

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

Relatório Analítico dos Investimentos

em maio de 2020

Carteira consolidada de investimentos - base (Maio / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2030	8.870.875,00	3,03%	18	13,58%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	39.141.970,81	13,36%	595	0,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2024	8.497.380,00	2,90%	104	1,87%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	7.061.194,06	2,41%	1.372	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	9.590.825,00	3,27%	74	0,68%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+0	15/08/2022	4.949.234,36	1,69%	95	0,99%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	19.486.263,63	6,65%	441	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	23.868,27	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	10.669.943,52	3,64%	140	1,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	15/08/2022	1.503.563,16	0,51%	165	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVID...	D+0	15/08/2020	1.086.210,92	0,37%	119	0,50%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	42.691.351,50	14,57%	752	0,35%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2020	1.410.147,54	0,48%	45	0,55%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	15.605.461,73	5,33%	709	0,31%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+1	Não há	17.411.555,07	5,94%	21	8,33%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	7.842.161,17	2,68%	36	3,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	D+0	Não há	1.531.542,56	0,52%	305	0,05%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CUR...	D+0	Não há	596.186,23	0,20%	10.211	0,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	10.723.534,12	3,66%	626	0,42%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	18.973.284,26	6,48%	111	0,96%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Maio / 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	14.172.047,66	4,84%	355	8,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO...	D+30 ou...	Não há	10.242.212,05	3,50%	74	1,72%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b'
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC ...	D+34	Não há	6.131.452,71	2,09%	273	4,33%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	23/08/2017	1.302.777,85	0,44%	154	0,17%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	2.285.376,37	0,78%	106	0,48%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	4.181.618,14	1,43%	479	1,25%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MUL...	D+2	01/10/2020	9.458.048,05	3,23%	956	1,87%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	3.232.228,87	1,10%	59	2,48%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	3.250.000,00	1,11%		1,58%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	D+4	Não há	11.093.845,62	3,79%	98	0,98%	Artigo 9º - A, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			293.016.160,23				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			2.446.398,66	Artigo 6º			
PL Total			295.462.558,89				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	195.842.005,74	66,84%	40,00%	66,50%	90,00%	67.872.538,47
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	1.531.542,56	0,52%	0,00%	1,00%	10,00%	27.770.073,46
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	29.301.616,02
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	44.465.052,27	15,17%	10,00%	16,50%	38,00%	66.881.088,62
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	5.860.323,20
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	1,00%	2.930.161,60
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	43.952.424,03
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	10.242.212,05	3,50%	0,00%	0,00%	20,00%	48.361.020,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	43.952.424,03
Total Renda Fixa	100,00%	252.080.812,62	86,03%	50,00%	84,00%	201,00%	

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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	13.901.225,07	4,74%	2,00%	25,00%	35,00%	88.654.431,01
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	12.690.276,92	4,33%	2,00%	5,00%	10,00%	16.611.339,10
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	29.301.616,02
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	5,00%	3.250.000,00	1,11%	0,00%	5,00%	10,00%	26.051.616,02
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	43.952.424,03
Total Renda Variável	30,00%	29.841.501,99	10,18%	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%	29.301.616,02
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	11.093.845,62	3,79%	0,00%	0,00%	5,00%	3.556.962,39
Total Exterior	10,00%	11.093.845,62	3,79%	0,00%	0,00%	15,00%	

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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	126.197.570,10	43,07	0,03
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	98.103.748,81	33,48	0,01
BANESTES DTVM	65.126.687,10	22,23	1,14
VINCI PARTNERS	3.588.154,22	1,22	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 '	195.842.005,74	66,84	40,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	1.531.542,56	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 '	44.465.052,27	15,17	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 '	10.242.212,05	3,50	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	13.901.225,07	4,74	2,00	35,00
Artigo 8º, Inciso III	12.690.276,92	4,33	2,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	3.250.000,00	1,11	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	11.093.845,62	3,79	0,00	5,00

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA Geral ex-C (Benchmark)	0,97%	0,80%	-0,15%	1,71%	7,42%	21,97%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,07%	0,79%	-0,15%	1,76%	7,59%	22,37%	0,02%	0,04%

IRF-M 1 (Benchmark)	0,42%	2,31%	1,47%	2,74%	6,33%	13,97%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,39%	2,22%	1,42%	2,63%	6,11%	13,55%	0,00%	0,00%
BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,81%	4,35%	2,87%	4,81%	10,49%	20,96%	0,01%	0,01%

IMA-B 5 (Benchmark)	2,12%	2,03%	0,82%	3,29%	9,46%	23,93%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,11%	1,92%	0,74%	3,15%	9,15%	23,37%	0,01%	0,04%

IMA-B (Benchmark)	1,52%	-3,64%	-4,32%	-1,70%	6,68%	31,99%	-	-
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1,49%	-3,80%	-4,44%	-1,89%	6,26%	31,07%	0,04%	0,10%
BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,71%	-10,47%	-11,03%	-8,17%	2,16%	33,67%	0,07%	0,18%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3,16%	0,19%	1,08%	1,68%	6,95%	19,35%	0,03%	0,07%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,76%	-4,11%	-3,76%	-3,06%	3,01%	23,35%	0,06%	0,11%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3,16%	0,19%	1,08%	1,68%	6,57%	19,48%	0,03%	0,07%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,25%	0,64%	0,03%	1,57%	6,31%	18,52%	0,00%	0,02%
CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,80%	-2,83%	-0,37%	-2,07%	-0,89%	2,57%	0,01%	0,04%

IRF-M (Benchmark)	1,42%	4,05%	2,47%	4,69%	11,31%	26,14%	-	-
--------------------------	-------	-------	-------	-------	--------	--------	---	---

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,38%	3,88%	2,35%	4,51%	11,00%	25,54%	0,02%	0,03%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,40%	3,94%	2,42%	4,57%	11,04%	25,67%	0,02%	0,03%
CDI (Benchmark)	0,24%	1,54%	0,86%	1,92%	4,87%	11,55%	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,26%	1,11%	0,48%	1,47%	4,27%	10,77%	0,00%	0,01%
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,25%	-1,99%	-2,66%	-1,60%	1,11%	8,06%	0,00%	0,03%
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,03%	0,36%	0,16%	0,49%	1,86%	5,20%	0,00%	0,00%
IPCA (Benchmark)	-0,38%	-0,16%	-0,62%	0,99%	1,88%	6,62%	-	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	2,17%	1,68%	0,53%	2,80%	8,29%	23,00%	0,01%	0,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,10%	2,18%	0,80%	3,39%	9,70%	26,84%	0,01%	0,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,83%	1,41%	0,43%	2,52%	8,26%	29,72%	0,01%	0,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,80%	-0,14%	-0,36%	0,64%	4,63%	14,62%	0,01%	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1,38%	3,85%	2,37%	4,46%	11,99%	27,82%	0,02%	0,03%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	0,37%	-1,90%	-2,91%	-0,78%	8,23%	-	0,00%	0,05%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDIV (Benchmark)	5,00%	-25,08%	-18,87%	-17,60%	-5,50%	29,54%	-	-
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	7,50%	-20,44%	-16,30%	-13,65%	-1,18%	31,96%	0,16%	0,33%

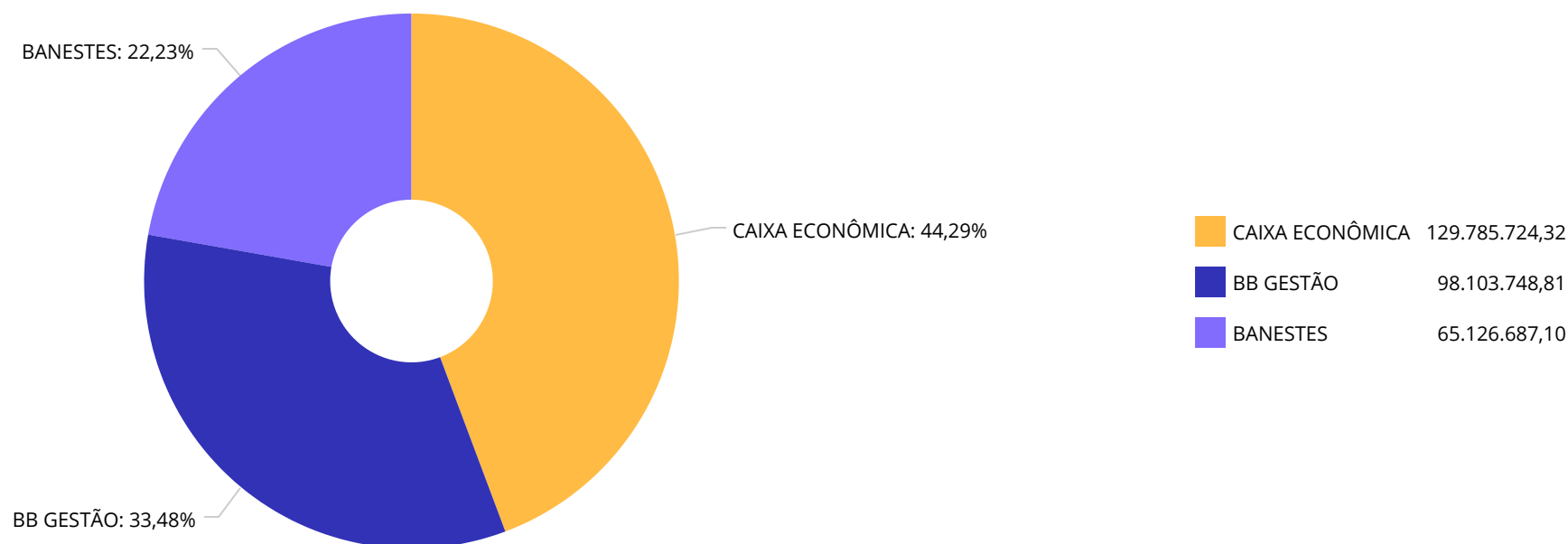
Ibovespa (Benchmark)	8,57%	-24,42%	-16,10%	-19,25%	-9,92%	13,87%	-	-
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	7,13%	-27,67%	-19,86%	-21,74%	-12,93%	8,93%	0,15%	0,38%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	0,26%	1,68%	1,09%	2,01%	6,33%	-	0,00%	0,01%

Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	7,03%	-23,10%	-19,07%	-13,70%	2,77%	36,75%	0,17%	0,39%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	3,87%	-12,75%	-11,81%	-4,06%	27,46%	25,24%	0,13%	0,40%
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	10,24%	-16,86%	-12,28%	-10,89%	3,44%	41,18%	0,15%	0,41%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	2,38%	-3,78%	-1,80%	-1,46%	-	-	0,04%	-

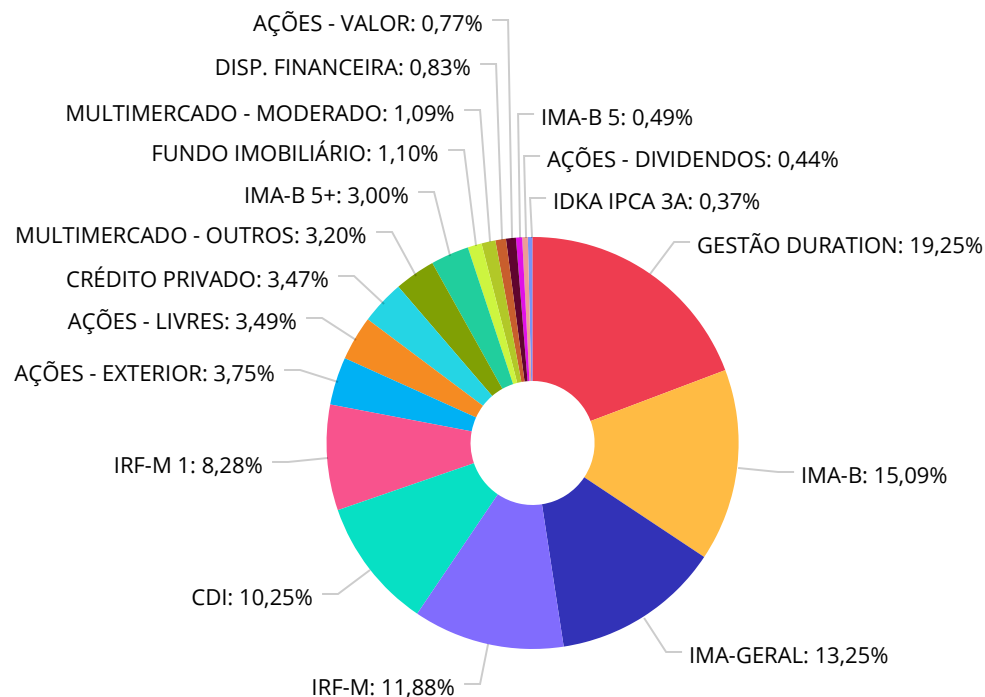
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Maio/2020 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	2,90%	26,74%	26,24%	24,81%	53,67%	68,19%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	2,78%	27,29%	26,70%	25,05%	53,85%	66,23%	0,11%	0,20%

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



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

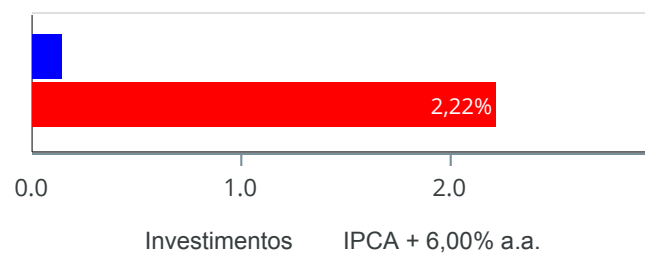


GESTÃO DURATION	56.863.399,16
IMA-B	44.584.649,77
IMA-GERAL	39.141.970,81
IRF-M	35.091.725,36
CDI	30.293.004,61
IRF-M 1	24.472.749,13
AÇÕES - EXTERIOR	11.093.845,62
AÇÕES - LIVRES	10.313.070,85
CRÉDITO PRIVADO	10.242.212,05
MULTIMERCADO - OUTROS	9.458.048,05
IMA-B 5+	8.870.875,00
FUNDO IMOBILIÁRIO	3.250.000,00
MULTIMERCADO - MODERADO	3.232.228,87
DISP. FINANCEIRA	2.446.398,66
AÇÕES - VALOR	2.285.376,37
IMA-B 5	1.434.015,81
AÇÕES - DIVIDENDOS	1.302.777,85
IDKA IPCA 3A	1.086.210,92

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

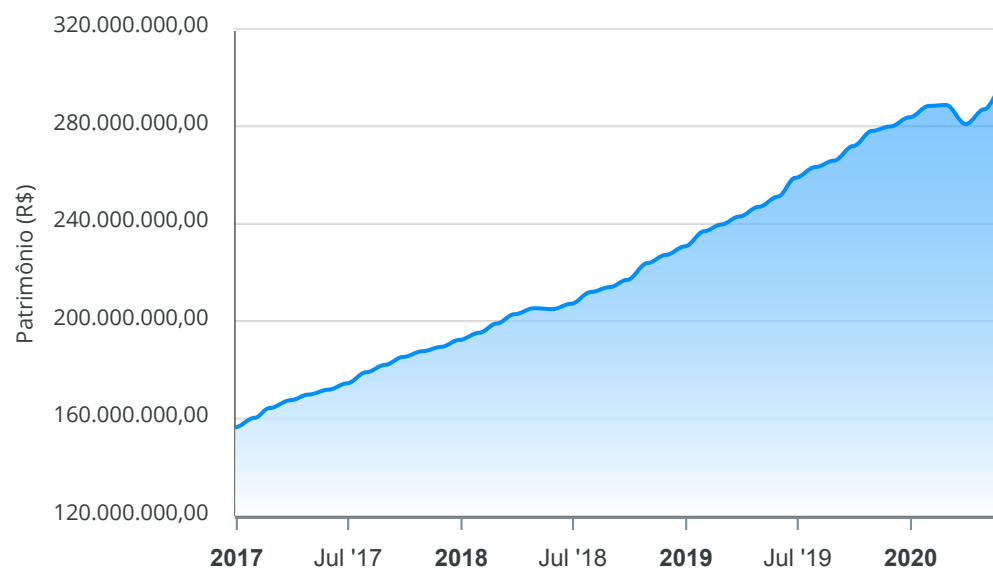
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	283.697.129,90	12.896.031,99	11.142.958,27	288.307.192,72	2.856.989,10	2.856.989,10	1,00%	1,00%	0,72%	0,72%	138,80%	1,65%
Fevereiro	288.307.192,72	7.204.074,12	4.802.321,61	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%
Maio	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%

Investimentos x Meta Atuarial



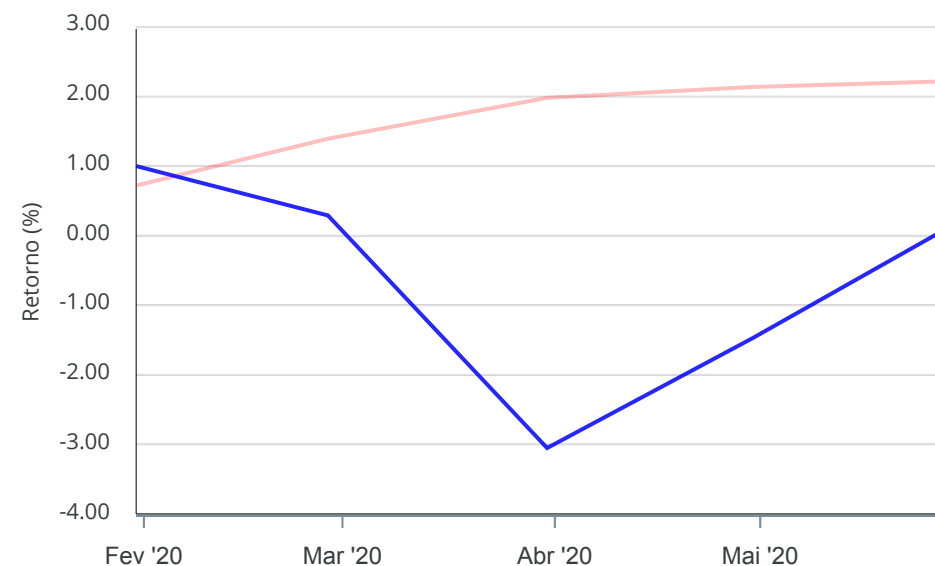
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Maio/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	9.297.431,25	0,00	0,00	9.590.825,00	293.393,75	3,16%	3,16%	2,56%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	8.237.485,00	0,00	0,00	8.497.380,00	259.895,00	3,16%	3,16%	2,56%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	10.024.384,17	0,00	0,00	10.242.212,05	217.827,88	2,17%	2,17%	1,12%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	23.376,14	0,00	0,00	23.868,27	492,13	2,11%	2,11%	1,25%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENC...	4.847.540,98	0,00	0,00	4.949.234,36	101.693,38	2,10%	2,10%	1,07%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDE...	10.477.780,52	0,00	0,00	10.669.943,52	192.163,00	1,83%	1,83%	0,94%
CAIXA BRASIL 2030 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	8.717.175,00	0,00	0,00	8.870.875,00	153.700,00	1,76%	1,76%	5,61%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	1.509.117,06	0,00	0,00	1.531.542,56	22.425,50	1,49%	1,49%	3,63%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	19.218.080,48	0,00	0,00	19.486.263,63	268.183,15	1,40%	1,40%	1,72%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	15.393.352,55	0,00	0,00	15.605.461,73	212.109,18	1,38%	1,38%	1,73%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	41.562.715,80	549.285,38	0,00	42.691.351,50	579.350,32	1,38%	1,38%	1,72%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	1.485.029,79	0,00	0,00	1.503.563,16	18.533,37	1,25%	1,25%	0,48%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	38.197.781,37	528.339,70	0,00	39.141.970,81	415.849,74	1,07%	1,07%	1,74%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA II FI RENDA FIXA PREVIDEN...	1.077.580,13	0,00	0,00	1.086.210,92	8.630,79	0,80%	0,80%	0,54%
CAIXA BRASIL 2020 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.398.972,39	0,00	0,00	1.410.147,54	11.175,15	0,80%	0,80%	0,54%
BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	16.737.405,20	536.393,32	0,00	17.411.555,07	137.756,55	0,80%	0,81%	0,91%
BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.786.801,56	0,00	0,00	7.842.161,17	55.359,61	0,71%	0,71%	6,72%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.033.551,09	0,00	0,00	7.061.194,06	27.642,97	0,39%	0,39%	0,20%
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	14.120.074,69	0,00	0,00	14.172.047,66	51.972,97	0,37%	0,37%	0,31%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	11.035.522,31	0,00	340.175,63	10.723.534,12	28.187,44	0,26%	0,26%	0,05%

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

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	18.925.586,60	0,00	0,00	18.973.284,26	47.697,66	0,25%	0,25%	0,20%
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO...	587.001,79	4.245.147,99	4.236.199,69	596.186,23	236,14	0,00%	0,03%	0,00%
Total Renda Fixa	247.693.745,87	5.859.166,39	4.576.375,32	252.080.812,62	3.104.275,68	1,25%		1,63%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BANESTES BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇ...	5.561.717,57	0,00	0,00	6.131.452,71	569.735,14	10,24%	10,24%	14,67%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	1.211.838,65	0,00	0,00	1.302.777,85	90.939,20	7,50%	7,50%	16,26%
BB AÇÕES ALOCAÇÃO FI AÇÕES	3.903.192,11	0,00	0,00	4.181.618,14	278.426,03	7,13%	7,13%	14,88%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	2.135.302,91	0,00	0,00	2.285.376,37	150.073,46	7,03%	7,03%	16,75%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	3.128.900,00	0,00	0,00	3.250.000,00	121.100,00	3,87%	3,87%	12,69%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	3.157.084,16	0,00	0,00	3.232.228,87	75.144,71	2,38%	2,38%	3,87%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTI...	9.433.139,02	0,00	0,00	9.458.048,05	24.909,03	0,26%	0,26%	0,17%
Total Renda Variável	28.531.174,42	0,00	0,00	29.841.501,99	1.310.327,57	4,59%		8,95%

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE CARIACICA
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 29/05/2020

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	10.793.614,65	0,00	0,00	11.093.845,62	300.230,97	2,78%	2,78%	11,11%
Total Renda Variável	10.793.614,65	0,00	0,00	11.093.845,62	300.230,97	2,78%		11,11%