

CRÉDITO E MERCADO

Engenharia Financeira
Relatório Analítico dos Investimentos

em outubro de 2020

Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 2020)

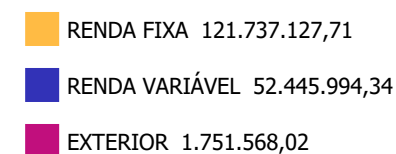
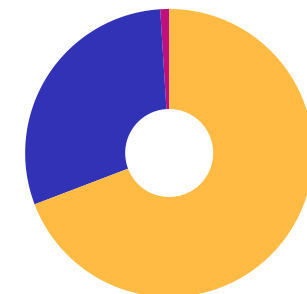
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	8.394.150,04	4,77%	675	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	4.007.093,24	2,28%	97	0,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	320.570,85	0,18%	1.366	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVID...	D+0	15/08/2024	3.184.747,31	1,81%	31	1,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	13.925.515,52	7,92%	988	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRDESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	7.188.112,71	4,09%	126	0,72%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	10.406.389,01	5,91%	954	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	17.542.999,48	9,97%	653	0,40%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	15.726.748,76	8,94%	874	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	8.882.295,38	5,05%	193	0,66%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA L...	D+1	Não há	5.998.161,24	3,41%	55	11,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	21.901,90	0,01%	762	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	76.687,70	0,04%	297	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	11.165.374,62	6,35%	276	0,24%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	4.979.461,23	2,83%	53	5,95%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	5.155.321,92	2,93%	135	0,32%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	4.546.426,19	2,58%	33	2,92%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
BBIF MASTER FIDC LP	Não se ...	27 meses	215.170,61	0,12%	13	0,93%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	2.350.015,04	1,34%	45.375	0,06%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	3.341.620,80	1,90%	115	0,46%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	2.377.652,21	1,35%	1.678	0,27%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	3.337.834,28	1,90%	7.630	0,32%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	2.787.894,99	1,58%	3.192	0,62%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	8.338.562,34	4,74%	6.399	0,37%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
HIX CAPITAL INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+63	Não há	3.308.379,18	1,88%	2.353	1,10%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	2.737.109,38	1,56%	1.545	1,05%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+32	Não há	2.399.426,85	1,36%	6	1,03%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	D+3 du	Não há	2.376.443,79	1,35%	157	2,47%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	6.304.061,65	3,58%	19.825	0,13%	Artigo 8º, Inciso III
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	D+2	Não há	1.589.765,14	0,90%	75	0,28%	Artigo 8º, Inciso III
DAYCOVAL MULTIESTRATÉGIA FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	5.262.168,32	2,99%	1.771	2,37%	Artigo 8º, Inciso III
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	Não se ...	Não se aplica	2.819.751,84	1,60%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	3.115.308,53	1,77%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	1.751.568,02	1,00%	598	0,10%	Artigo 9º - A, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			175.934.690,07				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Outubro / 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%	17.593.469,01
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	80.696.326,92	45,87%	15,00%	36,00%	76,00%	53.014.037,53
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	70,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	105.560.814,04
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	50,00%	36.279.203,99	20,62%	10,00%	20,00%	40,00%	34.094.672,04
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	26.390.203,51
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	10,00%	4.761.596,80	2,71%	0,00%	4,00%	5,00%	4.035.137,70
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	8.796.734,50
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	8.796.734,50
Total Renda Fixa	100,00%	121.737.127,71	69,19%	25,00%	60,00%	216,00%	



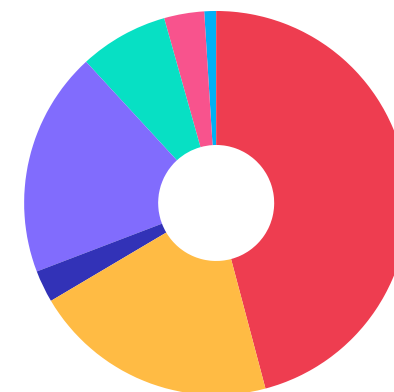
ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.695/18 em seus Artigo 7º § 10º e Artigo 8º § 10º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!



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

Artigos - Renda Variável	Resolução Pró Gestão - Nivel 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%	17.593.469,01
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	17.593.469,01
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	30,00%	33.354.938,86	18,96%	7,00%	25,00%	30,00%	19.425.468,16
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	13.155.995,11	7,48%	7,00%	8,00%	10,00%	4.437.473,90
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	5.935.060,37	3,37%	0,00%	5,00%	5,00%	2.861.674,13
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	8.796.734,50
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	8.796.734,50
Total Renda Variável	40,00%	52.445.994,34	29,81%	14,00%	40,00%	75,00%	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nivel 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%	8.796.734,50
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	17.593.469,01
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	1.751.568,02	1,00%	0,00%	0,00%	5,00%	7.045.166,48
Total Exterior	10,00%	1.751.568,02	1,00%	0,00%	0,00%	20,00%	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	46.759.973,49	26,58	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	31.521.450,94	17,92	-
ITAÚ UNIBANCO	18.670.711,58	10,61	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	16.070.408,09	9,13	-
INFINITY ASSET MANAGEMENT	10.977.622,47	6,24	-
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	8.338.562,34	4,74	-
BANCO J. SAFRA S/A	7.348.426,40	4,18	-
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	5.262.168,32	2,99	-
AURORA CAPITAL	4.546.426,19	2,58	-
VINCI PARTNERS	3.341.620,80	1,90	-
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	3.337.834,28	1,90	-
HIX CAPITAL	3.308.379,18	1,88	-
A5 CAPITAL PARTNERS	3.115.308,53	1,77	-
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	2.819.751,84	1,60	-
PERFIN INVESTIMENTOS	2.787.894,99	1,58	-
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	2.737.109,38	1,56	-
TRÍGONO CAPITAL	2.399.426,85	1,36	-
FINACAP CONSULTORIA FINANCEIRA	2.376.443,79	1,35	-
BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUT...	215.170,61	0,12	-

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 '	80.696.326,92	45,87	15,00	76,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	36.279.203,99	20,62	10,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	4.761.596,80	2,71	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 '	33.354.938,86	18,96	7,00	30,00
Artigo 8º, Inciso III	13.155.995,11	7,48	7,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5.935.060,37	3,37	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	1.751.568,02	1,00	0,00	5,00

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA PRÉ 2 ANOS (Benchmark)	-0,71%	5,91%	-1,53%	1,34%	6,18%	21,62%	-	-
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	-0,74%	5,66%	-1,68%	1,11%	5,80%	20,99%	0,02%	0,03%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,04%	5,45%	1,09%	4,85%	6,73%	19,60%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,15%	5,00%	0,98%	4,98%	6,16%	18,25%	0,01%	0,03%
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	1,43%	8,12%	3,48%	5,53%	11,13%	21,93%	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	0,10%	-23,10%	-0,14%	-8,39%	-23,00%	-29,74%	-	0,03%
IMA-B 5+ (Benchmark)	0,22%	-4,35%	-5,92%	4,90%	-5,85%	28,98%	-	-
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	0,60%	-1,78%	-4,16%	2,13%	-2,25%	8,12%	0,01%	0,11%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,16%	3,29%	0,43%	1,38%	4,06%	11,49%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,14%	3,12%	0,37%	1,27%	3,86%	11,05%	0,00%	0,01%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,20%	4,72%	0,50%	4,81%	5,71%	20,28%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,18%	4,48%	0,41%	4,66%	5,38%	19,69%	0,01%	0,03%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,19%	4,50%	0,40%	4,62%	5,42%	19,71%	0,01%	0,03%
IMA-B (Benchmark)	0,21%	-0,51%	-3,08%	4,81%	-1,00%	25,47%	-	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,20%	-0,73%	-3,19%	4,62%	-1,29%	24,83%	0,02%	0,10%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	-0,29%	-0,51%	-4,40%	3,86%	-0,87%	27,42%	0,03%	0,10%

CDI (Benchmark)	0,16%	2,44%	0,47%	1,12%	3,21%	9,62%	-	-
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	0,75%	-1,87%	-5,11%	-1,97%	-1,60%	5,31%	0,00%	0,08%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,06%	1,48%	0,13%	0,52%	2,07%	7,24%	0,00%	0,00%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,09%	1,73%	0,27%	0,70%	2,36%	7,80%	0,00%	0,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	0,26%	3,58%	0,30%	1,46%	4,71%	-	0,00%	0,01%

IPCA (Benchmark)	0,86%	2,22%	1,75%	1,99%	3,92%	6,55%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,27%	5,31%	0,59%	5,46%	6,03%	23,67%	0,01%	0,04%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,08%	2,55%	-0,28%	1,26%	3,26%	17,36%	0,00%	0,01%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	-0,11%	4,42%	-1,16%	1,94%	4,51%	23,65%	0,01%	0,02%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,28%	1,34%	-2,11%	1,64%	1,24%	16,26%	0,02%	0,04%

Não Possui (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BBIF MASTER FIDC LP	-0,45%	9,90%	-1,50%	12,37%	8,73%	-21,62%	0,00%	0,16%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	1,70%	11,04%	4,32%	7,26%	14,74%	30,00%	-	-
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	-	-
S&P 500 (Benchmark)	-2,77%	1,21%	-0,04%	12,28%	7,65%	20,59%	-	-
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	-2,30%	-1,22%	-0,60%	11,39%	5,21%	21,82%	0,09%	0,25%
IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	1,51%	8,95%	3,73%	6,03%	12,16%	24,21%	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	-	-	-	-	-	-	-	-
Ibovespa (Benchmark)	-0,69%	-18,76%	-8,71%	16,70%	-12,37%	7,47%	-	-
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-1,77%	-15,06%	-9,90%	14,82%	-5,18%	26,27%	0,07%	0,43%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	0,69%	-11,22%	-5,34%	22,10%	5,34%	22,83%	0,10%	0,39%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-1,73%	-5,68%	-5,06%	25,13%	1,35%	39,74%	0,09%	0,43%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	-1,68%	-22,25%	-11,97%	8,45%	-9,43%	24,35%	0,10%	0,40%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	-1,29%	-17,41%	-8,96%	14,80%	-11,41%	24,55%	0,12%	0,38%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	2,22%	-18,17%	-6,11%	15,33%	-8,40%	20,65%	0,12%	0,36%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	0,50%	-20,29%	-4,68%	18,03%	-12,18%	19,23%	0,11%	0,41%
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,05%	-	-3,66%	-	-	-	0,13%	-
CDI (Benchmark)	0,16%	2,44%	0,47%	1,12%	3,21%	9,62%	-	-

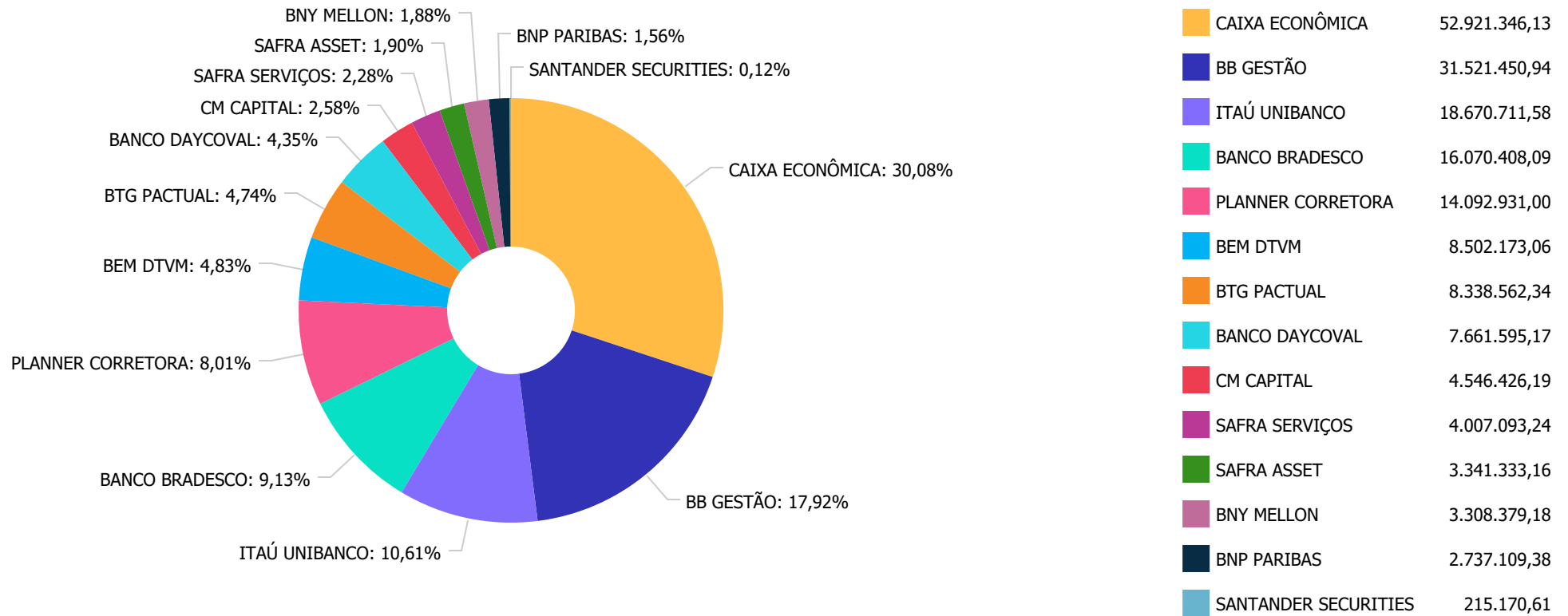
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Outubro/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
DAYCOVAL MULTISTRATÉGIA FI MULTIMERCADO	-0,40%	2,93%	-0,48%	1,04%	3,64%	12,43%	0,01%	0,01%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	-0,34%	-1,03%	-1,38%	2,71%	1,82%	18,95%	0,02%	0,07%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	-1,79%	-16,91%	-9,22%	15,64%	-4,71%	39,27%	0,10%	0,41%
HIX CAPITAL INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-0,30%	-12,04%	-7,32%	11,76%	6,56%	55,77%	0,08%	0,41%

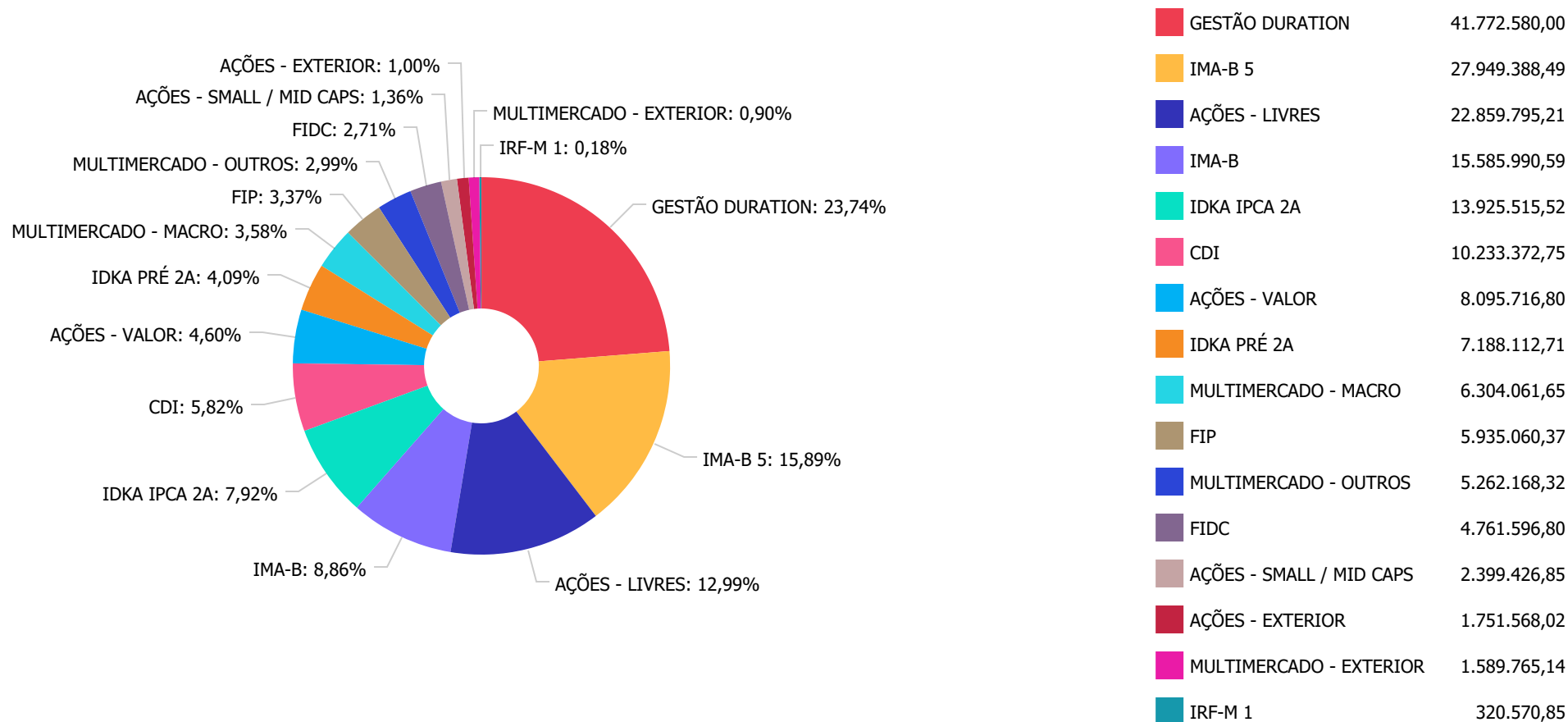
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Outubro/2020 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	-1,75%	48,79%	10,39%	20,81%	59,76%	95,14%	-	-
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-1,43%	40,52%	11,44%	18,54%	47,89%	88,35%	0,11%	0,24%

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



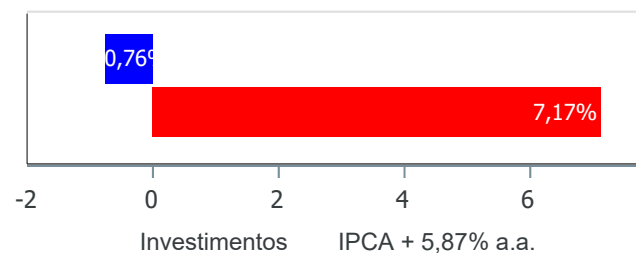
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Outubro / 2020)



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	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%
Outubro	174.069.697,78	10.971.423,76	8.710.757,57	175.934.690,07	-395.673,90	-1.377.973,18	-0,22%	-0,76%	1,34%	7,17%	-10,54%	3,19%

Investimentos x Meta Atuarial



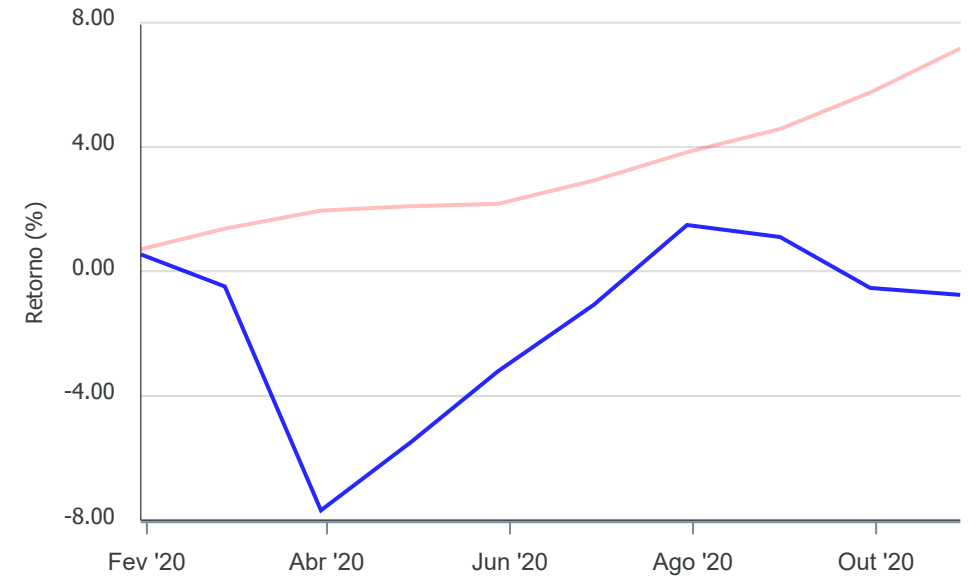
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Outubro/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	4.942.203,33	0,00	0,00	4.979.461,23	37.257,90	0,75%	0,75%	0,28%
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	5.962.712,50	0,00	0,00	5.998.161,24	35.448,74	0,59%	0,59%	1,02%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDEN...	3.176.340,28	0,00	0,00	3.184.747,31	8.407,03	0,26%	0,26%	1,06%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	5.141.748,54	0,00	0,00	5.155.321,92	13.573,38	0,26%	0,26%	0,35%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	20.018.815,03	0,00	2.520.000,00	17.542.999,48	44.184,45	0,22%	0,19%	1,12%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	8.377.745,87	0,00	0,00	8.394.150,04	16.404,17	0,20%	0,20%	2,26%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	10.467.316,21	1.671.961,14	1.751.961,14	10.406.389,01	19.072,80	0,16%	0,18%	1,10%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	10.561.279,62	3.346.284,38	0,00	13.925.515,52	17.951,52	0,13%	0,15%	1,15%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	4.542.059,39	0,00	0,00	4.546.426,19	4.366,80	0,10%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	11.156.716,79	0,00	0,00	11.165.374,62	8.657,83	0,08%	0,08%	0,34%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.320.339,96	0,00	1.000.000,00	320.570,85	230,89	0,02%	0,14%	0,24%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	66.577,75	3.417.943,62	3.408.036,56	76.687,70	202,89	0,01%	0,09%	0,00%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	17.429,46	35.234,62	30.759,87	21.901,90	-2,31	0,00%	0,06%	0,24%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	15.743.722,30	0,00	0,00	15.726.748,76	-16.973,54	-0,11%	-0,11%	1,18%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	8.907.051,06	0,00	0,00	8.882.295,38	-24.755,68	-0,28%	-0,28%	1,64%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	4.018.529,54	0,00	0,00	4.007.093,24	-11.436,30	-0,28%	-0,28%	2,97%
BBIF MASTER FIDC LP	216.147,96	0,00	0,00	215.170,61	-977,35	-0,45%	-0,45%	0,04%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	7.241.862,00	0,00	0,00	7.188.112,71	-53.749,29	-0,74%	-0,74%	1,82%
Total Renda Fixa	121.878.597,59	8.471.423,76	8.710.757,57	121.737.127,71	97.863,93	0,08%		1,20%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	2.325.922,09	0,00	0,00	2.377.652,21	51.730,12	2,22%	2,22%	12,04%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	2.360.182,68	0,00	0,00	2.376.443,79	16.261,11	0,69%	0,69%	10,39%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	2.338.371,88	0,00	0,00	2.350.015,04	11.643,16	0,50%	0,50%	10,68%
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	2.820.888,97	0,00	0,00	2.819.751,84	-1.137,13	-0,04%	-	-
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	3.120.817,91	0,00	0,00	3.115.308,53	-5.509,38	-0,18%	-	-
HIX CAPITAL INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3.318.278,34	0,00	0,00	3.308.379,18	-9.899,16	-0,30%	-0,30%	8,42%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	6.325.515,72	0,00	0,00	6.304.061,65	-21.454,07	-0,34%	-0,34%	2,29%
DAYCOVAL MULTISTRATÉGIA FI MULTIMERCADO	5.283.465,18	0,00	0,00	5.262.168,32	-21.296,86	-0,40%	-0,40%	0,86%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	2.772.764,67	0,00	0,00	2.737.109,38	-35.655,29	-1,29%	-1,29%	11,53%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	3.394.966,02	0,00	0,00	3.337.834,28	-57.131,74	-1,68%	-1,68%	9,53%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8.485.391,97	0,00	0,00	8.338.562,34	-146.829,63	-1,73%	-1,73%	9,37%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.838.117,09	0,00	0,00	2.787.894,99	-50.222,10	-1,77%	-1,77%	7,38%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	3.402.351,61	0,00	0,00	3.341.620,80	-60.730,81	-1,78%	-1,78%	10,32%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	1.627.107,84	0,00	0,00	1.589.765,14	-37.342,70	-2,30%	-2,30%	9,29%
TRÍGONO FLAGSHIP INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	0,00	2.500.000,00	0,00	2.399.426,85	-100.573,15	-4,02%	0,05%	13,20%
Total Renda Variável	50.414.141,97	2.500.000,00	0,00	52.445.994,34	-468.147,63	-0,88%		7,92%

CRÉDITO E MERCADO

Engenharia Financeira

INSTITUTO MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DE ITAÚNA - IMP
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/10/2020

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de (Outubro / 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	1.776.958,22	0,00	0,00	1.751.568,02	-25.390,20	-1,43%	-1,43%	11,01%
Total Renda Variável	1.776.958,22	0,00	0,00	1.751.568,02	-25.390,20	-1,43%		11,01%