

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

Relatório Analítico dos Investimentos

em junho, 2º trimestre e 1º semestre de 2020

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVID...	D+0	15/08/2020	1.095.896,71	0,37%	119	0,50%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	15.725.932,00	5,24%	714	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	43.843.592,33	14,62%	763	0,36%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2020	1.422.688,77	0,47%	45	0,55%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	8.021.749,64	2,67%	36	2,93%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+1	Não há	18.301.063,41	6,10%	21	8,50%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2030	9.125.555,00	3,04%	18	13,58%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	40.319.564,00	13,44%	600	0,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	7.079.497,59	2,36%	1.364	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2024	8.602.480,00	2,87%	104	1,87%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	19.635.821,92	6,55%	453	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	9.709.512,50	3,24%	74	0,68%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+0	15/08/2022	5.007.997,16	1,67%	95	0,99%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	24.130,49	0,01%	912	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVI...	D+0	15/08/2024	10.786.180,39	3,60%	140	1,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	15/08/2022	1.518.483,05	0,51%	165	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	D+0	Não há	1.562.556,17	0,52%	305	0,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	10.404.476,69	3,47%	608	0,43%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	19.059.692,81	6,36%	110	0,97%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CUR...	D+0	Não há	619.093,19	0,21%	10.715	0,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	D+2	Não há	14.257.487,20	4,75%	359	8,67%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO...	D+30 ou...	Não há	10.342.275,04	3,45%	74	1,72%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b'
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC ...	D+34	Não há	6.758.524,66	2,25%	280	4,27%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	23/08/2017	1.362.483,51	0,45%	154	0,17%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	4.560.948,19	1,52%	556	1,18%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	2.498.620,50	0,83%	107	0,47%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MUL...	D+2	01/10/2020	9.468.428,01	3,16%	956	1,87%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	3.304.702,10	1,10%	64	2,74%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	3.900.000,00	1,30%		1,59%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	D+4	Não há	11.578.584,72	3,86%	104	0,98%	Artigo 9º - A, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			299.898.017,75				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			36.778,64	Artigo 6º			
PL Total			299.934.796,39				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	200.220.144,96	66,76%	40,00%	66,50%	90,00%	69.688.071,02
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	1.562.556,17	0,52%	0,00%	1,00%	10,00%	28.427.245,61
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	29.989.801,78
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	44.340.749,89	14,79%	10,00%	16,50%	38,00%	69.620.496,86
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	5.997.960,36
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	1,00%	2.998.980,18
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	44.984.702,66
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	10.342.275,04	3,45%	0,00%	0,00%	20,00%	49.637.328,51
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	44.984.702,66
Total Renda Fixa	100,00%	256.465.726,06	85,52%	50,00%	84,00%	201,00%	

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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	15.180.576,86	5,06%	2,00%	25,00%	35,00%	89.783.729,35
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	12.773.130,11	4,26%	2,00%	5,00%	10,00%	17.216.671,67
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	29.989.801,78
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	5,00%	3.900.000,00	1,30%	0,00%	5,00%	10,00%	26.089.801,78
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	44.984.702,66
Total Renda Variável	30,00%	31.853.706,97	10,62%	4,00%	40,00%	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%	0,00%	10,00%	29.989.801,78
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	11.578.584,72	3,86%	0,00%	0,00%	5,00%	3.416.316,17
Total Exterior	10,00%	11.578.584,72	3,86%	0,00%	0,00%	15,00%	

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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	129.257.549,60	43,10	0,03
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	99.761.753,23	33,27	0,01
BANESTES DTVM	67.017.610,91	22,35	1,14
VINCI PARTNERS	3.861.104,01	1,29	0,00

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 '	200.220.144,96	66,76	40,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	1.562.556,17	0,52	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	44.340.749,89	14,79	10,00	38,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	10.342.275,04	3,45	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	15.180.576,86	5,06	2,00	35,00
Artigo 8º, Inciso III	12.773.130,11	4,26	2,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	3.900.000,00	1,30	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 9º - A, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º - A, Inciso III	11.578.584,72	3,86	0,00	5,00

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA Geral ex-C (Benchmark)	0,90%	1,71%	2,74%	1,71%	6,19%	22,95%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,95%	1,75%	2,96%	1,75%	6,31%	23,30%	0,01%	0,04%

IRF-M 1 (Benchmark)	0,28%	2,60%	1,15%	2,60%	5,98%	13,67%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,26%	2,48%	1,09%	2,48%	5,78%	13,28%	0,00%	0,00%
BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,48%	4,85%	2,22%	4,85%	9,17%	21,18%	0,01%	0,01%

IMA-B 5 (Benchmark)	1,12%	3,17%	3,77%	3,17%	8,73%	24,75%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,10%	3,04%	3,71%	3,04%	8,51%	24,21%	0,01%	0,04%

IMA-B (Benchmark)	2,05%	-1,66%	4,96%	-1,66%	4,73%	35,13%	-	-
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	2,03%	-1,86%	4,83%	-1,86%	4,56%	34,21%	0,03%	0,10%
BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,29%	-8,42%	4,76%	-8,42%	-0,74%	38,52%	0,05%	0,17%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,24%	1,43%	5,16%	1,43%	5,13%	20,83%	0,02%	0,07%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2,87%	-1,36%	6,25%	-1,36%	2,23%	28,14%	0,03%	0,10%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,24%	1,43%	5,16%	1,43%	4,77%	20,97%	0,02%	0,07%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,99%	1,64%	2,40%	1,64%	6,28%	19,00%	0,00%	0,02%
CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,89%	-1,96%	1,67%	-1,96%	-0,62%	3,38%	0,00%	0,04%

IRF-M (Benchmark)	0,79%	4,86%	3,39%	4,86%	9,64%	27,08%	-	-
--------------------------	-------	-------	-------	-------	-------	--------	---	---

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,77%	4,68%	3,26%	4,68%	9,51%	26,49%	0,01%	0,02%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,77%	4,73%	3,33%	4,73%	9,54%	26,59%	0,01%	0,02%

CDI (Benchmark)	0,21%	1,75%	0,73%	1,75%	4,58%	11,21%	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,26%	1,37%	0,78%	1,37%	4,06%	10,51%	0,00%	0,01%
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,46%	-1,54%	-0,92%	-1,54%	1,07%	7,95%	0,00%	0,03%
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,02%	0,38%	0,10%	0,38%	1,64%	4,94%	0,00%	0,00%

IPCA (Benchmark)	0,26%	0,10%	-0,43%	0,10%	2,12%	5,57%	-	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,98%	2,68%	3,62%	2,68%	7,94%	24,05%	0,01%	0,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,19%	3,40%	3,79%	3,40%	9,01%	27,95%	0,01%	0,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,09%	2,51%	3,28%	2,51%	7,73%	29,33%	0,01%	0,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,89%	0,75%	1,68%	0,75%	4,92%	14,92%	0,00%	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,75%	4,63%	3,27%	4,63%	9,82%	28,20%	0,01%	0,03%

Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	0,60%	-1,31%	-0,59%	-1,31%	6,44%	-	0,01%	0,04%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDIV (Benchmark)	8,95%	-18,38%	18,70%	-18,38%	0,08%	47,52%	-	-
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	4,58%	-16,79%	20,57%	-16,79%	-2,34%	45,79%	0,12%	0,33%

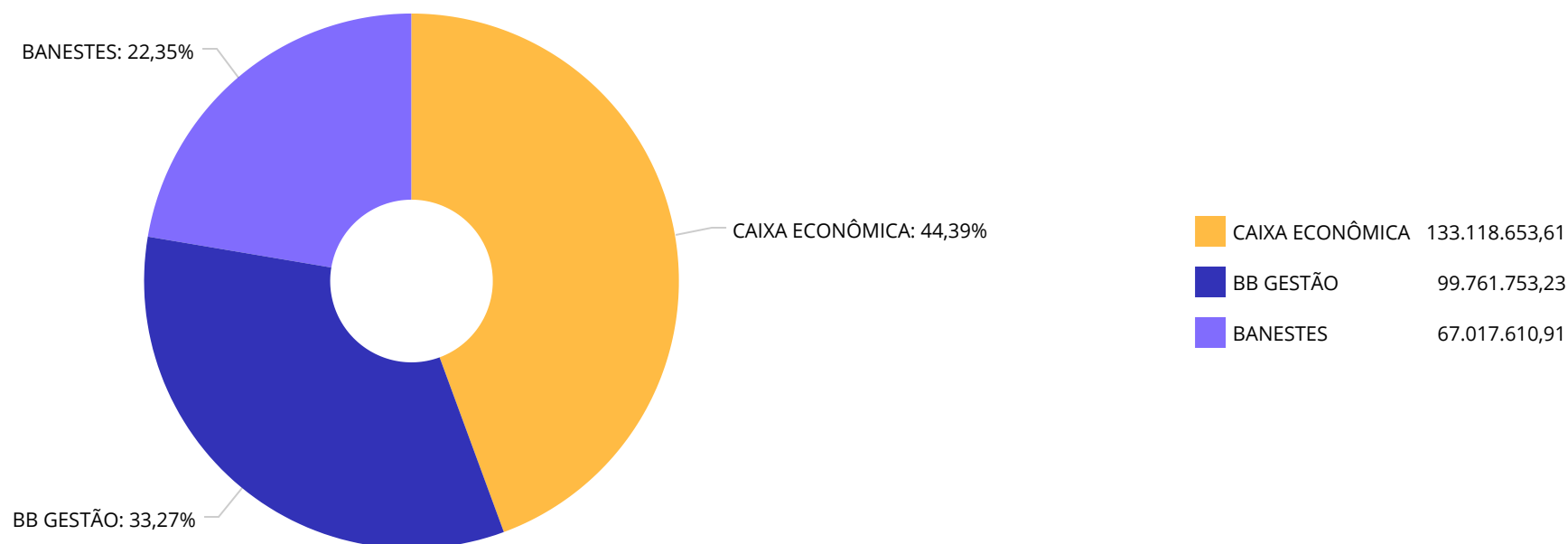
Ibovespa (Benchmark)	8,76%	-17,80%	30,18%	-17,80%	-6,20%	30,64%	-	-
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	9,07%	-21,11%	27,93%	-21,11%	-8,75%	24,85%	0,12%	0,39%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	0,11%	1,79%	0,62%	1,79%	5,40%	-	0,00%	0,01%

Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	9,33%	-15,92%	28,43%	-15,92%	5,63%	56,90%	0,12%	0,39%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	20,00%	4,70%	34,34%	4,70%	51,16%	70,31%	0,15%	0,43%
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	10,23%	-8,36%	41,46%	-8,36%	8,76%	58,50%	0,10%	0,42%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	2,24%	-1,63%	9,03%	-1,63%	-	-	0,03%	-

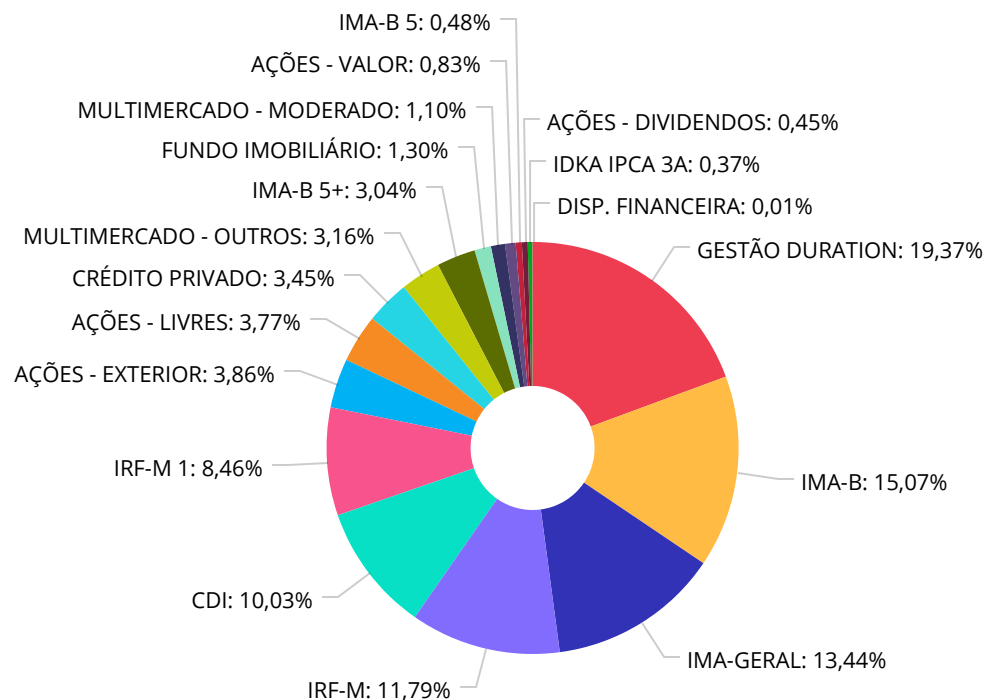
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2020 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	4,50%	32,44%	25,08%	32,44%	52,91%	68,50%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	4,37%	32,85%	24,40%	32,85%	54,59%	66,72%	0,12%	0,20%

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



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

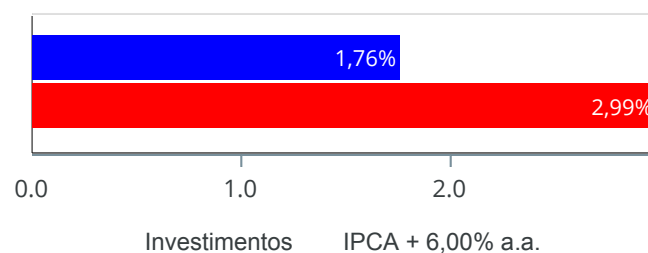


GESTÃO DURATION	58.101.079,53
IMA-B	45.208.958,91
IMA-GERAL	40.319.564,00
IRF-M	35.361.753,92
CDI	30.083.262,69
IRF-M 1	25.380.561,00
AÇÕES - EXTERIOR	11.578.584,72
AÇÕES - LIVRES	11.319.472,85
CRÉDITO PRIVADO	10.342.275,04
MULTIMERCADO - OUTROS	9.468.428,01
IMA-B 5+	9.125.555,00
FUNDO IMOBILIÁRIO	3.900.000,00
MULTIMERCADO - MODERADO	3.304.702,10
AÇÕES - VALOR	2.498.620,50
IMA-B 5	1.446.819,26
AÇÕES - DIVIDENDOS	1.362.483,51
IDKA IPCA 3A	1.095.896,71
DISP. FINANCEIRA	36.778,64

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

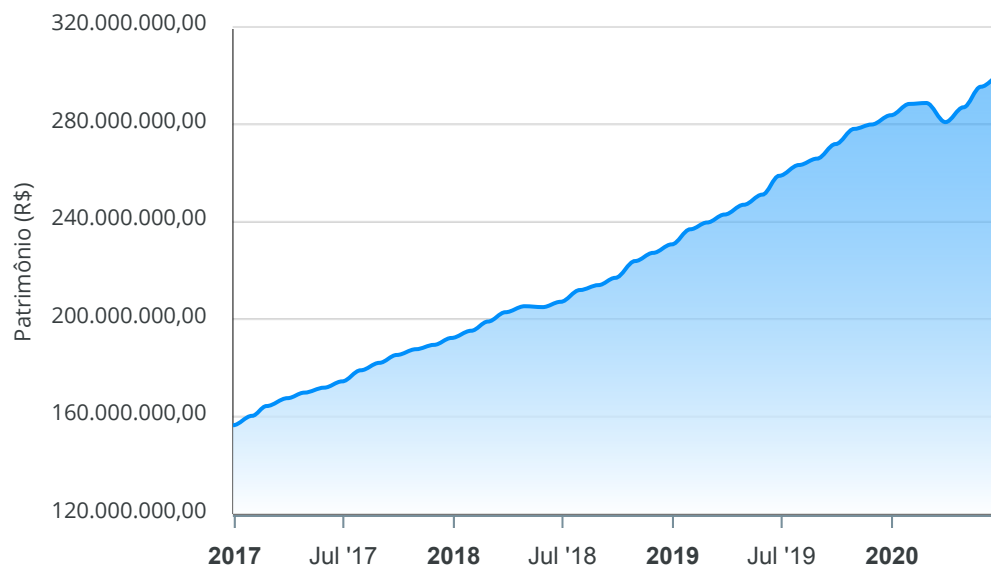
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	283.697.129,90	12.896.031,99	11.142.958,27	288.307.192,72	2.856.989,10	2.856.989,10	1,00%	1,00%	0,72%	0,72%	138,80%	1,65%
Fevereiro	288.307.192,72	7.204.074,12	4.802.321,61	288.665.248,30	-2.043.696,93	813.292,17	-0,70%	0,29%	0,67%	1,39%	20,86%	2,96%
Março	288.665.248,30	6.282.886,41	4.470.359,46	280.794.566,70	-9.683.208,55	-8.869.916,38	-3,33%	-3,05%	0,58%	1,98%	-153,97%	10,18%
Abril	280.794.566,70	5.910.606,75	4.419.743,79	286.884.207,66	4.598.778,00	-4.271.138,38	1,63%	-1,47%	0,15%	2,14%	-68,91%	5,71%
Mai	286.884.207,66	5.731.155,16	4.422.575,55	292.907.550,66	4.714.763,39	443.625,01	1,64%	0,14%	0,08%	2,22%	6,25%	2,73%
Junho	292.907.550,66	6.511.679,32	4.377.647,10	299.812.638,20	4.771.055,32	5.214.680,33	1,62%	1,76%	0,75%	2,99%	58,89%	2,28%

Investimentos x Meta Atuarial



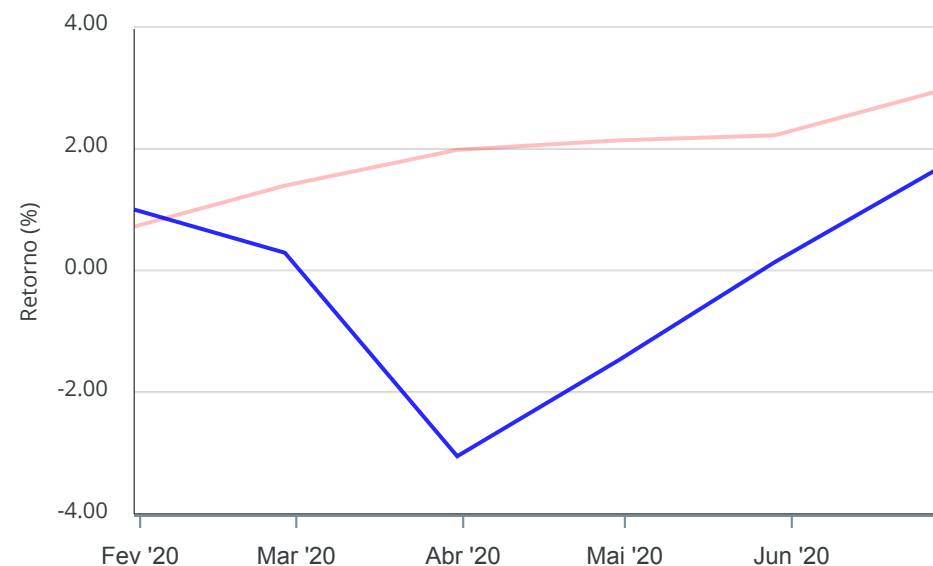
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Junho/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	8.870.875,00	0,00	0,00	9.125.555,00	254.680,00	2,87%	2,87%	2,99%
BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.842.161,17	0,00	0,00	8.021.749,64	179.588,47	2,29%	2,29%	5,24%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	1.531.542,56	0,00	0,00	1.562.556,17	31.013,61	2,02%	2,02%	2,98%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	9.590.825,00	0,00	0,00	9.709.512,50	118.687,50	1,24%	1,24%	1,72%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.497.380,00	0,00	0,00	8.602.480,00	105.100,00	1,24%	1,24%	1,72%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENC...	4.949.234,36	0,00	0,00	5.007.997,16	58.762,80	1,19%	1,19%	0,85%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	23.868,27	0,00	0,00	24.130,49	262,22	1,10%	1,10%	0,91%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	10.669.943,52	0,00	0,00	10.786.180,39	116.236,87	1,09%	1,09%	0,73%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	1.503.563,16	0,00	0,00	1.518.483,05	14.919,89	0,99%	0,99%	0,45%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	10.242.212,05	0,00	0,00	10.342.275,04	100.062,99	0,98%	0,98%	0,82%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	39.141.970,81	803.284,26	0,00	40.319.564,00	374.308,93	0,94%	0,95%	1,27%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDEN...	1.086.210,92	0,00	0,00	1.095.896,71	9.685,79	0,89%	0,89%	0,40%
CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.410.147,54	0,00	0,00	1.422.688,77	12.541,23	0,89%	0,89%	0,40%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	15.605.461,73	0,00	0,00	15.725.932,00	120.470,27	0,77%	0,77%	1,17%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	19.486.263,63	0,00	0,00	19.635.821,92	149.558,29	0,77%	0,77%	1,18%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	42.691.351,50	828.284,25	0,00	43.843.592,33	323.956,58	0,74%	0,75%	1,17%
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	14.172.047,66	0,00	0,00	14.257.487,20	85.439,54	0,60%	0,60%	1,03%
BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	17.411.555,07	803.284,26	0,00	18.301.063,41	86.224,08	0,47%	0,48%	0,54%
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	18.973.284,26	0,00	0,00	19.059.692,81	86.408,55	0,46%	0,46%	0,16%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.061.194,06	0,00	0,00	7.079.497,59	18.303,53	0,26%	0,26%	0,05%

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	10.723.534,12	0,00	346.853,92	10.404.476,69	27.796,49	0,26%	0,26%	0,03%
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO...	596.186,23	4.204.326,55	4.181.586,24	619.093,19	166,65	0,00%	0,02%	0,00%
Total Renda Fixa	252.080.812,62	6.639.179,32	4.528.440,16	256.465.726,06	2.274.174,28	0,89%		1,17%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Junho/2020**FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL**

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	3.250.000,00	0,00	0,00	3.900.000,00	650.000,00	20,00%	20,00%	15,34%
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇ...	6.131.452,71	0,00	0,00	6.758.524,66	627.071,95	10,23%	10,23%	10,24%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	2.285.376,37	0,00	0,00	2.498.620,50	213.244,13	9,33%	9,33%	12,08%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	4.181.618,14	0,00	0,00	4.560.948,19	379.330,05	9,07%	9,07%	12,25%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.302.777,85	0,00	0,00	1.362.483,51	59.705,66	4,58%	4,58%	12,48%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	3.232.228,87	0,00	0,00	3.304.702,10	72.473,23	2,24%	2,24%	2,60%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTI...	9.458.048,05	0,00	0,00	9.468.428,01	10.379,96	0,11%	0,11%	0,03%
Total Renda Variável	29.841.501,99	0,00	0,00	31.853.706,97	2.012.204,98	6,74%		7,57%

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE CARIACICA
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/06/2020

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	11.093.845,62	0,00	0,00	11.578.584,72	484.739,10	4,37%	4,37%	12,44%
Total Renda Variável	11.093.845,62	0,00	0,00	11.578.584,72	484.739,10	4,37%		12,44%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	40.519.503,36	1.959.685,64	0,00	43.843.592,33	1.364.403,33	3,21%	3,27%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	37.266.211,34	1.913.739,97	0,00	40.319.564,00	1.139.612,69	2,91%	2,96%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	19.003.647,50	0,00	0,00	19.635.821,92	632.174,42	3,33%	3,33%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	8.588.825,00	0,00	0,00	9.125.555,00	536.730,00	6,25%	6,25%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	15.230.081,18	0,00	0,00	15.725.932,00	495.850,82	3,26%	3,26%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	9.233.125,00	0,00	0,00	9.709.512,50	476.387,50	5,16%	5,16%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.180.550,00	0,00	0,00	8.602.480,00	421.930,00	5,16%	5,16%
BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	15.995.211,48	1.930.465,99	0,00	18.301.063,41	375.385,94	2,09%	2,22%
BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.657.110,50	0,00	0,00	8.021.749,64	364.639,14	4,76%	4,76%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	9.981.439,30	0,00	0,00	10.342.275,04	360.835,74	3,62%	3,62%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	10.443.248,12	0,00	0,00	10.786.180,39	342.932,27	3,28%	3,28%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENC...	4.825.172,31	0,00	0,00	5.007.997,16	182.824,85	3,79%	3,79%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	11.328.087,23	0,00	1.008.607,81	10.404.476,69	84.997,27	0,75%	0,78%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	6.982.005,75	21.250,00	0,00	7.079.497,59	76.241,84	1,09%	1,09%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA...	1.490.517,56	0,00	0,00	1.562.556,17	72.038,61	4,83%	4,83%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	1.482.908,24	0,00	0,00	1.518.483,05	35.574,81	2,40%	2,40%
CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.399.328,57	0,00	0,00	1.422.688,77	23.360,20	1,67%	1,67%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDEN...	1.077.803,84	0,00	0,00	1.095.896,71	18.092,87	1,68%	1,68%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	23.267,88	0,00	0,00	24.130,49	862,61	3,71%	3,71%
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO...	557.544,90	12.753.810,86	12.693.087,17	619.093,19	824,60	0,01%	0,10%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2020**FUNDOS DE RENDA FIXA**

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	14.342.457,17	0,00	0,00	14.257.487,20	-84.969,97	-0,59%	-0,59%
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	19.236.158,26	0,00	0,00	19.059.692,81	-176.465,45	-0,92%	-0,92%
			Total Renda Fixa		6.744.264,09	2,70%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2020

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇ...	4.777.772,80	0,00	0,00	6.758.524,66	1.980.751,86	41,46%	41,46%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	3.565.125,01	0,00	0,00	4.560.948,19	995.823,18	27,93%	27,93%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	2.924.975,00	0,00	0,00	3.900.000,00	975.025,00	33,33%	34,34%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	1.945.481,10	0,00	0,00	2.498.620,50	553.139,40	28,43%	28,43%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	3.030.958,01	0,00	0,00	3.304.702,10	273.744,09	9,03%	9,03%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.130.036,05	0,00	0,00	1.362.483,51	232.447,46	20,57%	20,57%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTI...	9.409.723,52	0,00	0,00	9.468.428,01	58.704,49	0,62%	0,62%
				Total Renda Variável	5.069.635,48	18,93%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2020

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	9.307.664,46	0,00	0,00	11.578.584,72	2.270.920,26	24,40%	24,40%
				Total Exterior	2.270.920,26	24,40%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	38.036.052,50	3.947.903,13	0,00	43.843.592,33	1.859.636,70	4,43%	4,63%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	18.748.579,95	0,00	0,00	19.635.821,92	887.241,97	4,73%	4,73%
BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	15.594.756,16	1.930.465,99	0,00	18.301.063,41	775.841,26	4,43%	4,85%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	14.556.159,29	473.995,07	0,00	15.725.932,00	695.777,64	4,63%	4,68%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	36.054.104,32	3.577.981,86	0,00	40.319.564,00	687.477,82	1,73%	1,75%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	10.072.592,50	0,00	0,00	10.342.275,04	269.682,54	2,68%	2,68%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	10.795.592,96	0,00	276.174,82	10.786.180,39	266.762,25	2,47%	2,51%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	6.866.018,71	42.500,00	0,00	7.079.497,59	170.978,88	2,47%	2,48%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENC...	4.968.097,48	0,00	126.018,00	5.007.997,16	165.917,68	3,34%	3,40%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	11.261.573,14	0,00	1.008.607,81	10.404.476,69	151.511,36	1,35%	1,37%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	9.573.025,00	0,00	0,00	9.709.512,50	136.487,50	1,43%	1,43%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.481.100,00	0,00	0,00	8.602.480,00	121.380,00	1,43%	1,43%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	1.534.139,61	0,00	40.390,50	1.518.483,05	24.733,94	1,61%	1,64%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDEN...	1.119.099,67	0,00	31.411,75	1.095.896,71	8.208,79	0,73%	0,75%
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO...	358.081,89	25.498.038,29	25.239.591,60	619.093,19	2.564,61	0,01%	0,38%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	23.418,04	0,00	0,00	24.130,49	712,45	3,04%	3,04%
CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.451.149,52	0,00	0,00	1.422.688,77	-28.460,75	-1,96%	-1,96%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	1.592.102,74	0,00	0,00	1.562.556,17	-29.546,57	-1,86%	-1,86%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	9.251.325,00	0,00	0,00	9.125.555,00	-125.770,00	-1,36%	-1,36%
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	11.909.883,16	2.563.129,76	0,00	14.257.487,20	-215.525,72	-1,49%	-1,31%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	20.305.241,49	0,00	951.090,53	19.059.692,81	-294.458,15	-1,45%	-1,54%
BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.758.943,91	0,00	0,00	8.021.749,64	-737.194,27	-8,42%	-8,42%
			Total Renda Fixa		4.793.959,93	1,90%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre/2020

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	3.724.975,00	0,00	0,00	3.900.000,00	175.025,00	4,70%	4,70%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTI...	9.301.824,69	0,00	0,00	9.468.428,01	166.603,32	1,79%	1,79%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MUL...	6.755.582,58	0,00	6.777.024,13	0,00	21.441,55	0,32%	-
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	0,00	3.388.512,07	0,00	3.304.702,10	-83.809,97	-2,47%	-1,62%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	0,00	1.694.256,03	0,00	1.362.483,51	-331.772,52	-19,58%	-16,79%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	1.333.594,89	1.694.256,03	0,00	2.498.620,50	-529.230,42	-17,48%	-15,92%
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇ...	6.834.926,76	563.810,90	0,00	6.758.524,66	-640.213,00	-8,65%	-8,36%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	5.781.031,76	0,00	0,00	4.560.948,19	-1.220.083,57	-21,10%	-21,10%
				Total Renda Variável	-2.442.039,61	-7,12%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre/2020

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	8.715.358,64	0,00	0,00	11.578.584,72	2.863.226,08	32,85%	32,85%
				Total Exterior	2.863.226,08	32,85%	