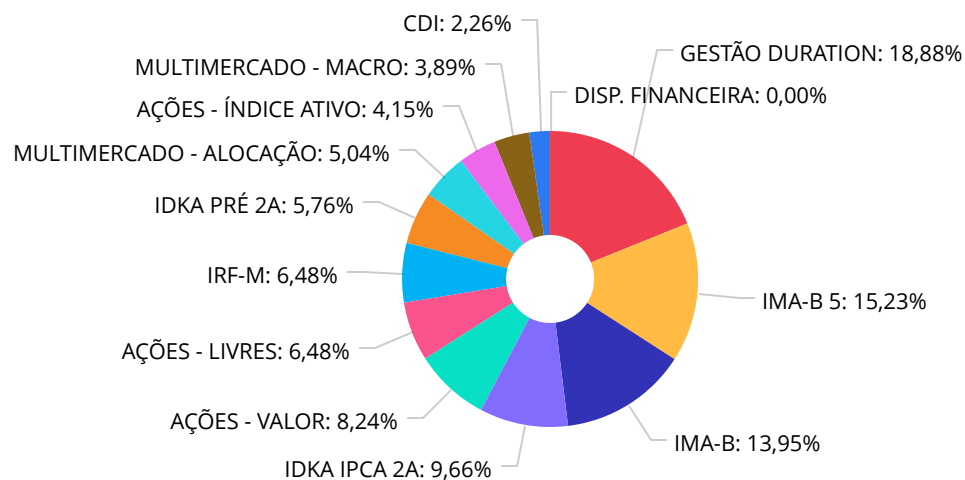
Ibovespa (Benchmark)	-4,80%	-18,20%	-0,48%	29,56%	-9,68%	19,23%	-	-
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-4,94%	-11,01%	3,01%	39,99%	0,91%	53,79%	10,55%	0,43%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-8,03%	-33,17%	-6,52%	24,90%	-23,46%	13,87%	11,91%	0,51%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-4,77%	-19,95%	-2,30%	22,29%	-9,26%	41,30%	9,73%	0,36%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	-2,74%	-20,15%	5,81%	32,85%	-12,72%	15,23%	10,29%	0,40%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-4,96%	-20,69%	2,00%	30,39%	-10,53%	31,29%	10,80%	0,41%

CDI (Benchmark)	0,16%	2,28%	0,51%	1,25%	3,54%	10,04%	-	-
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	-2,05%	-3,54%	-0,45%	8,24%	0,88%	14,18%	3,06%	0,11%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	-0,91%	-0,69%	0,35%	5,77%	3,05%	22,65%	1,88%	0,07%

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



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

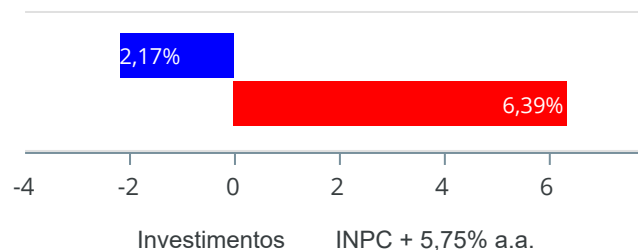


■ GESTÃO DURATION	11.041.379,48	■ IMA-B 5	8.909.788,53	■ IMA-B	8.157.925,18	■ IDKA IPCA 2A	5.648.112,48
■ AÇÕES - VALOR	4.818.726,96	■ AÇÕES - LIVRES	3.789.211,57	■ IRF-M	3.788.363,57	■ IDKA PRÉ 2A	3.366.899,52
■ MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	2.945.205,67	■ AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	2.425.467,89	■ MULTIMERCADO - MACRO	2.273.089,15	■ CDI	1.319.073,02
■ DISP. FINANCEIRA	1,00						

Retorno e Meta de Rentabilidade 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	54.761.905,70	13.378.481,74	13.320.807,95	54.956.059,28	136.479,79	136.479,79	0,25%	0,25%	0,68%	0,68%	36,60%	2,53%
Fevereiro	54.956.059,28	2.191.580,42	746.408,09	55.583.418,29	-817.813,32	-681.333,53	-1,45%	-1,20%	0,57%	1,25%	-95,99%	3,67%
Março	55.583.418,29	2.165.477,03	124.820,35	53.461.223,34	-4.162.851,63	-4.844.185,16	-7,22%	-8,34%	0,67%	1,93%	-431,44%	14,53%
Abril	53.461.223,34	508.718,99	135.002,45	54.889.485,31	1.054.545,43	-3.789.639,73	1,96%	-6,55%	0,21%	2,15%	-304,30%	7,16%
Mai	54.889.485,31	443.003,61	120.163,26	56.522.612,95	1.310.287,29	-2.479.352,44	2,37%	-4,33%	0,19%	2,35%	-184,27%	3,74%
Junho	56.522.612,95	315.365,61	60.162,46	58.042.803,28	1.264.987,18	-1.214.365,26	2,23%	-2,20%	0,77%	3,14%	-70,07%	3,11%
Julho	58.042.803,28	251.217,99	141.288,64	59.497.518,24	1.344.785,61	130.420,35	2,31%	0,06%	0,95%	4,12%	1,57%	2,56%
Agosto	59.497.518,24	6.974.906,13	6.603.105,73	59.432.977,56	-436.341,08	-305.920,73	-0,73%	-0,66%	0,83%	4,98%	-13,34%	2,76%
Setembro	59.432.977,56	3.437.040,70	3.485.228,35	58.483.243,02	-901.546,89	-1.207.467,62	-1,52%	-2,17%	1,34%	6,39%	-33,98%	3,71%

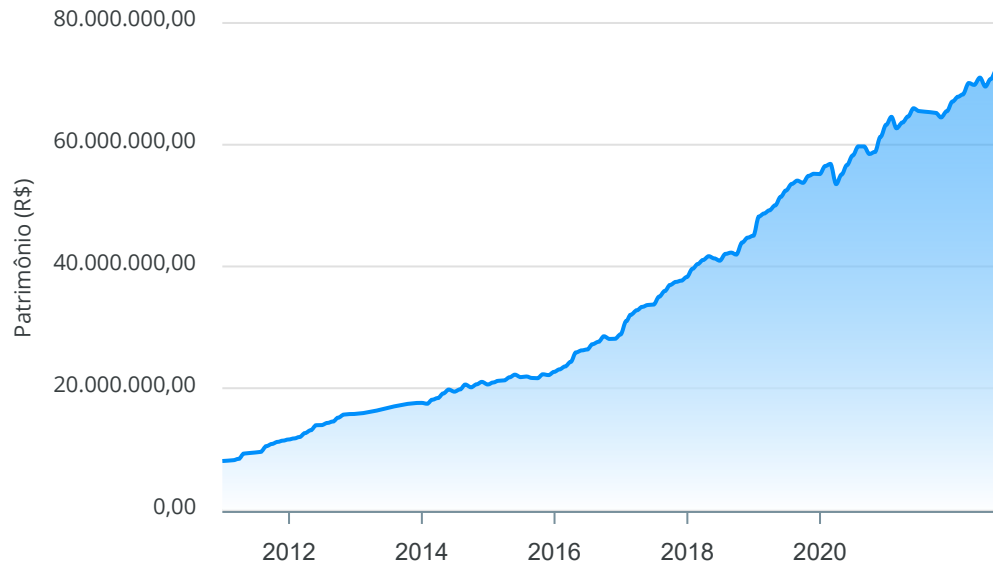
Investimentos x Meta de Rentabilidade



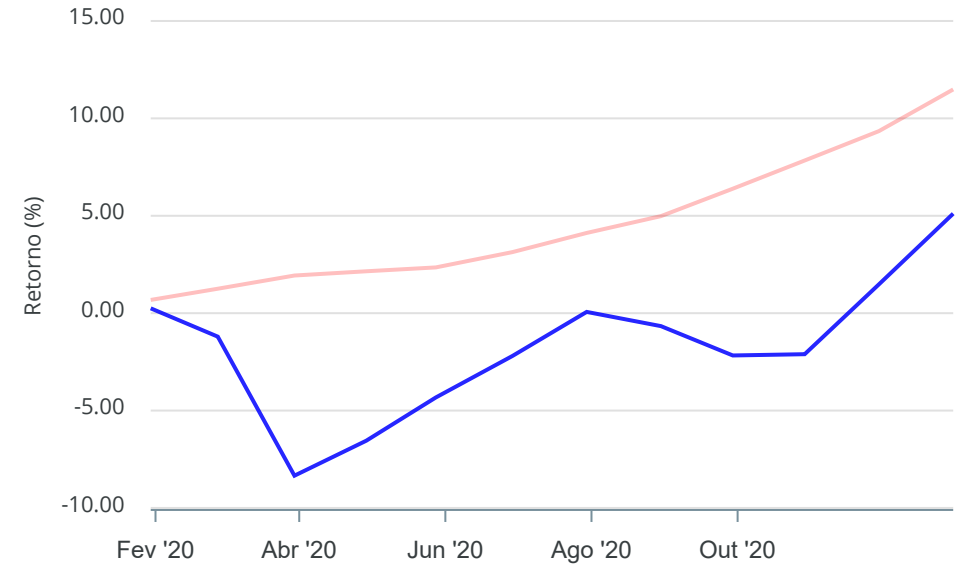
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

ANO 36M

Evolução do Patrimônio



Comparativo



- Investimentos Meta de Rentabilidade CDI IMA-B
- IMA-B 5 IMA-B 5+ IMA Geral IRF-M IRF-M 1
- IRF-M 1+ Ibovespa IBX SMLL IDIV
- Investimentos Meta de Rentabilidade 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 VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	547.686,56	0,00	0,00	548.732,39	1.045,83	0,19%	0,19%	1,15%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	2.121.868,61	0,00	0,00	2.124.289,88	2.421,27	0,11%	0,11%	1,35%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	3.932.277,94	0,00	412.000,00	3.523.822,60	3.544,66	0,09%	0,04%	1,38%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,00	1.058.692,62	1.000.857,63	57.932,65	97,66	0,01%	0,09%	0,00%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	2.720.014,74	378.348,08	2.059.638,64	1.038.823,26	99,08	0,00%	0,00%	0,03%
BRDESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	235.308,37	0,00	12.732,08	222.317,11	-259,18	-0,11%	-0,11%	0,09%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2.285.844,05	0,00	0,00	2.282.332,00	-3.512,05	-0,15%	-0,15%	1,65%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	6.088.422,42	0,00	0,00	6.078.724,14	-9.698,28	-0,16%	-0,16%	1,65%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	1.002.273,88	0,00	0,00	1.000.273,56	-2.000,32	-0,20%	-0,23%	0,49%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	10.091.884,12	0,00	0,00	10.041.105,92	-50.778,20	-0,50%	-0,50%	1,68%
BRDESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	3.385.532,53	0,00	0,00	3.366.899,52	-18.633,01	-0,55%	-0,55%	1,76%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	177.237,76	0,00	0,00	176.151,82	-1.085,94	-0,61%	-0,61%	1,79%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	3.636.115,86	0,00	0,00	3.612.211,75	-23.904,11	-0,66%	-0,66%	1,79%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	4.021.677,39	0,00	0,00	3.959.122,40	-62.554,99	-1,56%	-1,56%	4,15%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	2.765.400,61	0,00	0,00	2.721.099,41	-44.301,20	-1,60%	-1,60%	4,24%
ITAÚ IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	1.502.770,31	0,00	0,00	1.477.703,37	-25.066,94	-1,67%	-1,67%	4,50%
Total Renda Fixa	44.514.315,15	1.437.040,70	3.485.228,35	42.231.541,78	-234.585,72	-0,53%		2,06%

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 ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	2.293.949,63	0,00	0,00	2.273.089,15	-20.860,48	-0,91%	-0,91%	1,88%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	1.996.510,23	1.000.000,00	0,00	2.945.205,67	-51.304,56	-1,71%	-2,05%	3,06%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	2.493.723,07	0,00	0,00	2.425.467,89	-68.255,18	-2,74%	-2,74%	10,29%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	4.079.152,79	0,00	0,00	3.884.559,36	-194.593,43	-4,77%	-4,77%	9,73%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	989.966,05	0,00	0,00	941.041,26	-48.924,79	-4,94%	-4,94%	10,55%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	945.940,17	0,00	0,00	899.009,94	-46.930,23	-4,96%	-4,96%	10,80%
META VALOR FI AÇÕES	0,00	1.000.000,00	0,00	934.167,60	-65.832,40	-6,58%	-5,43%	11,81%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	2.119.420,47	0,00	0,00	1.949.160,37	-170.260,10	-8,03%	-8,03%	11,91%
Total Renda Variável	14.918.662,41	2.000.000,00	0,00	16.251.701,24	-666.961,17	-3,94%		8,00%

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 IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	6.006.185,39	0,00	0,00	6.078.724,14	72.538,75	1,21%	1,21%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	3.869.313,43	0,00	412.000,00	3.523.822,60	66.509,17	1,72%	1,66%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	2.090.545,80	0,00	0,00	2.124.289,88	33.744,08	1,61%	1,61%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	3.926.348,23	0,00	0,00	3.959.122,40	32.774,17	0,83%	0,83%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2.255.674,28	0,00	0,00	2.282.332,00	26.657,72	1,18%	1,18%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	2.696.401,83	0,00	0,00	2.721.099,41	24.697,58	0,92%	0,92%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	1.570.147,67	0,00	1.033.153,46	548.732,39	11.738,18	0,75%	0,98%
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	2.492.974,83	0,00	1.500.000,00	1.000.273,56	7.298,73	0,29%	0,20%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	2.106.584,62	3.104.472,20	4.176.515,15	1.038.823,26	4.281,59	0,08%	0,18%
BRADESCO MAXI PODER PÚBLICO FI RENDA FIXA	328.771,86	0,00	107.096,48	222.317,11	641,73	0,20%	0,20%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,00	1.058.692,62	1.000.857,63	57.932,65	97,66	0,01%	0,29%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	176.688,85	0,00	0,00	176.151,82	-537,03	-0,30%	-0,30%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	3.368.628,72	0,00	0,00	3.366.899,52	-1.729,20	-0,05%	-0,05%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	10.050.206,07	0,00	0,00	10.041.105,92	-9.100,15	-0,09%	-0,09%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	3.624.731,07	0,00	0,00	3.612.211,75	-12.519,32	-0,35%	-0,35%
ITAU IMA-B ATIVO FIC RENDA FIXA	0,00	1.500.000,00	0,00	1.477.703,37	-22.296,63	-1,49%	0,72%
Total Renda Fixa	44.563.202,65	5.663.164,82	8.229.622,72	42.231.541,78	234.797,03	0,47%	

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
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	2.292.337,34	0,00	0,00	2.425.467,89	133.130,55	5,81%	5,81%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	4.244.862,76	0,00	2.000.000,00	2.273.089,15	28.226,39	0,66%	0,35%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	881.365,92	0,00	0,00	899.009,94	17.644,02	2,00%	2,00%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	0,00	3.000.000,00	0,00	2.945.205,67	-54.794,33	-1,83%	-0,45%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	0,00	1.000.000,00	0,00	941.041,26	-58.958,74	-5,90%	3,01%
META VALOR FI AÇÕES	0,00	1.000.000,00	0,00	934.167,60	-65.832,40	-6,58%	1,65%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	3.975.916,49	0,00	0,00	3.884.559,36	-91.357,13	-2,30%	-2,30%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	2.085.118,12	0,00	0,00	1.949.160,37	-135.957,75	-6,52%	-6,52%
Total Renda Variável	13.479.600,63	5.000.000,00	2.000.000,00	16.251.701,24	-227.899,39	-1,38%	

Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da empresa. As informações aqui contidas são somente com o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos. As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre os produtos mencionados, entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas ao objetivo, aos riscos e à política de investimento dos produtos. Todas as informações podem ser obtidas com o responsável pela distribuição, gestão ou no site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários).

Sua elaboração buscou atender os objetivos de investimentos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas aos investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de consultoria de valores mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe a consultoria de valores mobiliários a prestação dos serviços de orientação, recomendação e aconselhamento, de forma profissional, independente e individualizada, sobre investimentos no mercado de valores mobiliários, cuja adoção e implementação sejam exclusivas do cliente.

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no art. 6º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria nº 402/2008, art. 15, inciso III, alínea "a".

Os RPPS devem estar adequados às normativas pertinentes e principalmente a Portaria nº 519, de 24 de agosto de 2011 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963 de 25 de novembro de 2021 e suas alterações, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.