

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

Relatório Analítico dos Investimentos

em setembro e 3º trimestre de 2020

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2020)

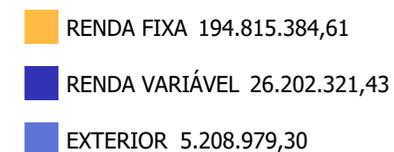
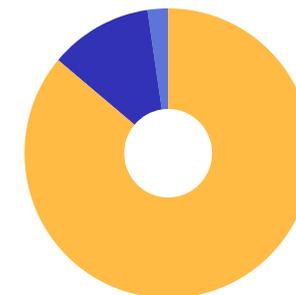
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	4.256.475,78	1,88%	463	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	4.370.113,17	1,93%	1.361	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	16.609.794,30	7,34%	953	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	5.804.430,00	2,57%	714	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	23.335.095,74	10,31%	982	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	13.278.367,14	5,87%	130	1,36%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	18.129.076,85	8,01%	903	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+0	15/08/2022	1.469.198,13	0,65%	95	0,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	27.961.899,40	12,36%	868	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	16.044.426,55	7,09%	676	0,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	38.018.411,93	16,81%	388	1,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	7.718.862,41	3,41%	1.239	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2024	847.120,50	0,37%	104	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	11.980.273,07	5,30%	126	1,52%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	4.991.839,64	2,21%	290	0,10%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	D+4	Não há	4.623.763,48	2,04%	1.637	0,51%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	9.579.159,03	4,23%	6.456	0,39%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	4.944.283,30	2,19%	6.258	0,30%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	2.556.633,14	1,13%	46.574	0,07%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BRADESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	2.166.084,76	0,96%	27	0,76%	Artigo 8º, Inciso III

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BRADESCO S&P 500 MAIS FI MULTIMERCADO	D+4	Não há	2.332.397,72	1,03%	947	1,66%	Artigo 8º, Inciso III
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+3 du	Não há	5.208.979,30	2,30%	32.266	0,83%	Artigo 9º - A, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			226.226.685,34				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			24.093,85				Artigo 6º
PL Total			226.250.779,19				

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

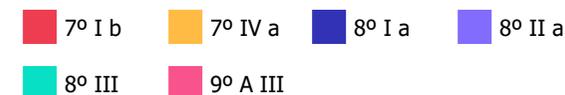
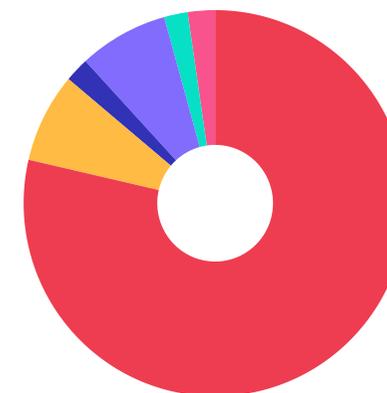
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	177.843.271,90	78,61%	0,00%	70,00%	100,00%	48.383.413,44
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	16.972.112,71	7,50%	0,00%	10,00%	40,00%	73.518.561,43
Total Renda Fixa	100,00%	194.815.384,61	86,12%	0,00%	80,00%	140,00%	



Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 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 I, Alínea ' a '	30,00%	4.623.763,48	2,04%	0,00%	2,00%	20,00%	40.621.573,59
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	17.080.075,47	7,55%	0,00%	15,00%	20,00%	28.165.261,60
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	45.245.337,07
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	4.498.482,48	1,99%	0,00%	2,00%	10,00%	18.124.186,05
Total Renda Variável	30,00%	26.202.321,43	11,58%	0,00%	20,00%	70,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2020			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	5.208.979,30	2,30%	0,00%	0,00%	0,00%	-5.208.979,30
Total Exterior	10,00%	5.208.979,30	2,30%	0,00%	0,00%	0,00%	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	115.398.910,82	51,01	0,02
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	58.998.736,72	26,08	0,00
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	29.757.122,69	13,15	0,00
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	9.579.159,03	4,23	0,01
ITAÚ UNIBANCO	7.548.472,78	3,34	0,00
AZ QUEST INVESTIMENTOS	4.944.283,30	2,19	0,02

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 '	177.843.271,90	78,61	0,00	100,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	16.972.112,71	7,50	0,00	40,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	4.623.763,48	2,04	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	17.080.075,47	7,55	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	4.498.482,48	1,99	0,00	10,00

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%	-	-
BRABESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	-0,55%	6,45%	-0,05%	3,09%	8,31%	25,84%	0,02%	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%	0,01%	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%	0,01%	0,03%
IRF-M 1+ (Benchmark)	-0,91%	5,40%	-0,59%	3,90%	7,61%	30,00%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,98%	5,16%	-0,68%	3,70%	7,33%	29,68%	0,03%	0,04%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,15%	3,12%	0,51%	1,66%	4,54%	12,32%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,04%	2,83%	0,36%	1,43%	4,17%	11,70%	0,00%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,13%	2,97%	0,47%	1,57%	4,34%	11,93%	0,00%	0,01%
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%	0,02%	0,04%
BRABESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	-0,19%	4,48%	1,21%	5,10%	7,13%	23,57%	0,02%	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%	0,04%	0,11%

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
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,77%	-0,12%	-1,53%	3,55%	2,77%	20,76%	0,03%	0,07%
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%	0,02%	0,03%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,61%	4,41%	-0,30%	3,01%	6,31%	24,12%	0,02%	0,03%
IPCA (Benchmark)	0,64%	1,34%	1,24%	0,81%	3,14%	6,12%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,20%	5,28%	1,82%	5,68%	7,86%	27,55%	0,01%	0,03%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,23%	2,47%	0,20%	1,32%	3,69%	17,87%	0,00%	0,01%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	-0,50%	4,53%	-0,09%	3,18%	6,41%	25,88%	0,02%	0,03%

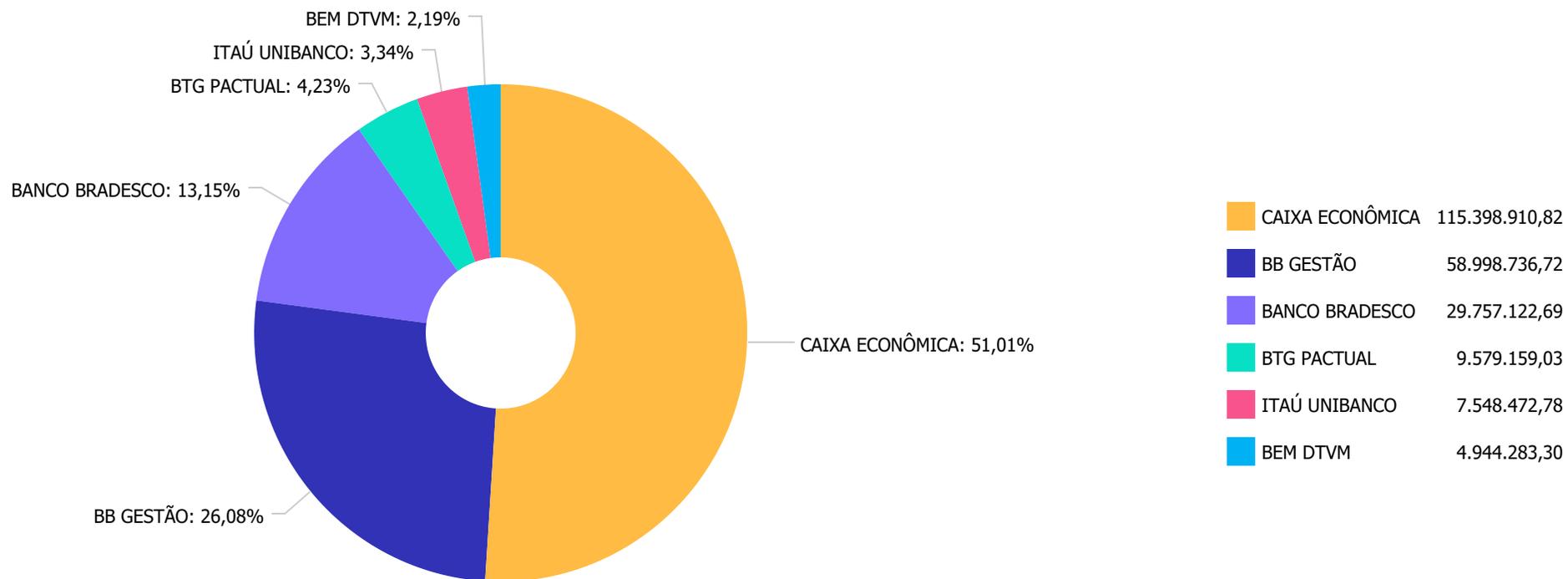
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
S&P 500 (Benchmark)	-3,92%	4,09%	8,47%	30,12%	12,98%	15,41%	-	-
BRDESCO S&P 500 MAIS FI MULTIMERCADO	-4,71%	1,16%	7,56%	27,65%	9,85%	14,93%	0,11%	0,24%
IGC (Benchmark)	-4,81%	-14,61%	0,77%	33,69%	-3,97%	32,91%	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	-5,04%	-17,78%	-0,39%	30,27%	-8,20%	24,95%	0,10%	0,40%
Ibovespa (Benchmark)	-4,80%	-18,20%	-0,48%	29,56%	-9,68%	19,23%	-	-
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-2,97%	-4,02%	4,71%	48,34%	5,55%	60,69%	0,11%	0,43%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-4,96%	-20,69%	2,00%	30,39%	-10,53%	31,29%	0,11%	0,41%
SMLL (Benchmark)	-5,44%	-18,93%	2,27%	35,50%	-1,78%	54,49%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	-5,97%	-17,19%	3,84%	32,93%	-0,96%	56,53%	0,11%	0,48%
CDI (Benchmark)	0,16%	2,28%	0,51%	1,25%	3,54%	10,04%	-	-
BRDESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	-0,37%	4,45%	0,01%	3,23%	6,11%	15,02%	0,01%	0,02%

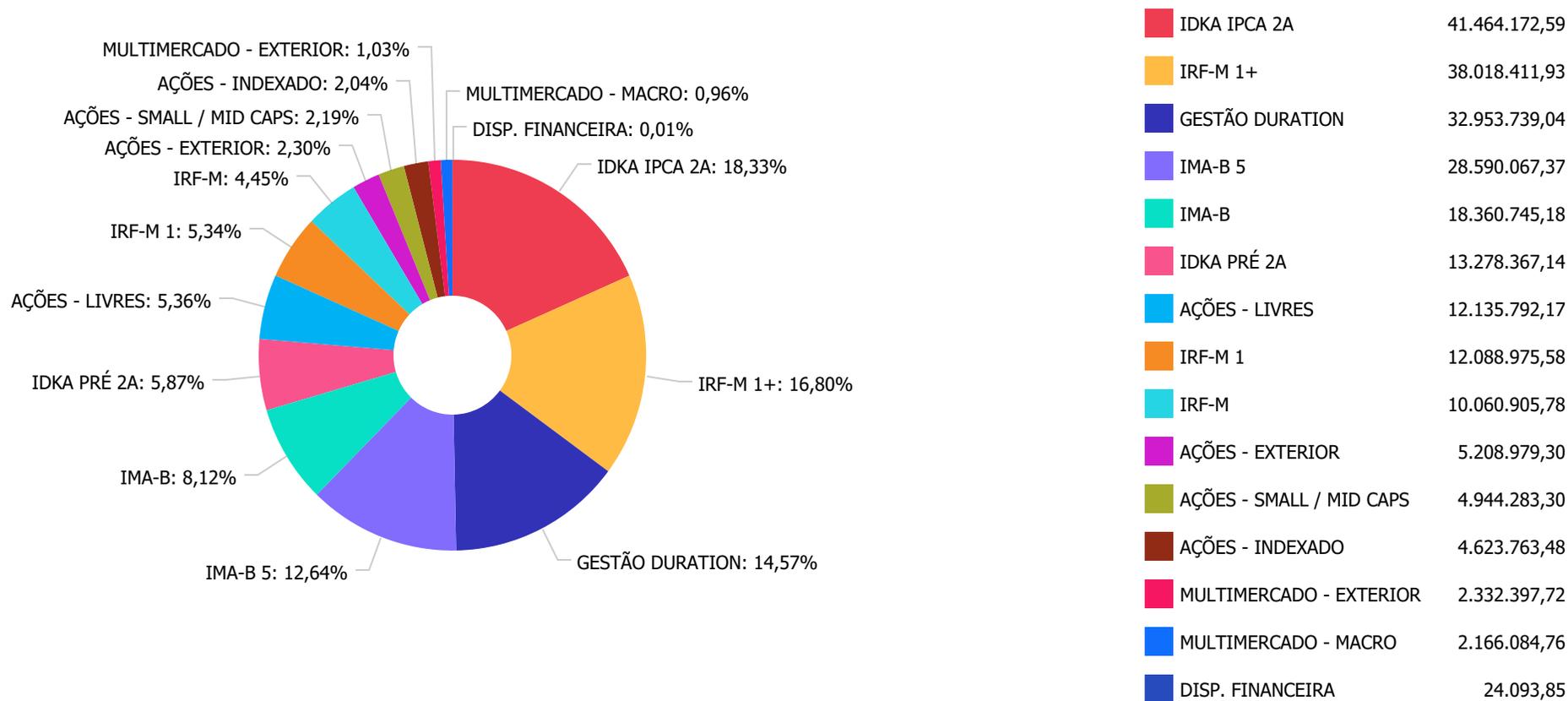
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2020 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Ibovespa (Benchmark)	-4,80%	-18,20%	-0,48%	29,56%	-9,68%	19,23%	-	-
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-5,76%	2,67%	12,21%	39,12%	27,65%	101,56%	0,12%	0,38%

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



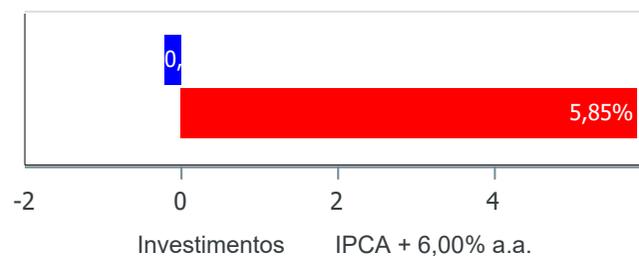
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Setembro / 2020)



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

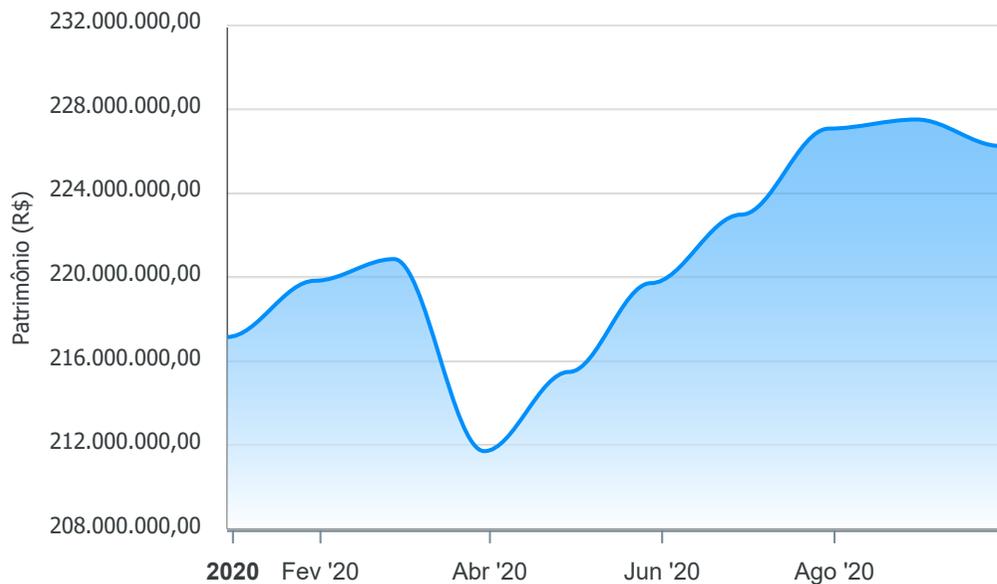
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	216.483.876,47	6.029.480,58	6.439.803,54	217.684.245,23	1.610.691,72	1.610.691,72	0,74%	0,74%	0,72%	0,72%	103,18%	1,59%
Fevereiro	217.684.245,23	1.973.095,63	881.909,20	218.772.482,58	-2.949,08	1.607.742,64	0,00%	0,74%	0,67%	1,39%	53,28%	2,37%
Março	218.772.482,58	86.531.499,38	85.471.225,54	209.686.956,00	-10.145.800,42	-8.538.057,78	-4,62%	-3,91%	0,58%	1,98%	-197,07%	9,33%
Abril	209.686.956,00	42.474.802,64	41.389.783,98	213.508.613,53	2.736.638,87	-5.801.418,91	1,30%	-2,66%	0,15%	2,14%	-124,40%	4,46%
Mai	213.508.613,53	6.198.336,70	5.107.500,00	217.833.355,64	3.233.905,41	-2.567.513,50	1,51%	-1,19%	0,08%	2,22%	-53,68%	1,86%
Junho	217.833.355,64	1.923.427,07	842.100,00	221.171.803,42	2.257.120,71	-310.392,79	1,03%	-0,17%	0,75%	2,99%	-5,81%	1,44%
Julho	221.171.803,42	21.902.782,65	20.844.100,00	225.342.459,55	3.111.973,48	2.801.580,69	1,40%	1,22%	0,90%	3,91%	31,33%	1,78%
Agosto	225.342.459,55	3.217.796,32	2.159.202,58	225.845.747,75	-555.305,54	2.246.275,15	-0,25%	0,98%	0,73%	4,66%	20,93%	1,80%
Setembro	225.845.747,75	48.555.192,80	47.057.464,51	224.678.918,92	-2.664.557,12	-418.281,97	-1,17%	-0,21%	1,13%	5,85%	-3,55%	3,07%

Investimentos x Meta Atuarial



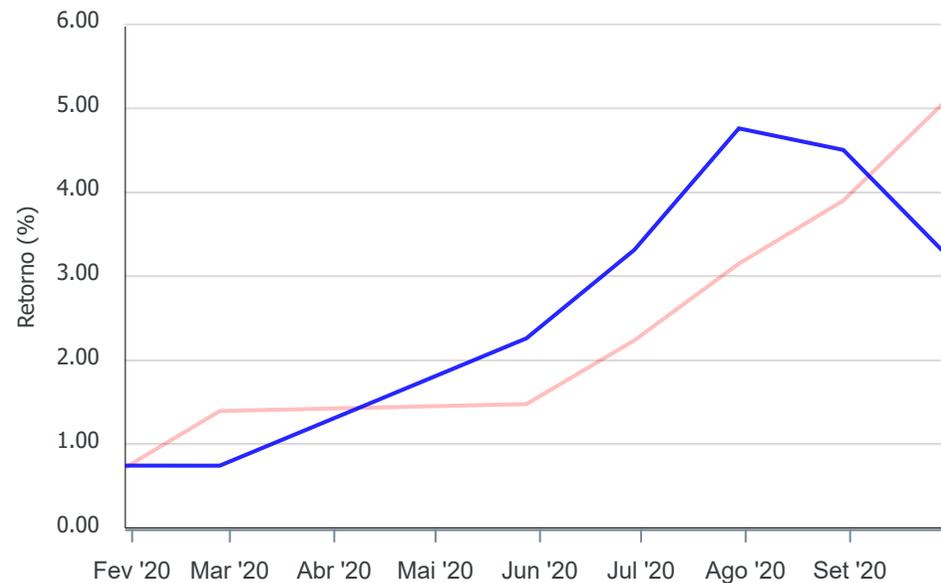
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Setembro/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.466.319,79	0,00	0,00	1.469.198,13	2.878,34	0,20%	0,20%	1,16%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.364.294,27	0,00	0,00	4.370.113,17	5.818,90	0,13%	0,13%	0,12%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	16.214.278,44	1.898.290,01	0,00	18.129.076,85	16.508,40	0,09%	0,11%	1,35%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	18.195.291,76	5.434.170,09	15.921.900,00	7.718.862,41	11.300,56	0,05%	0,04%	0,15%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	1.215.426,53	0,00	1.215.564,51	0,00	137,98	0,01%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	10.348.774,39	13.000.000,00	0,00	23.335.095,74	-13.678,65	-0,06%	0,04%	1,38%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	16.636.294,35	0,00	0,00	16.609.794,30	-26.500,05	-0,16%	-0,16%	1,65%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	0,00	5.000.000,00	0,00	4.991.839,64	-8.160,36	-0,16%	-0,23%	0,49%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	0,00	12.000.000,00	0,00	11.980.273,07	-19.726,93	-0,16%	-0,19%	1,69%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	28.103.303,64	0,00	0,00	27.961.899,40	-141.404,24	-0,50%	-0,50%	1,68%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	43.509.122,04	0,00	30.000.000,00	13.278.367,14	-230.754,90	-0,53%	-0,55%	1,76%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	4.282.716,25	0,00	0,00	4.256.475,78	-26.240,47	-0,61%	-0,61%	1,79%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	5.842.841,29	0,00	0,00	5.804.430,00	-38.411,29	-0,66%	-0,66%	1,79%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	853.695,00	0,00	0,00	847.120,50	-6.574,50	-0,77%	-0,77%	2,55%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	38.393.850,43	0,00	0,00	38.018.411,93	-375.438,50	-0,98%	-0,98%	2,60%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	15.079.517,75	1.222.732,70	0,00	16.044.426,55	-257.823,90	-1,58%	-1,56%	4,15%
Total Renda Fixa	204.505.725,93	38.555.192,80	47.137.464,51	194.815.384,61	-1.108.069,61	-0,46%		1,88%

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
BRADESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	2.174.167,68	0,00	0,00	2.166.084,76	-8.082,92	-0,37%	-0,37%	0,53%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,00	10.000.000,00	0,00	9.579.159,03	-420.840,97	-4,21%	-2,97%	11,45%
BRADESCO S&P 500 MAIS FI MULTIMERCADO	2.447.617,92	0,00	0,00	2.332.397,72	-115.220,20	-4,71%	-4,71%	10,94%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	2.690.094,83	0,00	0,00	2.556.633,14	-133.461,69	-4,96%	-4,96%	10,80%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	4.869.400,04	0,00	0,00	4.623.763,48	-245.636,56	-5,04%	-5,04%	10,36%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	5.258.162,75	0,00	0,00	4.944.283,30	-313.879,45	-5,97%	-5,97%	10,55%
Total Renda Variável	17.439.443,22	10.000.000,00	0,00	26.202.321,43	-1.237.121,79	-4,51%		10,07%

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DE MARIANA
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/09/2020

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	5.527.594,60	0,00	0,00	5.208.979,30	-318.615,30	-5,76%	-5,76%	12,19%
Total Renda Variável	5.527.594,60	0,00	0,00	5.208.979,30	-318.615,30	-5,76%		12,19%

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
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	15.974.924,90	1.898.290,01	0,00	18.129.076,85	255.861,94	1,43%	1,61%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	16.411.586,00	0,00	0,00	16.609.794,30	198.208,30	1,21%	1,21%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	10.183.067,50	13.000.000,00	0,00	23.335.095,74	152.028,24	0,66%	1,66%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	39.886.904,62	5.508.034,90	37.769.105,00	7.718.862,41	93.027,89	0,20%	0,36%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.479.685,67	0,00	37.337,66	1.469.198,13	26.850,12	1,81%	1,82%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.072.179,76	1.281.664,92	0,00	4.370.113,17	16.268,49	0,37%	0,47%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	860.248,00	0,00	19.694,07	847.120,50	6.566,57	0,76%	-1,53%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	1.211.702,40	0,00	1.215.564,51	0,00	3.862,11	0,32%	-
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.259.691,03	0,00	1.261.970,85	0,00	2.279,82	0,18%	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	0,00	5.000.000,00	0,00	4.991.839,64	-8.160,36	-0,16%	0,20%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	4.269.452,33	0,00	0,00	4.256.475,78	-12.976,55	-0,30%	-0,30%
BRASESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	43.291.883,17	0,00	30.000.000,00	13.278.367,14	-13.516,03	-0,03%	-0,05%
BRASESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	0,00	12.000.000,00	0,00	11.980.273,07	-19.726,93	-0,16%	1,21%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	5.824.547,19	0,00	0,00	5.804.430,00	-20.117,19	-0,35%	-0,35%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	27.987.241,00	0,00	0,00	27.961.899,40	-25.341,60	-0,09%	-0,09%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	38.278.213,49	0,00	0,00	38.018.411,93	-259.801,56	-0,68%	-0,68%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.362.739,44	14.987.781,94	0,00	16.044.426,55	-306.094,83	-1,87%	0,83%
Total Renda Fixa					89.218,43	0,03%	

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
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	4.761.291,07	0,00	0,00	4.944.283,30	182.992,23	3,84%	3,84%
BRADESCO S&P 500 MAIS FI MULTIMERCADO	2.168.466,70	0,00	0,00	2.332.397,72	163.931,02	7,56%	7,56%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	2.506.456,51	0,00	0,00	2.556.633,14	50.176,63	2,00%	2,00%
BRADESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	2.165.885,63	0,00	0,00	2.166.084,76	199,13	0,01%	0,01%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	0,00	5.000.000,00	0,00	4.623.763,48	-376.236,52	-7,52%	-0,39%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,00	10.000.000,00	0,00	9.579.159,03	-420.840,97	-4,21%	4,71%
				Total Renda Variável	-399.778,48	-1,50%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre/2020

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB TECNOLOGIA FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,00	5.000.000,00	0,00	5.208.979,30	208.979,30	4,18%	12,21%
				Total Exterior	208.979,30	4,18%	