

Relatório Analítico dos Investimentos

em julho de 2020

Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	16/08/2020	2.539.044,00	0,84%	107	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	D+2	Não há	2.998.103,63	1,00%	23.039	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	49.463.441,73	16,45%	593	0,46%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	118.378,51	0,04%	885	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVID...	D+0	15/08/2024	28.724.951,20	9,55%	31	9,83%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVI...	D+2	Não há	13.702.245,72	4,56%	312	0,66%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENC...	D+0	16/05/2023	7.973.762,26	2,65%	51	2,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	38.582.688,07	12,83%	791	0,31%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	2.429.324,78	0,81%	34	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	23.070.978,30	7,67%	1.251	0,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	15/08/2022	6.091.730,43	2,03%	165	0,89%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	2.058.782,50	0,68%	114	0,21%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRABESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	530,27	0,00%	420	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRABESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	2.028.120,65	0,67%	47	0,73%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3 du	Não há	2.046.866,14	0,68%	263	0,17%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.130.549,34	0,71%	751	0,12%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	8.335.606,85	2,77%	275	0,55%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRABESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	4.402.637,14	1,46%	123	0,22%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.838,04	0,00%	319	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRABESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZ...	D+0	Não há	13.334.591,04	4,44%	1.578	1,77%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2020)

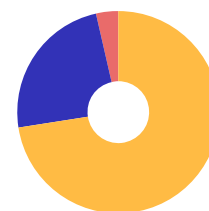
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	5.540.558,47	1,84%	178	0,45%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' '
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO...	D+30 ou...	Não há	2.543.391,68	0,85%	74	0,42%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b ' '
XP INVESTOR FI AÇÕES	D+4	Não há	1.921.539,03	0,64%	3.270	0,50%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' '
XP INVESTOR 30 FIC AÇÕES	D+33	Não há	2.597.320,30	0,86%	3.941	0,38%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' '
MOAT CAPITAL FIC AÇÕES	D+17	Não há	4.534.308,88	1,51%	3.130	0,19%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' '
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	8.731.354,67	2,90%	2.501	1,00%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' '
INDIE FIC AÇÕES	D+32	Não há	3.060.562,72	1,02%	19.725	0,32%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' '
BRADESCO VALUATION IBOVESPA FIC AÇÕES	D+4	Não há	3.258.282,85	1,08%	703	3,99%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' '
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	D+4	Não há	6.968.901,46	2,32%	2.060	0,33%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' '
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	6.325.307,14	2,10%	48.524	0,15%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' '
ALASKA BLACK INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+32	Não há	3.013.384,79	1,00%	124.983	0,13%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' '
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.729.209,16	0,58%	20.934	0,33%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' '
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	9.427.868,60	3,14%	3.633	0,55%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' '
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	7.144.868,09	2,38%	74	0,87%	Artigo 8º, Inciso III
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	3.391.839,68	1,13%	962	0,33%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MUL...	D+2	01/10/2020	7.064.370,51	2,35%	956	1,39%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	1.143.016,24	0,38%	19.189	0,02%	Artigo 8º, Inciso III
FP2 MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não há	1.535.969,39	0,51%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a ' '
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO...	D+5	Não há	10.694.264,03	3,56%	3.947	2,48%	Artigo 9º - A, Inciso II

Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
Total para cálculo dos limites da Resolução			300.661.488,29				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			709.081,46				Artigo 6º
		PL Total	301.370.569,75				

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

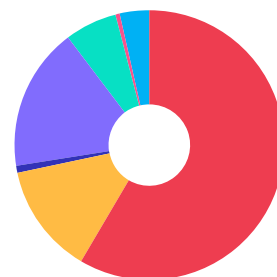
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	100,00%	300.661.488,29
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	175.694.648,63	58,44%	40,00%	50,00%	100,00%	124.966.839,66
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	300.661.488,29
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	15.033.074,41
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	180.396.892,97
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	180.396.892,97
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	40,00%	39.881.080,44	13,26%	0,00%	8,00%	40,00%	80.383.514,88
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'b'	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	120.264.595,32
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	60.132.297,66
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea 'a'	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	15,00%	45.099.223,24
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea 'b'	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	45.099.223,24
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	15.033.074,41
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b'	5,00%	2.543.391,68	0,85%	0,00%	2,00%	5,00%	12.489.682,73
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	15.033.074,41
Total Renda Fixa	100,00%	218.119.120,75	72,55%	40,00%	65,00%	570,00%	



REDA FIXA 218.119.120,75
REDA VARIÁVEL 71.848.103,51
EXTERIOR 10.694.264,03

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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'a'	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	30,00%	90.198.446,49
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'b'	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	90.198.446,49
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	51.568.039,60	17,15%	0,00%	15,00%	20,00%	8.564.258,06
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'b'	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	60.132.297,66
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	18.744.094,52	6,23%	0,00%	5,00%	10,00%	11.322.054,31
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	5,00%	1.535.969,39	0,51%	0,00%	1,00%	5,00%	13.497.105,02
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	15.033.074,41
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	15.033.074,41
Total Renda Variável	30,00%	71.848.103,51	23,90%	0,00%	30,00%	125,00%	



Artigos - Exterior	Resolução	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%	1,00%	5,00%	15.033.074,41
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	10.694.264,03	3,56%	0,00%	1,00%	5,00%	4.338.810,38
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	5,00%	15.033.074,41
Total Exterior	10,00%	10.694.264,03	3,56%	0,00%	5,00%	15,00%	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	145.931.111,32	48,54	0,01
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	65.208.179,62	21,69	0,01
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	35.533.621,88	11,82	0,00
XP VISTA ASSET MANAGEMENT	10.694.264,03	3,56	0,00
ITAÚ UNIBANCO	9.717.146,82	3,23	0,00
NAVI CAPITAL	9.427.868,60	3,14	0,57
MOAT CAPITAL	4.534.308,88	1,51	0,04
XP GESTÃO DE RECURSOS	4.518.859,33	1,50	0,00
INDIE CAPITAL	3.060.562,72	1,02	0,10
ALASKA ASSET MANAGEMENT	3.013.384,79	1,00	0,03
SUL AMERICA INVESTIMENTOS GEST...	2.998.103,63	1,00	0,01
BANCO J. SAFRA S/A	2.429.324,78	0,81	0,00
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	2.058.782,50	0,68	0,00
LAD CAPITAL	1.535.969,39	0,51	-

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 ' a '	0,00	0,00	0,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	175.694.648,63	58,44	40,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	100,00
Artigo 7º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	39.881.080,44	13,26	0,00	40,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	40,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	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 '	2.543.391,68	0,85	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	30,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	51.568.039,60	17,15	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	18.744.094,52	6,23	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	1.535.969,39	0,51	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	10.694.264,03	3,56	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso III	0,00	0,00	0,00	5,00

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA Geral ex-C (Benchmark)	1,66%	3,39%	3,57%	2,88%	7,07%	23,27%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,77%	3,55%	3,84%	3,05%	7,10%	23,78%	0,01%	0,04%

IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,94%	4,31%	3,72%	3,76%	8,68%	22,37%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,81%	3,71%	4,07%	3,32%	7,99%	20,62%	0,01%	0,03%

IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	0,90%	3,91%	1,73%	3,16%	8,47%	18,63%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,12%	5,19%	4,83%	4,50%	10,22%	30,34%	0,01%	0,04%

IMA-B 5+ (Benchmark)	7,32%	1,68%	11,51%	1,64%	7,81%	49,37%	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7,28%	1,51%	11,38%	1,46%	7,68%	48,58%	0,04%	0,16%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	7,33%	0,99%	11,39%	1,02%	6,98%	47,49%	0,04%	0,16%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA	4,81%	4,27%	8,73%	3,91%	10,28%	-	0,03%	0,11%

IRF-M 1 (Benchmark)	0,24%	2,84%	0,94%	2,39%	5,51%	13,20%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,23%	2,69%	0,88%	2,26%	5,22%	12,65%	0,00%	0,00%

IMA-B (Benchmark)	4,39%	2,65%	8,14%	2,38%	8,16%	37,86%	-	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4,39%	2,36%	8,15%	2,09%	7,74%	36,90%	0,02%	0,11%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	4,48%	2,70%	8,39%	2,42%	8,21%	37,96%	0,02%	0,11%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	4,24%	1,18%	8,01%	1,53%	7,14%	36,22%	0,02%	0,10%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,32%	1,97%	2,58%	1,77%	5,74%	18,19%	0,00%	0,02%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,07%	-1,89%	1,77%	-1,86%	-1,27%	2,34%	0,00%	0,04%

Selic (Benchmark)	0,19%	1,95%	0,64%	1,57%	4,21%	10,83%	-	-
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	0,18%	1,83%	0,60%	1,46%	4,02%	10,43%	0,00%	0,00%

CDI (Benchmark)	0,19%	1,95%	0,64%	1,57%	4,21%	10,83%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,10%	1,35%	0,39%	1,06%	3,13%	8,50%	0,00%	0,00%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,12%	1,46%	0,43%	1,15%	3,35%	8,99%	0,00%	0,00%
BRADESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,00%	0,51%	0,05%	0,36%	1,63%	5,35%	0,00%	0,00%

IPCA (Benchmark)	0,36%	0,46%	0,24%	0,25%	2,31%	5,60%	-	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,98%	3,69%	4,19%	2,83%	8,10%	22,05%	0,01%	0,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,12%	4,69%	4,84%	3,97%	9,53%	28,55%	0,01%	0,04%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,98%	5,65%	3,14%	4,79%	9,68%	28,24%	0,01%	0,03%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,54%	2,53%	1,36%	2,18%	6,41%	20,46%	0,00%	0,02%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,71%	3,52%	3,83%	3,08%	7,06%	23,05%	0,01%	0,04%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,92%	-	4,10%	-	-	-	0,01%	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
S&P 500 (Benchmark)	5,51%	1,25%	12,32%	1,41%	9,76%	16,15%	-	-
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	5,68%	-0,60%	12,54%	-0,96%	9,02%	19,43%	0,06%	0,24%
IBX (Benchmark)	8,41%	-10,43%	28,20%	-9,30%	2,17%	33,69%	-	-
INDIE FIC AÇÕES	8,13%	-4,68%	31,96%	-6,66%	19,94%	67,31%	0,09%	0,45%
Ibovespa (Benchmark)	8,27%	-11,01%	27,83%	-9,54%	1,08%	29,91%	-	-
XP INVESTOR FI AÇÕES	8,64%	-10,21%	30,36%	-12,98%	8,65%	46,69%	0,11%	0,47%
BRADESCO VALUATION IBOVESPA FIC AÇÕES	10,07%	-13,71%	27,66%	-14,75%	-0,71%	27,32%	0,10%	0,40%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8,78%	-6,42%	26,25%	-4,22%	10,38%	49,87%	0,11%	0,37%
XP INVESTOR 30 FIC AÇÕES	8,53%	-10,69%	29,59%	-13,51%	8,07%	43,99%	0,11%	0,47%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	0,06%	1,85%	0,43%	1,53%	4,66%	-	0,00%	0,01%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	7,54%	-16,38%	23,82%	-16,23%	-0,92%	38,66%	0,09%	0,41%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	9,22%	-6,80%	29,18%	-9,67%	9,15%	-	0,09%	0,42%
MOAT CAPITAL FIC AÇÕES	12,57%	-0,28%	42,56%	0,39%	16,41%	68,44%	0,09%	0,51%
CDI (Benchmark)	0,19%	1,95%	0,64%	1,57%	4,21%	10,83%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,41%	0,36%	4,15%	-0,32%	6,35%	24,98%	0,01%	0,07%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-

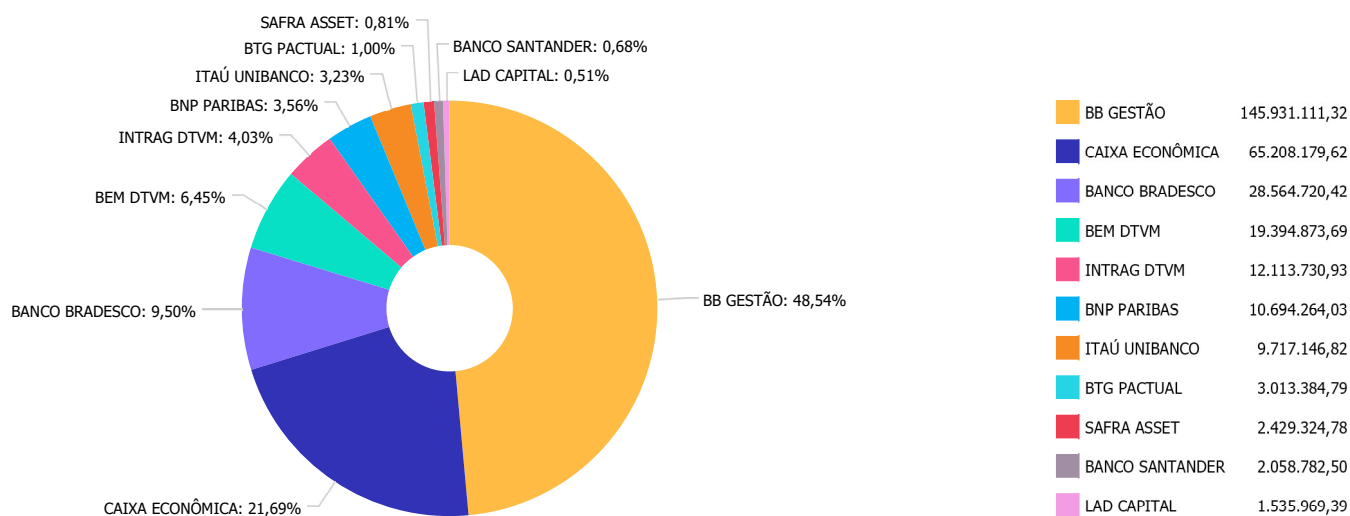
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
FP2 MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	-	-
ALASKA BLACK INSTITUCIONAL FI AÇÕES	11,35%	-7,56%	31,18%	-9,01%	7,88%	31,22%	0,14%	0,44%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	2,52%	0,86%	7,32%	0,59%	-	-	0,03%	-
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	8,23%	-8,64%	24,69%	-10,09%	9,43%	58,19%	0,09%	0,41%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	10,14%	-17,47%	31,08%	-17,78%	0,93%	41,18%	0,10%	0,47%

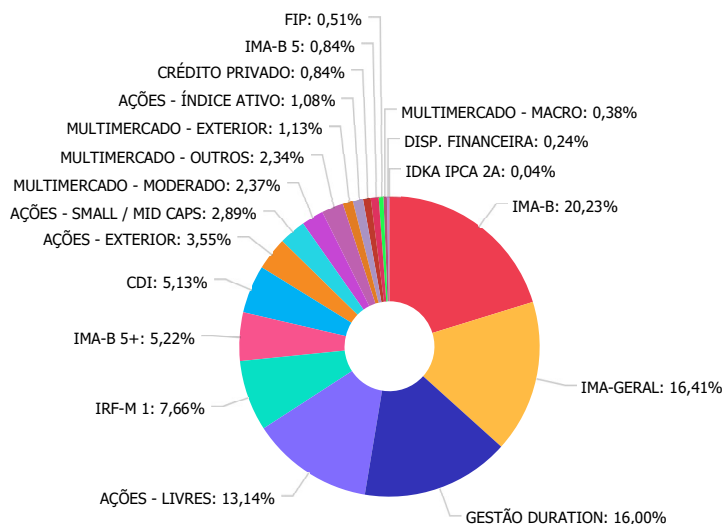
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2020 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕ...	3,31%	56,90%	17,45%	44,19%	-	-	0,16%	-

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



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

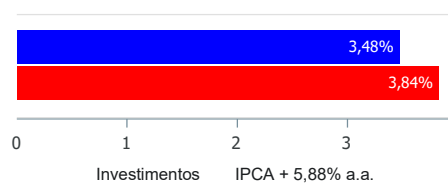


IMA-B	60.956.116,29
IMA-GERAL	49.463.441,73
GESTÃO DURATION	48.228.895,18
AÇÕES - LIVRES	39.611.646,13
IRF-M 1	23.070.978,30
IMA-B 5+	15.730.366,37
CDI	15.468.508,69
AÇÕES - EXTERIOR	10.694.264,03
AÇÕES - SMALL / MID CAPS	8.698.110,62
MULTIMERCADO - MODERADO	7.144.868,09
MULTIMERCADO - OUTROS	7.064.370,51
MULTIMERCADO - EXTERIOR	3.391.839,68
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	3.258.282,85
CRÉDITO PRIVADO	2.543.391,68
IMA-B 5	2.539.044,00
FIP	1.535.969,39
MULTIMERCADO - MACRO	1.143.016,24
DISP. FINANCEIRA	709.081,46
IDKA IPCA 2A	118.378,51

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

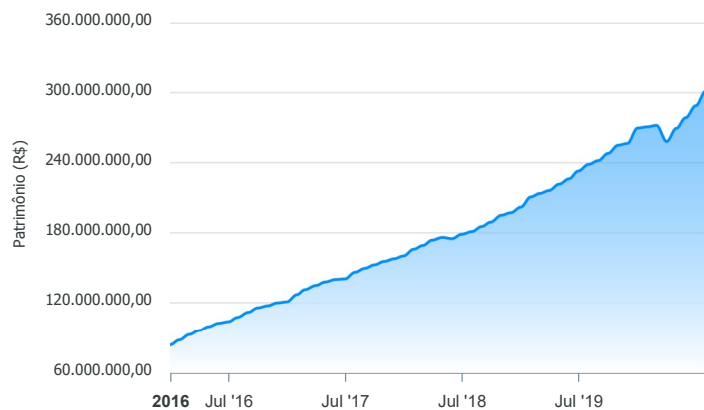
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	269.178.843,08	19.157.889,20	19.870.125,55	269.545.785,69	1.079.178,96	1.079.178,96	0,40%	0,40%	0,71%	0,71%	56,38%	2,13%
Fevereiro	269.545.785,69	21.259.186,81	17.391.810,86	270.813.319,60	-2.599.842,04	-1.520.663,08	-0,95%	-0,55%	0,66%	1,38%	-40,25%	3,31%
Março	270.813.319,60	66.210.024,06	62.649.762,03	256.935.597,06	-17.437.984,57	-18.958.647,65	-6,36%	-6,87%	0,57%	1,95%	-351,80%	14,74%
Abril	256.935.597,06	16.853.037,58	13.284.185,53	268.161.221,81	7.656.772,70	-11.301.874,95	2,94%	-4,14%	0,14%	2,10%	-197,01%	7,68%
Mai	268.161.221,81	35.829.496,00	33.182.457,23	277.216.449,58	6.408.189,00	-4.893.685,95	2,37%	-1,87%	0,07%	2,17%	-85,94%	4,38%
Junho	277.216.449,58	38.224.129,97	33.968.410,48	288.171.224,18	6.699.055,11	1.805.369,16	2,38%	0,47%	0,74%	2,93%	15,94%	3,85%
Julho	288.171.224,18	14.854.203,84	11.124.994,47	300.661.488,29	8.761.054,74	10.566.423,90	3,00%	3,48%	0,88%	3,84%	90,70%	3,22%

Investimentos x Meta Atuarial



Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

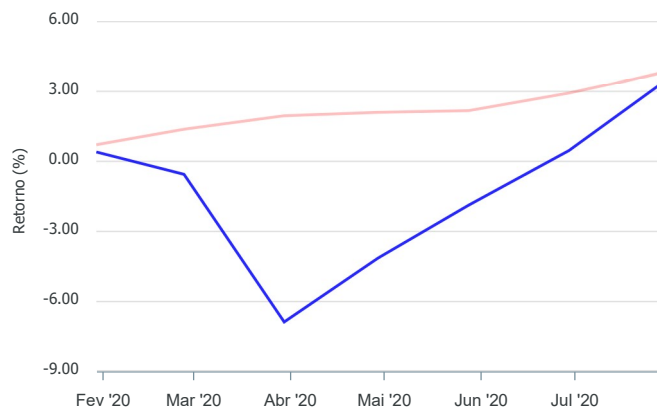
Evolução do Patrimônio



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 Julho/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	1.889.592,57	0,00	0,00	2.028.120,65	138.528,08	7,33%	7,33%	3,79%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	12.772.647,61	0,00	0,00	13.702.245,72	929.598,11	7,28%	7,28%	3,80%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA	2.317.900,24	0,00	0,00	2.429.324,78	111.424,54	4,81%	4,81%	2,56%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	4.214.068,07	0,00	0,00	4.402.637,14	188.569,07	4,47%	4,47%	2,33%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	7.985.380,07	0,00	0,00	8.335.606,85	350.226,78	4,39%	4,39%	2,27%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	2.876.191,65	0,00	0,00	2.998.103,63	121.911,98	4,24%	4,24%	2,15%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	2.008.261,17	0,00	0,00	2.046.866,14	38.604,97	1,92%	1,92%	1,19%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	48.604.231,26	0,00	0,00	49.463.441,73	859.210,47	1,77%	1,77%	1,05%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	3.960.461,77	1.500.000,00	0,00	5.540.558,47	80.096,70	1,47%	1,71%	1,05%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	7.885.470,77	0,00	0,00	7.973.762,26	88.291,49	1,12%	1,12%	1,05%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDEN...	28.407.508,31	0,00	0,00	28.724.951,20	317.442,89	1,12%	1,12%	1,01%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	2.518.611,97	0,00	0,00	2.543.391,68	24.779,71	0,98%	0,98%	0,97%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	38.209.268,38	0,00	0,00	38.582.688,07	373.419,69	0,98%	0,98%	0,92%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	117.431,26	0,00	0,00	118.378,51	947,25	0,81%	0,81%	0,74%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	2.047.834,62	0,00	0,00	2.058.782,50	10.947,88	0,53%	0,53%	0,33%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	6.072.293,63	0,00	0,00	6.091.730,43	19.436,80	0,32%	0,32%	0,32%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	23.017.366,05	0,00	0,00	23.070.978,30	53.612,25	0,23%	0,23%	0,15%
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	529,32	0,00	0,00	530,27	0,95	0,18%	0,18%	0,00%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	2.834,74	0,00	0,00	2.838,04	3,30	0,12%	0,12%	0,00%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.537.254,00	0,00	0,00	2.539.044,00	1.790,00	0,07%	0,07%	0,18%

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.083.386,27	1.093.637,09	1.048.658,81	2.130.549,34	2.184,79	0,07%	0,10%	0,00%
BRDESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	11.149.774,15	12.260.566,75	10.076.335,66	13.334.591,04	585,80	0,00%	0,00%	0,00%
Total Renda Fixa	210.678.297,88	14.854.203,84	11.124.994,47	218.119.120,75	3.711.613,50	1,73%		1,12%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
MOAT CAPITAL FIC AÇÕES	4.027.851,76	0,00	0,00	4.534.308,88	506.457,12	12,57%	12,57%	8,78%
ALASKA BLACK INSTITUCIONAL FI AÇÕES	2.706.170,40	0,00	0,00	3.013.384,79	307.214,39	11,35%	11,35%	14,30%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	1.570.077,03	0,00	0,00	1.729.209,16	159.132,13	10,14%	10,14%	9,85%
BRADESCO VALUATION IBOVESPA FIC AÇÕES	2.960.145,86	0,00	0,00	3.258.282,85	298.136,99	10,07%	10,07%	10,27%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	7.994.253,72	0,00	0,00	8.731.354,67	737.100,95	9,22%	9,22%	8,79%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8.667.185,60	0,00	0,00	9.427.868,60	760.683,00	8,78%	8,78%	11,00%
XP INVESTOR FI AÇÕES	1.768.741,94	0,00	0,00	1.921.539,03	152.797,09	8,64%	8,64%	10,95%
XP INVESTOR 30 FIC AÇÕES	2.393.107,33	0,00	0,00	2.597.320,30	204.212,97	8,53%	8,53%	11,02%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	6.438.986,17	0,00	0,00	6.968.901,46	529.915,29	8,23%	8,23%	8,76%
INDIE FIC AÇÕES	2.830.445,08	0,00	0,00	3.060.562,72	230.117,64	8,13%	8,13%	9,31%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	5.881.955,86	0,00	0,00	6.325.307,14	443.351,28	7,54%	7,54%	8,75%
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	3.209.664,16	0,00	0,00	3.391.839,68	182.175,52	5,68%	5,68%	6,47%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	6.969.166,34	0,00	0,00	7.144.868,09	175.701,75	2,52%	2,52%	2,59%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.127.168,70	0,00	0,00	1.143.016,24	15.847,54	1,41%	1,41%	1,46%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTI...	7.060.505,30	0,00	0,00	7.064.370,51	3.865,21	0,05%	0,05%	0,02%
FP2 MULTIESTRATÉGIA FIP	1.535.526,32	0,00	0,00	1.535.969,39	443,07	0,03%	-	-
Total Renda Variável	67.140.951,57	0,00	0,00	71.848.103,51	4.707.151,94	7,01%		7,83%

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO E...	10.351.974,73	0,00	0,00	10.694.264,03	342.289,30	3,31%	3,31%	15,69%
Total Renda Variável	10.351.974,73	0,00	0,00	10.694.264,03	342.289,30	3,31%		15,69%