

# CRÉDITO E MERCADO

*Engenharia Financeira*  
Relatório Analítico dos Investimentos

em setembro e 3º trimestre de 2020

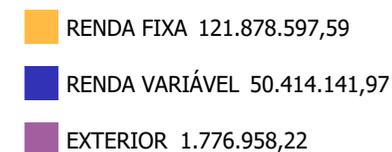
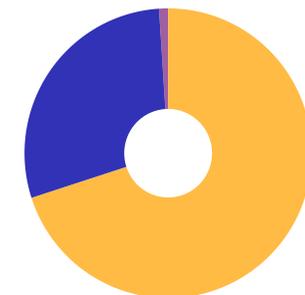
**Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2020)**

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	15.743.722,30	9,04%	868	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	10.467.316,21	6,01%	953	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	8.377.745,87	4,81%	676	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	4.018.529,54	2,31%	98	0,36%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.320.339,96	0,76%	1.361	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	10.561.279,62	6,07%	982	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVID...	D+0	15/08/2024	3.176.340,28	1,82%	31	1,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	7.241.862,00	4,16%	130	0,74%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	20.018.815,03	11,50%	648	0,45%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	5.141.748,54	2,95%	137	0,32%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	8.907.051,06	5,12%	194	0,65%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA L...	D+1	Não há	5.962.712,50	3,43%	55	11,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	66.577,75	0,04%	301	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	17.429,46	0,01%	755	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	11.156.716,79	6,41%	290	0,23%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	4.942.203,33	2,84%	53	5,95%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BBIF MASTER FIDC LP	Não se ...	27 meses	216.147,96	0,12%	13	0,93%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	4.542.059,39	2,61%	33	2,92%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	D+3 du	Não há	2.360.182,68	1,36%	156	2,58%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	2.338.371,88	1,34%	46.574	0,06%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '



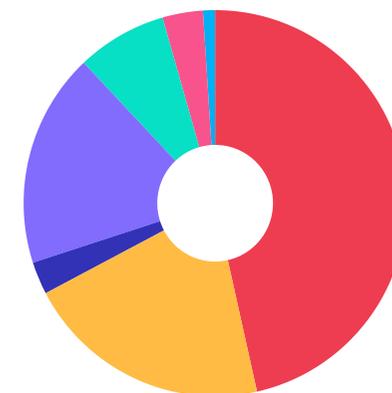
Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Setembro / 2020)

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nivel 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	17.406.969,78
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	80.925.950,81	46,49%	15,00%	36,00%	76,00%	51.367.019,50
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	70,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	104.441.818,67
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	50,00%	36.194.439,43	20,79%	10,00%	20,00%	40,00%	33.433.439,68
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	26.110.454,67
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	10,00%	4.758.207,35	2,73%	0,00%	4,00%	5,00%	3.945.277,54
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	8.703.484,89
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	8.703.484,89
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>121.878.597,59</b>	<b>70,02%</b>	<b>25,00%</b>	<b>60,00%</b>	<b>216,00%</b>	



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

Artigos - Renda Variável	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	17.406.969,78
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	17.406.969,78
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	30,00%	31.236.346,35	17,94%	7,00%	25,00%	30,00%	20.984.562,98
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	13.236.088,74	7,60%	7,00%	8,00%	10,00%	4.170.881,04
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	5.941.706,88	3,41%	0,00%	5,00%	5,00%	2.761.778,01
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	8.703.484,89
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	8.703.484,89
<b>Total Renda Variável</b>	<b>40,00%</b>	<b>50.414.141,97</b>	<b>28,96%</b>	<b>14,00%</b>	<b>40,00%</b>	<b>75,00%</b>	



Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2020			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	8.703.484,89
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	17.406.969,78
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	1.776.958,22	1,02%	0,00%	0,00%	5,00%	6.926.526,67
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>1.776.958,22</b>	<b>1,02%</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>20,00%</b>	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	44.484.751,56	25,56	0,01
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	33.916.252,73	19,48	0,00
ITAÚ UNIBANCO	18.636.837,21	10,71	0,00
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	16.148.913,06	9,28	0,00
INFINITY ASSET MANAGEMENT	10.904.915,83	6,26	2,15
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	8.485.391,97	4,87	0,01
BANCO J. SAFRA S/A	7.422.595,60	4,26	0,00
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	5.283.465,18	3,04	0,10
AURORA CAPITAL	4.542.059,39	2,61	5,71
VINCI PARTNERS	3.402.351,61	1,95	0,00
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	3.394.966,02	1,95	0,23
HIX CAPITAL	3.318.278,34	1,91	0,12
A5 CAPITAL PARTNERS	3.120.817,91	1,79	-
PERFIN INVESTIMENTOS	2.838.117,09	1,63	0,04
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	2.820.888,97	1,62	0,00
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	2.772.764,67	1,59	0,00
FINACAP CONSULTORIA FINANCEIRA	2.360.182,68	1,36	0,66
BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUT...	216.147,96	0,12	0,00

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2020		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	80.925.950,81	46,49	15,00	76,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	36.194.439,43	20,79	10,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	4.758.207,35	2,73	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	31.236.346,35	17,94	7,00	30,00
Artigo 8º, Inciso III	13.236.088,74	7,60	7,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5.941.706,88	3,41	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso I	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º - A, Inciso III	1.776.958,22	1,02	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
<b>IDKA PRÉ 2 ANOS (Benchmark)</b>	-0,47%	6,67%	0,06%	3,38%	8,65%	26,43%	-	-
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	-0,55%	6,45%	-0,05%	3,09%	8,31%	25,84%	0,02%	0,03%
<b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>	0,02%	5,41%	1,99%	5,41%	8,00%	21,88%	-	-
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%
<b>IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)</b>	1,21%	6,59%	3,03%	4,28%	10,35%	21,46%	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	-0,13%	-23,17%	-8,97%	-11,38%	-22,54%	-23,26%	-	0,04%
<b>IMA-B 5+ (Benchmark)</b>	-2,60%	-4,56%	0,75%	6,78%	-1,67%	42,42%	-	-
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	-5,98%	-2,36%	-1,43%	4,25%	-1,08%	11,81%	0,11%	0,11%
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	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%
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	-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%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	-0,15%	4,30%	1,18%	4,93%	6,95%	23,16%	0,02%	0,04%
<b>IMA-B (Benchmark)</b>	-1,51%	-0,72%	0,96%	5,97%	2,11%	34,14%	-	-

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
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%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	-2,12%	-0,22%	0,45%	5,97%	2,89%	38,19%	0,05%	0,11%

<b>CDI (Benchmark)</b>	0,16%	2,28%	0,51%	1,25%	3,54%	10,04%	-	-
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	-6,74%	-2,61%	-3,79%	-1,78%	-1,54%	5,39%	0,12%	0,08%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00%	1,42%	0,18%	0,66%	2,40%	7,66%	0,00%	0,00%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,09%	1,64%	0,29%	0,83%	2,68%	8,21%	0,00%	0,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	-0,09%	3,31%	0,42%	1,62%	-	-	0,00%	-

<b>IPCA (Benchmark)</b>	0,64%	1,34%	1,24%	0,81%	3,14%	6,12%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,14%	5,03%	1,45%	5,75%	7,75%	29,23%	0,02%	0,04%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,23%	2,47%	0,20%	1,32%	3,69%	17,87%	0,00%	0,01%
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%

<b>Não Possui (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
BBIF MASTER FIDC LP	-0,46%	10,40%	14,26%	12,14%	8,68%	-21,54%	0,00%	0,16%

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
<b>IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)</b>	1,48%	9,18%	3,89%	5,97%	13,96%	29,52%	-	-
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	-	-

<b>S&amp;P 500 (Benchmark)</b>	-3,92%	4,09%	8,47%	30,12%	12,98%	15,41%	-	-
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	-4,80%	1,10%	7,41%	27,36%	9,96%	16,39%	0,11%	0,24%

<b>IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)</b>	1,29%	7,33%	3,27%	4,76%	11,39%	23,74%	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	-	-	-	-	-	-	-	-

<b>Ibovespa (Benchmark)</b>	-4,80%	-18,20%	-0,48%	29,56%	-9,68%	19,23%	-	-
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-6,35%	-13,53%	-0,63%	33,12%	-0,36%	42,91%	0,07%	0,43%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	-2,86%	-11,83%	2,68%	34,85%	7,05%	32,75%	0,09%	0,39%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-2,97%	-4,02%	4,71%	48,34%	5,55%	60,69%	0,11%	0,43%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	-4,50%	-20,92%	-2,89%	20,13%	-6,28%	46,96%	0,09%	0,40%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	-4,54%	-16,33%	-0,64%	28,99%	-7,90%	38,38%	0,11%	0,38%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-4,77%	-19,95%	-2,30%	22,29%	-9,26%	41,30%	0,10%	0,36%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-4,96%	-20,69%	2,00%	30,39%	-10,53%	31,29%	0,11%	0,41%

<b>CDI (Benchmark)</b>	0,16%	2,28%	0,51%	1,25%	3,54%	10,04%	-	-
DAYCOVAL MULTISTRATÉGIA FI MULTIMERCADO	-0,21%	3,35%	0,41%	2,00%	4,59%	14,40%	0,01%	0,01%

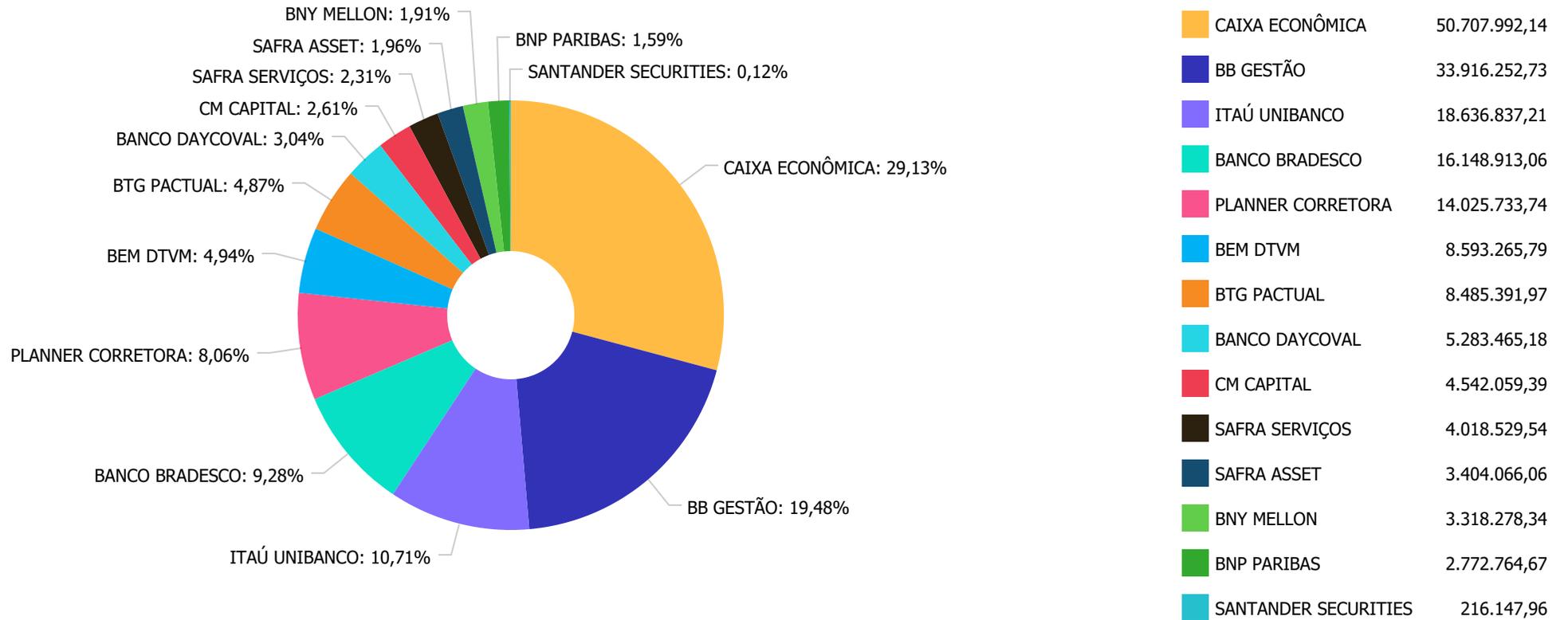
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	-0,91%	-0,69%	0,35%	5,77%	3,05%	22,65%	0,02%	0,07%
<b>Não Informado (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	-2,90%	-15,40%	0,62%	29,23%	-0,02%	56,46%	0,10%	0,41%
HIX CAPITAL INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-7,10%	-11,77%	-2,40%	28,93%	10,35%	69,11%	0,09%	0,41%

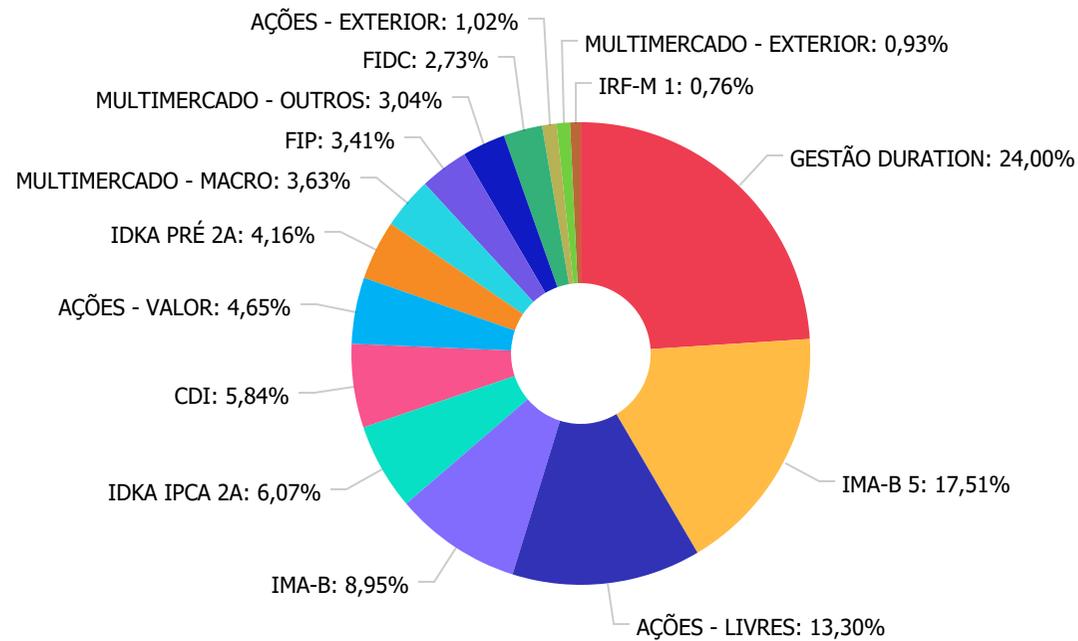
## Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2020 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	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%	-	-
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-2,53%	42,55%	15,35%	40,62%	48,85%	70,31%	0,14%	0,24%

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



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

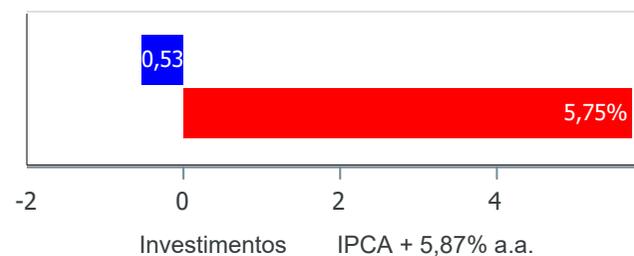


GESTÃO DURATION	41.770.202,65
IMA-B 5	30.486.131,24
AÇÕES - LIVRES	23.147.889,97
IMA-B	15.572.615,69
IDKA IPCA 2A	10.561.279,62
CDI	10.167.959,08
AÇÕES - VALOR	8.088.456,38
IDKA PRÉ 2A	7.241.862,00
MULTIMERCADO - MACRO	6.325.515,72
FIP	5.941.706,88
MULTIMERCADO - OUTROS	5.283.465,18
FIDC	4.758.207,35
AÇÕES - EXTERIOR	1.776.958,22
MULTIMERCADO - EXTERIOR	1.627.107,84
IRF-M 1	1.320.339,96

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	168.063.014,95	10.523.656,72	7.824.494,51	171.695.160,54	932.983,38	932.983,38	0,55%	0,55%	0,71%	0,71%	76,92%	2,67%
Fevereiro	171.695.160,54	6.072.870,73	4.082.600,70	171.902.257,18	-1.783.173,39	-850.190,01	-1,03%	-0,49%	0,66%	1,37%	-35,36%	4,00%
Março	171.902.257,18	2.888.077,90	2.551.605,84	159.778.288,70	-12.460.440,54	-13.310.630,55	-7,23%	-7,69%	0,57%	1,95%	-393,78%	15,29%
Abril	159.778.288,70	1.501.897,76	1.966.560,19	163.111.424,62	3.797.798,35	-9.512.832,20	2,38%	-5,49%	0,14%	2,10%	-261,88%	7,18%
Mai	163.111.424,62	28.923.727,91	29.692.505,52	166.276.442,37	3.933.795,36	-5.579.036,84	2,41%	-3,21%	0,07%	2,17%	-147,98%	4,07%
Junho	166.276.442,37	2.201.489,30	2.009.427,85	170.153.841,18	3.685.337,36	-1.893.699,48	2,21%	-1,07%	0,74%	2,92%	-36,56%	3,31%
Julho	170.153.841,18	6.250.386,86	4.388.633,74	176.466.672,02	4.451.077,72	2.557.378,24	2,59%	1,49%	0,88%	3,83%	38,89%	3,07%
Agosto	176.466.672,02	7.642.715,60	6.857.615,80	176.577.511,68	-674.260,14	1.883.118,10	-0,38%	1,10%	0,72%	4,58%	24,13%	2,64%
Setembro	176.577.511,68	9.825.291,85	9.467.688,37	174.069.697,78	-2.865.417,38	-982.299,28	-1,62%	-0,53%	1,12%	5,75%	-9,26%	4,21%

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...	1.168.781,61	150.000,00	0,00	1.320.339,96	1.558,35	0,12%	0,13%	0,12%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	31.090,21	17.294,86	30.961,21	17.429,46	5,60	0,01%	0,00%	0,03%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	66.991,11	4.870.144,37	4.870.821,71	66.577,75	263,98	0,01%	0,09%	0,00%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	10.287.039,26	4.765.219,38	4.485.905,45	10.561.279,62	-5.073,57	-0,03%	0,04%	1,38%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	5.146.379,02	0,00	0,00	5.141.748,54	-4.630,48	-0,09%	-0,09%	0,40%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	4.547.842,17	0,00	0,00	4.542.059,39	-5.782,78	-0,13%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDEN...	3.180.675,54	0,00	0,00	3.176.340,28	-4.335,26	-0,14%	-0,14%	1,59%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	20.049.620,00	0,00	0,00	20.018.815,03	-30.804,97	-0,15%	-0,15%	1,65%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	10.541.801,57	22.633,24	80.000,00	10.467.316,21	-17.118,60	-0,16%	-0,16%	1,65%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	11.182.352,32	0,00	0,00	11.156.716,79	-25.635,53	-0,23%	-0,23%	0,49%
BBIF MASTER FIDC LP	217.140,05	0,00	0,00	216.147,96	-992,09	-0,46%	-0,46%	0,01%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	15.823.338,81	0,00	0,00	15.743.722,30	-79.616,51	-0,50%	-0,50%	1,68%
BRASESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	7.281.939,72	0,00	0,00	7.241.862,00	-40.077,72	-0,55%	-0,55%	1,76%
BRASESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	8.995.497,23	0,00	0,00	8.907.051,06	-88.446,17	-0,98%	-0,98%	2,28%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	8.510.116,06	0,00	0,00	8.377.745,87	-132.370,19	-1,56%	-1,56%	4,15%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	4.105.359,44	0,00	0,00	4.018.529,54	-86.829,90	-2,12%	-2,12%	5,20%
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	6.341.719,76	0,00	0,00	5.962.712,50	-379.007,26	-5,98%	-5,98%	11,03%
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	5.299.302,87	0,00	0,00	4.942.203,33	-357.099,54	-6,74%	-6,74%	12,22%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>122.776.986,75</b>	<b>9.825.291,85</b>	<b>9.467.688,37</b>	<b>121.878.597,59</b>	<b>-1.255.992,64</b>	<b>-1,02%</b>		<b>2,72%</b>

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
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	2.820.511,24	0,00	0,00	2.820.888,97	377,73	0,01%	-	-
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	3.126.347,20	0,00	0,00	3.120.817,91	-5.529,29	-0,18%	-	-
DAYCOVAL MULTISTRATÉGIA FI MULTIMERCADO	5.294.619,51	0,00	0,00	5.283.465,18	-11.154,33	-0,21%	-0,21%	0,64%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	6.383.565,89	0,00	0,00	6.325.515,72	-58.050,17	-0,91%	-0,91%	1,88%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	2.429.718,08	0,00	0,00	2.360.182,68	-69.535,40	-2,86%	-2,86%	8,94%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	3.503.810,94	0,00	0,00	3.402.351,61	-101.459,33	-2,90%	-2,90%	10,44%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8.744.710,79	0,00	0,00	8.485.391,97	-259.318,82	-2,97%	-2,97%	11,45%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	3.555.073,65	0,00	0,00	3.394.966,02	-160.107,63	-4,50%	-4,50%	8,90%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	2.904.744,99	0,00	0,00	2.772.764,67	-131.980,32	-4,54%	-4,54%	10,52%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	2.442.437,02	0,00	0,00	2.325.922,09	-116.514,93	-4,77%	-4,77%	9,73%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	1.709.074,86	0,00	0,00	1.627.107,84	-81.967,02	-4,80%	-4,80%	10,72%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	2.460.439,87	0,00	0,00	2.338.371,88	-122.067,99	-4,96%	-4,96%	10,80%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3.030.496,13	0,00	0,00	2.838.117,09	-192.379,04	-6,35%	-6,35%	7,47%
HIX CAPITAL INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3.571.820,31	0,00	0,00	3.318.278,34	-253.541,97	-7,10%	-7,10%	8,87%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>51.977.370,48</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>50.414.141,97</b>	<b>-1.563.228,51</b>	<b>-3,01%</b>		<b>7,74%</b>

# CRÉDITO E MERCADO

Engenharia Financeira

INSTITUTO MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DE ITAÚNA - IMP  
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
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.823.154,45	0,00	0,00	1.776.958,22	-46.196,23	-2,53%	-2,53%	13,89%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>1.823.154,45</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>1.776.958,22</b>	<b>-46.196,23</b>	<b>-2,53%</b>		<b>13,89%</b>

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
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	19.737.881,50	78.681,53	31.000,00	20.018.815,03	233.252,00	1,18%	1,18%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	6.715.759,55	10.351.984,39	6.630.905,45	10.561.279,62	124.441,13	0,73%	1,66%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	10.088.771,01	497.428,85	240.000,00	10.467.316,21	121.116,35	1,14%	1,21%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	8.308.393,72	0,00	0,00	8.377.745,87	69.352,15	0,83%	0,83%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDEN...	3.208.610,37	0,00	78.681,53	3.176.340,28	46.411,44	1,45%	1,45%
BBIF MASTER FIDC LP	189.171,24	0,00	0,00	216.147,96	26.976,72	14,26%	14,26%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	11.134.907,84	0,00	0,00	11.156.716,79	21.808,95	0,20%	0,20%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	5.120.356,74	0,00	0,00	5.141.748,54	21.391,80	0,42%	0,42%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	4.989.413,00	0,00	466.765,01	4.542.059,39	19.411,40	0,39%	-8,97%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	4.000.401,83	0,00	0,00	4.018.529,54	18.127,71	0,45%	0,45%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.164.847,25	150.000,00	0,00	1.320.339,96	5.492,71	0,42%	0,47%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	257.439,00	9.964.544,22	10.156.085,38	66.577,75	679,91	0,01%	0,29%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	22.607,88	175.755,32	180.971,41	17.429,46	37,67	0,02%	0,18%
BRANCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	7.245.581,36	0,00	0,00	7.241.862,00	-3.719,36	-0,05%	-0,05%
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	8.921.072,18	0,00	0,00	8.907.051,06	-14.021,12	-0,16%	-0,16%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	15.757.990,68	0,00	0,00	15.743.722,30	-14.268,38	-0,09%	-0,09%
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	6.049.436,17	0,00	0,00	5.962.712,50	-86.723,67	-1,43%	-1,43%
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	5.136.971,46	0,00	0,00	4.942.203,33	-194.768,13	-3,79%	-3,79%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>394.999,28</b>	<b>0,33%</b>	

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
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8.103.881,15	0,00	0,00	8.485.391,97	381.510,82	4,71%	4,71%
FRANKLIN TEMPLETON VALOR E FVL FI AÇÕES	2.810.727,39	0,00	2.929.529,13	0,00	118.801,74	4,23%	-0,25%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	1.514.795,70	0,00	0,00	1.627.107,84	112.312,14	7,41%	7,41%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	2.292.478,86	0,00	0,00	2.338.371,88	45.893,02	2,00%	2,00%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	6.303.671,78	0,00	0,00	6.325.515,72	21.843,94	0,35%	0,35%
DAYCOVAL MULTISTRATÉGIA FI MULTIMERCADO	5.261.845,48	0,00	0,00	5.283.465,18	21.619,70	0,41%	0,41%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	3.381.407,12	0,00	0,00	3.402.351,61	20.944,49	0,62%	0,62%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	2.832.489,85	0,00	0,00	2.820.888,97	-11.600,88	-0,41%	-
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	2.790.625,09	0,00	0,00	2.772.764,67	-17.860,42	-0,64%	-0,64%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.856.014,47	0,00	0,00	2.838.117,09	-17.897,38	-0,63%	-0,63%
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	3.139.264,46	0,00	0,00	3.120.817,91	-18.446,55	-0,59%	-
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	2.380.623,17	0,00	0,00	2.325.922,09	-54.701,08	-2,30%	-2,30%
HIX CAPITAL INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3.399.887,86	0,00	0,00	3.318.278,34	-81.609,52	-2,40%	-2,40%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	3.495.977,36	0,00	0,00	3.394.966,02	-101.011,34	-2,89%	-2,89%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	0,00	2.500.000,00	0,00	2.360.182,68	-139.817,32	-5,59%	2,68%
				<b>Total Renda Variável</b>	<b>279.981,36</b>	<b>0,53%</b>	

## 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
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.540.538,66	0,00	0,00	1.776.958,22	236.419,56	15,35%	15,35%
				<b>Total Exterior</b>	<b>236.419,56</b>	<b>15,35%</b>	