

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos
Relatório Analítico dos Investimentos
em agosto de 2020

Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2020)

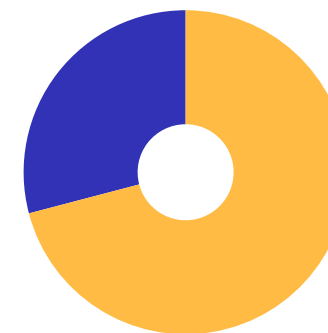
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENC...	D+0	16/05/2023	2.535.271,93	1,17%	51	0,72%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	30.962.157,03	14,31%	852	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVID...	D+0	15/08/2022	1.354.973,25	0,63%	115	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	7.279.198,13	3,36%	673	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	6.141.686,41	2,84%	932	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	13.042.199,27	6,03%	600	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	25.631.138,36	11,85%	970	0,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	6.626.545,84	3,06%	1.359	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	14.160.568,71	6,55%	892	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	12.350.137,50	5,71%	627	0,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2030	1.407.563,00	0,65%	34	0,65%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.144.201,05	1,45%	755	0,18%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	10.751.791,16	4,97%	289	0,21%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' '
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	D+0	Não há	1.607.379,64	0,74%	2.070	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' '
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	3.189.054,98	1,47%	85	0,42%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' '
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	4.945.492,03	2,29%	189	0,36%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	165.171,42	0,08%	472	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' '
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	5.384.893,10	2,49%	100	0,91%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' '
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO...	D+30 ou...	Não há	1.999.721,53	0,92%	74	0,33%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIV...	D+0	3 anos	733.621,20	0,34%	74	0,40%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b ' '

Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GENESIS FIC AÇÕ...	D+24	Não há	2.685.446,75	1,24%	14	0,63%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	23/08/2017	3.751.739,38	1,73%	154	0,47%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	3.381.942,14	1,56%	2.497	0,39%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	2.612.569,83	1,21%	47.653	0,06%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	3.058.495,23	1,41%	158	0,08%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	1.833.737,66	0,85%	114	0,25%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	2.950.837,88	1,36%	204	0,42%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	8.698.378,58	4,02%	1.650	0,96%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	2.701.636,81	1,25%	8.187	0,27%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	3.110.649,02	1,44%	6.469	0,13%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
GERAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	2.391.309,03	1,11%	15.818	0,70%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	1.994.319,79	0,92%	80	0,24%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	2.260.781,01	1,05%	20.483	0,09%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	10.765.256,77	4,98%	19.855	0,21%	Artigo 8º, Inciso III
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	6.033.979,81	2,79%	198	1,30%	Artigo 8º, Inciso III
BRASIL AGRO II MULTISTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	3.144.038,04	1,45%	18	4,42%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	1.550.000,00	0,72%		0,63%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'
Total para cálculo dos limites da Resolução			216.337.883,27				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			6.738,52	Artigo 6º			
PL Total			216.344.621,79				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	121.491.439,43	56,16%	15,00%	25,00%	90,00%	73.212.655,51
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	129.802.729,96
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	29.187.983,38	13,49%	10,00%	30,00%	40,00%	57.347.169,93
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	32.450.682,49
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	10.816.894,16
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	2.733.342,73	1,26%	0,00%	5,00%	5,00%	8.083.551,43
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	10.816.894,16
Total Renda Fixa	100,00%	153.412.765,54	70,91%	25,00%	70,00%	220,00%	



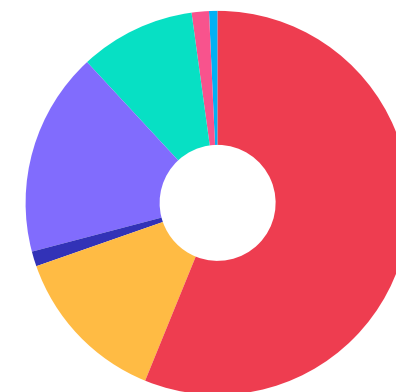
RENTA FIXA 153.412.765,54

RENTA VARIÁVEL 62.925.117,73

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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	37.176.742,31	17,18%	7,00%	15,00%	20,00%	6.090.834,34
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	21.054.337,38	9,73%	7,00%	10,00%	10,00%	579.450,95
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	5,00%	3.144.038,04	1,45%	2,00%	2,00%	5,00%	7.672.856,12
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	5,00%	1.550.000,00	0,72%	1,00%	3,00%	5,00%	9.266.894,16
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	10.816.894,16
Total Renda Variável	30,00%	62.925.117,73	29,09%	17,00%	30,00%	45,00%	

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%	21.633.788,33
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	91.620.182,97	42,35	0,02
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	70.598.629,76	32,63	0,00
ITAÚ UNIBANCO	26.604.183,94	12,30	0,00
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	7.896.329,91	3,65	0,00
VINCI PARTNERS	5.585.477,04	2,58	0,01
AGBI REAL ASSETS	3.144.038,04	1,45	4,42
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	3.110.649,02	1,44	0,00
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	2.701.636,81	1,25	0,18
ITAÚ DTVM	2.685.446,75	1,24	0,00
GENIAL INVESTIMENTOS	2.391.309,03	1,11	0,03

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 '	121.491.439,43	56,16	15,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	29.187.983,38	13,49	10,00	40,00
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	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	2.733.342,73	1,26	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	37.176.742,31	17,18	7,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	21.054.337,38	9,73	7,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	3.144.038,04	1,45	2,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	1.550.000,00	0,72	1,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA Geral ex-C (Benchmark)	-0,68%	2,69%	1,88%	1,72%	6,16%	22,72%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,89%	2,63%	1,82%	1,67%	6,05%	23,16%	0,01%	0,04%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	1,03%	5,39%	2,99%	4,11%	9,71%	23,52%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,69%	4,43%	2,73%	3,38%	8,67%	21,54%	0,01%	0,03%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,79%	4,80%	2,82%	3,70%	8,84%	21,88%	0,01%	0,03%
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	0,73%	4,66%	2,39%	3,22%	8,58%	18,96%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,66%	5,89%	2,95%	4,38%	11,02%	31,73%	0,01%	0,04%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,12%	2,96%	0,64%	2,12%	5,06%	12,83%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,10%	2,83%	0,60%	2,03%	4,85%	12,44%	0,00%	0,01%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,43%	4,63%	2,55%	3,39%	9,24%	25,01%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,39%	4,45%	2,48%	3,24%	8,93%	24,43%	0,01%	0,04%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,37%	4,46%	2,43%	3,21%	8,96%	24,42%	0,01%	0,04%
IMA-B (Benchmark)	-1,80%	0,80%	4,61%	0,09%	6,64%	36,00%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,85%	0,64%	4,50%	-0,06%	6,38%	35,28%	0,02%	0,11%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	-1,92%	2,09%	4,48%	1,17%	8,22%	39,31%	0,02%	0,10%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,16%	2,12%	0,57%	1,43%	3,86%	10,38%	-	-
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,15%	2,00%	0,53%	1,36%	3,70%	10,05%	0,00%	0,00%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,08%	1,42%	0,31%	0,92%	2,78%	8,08%	0,00%	0,00%
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	0,39%	5,92%	0,83%	5,14%	9,20%	21,62%	0,00%	0,03%
IPCA (Benchmark)	0,24%	0,70%	0,86%	0,24%	2,44%	5,95%	-	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,49%	4,20%	2,47%	3,01%	8,50%	23,10%	0,01%	0,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,76%	4,51%	2,61%	3,26%	8,84%	26,23%	0,01%	0,03%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-2,02%	-0,51%	-0,69%	0,51%	2,68%	6,27%	0,00%	0,04%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	-0,22%	5,24%	2,92%	3,64%	10,47%	28,20%	0,01%	0,06%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,13%	2,70%	0,86%	2,09%	4,74%	18,63%	0,00%	0,01%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	-0,56%	5,06%	1,17%	3,57%	9,21%	27,35%	0,01%	0,03%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,86%	2,63%	1,79%	1,79%	6,03%	22,43%	0,01%	0,04%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,15%	2,17%	0,55%	1,48%	3,90%	10,35%	0,00%	0,00%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	0,88%	5,97%	2,88%	4,20%	10,63%	23,47%	-	-
BRASIL AGRO II MULTISTRATÉGIA FIP	-0,09%	-	0,14%	-	-	38,10%	0,01%	-

IDIV (Benchmark)	-4,83%	-17,25%	10,46%	-10,38%	-3,64%	44,78%	-	-
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	-3,82%	-13,31%	8,95%	-8,81%	-1,14%	48,70%	0,09%	0,34%

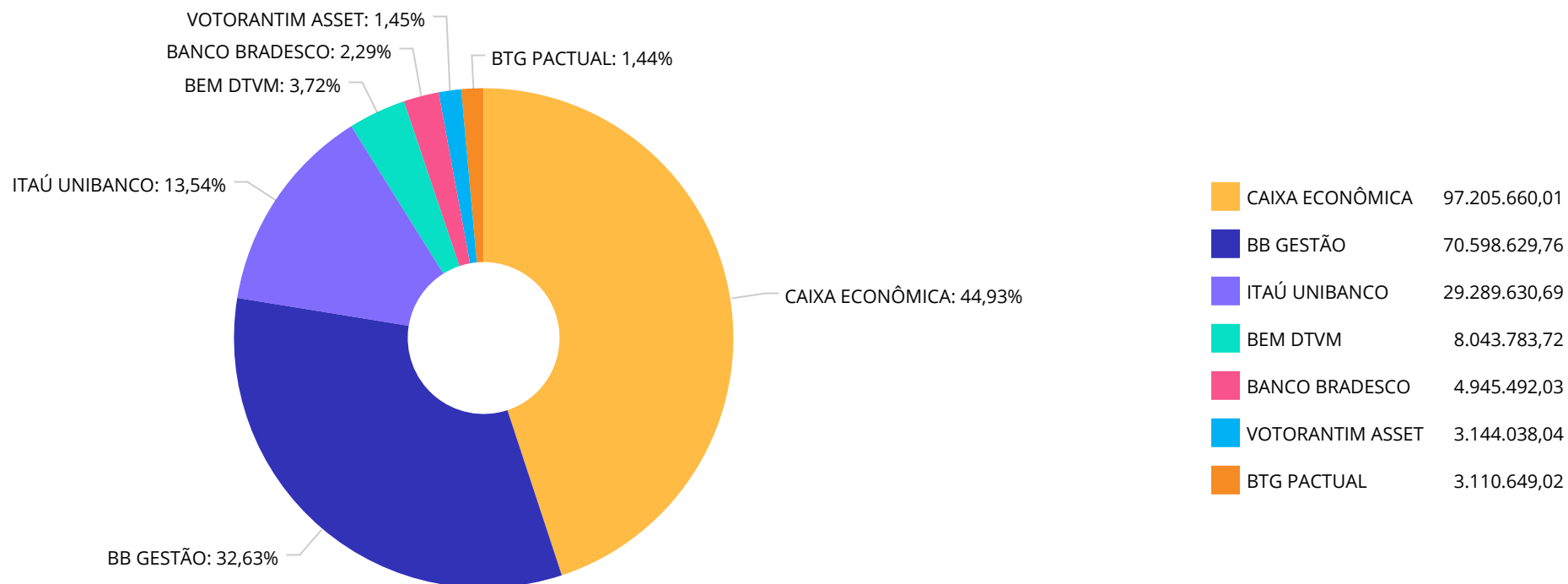
Ibovespa (Benchmark)	-3,44%	-14,07%	13,69%	-4,61%	-1,75%	29,59%	-	-
GERAÇÃO FI AÇÕES	-2,88%	-13,86%	15,21%	-4,49%	-3,84%	32,69%	0,10%	0,38%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-0,43%	-1,08%	18,99%	4,39%	10,14%	69,23%	0,09%	0,42%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	-6,24%	-17,19%	8,81%	-13,91%	-0,49%	50,93%	0,08%	0,40%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-3,93%	-27,34%	13,94%	-21,07%	-17,17%	22,23%	0,12%	0,50%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-3,55%	-15,94%	10,23%	-6,32%	-2,66%	48,05%	0,10%	0,35%
BRANCO SELECTION FI AÇÕES	-1,15%	-17,90%	18,53%	-6,49%	-9,95%	23,51%	0,10%	0,40%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-0,20%	-16,55%	17,29%	-7,31%	-2,64%	42,50%	0,09%	0,41%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-3,45%	-10,02%	15,87%	-4,39%	6,16%	-	0,09%	0,42%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GENESIS FIC AÇÕES	-2,26%	-6,13%	17,47%	-0,39%	8,28%	-	0,09%	0,41%

CDI (Benchmark)	0,16%	2,12%	0,57%	1,43%	3,86%	10,38%	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	-0,42%	0,88%	0,41%	0,57%	4,60%	13,25%	0,00%	0,02%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	-0,78%	-1,51%	4,29%	1,17%	4,36%	18,02%	0,03%	0,11%

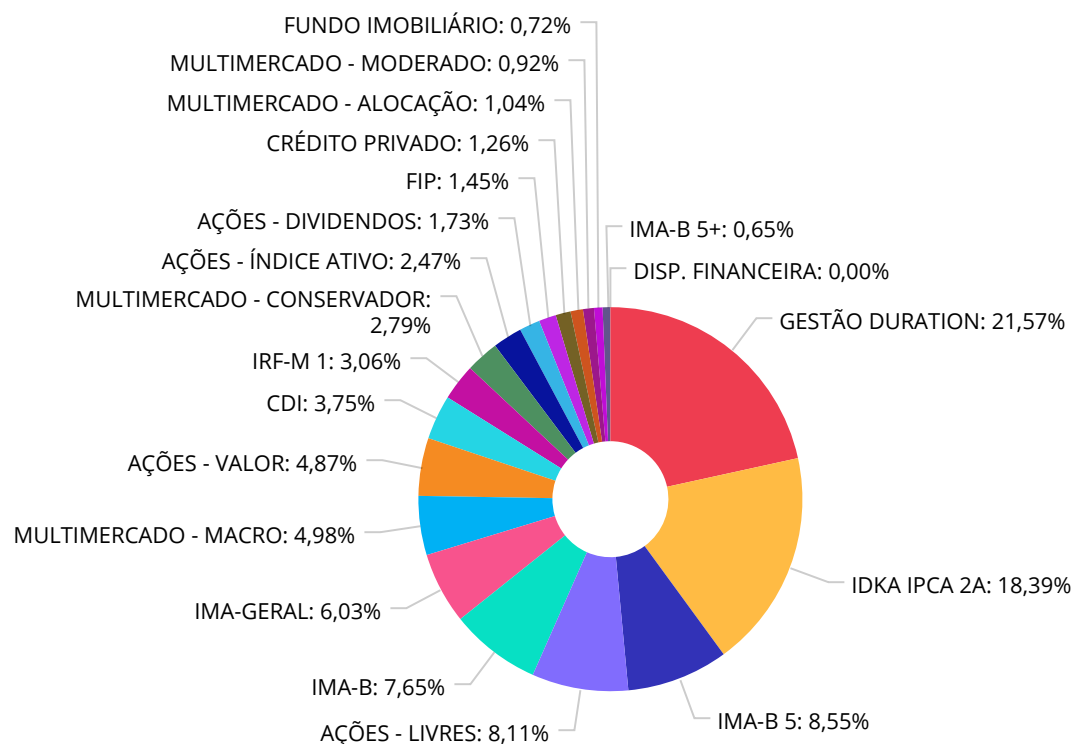
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	-0,14%	0,22%	2,54%	1,07%	5,57%	24,78%	0,01%	0,07%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	-4,82%	-12,88%	13,29%	-8,31%	4,43%	59,74%	0,09%	0,40%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	-10,41%	4,03%	19,23%	5,16%	41,29%	63,76%	0,11%	0,46%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	-0,23%	0,62%	4,58%	2,70%	-	-	0,03%	-

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



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

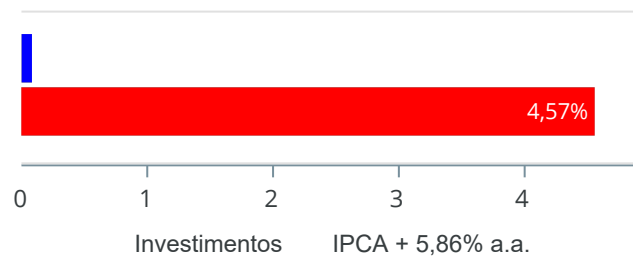


GESTÃO DURATION	46.659.440,22
IDKA IPCA 2A	39.791.707,07
IMA-B 5	18.491.823,91
AÇÕES - LIVRES	17.550.739,78
IMA-B	16.554.336,41
IMA-GERAL	13.042.199,27
MULTIMERCADO - MACRO	10.765.256,77
AÇÕES - VALOR	10.532.116,24
CDI	8.105.807,09
IRF-M 1	6.626.545,84
MULTIMERCADO - CONSERVADOR	6.033.979,81
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	5.342.146,91
AÇÕES - DIVIDENDOS	3.751.739,38
FIP	3.144.038,04
CRÉDITO PRIVADO	2.733.342,73
MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	2.260.781,01
MULTIMERCADO - MODERADO	1.994.319,79
FUNDO IMOBILIÁRIO	1.550.000,00
IMA-B 5+	1.407.563,00

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

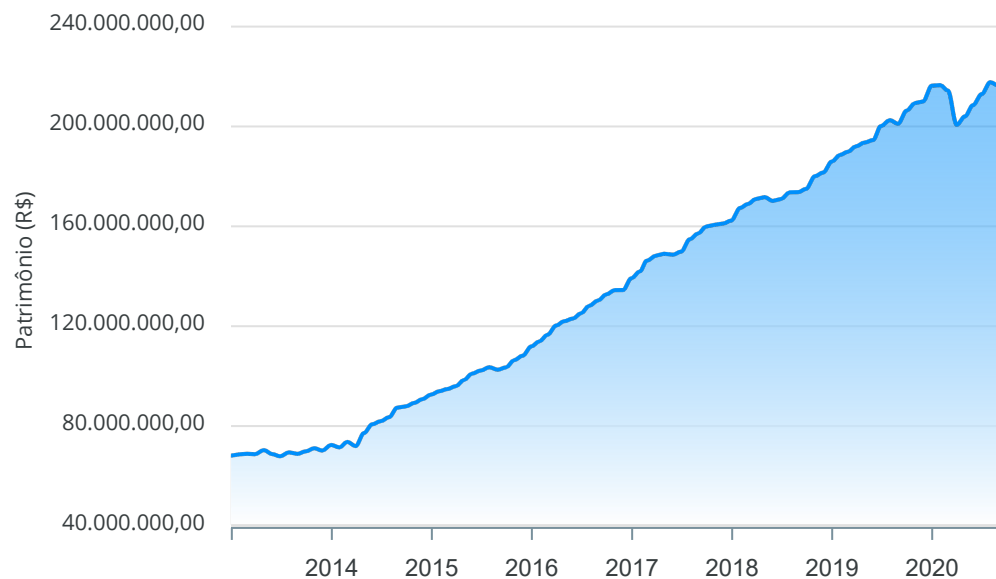
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	214.207.749,87	1.322.881,96	2.484.374,30	214.203.168,74	1.156.911,21	1.156.911,21	0,54%	0,54%	0,71%	0,71%	76,13%	2,29%
Fevereiro	214.203.168,74	5.969.817,04	7.600.836,88	209.874.462,79	-2.697.686,11	-1.540.774,90	-1,26%	-0,73%	0,66%	1,37%	-52,90%	3,69%
Março	209.874.462,79	3.902.301,44	1.064.632,86	198.242.123,80	-14.470.007,57	-16.010.782,47	-6,80%	-7,48%	0,57%	1,95%	-383,70%	12,66%
Abril	198.242.123,80	1.597.480,71	2.250.943,89	201.466.086,24	3.877.425,62	-12.133.356,85	1,96%	-5,67%	0,14%	2,09%	-270,81%	6,37%
Maio	201.466.086,24	1.891.668,55	1.919.718,66	206.003.308,84	4.565.272,71	-7.568.084,14	2,27%	-3,53%	0,07%	2,17%	-163,05%	3,45%
Junho	206.003.308,84	1.639.403,38	1.687.493,22	210.408.821,75	4.453.602,75	-3.114.481,39	2,16%	-1,45%	0,74%	2,92%	-49,55%	2,84%
Julho	210.408.821,75	1.366.148,23	1.362.301,63	215.121.452,70	4.708.784,35	1.594.302,96	2,24%	0,76%	0,88%	3,83%	19,82%	2,34%
Agosto	215.121.452,70	16.590.992,96	16.419.986,16	213.831.466,65	-1.460.992,85	133.310,11	-0,68%	0,08%	0,72%	4,57%	1,64%	2,46%

Investimentos x Meta Atuarial

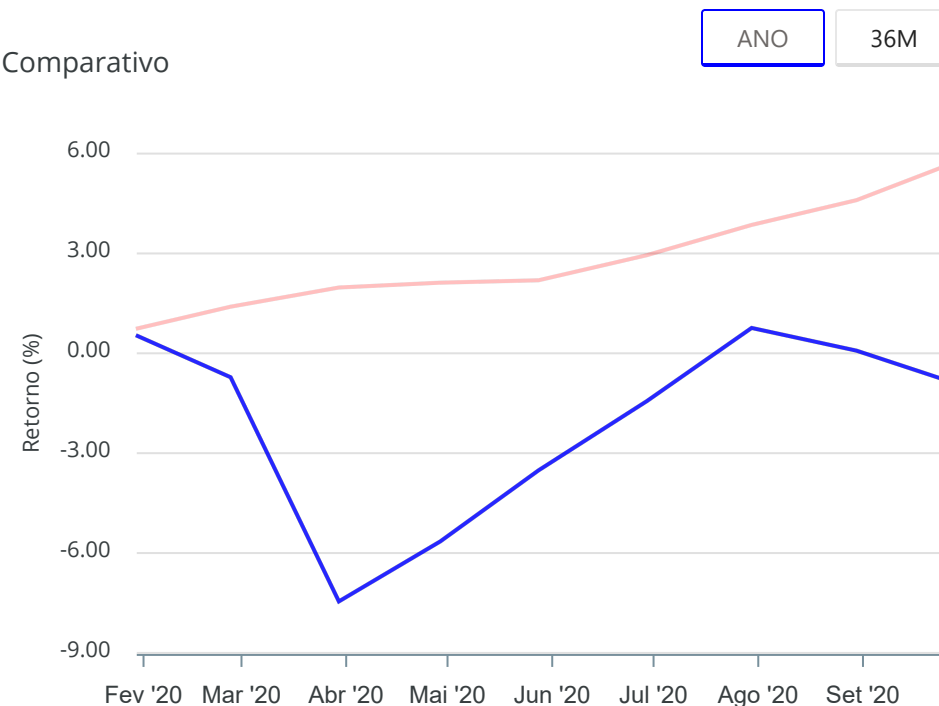


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



- ☐ 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 Agosto/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	25.429.851,00	0,00	0,00	25.631.138,36	201.287,36	0,79%	0,79%	0,77%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.436.623,00	0,00	40.060,49	1.407.563,00	11.000,49	0,77%	-2,02%	0,08%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDEN...	1.582.158,84	0,00	238.715,26	1.354.973,25	11.529,67	0,73%	0,76%	0,67%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	14.064.071,69	0,00	0,00	14.160.568,71	96.497,02	0,69%	0,69%	0,74%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	2.518.639,97	0,00	0,00	2.535.271,93	16.631,96	0,66%	0,66%	1,05%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	1.989.970,46	0,00	0,00	1.999.721,53	9.751,07	0,49%	0,49%	0,97%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	6.117.717,16	0,00	0,00	6.141.686,41	23.969,25	0,39%	0,39%	0,83%
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	4.671.882,37	0,00	1.500.000,00	3.189.054,98	17.172,61	0,37%	0,39%	0,25%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	11.258.868,09	1.050.000,00	0,00	12.350.137,50	41.269,41	0,34%	0,37%	0,81%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	164.929,75	0,00	0,00	165.171,42	241,67	0,15%	0,15%	0,03%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.225.719,90	0,00	4.230.383,26	0,00	4.663,36	0,11%	-	0,18%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	10.116.989,39	0,00	3.500.000,00	6.626.545,84	9.556,45	0,09%	0,10%	0,15%
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	507.408,79	2.000.000,00	901.688,43	1.607.379,64	1.659,28	0,07%	0,15%	0,00%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.910.742,57	2.392.651,91	3.162.262,58	3.144.201,05	3.069,15	0,05%	0,08%	0,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	10.765.217,26	0,00	0,00	10.751.791,16	-13.426,10	-0,12%	-0,12%	0,26%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	735.210,80	0,00	0,00	733.621,20	-1.589,60	-0,22%	-0,22%	1,42%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	26.814.693,31	4.294.000,41	0,00	30.962.157,03	-146.536,69	-0,47%	-0,56%	0,92%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	3.027.196,28	0,00	3.003.054,69	0,00	-24.141,59	-0,80%	-0,80%	1,03%
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	4.988.393,15	0,00	0,00	4.945.492,03	-42.901,12	-0,86%	-0,86%	1,05%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.159.151,25	0,00	0,00	13.042.199,27	-116.951,98	-0,89%	-0,89%	1,05%

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	5.392.509,62	2.000.000,00	0,00	7.279.198,13	-113.311,49	-1,53%	-1,85%	2,27%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	5.490.081,09	0,00	0,00	5.384.893,10	-105.187,99	-1,92%	-1,92%	2,30%
Total Renda Fixa	158.368.025,74	11.736.652,32	16.576.164,71	153.412.765,54	-115.747,81	-0,07%		0,87%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BRASIL AGRO II MULTIESTRATÉGIA FIP	3.146.996,36	0,00	0,00	3.144.038,04	-2.958,32	-0,09%	-0,09%	0,64%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	10.779.984,14	0,00	0,00	10.765.256,77	-14.727,37	-0,14%	-0,14%	1,46%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	2.617.702,86	0,00	0,00	2.612.569,83	-5.133,03	-0,20%	-0,20%	8,75%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	0,00	2.000.000,00	0,00	1.994.319,79	-5.680,21	-0,28%	-0,23%	2,59%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	6.059.621,82	0,00	0,00	6.033.979,81	-25.642,01	-0,42%	-0,42%	0,45%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3.124.156,77	0,00	0,00	3.110.649,02	-13.507,75	-0,43%	-0,43%	8,98%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	2.278.446,23	0,00	0,00	2.260.781,01	-17.665,22	-0,78%	-0,78%	2,84%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	2.985.014,00	0,00	0,00	2.950.837,88	-34.176,12	-1,14%	-1,14%	10,30%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GENESIS FIC AÇÕES	1.228.512,53	1.500.000,00	0,00	2.685.446,75	-43.065,78	-1,58%	-2,26%	9,13%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	1.965.449,16	1.500.000,00	0,00	3.381.942,14	-83.507,02	-2,41%	-3,45%	8,79%
GERAÇÃO FI AÇÕES	2.462.209,60	0,00	0,00	2.391.309,03	-70.900,57	-2,88%	-2,88%	9,81%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	9.018.894,45	0,00	0,00	8.698.378,58	-320.515,87	-3,55%	-3,55%	9,60%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	3.900.827,91	0,00	0,00	3.751.739,38	-149.088,53	-3,82%	-3,82%	9,12%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	3.183.444,13	0,00	0,00	3.058.495,23	-124.948,90	-3,92%	-3,92%	11,66%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	1.926.543,19	0,00	0,00	1.833.737,66	-92.805,53	-4,82%	-4,82%	8,78%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	2.881.403,73	0,00	0,00	2.701.636,81	-179.766,92	-6,24%	-6,24%	8,07%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.730.000,00	0,00	7.000,00	1.550.000,00	-173.000,00	-10,00%	-10,40%	11,49%
Total Renda Variável	59.289.206,88	5.000.000,00	7.000,00	62.925.117,73	-1.357.089,15	-2,11%		6,36%