

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

Relatório Analítico dos Investimentos

em setembro e 3º trimestre de 2020

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2020)

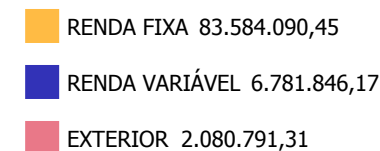
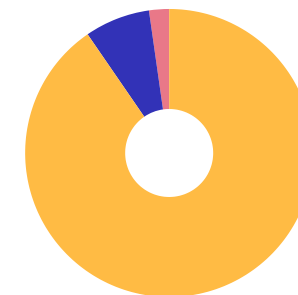
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	8.118.853,18	8,78%	868	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	2.714.020,65	2,94%	903	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	297.843,12	0,32%	388	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	9.396.448,57	10,16%	905	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADERCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	649.642,49	0,70%	130	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVI...	D+2	Não há	784.205,51	0,85%	310	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	3.606.101,88	3,90%	982	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	11.488.669,16	12,43%	676	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	2.813.415,17	3,04%	1.361	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADERCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.466.572,47	1,59%	265	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	3.544.624,90	3,83%	953	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 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	6.189,84	0,01%	28	1,10%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO P...	D+90 ou...	18 meses	776.903,04	0,84%		8,35%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b'
BRADERCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	1.057.065,35	1,14%	205	0,15%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a'
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	D+4382	Não há	0,01	0,00%	5	0,00%	Artigo 8º, Inciso III
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	Não se ...	Não se aplica	3.041.999,00	3,29%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se ...	Não se aplica	2.682.781,81	2,90%		6,83%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	D+4	Não há	2.080.791,31	2,25%	158	0,12%	Artigo 9º - A, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			92.446.727,93				

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

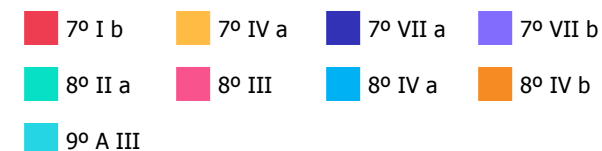
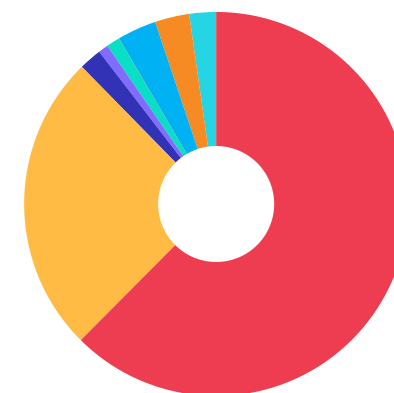
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	57.736.829,08	62,45%	20,00%	30,00%	90,00%	25.465.226,06
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	55.468.036,76
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	23.309.893,01	25,21%	10,00%	30,00%	40,00%	13.668.798,16
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	1.760.465,32	1,90%	0,00%	0,00%	5,00%	2.861.871,08
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	776.903,04	0,84%	0,00%	0,00%	5,00%	3.845.433,36
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.622.336,40
Total Renda Fixa	100,00%	83.584.090,45	90,41%	30,00%	70,00%	205,00%	



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 II, Alínea ' a '	20,00%	1.057.065,35	1,14%	0,00%	15,00%	20,00%	17.432.280,24
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,01	0,00%	0,00%	10,00%	10,00%	9.244.672,78
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	3.041.999,00	3,29%	0,00%	0,00%	5,00%	1.580.337,40
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	2.682.781,81	2,90%	0,00%	5,00%	5,00%	1.939.554,59
Total Renda Variável	30,00%	6.781.846,17	7,34%	0,00%	30,00%	40,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2020			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	2.080.791,31	2,25%	0,00%	0,00%	5,00%	2.541.545,09
Total Exterior	10,00%	2.080.791,31	2,25%	0,00%	0,00%	5,00%	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	29.858.078,13	32,30	0,01
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	28.842.308,32	31,20	0,00
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	24.664.543,18	26,68	0,00
ÍNDIGO DTVM	3.041.999,00	3,29	-
REDITUS INVESTIMENTOS	2.682.781,81	2,90	-
PETRA CAPITAL	1.754.275,48	1,90	0,03
SECURITY ADMINISTRADORA DE REC...	776.903,04	0,84	0,02
BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUT...	603.074,81	0,65	0,01
RJI CORRETORA DE VALORES	222.764,16	0,24	0,13

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 '	57.736.829,08	62,45	20,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	23.309.893,01	25,21	10,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	1.760.465,32	1,90	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	776.903,04	0,84	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	1.057.065,35	1,14	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	0,01	0,00	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	3.041.999,00	3,29	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	2.682.781,81	2,90	0,00	5,00

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA PRÉ 2 ANOS (Benchmark)	-0,47%	6,67%	0,06%	3,38%	8,65%	26,43%	-	-
BRADERCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	-0,55%	6,45%	-0,05%	3,09%	8,31%	25,84%	0,02%	0,03%
CDI + 3,50% ao ano (Benchmark)	0,44%	4,93%	1,41%	3,01%	7,17%	17,86%	-	-
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-27,14%	-9,35%	8,56%	7,31%	6,00%	-25,62%	0,57%	0,53%
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%
IMA-B 5+ (Benchmark)	-2,60%	-4,56%	0,75%	6,78%	-1,67%	42,42%	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-2,65%	-4,82%	0,59%	6,44%	-1,87%	41,55%	0,06%	0,17%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,15%	3,12%	0,51%	1,66%	4,54%	12,32%	-	-
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%
BRADERCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,03%	2,79%	0,34%	1,42%	4,14%	11,61%	0,00%	0,01%

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
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%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,32%	-34,60%	-4,89%	-7,71%	-33,21%	-29,98%	0,00%	0,27%
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	-0,19%	4,48%	1,21%	5,10%	7,13%	23,57%	0,02%	0,04%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	0,01%	-19,44%	-1,67%	-3,54%	-18,88%	-16,67%	0,01%	0,17%

IMA-B (Benchmark)	-1,51%	-0,72%	0,96%	5,97%	2,11%	34,14%	-	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,57%	-1,05%	0,91%	5,82%	1,71%	33,16%	0,04%	0,11%
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%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	-1,60%	-0,80%	0,92%	6,12%	2,03%	34,42%	0,04%	0,11%
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	-1,54%	-0,98%	0,88%	5,79%	1,77%	33,22%	0,04%	0,11%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,53%	-1,00%	0,89%	5,84%	1,68%	33,36%	0,04%	0,11%

Selic (Benchmark)	0,16%	2,28%	0,51%	1,25%	3,54%	10,04%	-	-
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,11%	1,71%	0,55%	1,08%	2,90%	9,28%	0,00%	0,01%

CDI (Benchmark)	0,16%	2,28%	0,51%	1,25%	3,54%	10,04%	-	-
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	-1,06%	-1,33%	-2,11%	-1,65%	-0,57%	-18,68%	-	-
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRIVADO LP	-1,06%	-1,33%	-2,11%	-1,65%	-0,57%	-18,68%	-	-

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
IPCA (Benchmark)	0,64%	1,34%	1,24%	0,81%	3,14%	6,12%	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,17%	-4,39%	-2,88%	-3,45%	-4,90%	-13,75%	0,00%	0,11%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	-0,50%	4,53%	-0,09%	3,18%	6,41%	25,88%	0,02%	0,03%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,98%	1,62%	-0,16%	2,97%	3,46%	20,62%	0,02%	0,04%

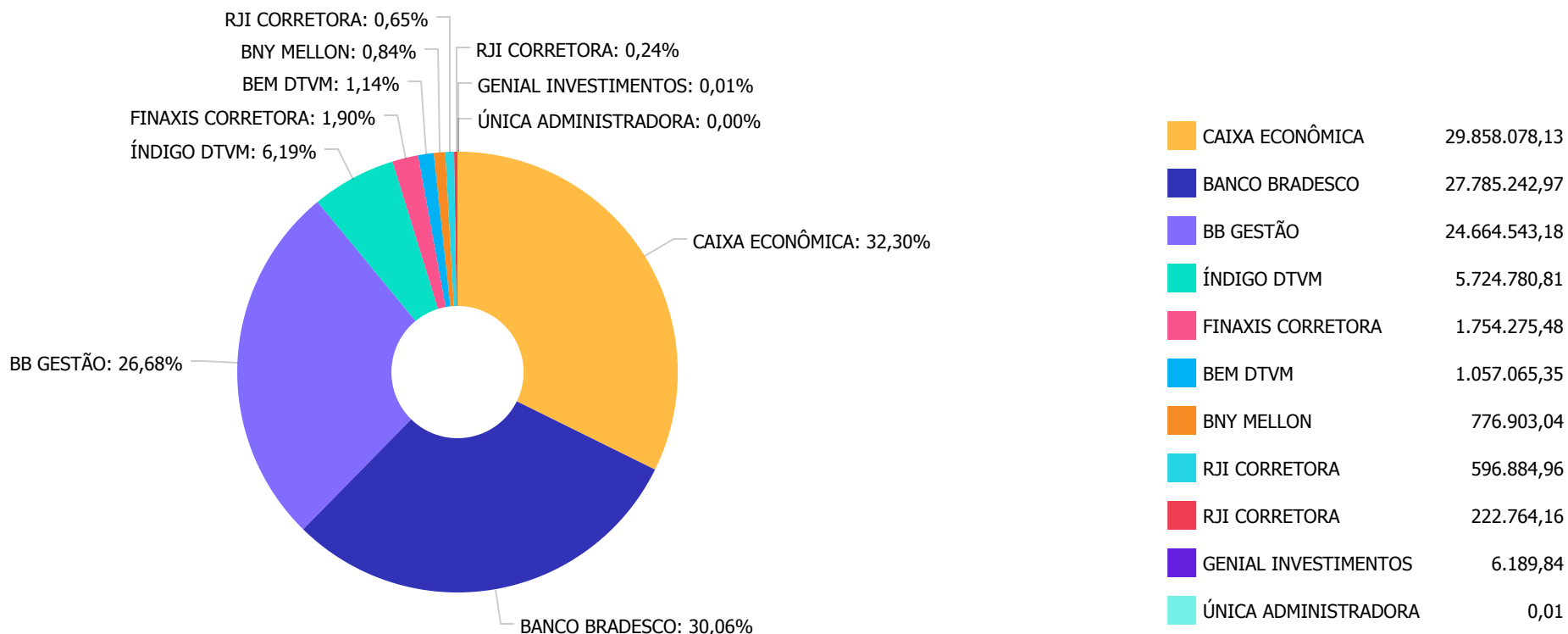
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 8,50% ao ano (Benchmark)	1,33%	7,70%	3,40%	5,01%	11,90%	24,89%	-	-
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	-	-	-	-	-	-	-	-
IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	1,29%	7,33%	3,27%	4,76%	11,39%	23,74%	-	-
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	2,03%	24,97%	-	-	42,39%	131,90%	0,00%	-
Ibovespa (Benchmark)	-4,80%	-18,20%	-0,48%	29,56%	-9,68%	19,23%	-	-
BRADERCO SELECTION FI AÇÕES	-2,74%	-20,15%	5,81%	32,85%	-12,72%	15,23%	0,10%	0,40%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	0,00%	11,11%	-20,00%	10,80%	-14,89%	0,00%	0,00%	0,49%

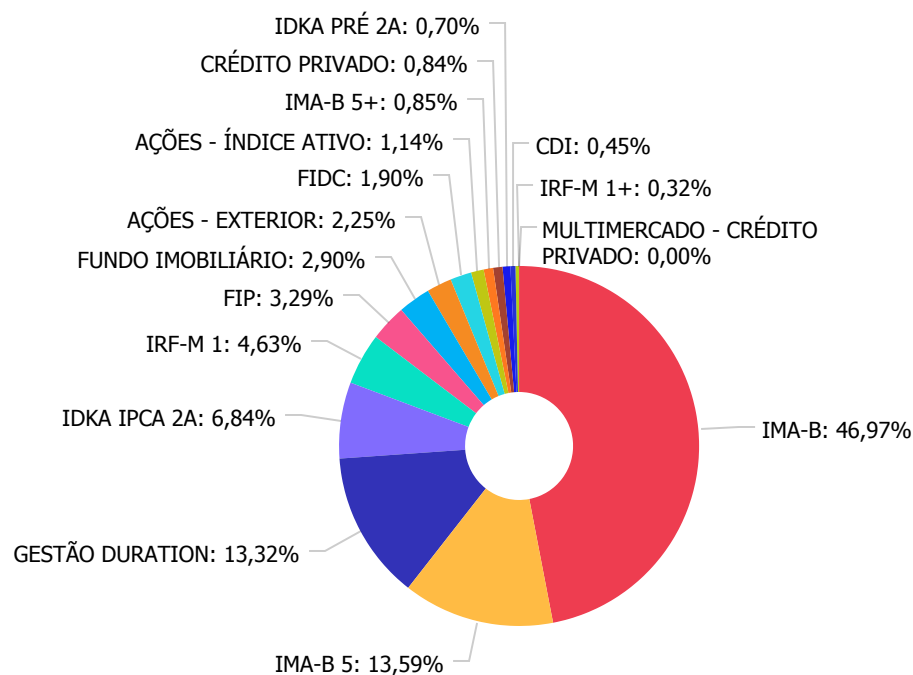
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2020 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	-1,97%	51,44%	14,34%	43,02%	60,30%	70,28%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	-1,99%	52,76%	14,98%	43,04%	61,21%	70,33%	0,16%	0,23%

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



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

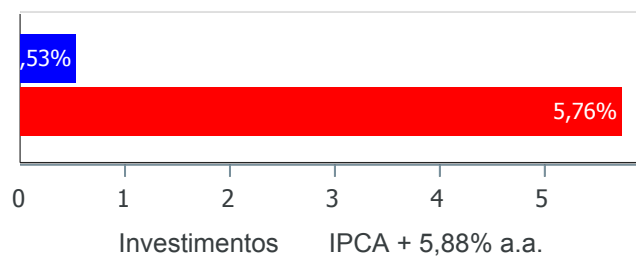


IMA-B	43.425.724,13
IMA-B 5	12.560.769,05
GESTÃO DURATION	12.315.676,53
IDKA IPCA 2A	6.320.122,53
IRF-M 1	4.279.987,64
FIP	3.041.999,00
FUNDO IMOBILIÁRIO	2.682.781,81
AÇÕES - EXTERIOR	2.080.791,31
FIDC	1.760.465,32
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	1.057.065,35
IMA-B 5+	784.205,51
CRÉDITO PRIVADO	776.903,04
IDKA PRÉ 2A	649.642,49
CDI	412.751,09
IRF-M 1+	297.843,12
MULTIMERCADO - CRÉDITO PRIVADO	0,01

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%
Julho	86.709.009,65	1.260.248,61	2.059.637,46	88.030.912,65	2.121.291,85	1.690.549,95	2,45%	2,06%	0,88%	3,84%	53,58%	3,04%
Agosto	88.030.912,65	1.260.248,62	3.301.977,32	85.559.150,30	-430.033,65	1.260.516,30	-0,49%	1,56%	0,72%	4,59%	33,99%	3,13%
Setembro	85.559.150,30	2.875.681,13	2.056.795,44	85.506.284,22	-871.751,77	388.764,53	-1,01%	0,53%	1,12%	5,76%	9,27%	3,19%

Investimentos x Meta Atuarial



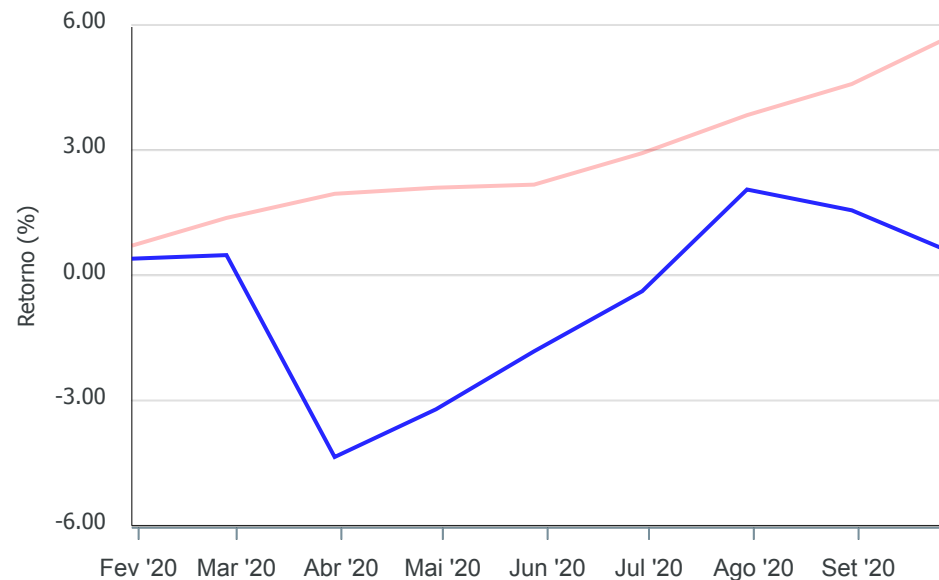
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.809.669,06	0,00	0,00	2.813.415,17	3.746,11	0,13%	0,13%	0,12%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	2.710.927,19	0,00	0,00	2.714.020,65	3.093,46	0,11%	0,11%	1,35%
BRADERCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	412.282,63	0,00	0,00	412.751,09	468,46	0,11%	0,11%	0,05%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	3.604.778,03	0,00	0,00	3.606.101,88	1.323,85	0,04%	0,04%	1,38%
BRADERCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.466.188,23	0,00	0,00	1.466.572,47	384,24	0,03%	0,03%	0,14%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	222.738,39	0,00	0,00	222.764,16	25,77	0,01%	0,01%	1,33%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.550.280,15	0,00	0,00	3.544.624,90	-5.655,25	-0,16%	-0,16%	1,65%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.757.245,92	0,00	0,00	1.754.275,48	-2.970,44	-0,17%	-0,17%	0,01%
BRADERCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	8.211.841,71	0,00	0,00	8.196.495,03	-15.346,68	-0,19%	-0,19%	1,69%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	598.822,43	0,00	0,00	596.884,96	-1.937,47	-0,32%	-0,32%	0,13%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	8.159.910,49	0,00	0,00	8.118.853,18	-41.057,31	-0,50%	-0,50%	1,68%
BRADERCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	653.237,72	0,00	0,00	649.642,49	-3.595,23	-0,55%	-0,55%	1,76%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	300.784,37	0,00	0,00	297.843,12	-2.941,25	-0,98%	-0,98%	2,60%
BRADERCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	4.238.497,41	0,00	0,00	4.196.823,35	-41.674,06	-0,98%	-0,98%	2,28%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRI...	785.203,32	0,00	0,00	776.903,04	-8.300,28	-1,06%	-1,06%	

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 IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	805.524,33	0,00	0,00	784.205,51	-21.318,82	-2,65%	-2,65%	6,28%
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	8.495,05	0,00	0,00	6.189,84	-2.305,21	-27,14%	-27,14%	57,29%
Total Renda Fixa	83.812.440,01	2.875.681,13	2.239.386,50	83.584.090,45	-864.644,19	-1,02%		2,89%

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
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	2,03%	0,00%
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	3.043.125,23	0,00	0,00	3.041.999,00	-1.126,23	-0,04%	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	2.684.196,52	0,00	0,00	2.682.781,81	-1.414,71	-0,05%	0,00%	0,00%
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	1.086.812,27	0,00	0,00	1.057.065,35	-29.746,92	-2,74%	-2,74%	10,29%
Total Renda Variável	6.814.134,03	0,00	0,00	6.781.846,17	-32.287,86	-0,47%		2,91%

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

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

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
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	2.123.132,63	0,00	0,00	2.080.791,31	-42.341,32	-1,99%	-1,99%	15,53%
Total Renda Variável	2.123.132,63	0,00	0,00	2.080.791,31	-42.341,32	-1,99%		15,53%

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
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FIC ...	13.909.628,51	2.067.964,88	3.250.811,60	12.856.431,98	129.650,19	0,81%	0,88%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	10.460.251,26	2.067.964,87	3.250.811,60	9.396.448,57	119.044,04	0,95%	0,89%
BRADESCO INSTITUCIONAL FIC FI RENDA FIXA IMA-B 5	8.098.327,85	0,00	0,00	8.196.495,03	98.167,18	1,21%	1,21%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	11.393.564,36	0,00	0,00	11.488.669,16	95.104,80	0,83%	0,83%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.590.615,90	0,00	0,00	9.677.647,86	87.031,96	0,91%	0,91%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	3.547.057,52	0,00	0,00	3.606.101,88	59.044,36	1,66%	1,66%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.499.356,63	1.260.248,61	1.260.248,62	3.544.624,90	45.268,28	0,95%	1,21%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	2.670.908,76	0,00	0,00	2.714.020,65	43.111,89	1,61%	1,61%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.800.211,11	0,00	0,00	2.813.415,17	13.204,06	0,47%	0,47%
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.461.610,41	0,00	0,00	1.466.572,47	4.962,06	0,34%	0,34%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	779.629,51	0,00	0,00	784.205,51	4.576,00	0,59%	0,59%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	410.488,26	0,00	0,00	412.751,09	2.262,83	0,55%	0,55%
MASTER II FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	5.701,71	0,00	0,00	6.189,84	488,13	8,56%	8,56%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	6.467,33	0,00	0,00	6.526,56	59,23	0,92%	0,92%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	649.976,14	0,00	0,00	649.642,49	-333,65	-0,05%	-0,05%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	299.878,45	0,00	0,00	297.843,12	-2.035,33	-0,68%	-0,68%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	226.557,71	0,00	0,00	222.764,16	-3.793,55	-1,67%	-1,67%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	4.203.429,82	0,00	0,00	4.196.823,35	-6.606,47	-0,16%	-0,16%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	8.126.291,21	0,00	0,00	8.118.861,18	-7.430,03	-0,09%	-0,09%
SECURITY FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI CRÉDITO PRI...	793.666,33	0,00	0,00	776.903,04	-16.763,29	-2,11%	-2,11%

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
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	627.581,90	0,00	0,00	596.884,96	-30.696,94	-4,89%	-4,89%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.806.378,16	0,00	0,00	1.754.275,48	-52.102,68	-2,88%	-2,88%
				Total Renda Fixa	582.285,06	0,64%	

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	999.044,51	0,00	0,00	1.057.065,35	58.020,84	5,81%	5,81%
ECO HEDGE FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO LP	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-
CONQUEST EMPRESAS EMERGENTES FIP - FCCQ11	3.044.877,14	0,00	0,00	3.041.999,00	-2.878,14	-0,09%	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	2.695.746,30	0,00	0,00	2.682.781,81	-12.964,49	-0,48%	-20,00%
				Total Renda Variável	42.178,21	0,63%	

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
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	1.809.661,52	0,00	0,00	2.080.791,31	271.129,79	14,98%	14,98%
				Total Exterior	271.129,79	14,98%	