

# 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)**

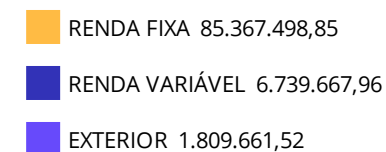
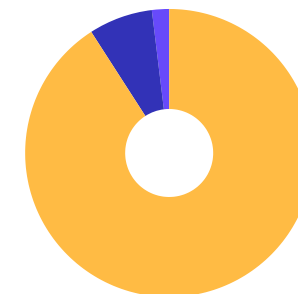
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	2.670.908,76	2,84%	884	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	299.878,45	0,32%	367	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	10.460.251,26	11,14%	901	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	8.126.211,22	8,65%	763	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVI...	D+2	Não há	779.629,51	0,83%	310	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	3.547.057,52	3,78%	956	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	649.976,14	0,69%	118	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	11.393.564,36	12,13%	670	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	2.800.211,11	2,98%	1.364	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.461.610,41	1,56%	267	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	3.499.356,63	3,73%	912	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI...	D+1	Não há	13.909.628,51	14,81%	114	1,85%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	6.467,33	0,01%	125	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	627.581,90	0,67%	31	0,23%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	D+1	Não há	8.098.327,85	8,62%	119	0,94%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	410.488,26	0,44%	222	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	D+1471	Não há	226.557,71	0,24%	26	0,33%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	9.590.615,90	10,21%	275	0,66%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	4.203.429,82	4,48%	174	0,35%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se ...	Não se aplica	1.806.378,16	1,92%	98	2,14%	Artigo 7º, Inciso VII, 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
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se ...	Não se aplica	5.701,71	0,01%		1,10%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO P...	D+90 ou...	18 meses	793.666,33	0,85%		8,35%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	999.044,51	1,06%	204	0,15%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	D+4382	Não há	0,01	0,00%		0,00%	Artigo 8º, Inciso III
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	Não se ...	Não se aplica	3.044.877,14	3,24%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se ...	Não se aplica	2.695.746,30	2,87%		5,49%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	D+4	Não há	1.809.661,52	1,93%	104	0,15%	Artigo 9º - A, Inciso III
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>93.916.828,33</b>				

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

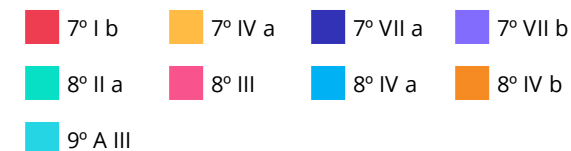
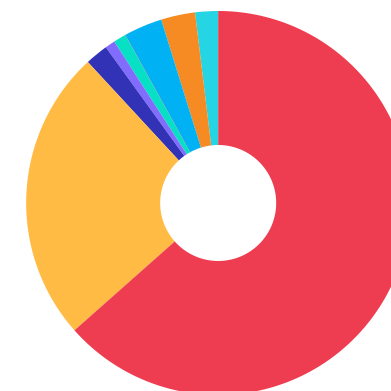
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	59.598.283,88	63,46%	20,00%	30,00%	90,00%	24.926.861,62
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	56.350.097,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	23.163.468,77	24,66%	10,00%	30,00%	40,00%	14.403.262,56
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	1.812.079,87	1,93%	0,00%	0,00%	5,00%	2.883.761,55
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	793.666,33	0,85%	0,00%	0,00%	5,00%	3.902.175,09
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.695.841,42
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>85.367.498,85</b>	<b>90,90%</b>	<b>30,00%</b>	<b>70,00%</b>	<b>205,00%</b>	



**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%	999.044,51	1,06%	0,00%	15,00%	20,00%	17.784.321,16
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,01	0,00%	0,00%	10,00%	10,00%	9.391.682,82
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	3.044.877,14	3,24%	0,00%	0,00%	5,00%	1.650.964,28
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	2.695.746,30	2,87%	0,00%	5,00%	5,00%	2.000.095,12
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>6.739.667,96</b>	<b>7,18%</b>	<b>0,00%</b>	<b>30,00%</b>	<b>40,00%</b>	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2020			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	1.809.661,52	1,93%	0,00%	0,00%	5,00%	2.886.179,90
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>1.809.661,52</b>	<b>1,93%</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>5,00%</b>	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	30.542.627,71	32,52	0,01
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	29.738.972,83	31,67	0,00
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	24.434.718,53	26,02	0,00
ÍNDIGO DTVM	3.044.877,14	3,24	-
REDITUS INVESTIMENTOS	2.695.746,30	2,87	-
PETRA CAPITAL	1.806.378,16	1,92	0,03
SECURITY ADMINISTRADORA DE REC...	793.666,33	0,85	6,90
BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUT...	633.283,62	0,67	0,01
RJI CORRETORA DE VALORES	226.557,71	0,24	0,04

**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 '	59.598.283,88	63,46	20,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	23.163.468,77	24,66	10,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	1.812.079,87	1,93	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	793.666,33	0,85	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	999.044,51	1,06	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	0,01	0,00	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	3.044.877,14	3,24	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	2.695.746,30	2,87	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso III	1.809.661,52	1,93	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
<b>IDKA PRÉ 2 ANOS (Benchmark)</b>	0,70%	6,60%	3,31%	6,60%	11,71%	28,80%	-	-
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	0,70%	6,50%	3,14%	6,50%	11,48%	28,06%	0,01%	0,02%
<b>CDI + 3,50% ao ano (Benchmark)</b>	0,50%	3,48%	1,58%	3,48%	8,24%	19,10%	-	-
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	3,85%	-16,50%	-1,15%	-16,50%	16,48%	-40,98%	0,47%	0,46%
<b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>	0,99%	3,35%	3,35%	3,35%	8,68%	23,17%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,21%	2,88%	3,57%	2,88%	8,18%	21,13%	0,01%	0,03%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,18%	3,12%	3,54%	3,12%	8,19%	21,36%	0,01%	0,03%
<b>IRF-M 1+ (Benchmark)</b>	1,04%	6,03%	4,53%	6,03%	11,57%	33,23%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,02%	5,88%	4,41%	5,88%	11,53%	32,77%	0,02%	0,03%
<b>IMA-B 5+ (Benchmark)</b>	2,84%	-5,26%	5,99%	-5,26%	1,68%	43,55%	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,80%	-5,38%	5,82%	-5,38%	1,88%	42,80%	0,05%	0,15%
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	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%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,26%	2,44%	1,07%	2,44%	5,70%	13,08%	0,00%	0,00%

**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
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	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%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-3,09%	-31,24%	-2,96%	-31,24%	-27,12%	-34,47%	0,05%	0,27%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	1,09%	3,23%	3,84%	3,23%	8,75%	24,57%	0,01%	0,04%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	-3,02%	-18,07%	-1,89%	-18,07%	-16,87%	-13,86%	0,06%	0,17%

<b>IMA-B (Benchmark)</b>	2,05%	-1,66%	4,96%	-1,66%	4,73%	35,13%	-	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,03%	-1,94%	4,87%	-1,94%	4,50%	34,26%	0,03%	0,10%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,02%	-1,75%	4,90%	-1,75%	4,74%	34,48%	0,03%	0,10%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	2,09%	-1,70%	5,16%	-1,70%	4,85%	35,14%	0,03%	0,10%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	2,02%	-1,84%	4,86%	-1,84%	4,59%	34,19%	0,03%	0,10%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,03%	-1,88%	4,91%	-1,88%	4,52%	34,35%	0,03%	0,10%

<b>Selic (Benchmark)</b>	0,21%	1,75%	0,73%	1,75%	4,58%	11,21%	-	-
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,26%	1,16%	0,53%	1,16%	3,89%	10,37%	0,00%	0,01%

<b>CDI (Benchmark)</b>	0,21%	1,75%	0,73%	1,75%	4,58%	11,21%	-	-
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	0,13%	0,81%	0,47%	0,81%	2,58%	-16,31%	-	-

<b>IPCA (Benchmark)</b>	0,26%	0,10%	-0,43%	0,10%	2,12%	5,57%	-	-
-------------------------	-------	-------	--------	-------	-------	-------	---	---



**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
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,21%	-1,55%	-0,59%	-1,55%	-8,44%	-12,07%	0,00%	0,06%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,75%	4,63%	3,27%	4,63%	9,82%	28,20%	0,01%	0,03%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,95%	1,78%	3,13%	1,78%	6,24%	22,63%	0,01%	0,04%

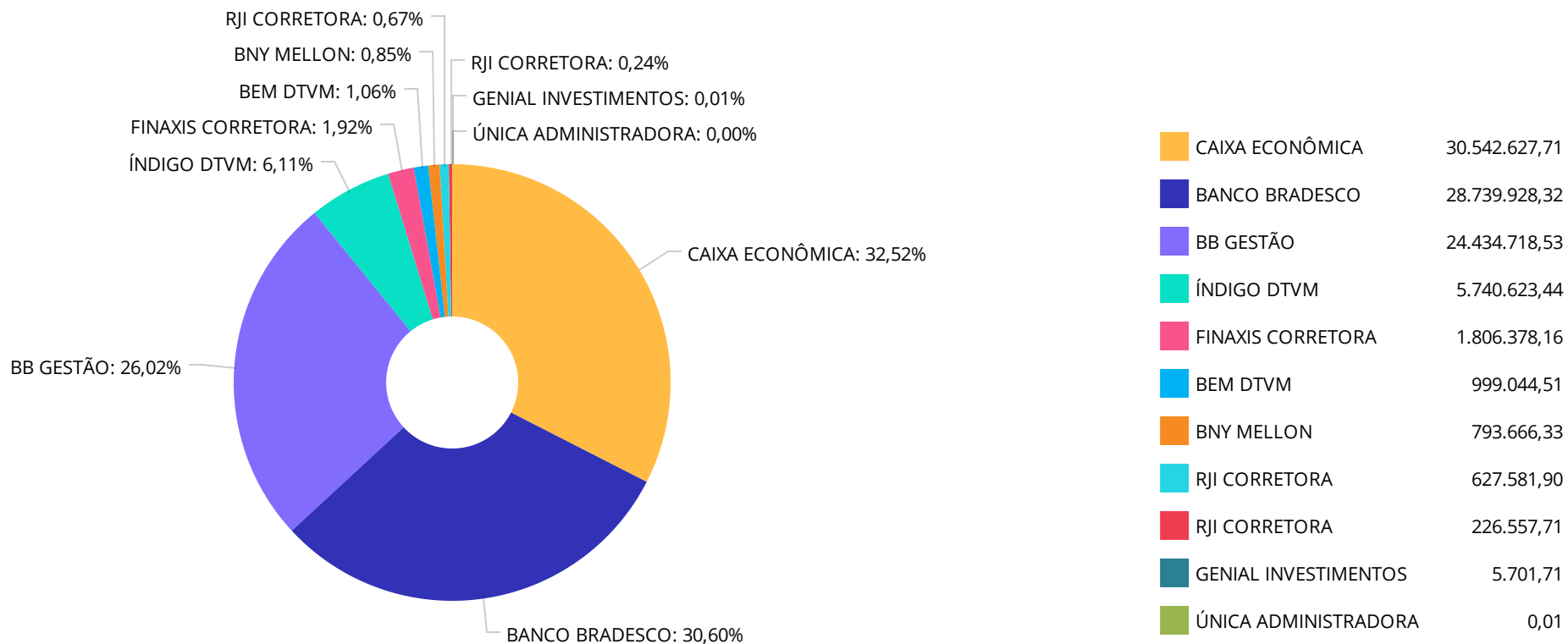
**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2020 - RENDA VARIÁVEL**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IPCA + 8,50% ao ano (Benchmark)</b>	0,94%	4,16%	1,56%	4,16%	10,80%	24,20%	-	-
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	-	-	-	-	-	-0,36%	-	-
<b>IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)</b>	0,91%	3,93%	1,44%	3,93%	10,29%	23,06%	-	-
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	-	-	-	-	-	-	-	-
<b>Ibovespa (Benchmark)</b>	8,76%	-17,80%	30,18%	-17,80%	-6,20%	30,64%	-	-
BRADESCO SELECTION FIAÇÕES	8,95%	-24,53%	25,56%	-24,53%	-13,48%	19,34%	0,12%	0,39%
<b>Não Informado (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	38,49%	38,89%	38,49%	38,89%	4,17%	23,45%	0,63%	0,45%

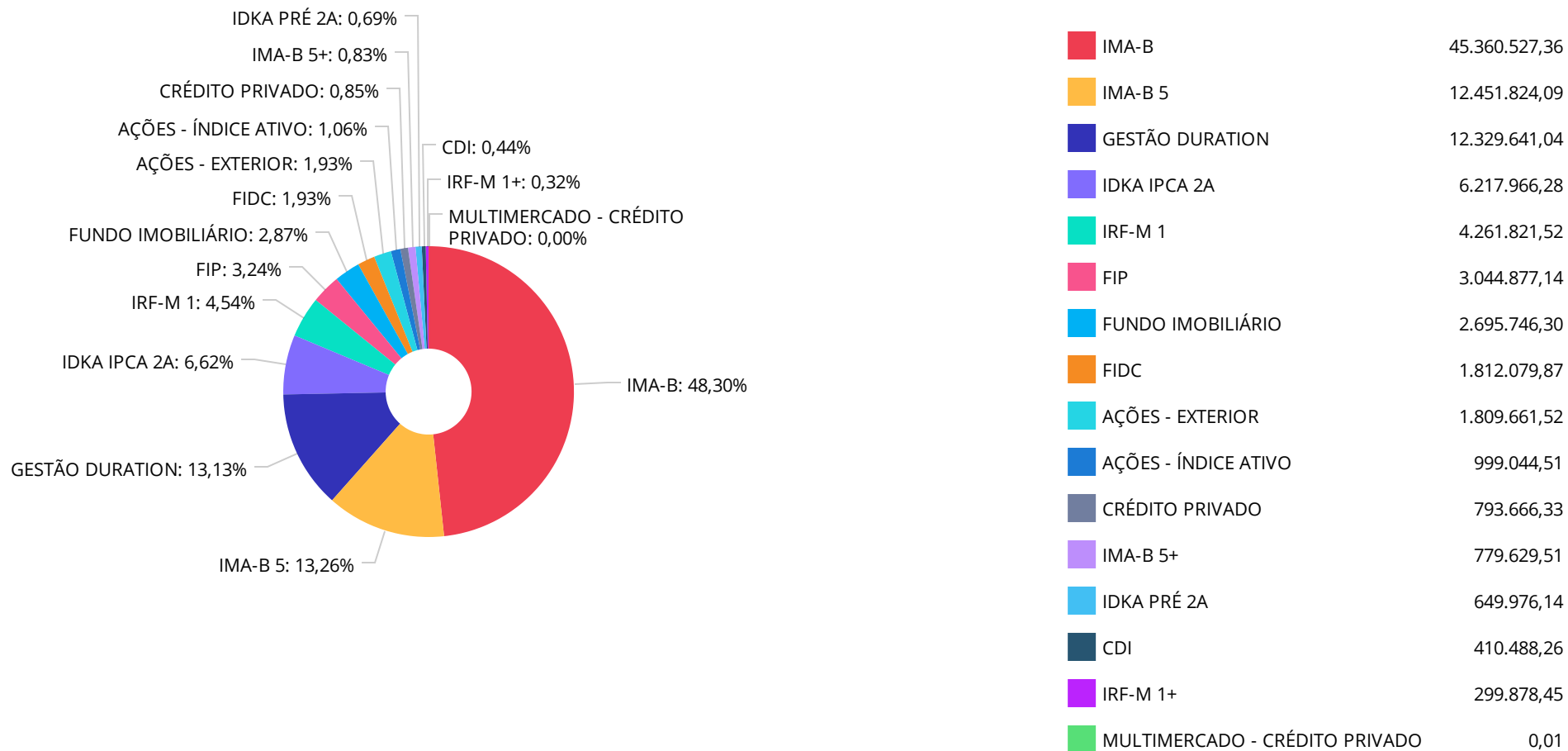
**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2020 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR**

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

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



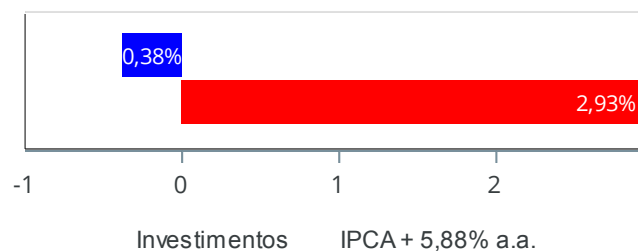
**Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Junho / 2020)**



**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	86.452.787,15	0,00	1.892.546,71	84.904.794,18	344.553,74	344.553,74	0,40%	0,40%	0,71%	0,71%	56,05%	1,40%
Fevereiro	84.904.794,18	7.813.885,96	1.918.158,62	90.878.787,47	78.265,95	422.819,69	0,09%	0,49%	0,66%	1,38%	35,26%	2,14%
Março	90.878.787,47	3.177.404,30	1.951.165,84	87.669.144,75	-4.435.881,18	-4.013.061,49	-4,82%	-4,35%	0,57%	1,95%	-222,84%	12,84%
Abril	87.669.144,75	873.784,63	1.968.430,08	87.623.924,97	1.049.425,67	-2.963.635,82	1,20%	-3,21%	0,14%	2,10%	-152,84%	6,80%
Mai	87.623.924,97	0,00	1.952.217,60	86.928.887,63	1.257.180,26	-1.706.455,56	1,43%	-1,82%	0,07%	2,17%	-83,75%	2,79%
Junho	86.928.887,63	1.946.420,28	3.442.011,92	86.709.009,65	1.275.713,66	-430.741,90	1,47%	-0,38%	0,74%	2,93%	-12,97%	4,24%

Investimentos x Meta Atuarial



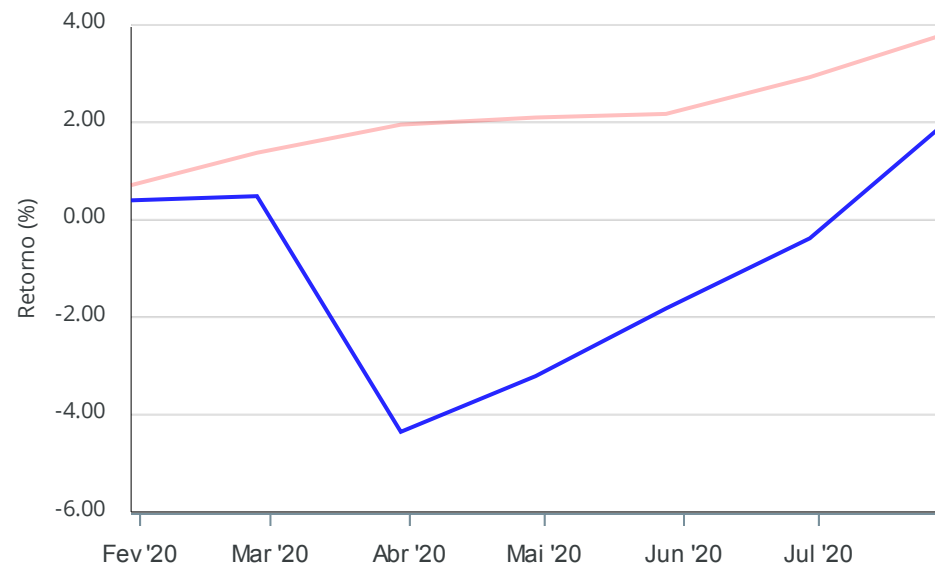
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	5.490,21	0,00	0,00	5.701,71	211,50	3,85%	3,85%	47,16%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	758.394,11	0,00	0,00	779.629,51	21.235,40	2,80%	2,80%	4,98%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	6.335,06	0,00	0,00	6.467,33	132,27	2,09%	2,09%	3,04%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.399.674,73	0,00	0,00	9.590.615,90	190.941,17	2,03%	2,03%	2,99%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	11.168.020,81	0,00	0,00	11.393.564,36	225.543,55	2,02%	2,02%	2,98%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	11.712.024,04	0,00	1.482.225,52	10.460.251,26	230.452,74	1,97%	2,03%	2,99%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC ...	15.065.129,43	0,00	1.450.117,25	13.909.628,51	294.616,33	1,96%	2,02%	2,98%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	2.638.898,58	0,00	0,00	2.670.908,76	32.010,18	1,21%	1,21%	0,81%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.461.329,87	0,00	0,00	3.499.356,63	38.026,76	1,10%	1,10%	0,91%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	8.010.963,98	0,00	0,00	8.098.327,85	87.363,87	1,09%	1,09%	0,94%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	296.859,78	0,00	0,00	299.878,45	3.018,67	1,02%	1,02%	1,75%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	4.163.869,82	0,00	0,00	4.203.429,82	39.560,00	0,95%	0,95%	1,28%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	2.866.108,26	1.297.613,52	648.806,76	3.547.057,52	32.142,50	0,77%	1,18%	0,86%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	8.065.749,49	0,00	0,00	8.126.211,22	60.461,73	0,75%	0,75%	1,17%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.489.854,61	0,00	32.108,27	1.461.610,41	3.864,07	0,26%	0,26%	0,05%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.792.971,37	0,00	0,00	2.800.211,11	7.239,74	0,26%	0,26%	0,05%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	409.427,34	0,00	0,00	410.488,26	1.060,92	0,26%	0,26%	0,04%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	0,00	648.806,76	0,00	649.976,14	1.169,38	0,18%	0,70%	0,92%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRI...	792.664,54	0,00	0,00	793.666,33	1.001,79	0,13%	0,13%	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.810.221,40	0,00	0,00	1.806.378,16	-3.843,24	-0,21%	-0,21%	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
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	233.612,64	0,00	0,00	226.557,71	-7.054,93	-3,02%	-3,02%	5,92%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	647.564,54	0,00	0,00	627.581,90	-19.982,64	-3,09%	-3,09%	5,20%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>85.795.164,61</b>	<b>1.946.420,28</b>	<b>3.613.257,80</b>	<b>85.367.498,85</b>	<b>1.239.171,76</b>	<b>1,41%</b>		<b>2,09%</b>

**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
BRADESCO SELECTION FIAÇÕES	916.948,16	0,00	0,00	999.044,51	82.096,35	8,95%	8,95%	12,00%
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	3.046.375,57	0,00	0,00	3.044.877,14	-1.498,43	-0,05%	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	2.699.931,30	0,00	0,00	2.695.746,30	-4.185,00	-0,16%	38,49%	63,32%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>6.663.255,04</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>6.739.667,96</b>	<b>76.412,92</b>	<b>1,15%</b>		<b>49,44%</b>

# CRÉDITO E MERCADO

*Consultoria em Investimentos*

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DO MUNICÍPIO DE QUEIMADOS  
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 FIAÇÕES	1.733.899,79	0,00	0,00	1.809.661,52	75.761,73	4,37%	4,37%	12,44%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>1.733.899,79</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>1.809.661,52</b>	<b>75.761,73</b>	<b>4,37%</b>		<b>12,44%</b>

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
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC ...	16.244.073,74	436.892,32	3.489.861,38	13.909.628,51	718.523,83	4,31%	4,86%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	12.974.611,95	436.892,31	3.521.969,65	10.460.251,26	570.716,65	4,26%	4,91%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	10.861.820,04	0,00	0,00	11.393.564,36	531.744,32	4,90%	4,90%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.145.191,51	0,00	0,00	9.590.615,90	445.424,39	4,87%	4,87%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	7.798.648,63	0,00	0,00	8.098.327,85	299.679,22	3,84%	3,84%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	7.868.614,26	0,00	0,00	8.126.211,22	257.596,96	3,27%	3,27%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	4.075.921,96	0,00	0,00	4.203.429,82	127.507,86	3,13%	3,13%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.374.263,26	0,00	0,00	3.499.356,63	125.093,37	3,71%	3,71%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	2.800.592,94	1.297.613,52	648.806,76	3.547.057,52	97.657,82	2,38%	3,54%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	2.578.792,56	0,00	0,00	2.670.908,76	92.116,20	3,57%	3,57%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	736.764,72	0,00	0,00	779.629,51	42.864,79	5,82%	5,82%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.770.036,29	0,00	0,00	2.800.211,11	30.174,82	1,09%	1,09%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.477.875,62	0,00	32.108,27	1.461.610,41	15.843,06	1,07%	1,07%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	287.211,31	0,00	0,00	299.878,45	12.667,14	4,41%	4,41%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRI...	789.938,67	0,00	0,00	793.666,33	3.727,66	0,47%	0,47%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	408.344,98	0,00	0,00	410.488,26	2.143,28	0,52%	0,52%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	0,00	648.806,76	0,00	649.976,14	1.169,38	0,18%	3,14%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	6.150,14	0,00	0,00	6.467,33	317,19	5,16%	5,16%
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	5.768,22	0,00	0,00	5.701,71	-66,51	-1,15%	-1,15%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	230.928,91	0,00	0,00	226.557,71	-4.371,20	-1,89%	-1,89%

**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
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.817.042,11	0,00	0,00	1.806.378,16	-10.663,95	-0,59%	-0,59%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	646.711,62	0,00	0,00	627.581,90	-19.129,72	-2,96%	-2,96%
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>3.340.736,56</b>	<b>3,72%</b>	

**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
BRADESCO SELECTION FIAÇÕES	795.685,70	0,00	0,00	999.044,51	203.358,81	25,56%	25,56%
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	3.048.054,97	0,00	0,00	3.044.877,14	-3.177,83	-0,10%	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	2.707.941,60	0,00	0,00	2.695.746,30	-12.195,30	-0,45%	38,49%
				<b>Total Renda Variável</b>	<b>187.985,68</b>	<b>2,87%</b>	

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 FIAÇÕES	1.454.730,66	0,00	0,00	1.809.661,52	354.930,86	24,40%	24,40%
				<b>Total Exterior</b>	<b>354.930,86</b>	<b>24,40%</b>	

**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	7.766.952,99	0,00	0,00	8.126.211,22	359.258,23	4,63%	4,63%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	7.844.814,45	0,00	0,00	8.098.327,85	253.513,40	3,23%	3,23%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.396.038,97	0,00	0,00	3.499.356,63	103.317,66	3,04%	3,04%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	2.812.059,41	1.297.613,52	648.806,76	3.547.057,52	86.191,35	2,10%	3,12%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	2.596.029,07	0,00	0,00	2.670.908,76	74.879,69	2,88%	2,88%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	4.129.986,54	0,00	0,00	4.203.429,82	73.443,28	1,78%	1,78%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.459.208,77	1.288.711,51	4.803,39	2.800.211,11	57.094,22	2,08%	2,48%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.978.103,67	1.588.702,16	2.148.209,61	1.461.610,41	43.014,19	1,21%	2,44%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	283.223,86	0,00	0,00	299.878,45	16.654,59	5,88%	5,88%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRI...	787.331,49	0,00	0,00	793.666,33	6.334,84	0,80%	0,80%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	405.802,10	0,00	0,00	410.488,26	4.686,16	1,15%	1,15%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	0,00	648.806,76	0,00	649.976,14	1.169,38	0,18%	6,50%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	6.579,12	0,00	0,00	6.467,33	-111,79	-1,70%	-1,70%
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	6.828,31	0,00	0,00	5.701,71	-1.126,60	-16,50%	-16,50%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.834.890,49	0,00	0,00	1.806.378,16	-28.512,33	-1,55%	-1,55%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	823.916,06	0,00	0,00	779.629,51	-44.286,55	-5,38%	-5,38%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	276.529,10	0,00	0,00	226.557,71	-49.971,39	-18,07%	-18,07%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.780.611,79	0,00	0,00	9.590.615,90	-189.995,89	-1,94%	-1,94%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	11.596.299,37	0,00	0,00	11.393.564,36	-202.735,01	-1,75%	-1,75%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	912.730,27	0,00	0,00	627.581,90	-285.148,37	-31,24%	-31,24%



**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 IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	12.832.250,37	4.643.825,91	6.619.522,72	10.460.251,26	-396.302,30	-2,27%	-1,88%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC ...	14.462.948,53	4.343.835,31	4.476.116,51	13.909.628,51	-421.038,82	-2,24%	-1,84%
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>-539.672,06</b>	<b>-0,54%</b>	

**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
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	3.039.409,90	0,00	0,00	3.044.877,14	5.467,24	0,18%	-
ECO HEDGE FI MULTIMERCA DO CRÉDITO PRIVADO LP	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	2.720.394,63	0,00	0,00	2.695.746,30	-24.648,33	-0,91%	38,89%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	1.323.782,56	0,00	0,00	999.044,51	-324.738,05	-24,53%	-24,53%
				<b>Total Renda Variável</b>	<b>-343.919,14</b>	<b>-4,86%</b>	

**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 FIAÇÕES	1.362.156,91	0,00	0,00	1.809.661,52	447.504,61	32,85%	32,85%
				<b>Total Exterior</b>	<b>447.504,61</b>	<b>32,85%</b>	