

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
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	38.367.721,59	12,70%	852	0,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	2.380.034,48	0,79%	36	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	119.190,73	0,04%	892	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVID...	D+0	15/08/2024	28.160.186,58	9,32%	31	9,83%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVI...	D+2	Não há	13.196.881,56	4,37%	312	0,66%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	23.091.343,99	7,65%	1.244	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	15/08/2022	2.118.089,67	0,70%	165	0,89%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	D+2	Não há	2.944.119,02	0,97%	22.202	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	49.023.835,30	16,23%	600	0,45%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENC...	D+0	16/05/2023	8.026.417,36	2,66%	51	2,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.952.497,36	0,65%	47	0,81%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.028.109,59	0,67%	755	0,11%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	8.186.107,26	2,71%	271	0,56%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZ...	D+0	Não há	13.428.474,93	4,45%	1.539	1,81%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	6.493.655,00	2,15%	189	0,47%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	4.321.902,73	1,43%	122	0,23%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	104,58	0,00%	316	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	2.051.520,88	0,68%	120	0,18%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3 du	Não há	6.731.033,41	2,23%	361	0,35%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	531,04	0,00%	420	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2020)

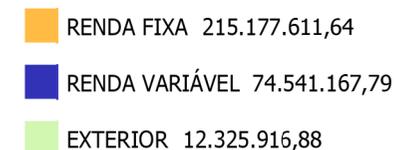
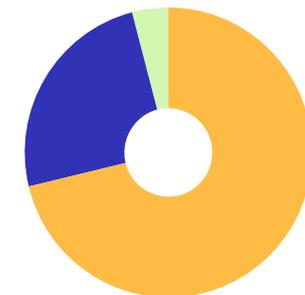
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO...	D+30 ou...	Não há	2.555.854,58	0,85%	74	0,42%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
MOAT CAPITAL FIC AÇÕES	D+17	Não há	4.367.246,00	1,45%	3.207	0,19%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
XP DIVIDENDOS 30 FIC AÇÕES	D+33	Não há	969.907,19	0,32%	2.044	0,68%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	8.429.909,85	2,79%	2.497	0,97%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
INDIE FIC AÇÕES	D+32	Não há	3.075.241,95	1,02%	20.059	0,30%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BRDESCO VALUATION IBOVESPA FIC AÇÕES	D+4	Não há	3.184.642,10	1,05%	697	4,00%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BRDESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	D+4	Não há	6.858.924,74	2,27%	2.026	0,32%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	6.312.903,91	2,09%	47.653	0,15%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ALASKA BLACK INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+32	Não há	2.939.389,71	0,97%	123.838	0,14%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	D+4	Não há	1.704.088,86	0,56%	20.463	0,33%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	9.156.532,45	3,03%	3.533	0,55%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
XP INVESTOR FI AÇÕES	D+4	Não há	1.930.134,78	0,64%	3.221	0,52%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
XP INVESTOR 30 FIC AÇÕES	D+33	Não há	2.605.296,52	0,86%	3.861	0,38%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	23/08/2017	2.507.077,66	0,83%	154	0,31%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	7.128.409,57	2,36%	80	0,85%	Artigo 8º, Inciso III
ITAÚ PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	3.628.191,35	1,20%	969	0,33%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MUL...	D+2	01/10/2020	7.065.975,44	2,34%	956	1,39%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	1.141.454,68	0,38%	19.855	0,02%	Artigo 8º, Inciso III
FP2 MULTISTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não há	1.535.841,03	0,51%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO...	D+5	Não há	12.325.916,88	4,08%	5.590	1,82%	Artigo 9º - A, Inciso II

Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
Total para cálculo dos limites da Resolução			302.044.696,31				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			2.172.595,42				Artigo 6º
		PL Total	304.217.291,73				

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

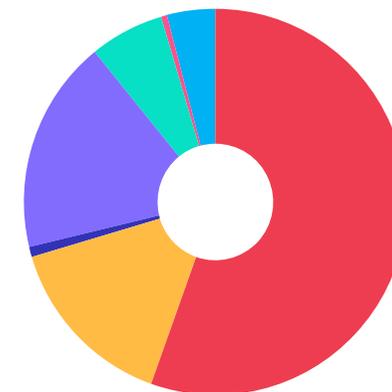
Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nível 2	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	100,00%	302.044.696,31
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	167.427.820,28	55,43%	40,00%	50,00%	100,00%	134.616.876,03
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	302.044.696,31
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	15.102.234,82
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	70,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	181.226.817,79
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	70,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	181.226.817,79
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	50,00%	45.193.936,78	14,96%	0,00%	8,00%	40,00%	75.623.941,74
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	50,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	120.817.878,52
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	60.408.939,26
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	15,00%	45.306.704,45
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	45.306.704,45
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	15.102.234,82
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	15,00%	2.555.854,58	0,85%	0,00%	2,00%	5,00%	12.546.380,24
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	15.102.234,82
Total Renda Fixa	100,00%	215.177.611,64	71,24%	40,00%	65,00%	570,00%	



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 (Agosto / 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%	5,00%	30,00%	90.613.408,89
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'b'	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	90.613.408,89
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	30,00%	54.041.295,72	17,89%	0,00%	15,00%	20,00%	6.367.643,54
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'b'	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	60.408.939,26
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	18.964.031,04	6,28%	0,00%	5,00%	10,00%	11.240.438,59
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	5,00%	1.535.841,03	0,51%	0,00%	1,00%	5,00%	13.566.393,79
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	15.102.234,82
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	15.102.234,82
Total Renda Variável	40,00%	74.541.167,79	24,68%	0,00%	30,00%	125,00%	



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%	1,00%	5,00%	15.102.234,82
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	12.325.916,88	4,08%	0,00%	1,00%	5,00%	2.776.317,94
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	5,00%	15.102.234,82
Total Exterior	10,00%	12.325.916,88	4,08%	0,00%	5,00%	15,00%	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	144.941.138,89	47,99	0,01
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	62.133.575,71	20,57	0,01
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	36.240.627,90	12,00	0,00
XP VISTA ASSET MANAGEMENT	12.325.916,88	4,08	0,00
ITAÚ UNIBANCO	9.941.095,26	3,29	0,00
NAVI CAPITAL	9.156.532,45	3,03	0,56
XP GESTÃO DE RECURSOS	5.505.338,49	1,82	0,00
MOAT CAPITAL	4.367.246,00	1,45	0,04
INDIE CAPITAL	3.075.241,95	1,02	0,10
SUL AMERICA INVESTIMENTOS GEST...	2.944.119,02	0,97	0,01
ALASKA ASSET MANAGEMENT	2.939.389,71	0,97	0,03
VINCI PARTNERS	2.507.077,66	0,83	0,00
BANCO J. SAFRA S/A	2.380.034,48	0,79	0,00
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	2.051.520,88	0,68	0,00
LAD CAPITAL	1.535.841,03	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 '	167.427.820,28	55,43	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 IV, Alínea ' a '	45.193.936,78	14,96	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 '	2.555.854,58	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 '	54.041.295,72	17,89	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	18.964.031,04	6,28	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	1.535.841,03	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	12.325.916,88	4,08	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 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%
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%
IMA-B 5+ (Benchmark)	-3,62%	-2,01%	6,38%	-2,35%	4,71%	44,71%	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-3,69%	-2,23%	6,21%	-2,57%	4,54%	43,91%	0,04%	0,17%
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	-3,73%	-2,78%	6,17%	-3,03%	3,83%	42,79%	0,04%	0,17%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA	-2,03%	2,16%	4,85%	1,15%	8,56%	-	0,03%	0,11%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,12%	2,96%	0,64%	2,12%	5,06%	12,83%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,09%	2,78%	0,58%	1,99%	4,77%	12,31%	0,00%	0,01%
IMA-B (Benchmark)	-1,80%	0,80%	4,61%	0,09%	6,64%	36,00%	-	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,79%	0,52%	4,60%	-0,14%	6,27%	35,06%	0,02%	0,11%
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	-1,83%	0,82%	4,70%	0,08%	6,70%	36,30%	0,02%	0,11%

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
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	-1,80%	-0,64%	4,55%	-0,16%	5,25%	33,49%	0,02%	0,10%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,47%	2,45%	1,79%	1,83%	6,06%	18,80%	0,00%	0,02%
Selic (Benchmark)	0,16%	2,12%	0,57%	1,43%	3,86%	10,38%	-	-
BRADESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	0,15%	1,98%	0,53%	1,34%	3,66%	9,99%	0,00%	0,00%
CDI (Benchmark)	0,16%	2,12%	0,57%	1,43%	3,86%	10,38%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,08%	1,42%	0,31%	0,92%	2,78%	8,08%	0,00%	0,00%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,09%	1,55%	0,35%	1,01%	3,00%	8,56%	0,00%	0,00%
BRADESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	-0,01%	0,50%	0,01%	0,23%	1,34%	4,99%	0,00%	0,00%
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 VI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,46%	5,18%	2,81%	3,71%	9,99%	30,01%	0,01%	0,04%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	-0,56%	5,06%	1,17%	3,57%	9,21%	27,35%	0,01%	0,03%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	-0,35%	2,16%	0,52%	1,55%	6,43%	19,40%	0,00%	0,02%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,86%	2,63%	1,79%	1,79%	6,03%	22,43%	0,01%	0,04%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,05%	-	1,81%	-	-	-	0,01%	-

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
S&P 500 (Benchmark)	7,01%	8,34%	14,98%	18,49%	19,61%	20,64%	-	-
ITAÚ PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO	6,97%	6,33%	14,33%	14,59%	18,33%	23,18%	0,06%	0,24%
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%
IBX (Benchmark)	-3,38%	-13,46%	14,15%	-4,51%	-1,12%	33,35%	-	-
INDIE FIC AÇÕES	0,48%	-4,23%	22,46%	0,07%	15,87%	76,26%	0,09%	0,45%
Ibovespa (Benchmark)	-3,44%	-14,07%	13,69%	-4,61%	-1,75%	29,59%	-	-
XP INVESTOR FI AÇÕES	0,45%	-9,81%	19,23%	-7,13%	7,30%	59,64%	0,11%	0,47%
BRDESCO VALUATION IBOVESPA FIC AÇÕES	-2,26%	-15,66%	15,86%	-7,93%	-6,10%	27,53%	0,10%	0,40%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-2,88%	-9,11%	14,42%	-0,74%	4,56%	52,97%	0,11%	0,37%
XP INVESTOR 30 FIC AÇÕES	0,31%	-10,42%	18,75%	-7,82%	6,62%	55,88%	0,11%	0,47%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	0,02%	1,87%	0,19%	1,28%	4,31%	16,69%	0,00%	0,01%
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%
MOAT CAPITAL FIC AÇÕES	-3,68%	-3,96%	22,22%	5,96%	12,20%	73,60%	0,09%	0,51%
CDI (Benchmark)	0,16%	2,12%	0,57%	1,43%	3,86%	10,38%	-	-

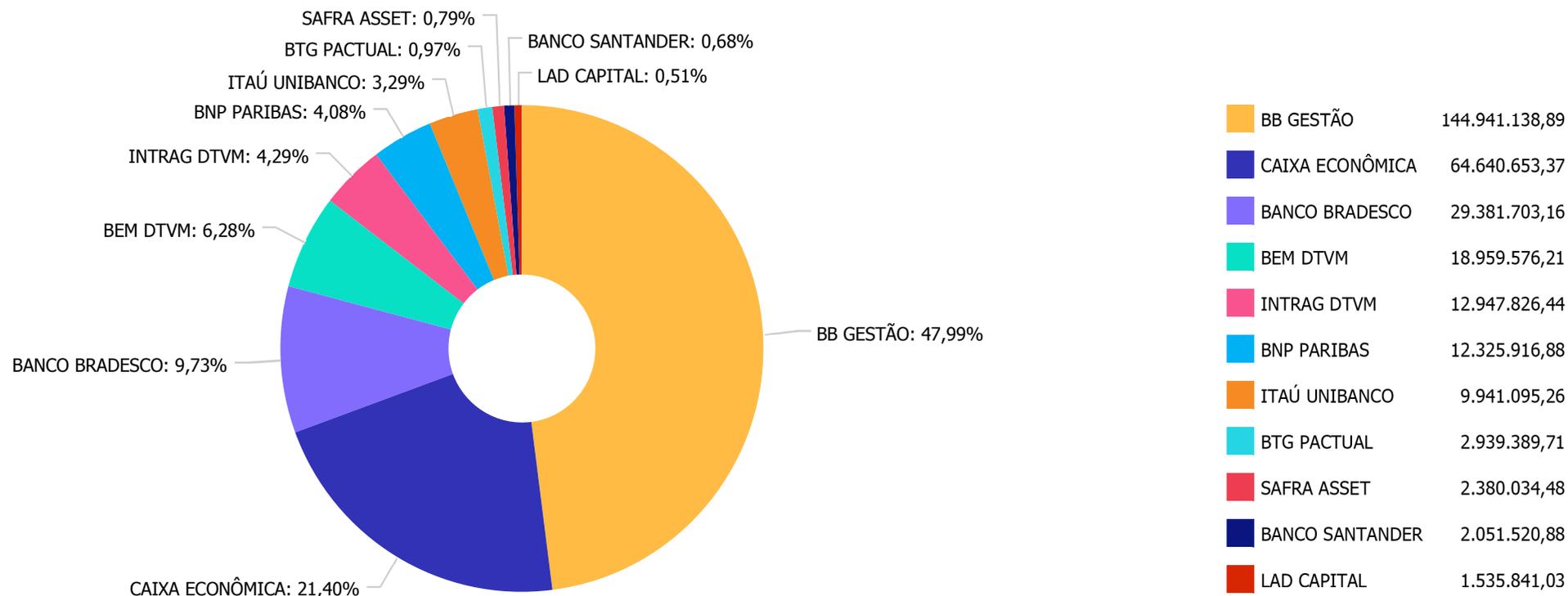
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2020 - RENDA VARIÁVEL

	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)	-	-	-	-	-	-	-	-
FP2 MULTIESTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	-	-
XP DIVIDENDOS 30 FIC AÇÕES	-4,73%	-23,29%	7,45%	-18,85%	-9,63%	47,16%	0,11%	0,35%
ALASKA BLACK INSTITUCIONAL FI AÇÕES	-2,46%	-9,83%	15,85%	-0,95%	8,81%	30,25%	0,14%	0,43%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	-0,23%	0,62%	4,58%	2,70%	-	-	0,03%	-
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	-1,58%	-10,08%	15,58%	-3,91%	6,20%	58,35%	0,09%	0,41%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	-1,45%	-18,67%	23,07%	-11,11%	-0,92%	44,22%	0,10%	0,47%

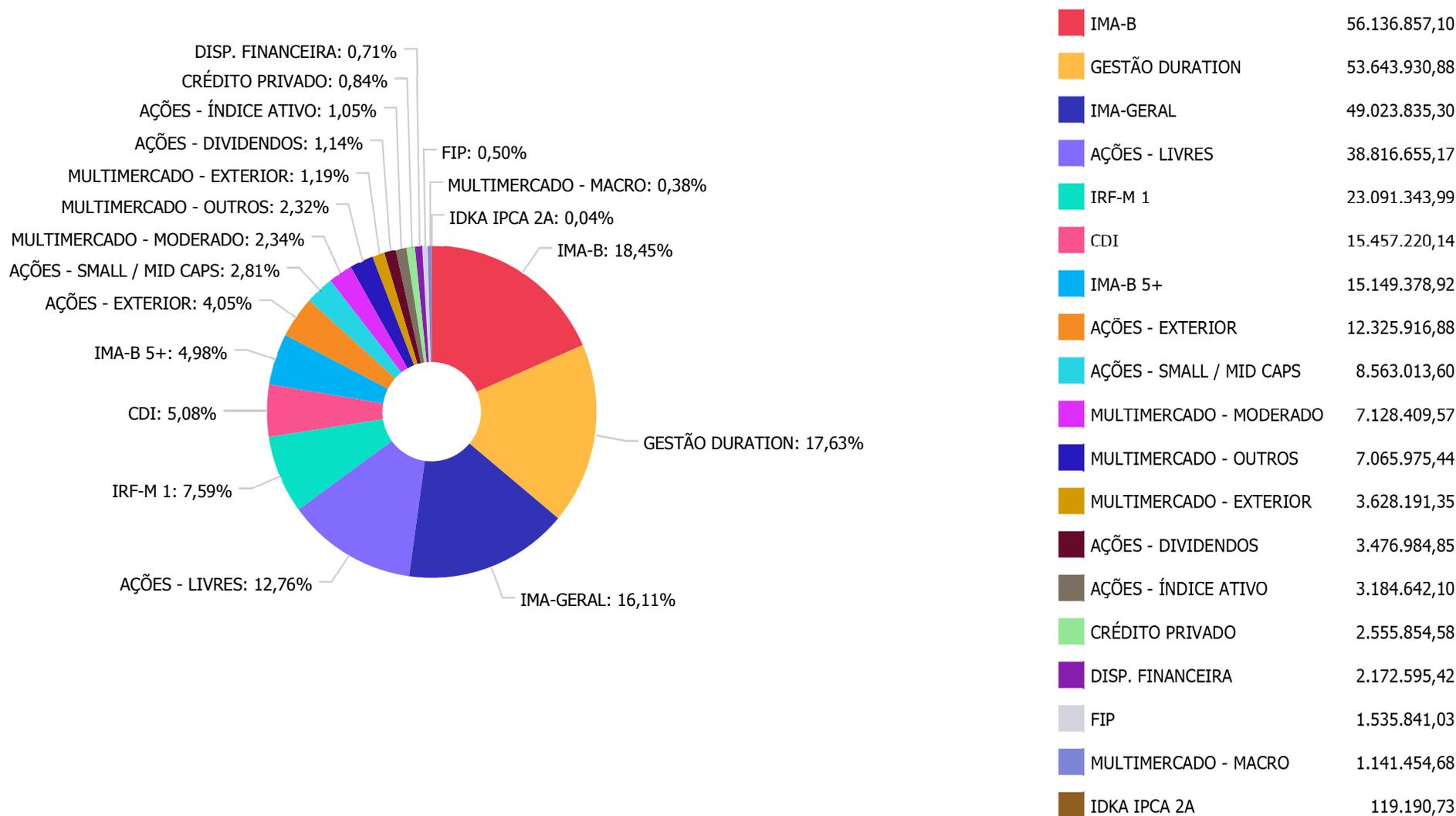
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2020 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕ...	15,26%	80,84%	28,22%	71,29%	-	-	0,16%	-

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



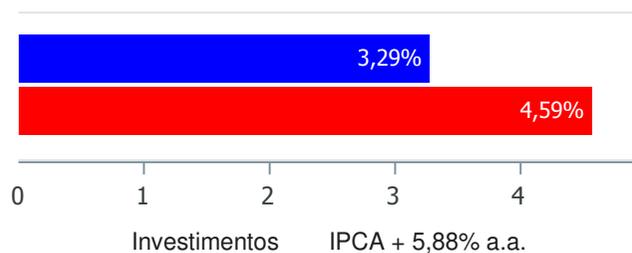
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Agosto / 2020)



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	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%
Agosto	300.661.488,29	28.597.449,04	26.650.920,44	302.044.696,31	-563.320,58	10.003.103,32	-0,19%	3,29%	0,72%	4,59%	71,74%	3,37%

Investimentos x Meta Atuarial



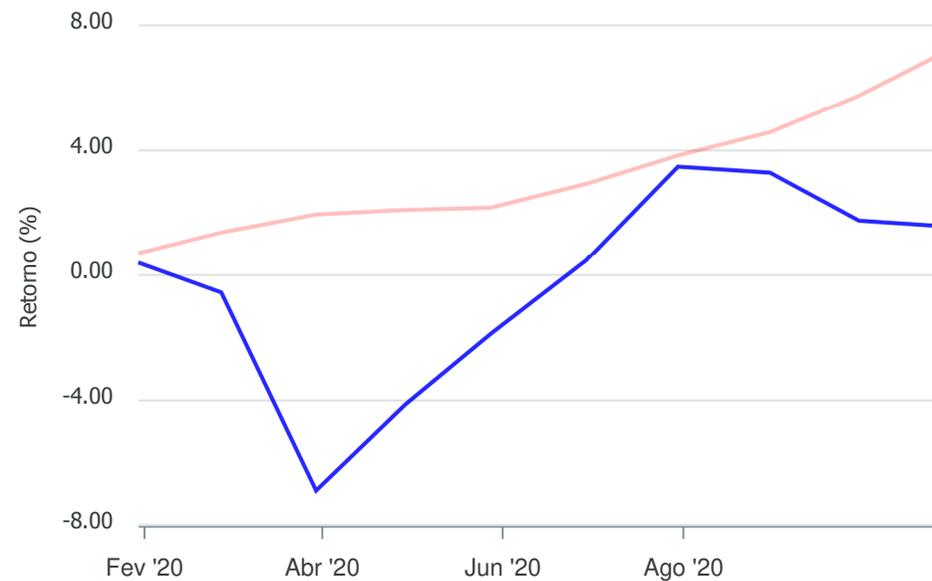
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Agosto/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	2.130.549,34	5.635.429,59	5.795.019,45	2.028.109,59	57.150,11	0,74%	0,08%	0,00%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	118.378,51	0,00	0,00	119.190,73	812,22	0,69%	0,69%	0,74%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	7.973.762,26	0,00	0,00	8.026.417,36	52.655,10	0,66%	0,66%	1,05%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	2.543.391,68	0,00	0,00	2.555.854,58	12.462,90	0,49%	0,49%	0,97%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDEN...	28.724.951,20	0,00	696.608,77	28.160.186,58	131.844,15	0,46%	0,46%	1,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	6.091.730,43	0,00	3.995.554,89	2.118.089,67	21.914,13	0,36%	0,47%	0,32%
BRDESCO FEDERAL EXTRA FI REFERENCIADO DI	530,27	0,00	0,00	531,04	0,77	0,15%	0,15%	0,00%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.539.044,00	0,00	2.541.846,00	0,00	2.802,00	0,11%	-	0,18%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	23.070.978,30	0,00	0,00	23.091.343,99	20.365,69	0,09%	0,09%	0,15%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	2.838,04	2.541.846,00	2.544.898,57	104,58	319,11	0,01%	0,09%	0,00%
BRDESCO PODER PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	13.334.591,04	11.173.027,51	11.076.992,76	13.428.474,93	-2.150,86	-0,01%	-0,01%	0,00%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	2.046.866,14	4.702.247,37	0,00	6.731.033,41	-18.080,10	-0,27%	-1,05%	1,19%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	2.058.782,50	0,00	0,00	2.051.520,88	-7.261,62	-0,35%	-0,35%	0,33%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	38.582.688,07	0,00	0,00	38.367.721,59	-214.966,48	-0,56%	-0,56%	0,92%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	5.540.558,47	1.000.000,00	0,00	6.493.655,00	-46.903,47	-0,72%	-0,86%	1,05%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	49.463.441,73	0,00	0,00	49.023.835,30	-439.606,43	-0,89%	-0,89%	1,05%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	8.335.606,85	0,00	0,00	8.186.107,26	-149.499,59	-1,79%	-1,79%	2,27%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	2.998.103,63	0,00	0,00	2.944.119,02	-53.984,61	-1,80%	-1,80%	2,15%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	4.402.637,14	0,00	0,00	4.321.902,73	-80.734,41	-1,83%	-1,83%	2,33%
SAFRA IMA INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA	2.429.324,78	0,00	0,00	2.380.034,48	-49.290,30	-2,03%	-2,03%	2,56%

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 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	13.702.245,72	0,00	0,00	13.196.881,56	-505.364,16	-3,69%	-3,69%	3,80%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	2.028.120,65	0,00	0,00	1.952.497,36	-75.623,29	-3,73%	-3,73%	3,79%
Total Renda Fixa	218.119.120,75	25.052.550,47	26.650.920,44	215.177.611,64	-1.343.139,14	-0,55%		1,14%

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
ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO	3.391.839,68	0,00	0,00	3.628.191,35	236.351,67	6,97%	6,97%	6,47%
INDIE FIC AÇÕES	3.060.562,72	0,00	0,00	3.075.241,95	14.679,23	0,48%	0,48%	9,31%
XP INVESTOR FI AÇÕES	1.921.539,03	0,00	0,00	1.930.134,78	8.595,75	0,45%	0,45%	10,95%
XP INVESTOR 30 FIC AÇÕES	2.597.320,30	0,00	0,00	2.605.296,52	7.976,22	0,31%	0,31%	11,02%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTI...	7.064.370,51	0,00	0,00	7.065.975,44	1.604,93	0,02%	0,02%	0,02%
FP2 MULTISTRATÉGIA FIP	1.535.969,39	0,00	0,00	1.535.841,03	-128,36	-0,01%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1.143.016,24	0,00	0,00	1.141.454,68	-1.561,56	-0,14%	-0,14%	1,46%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	6.325.307,14	0,00	0,00	6.312.903,91	-12.403,23	-0,20%	-0,20%	8,75%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	7.144.868,09	0,00	0,00	7.128.409,57	-16.458,52	-0,23%	-0,23%	2,59%
BB SMALL CAPS FIC AÇÕES	1.729.209,16	0,00	0,00	1.704.088,86	-25.120,30	-1,45%	-1,45%	9,85%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	0,00	2.544.898,57	0,00	2.507.077,66	-37.820,91	-1,49%	-3,82%	9,12%
BRANCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	6.968.901,46	0,00	0,00	6.858.924,74	-109.976,72	-1,58%	-1,58%	8,76%
BRANCO VALUATION IBOVESPA FIC AÇÕES	3.258.282,85	0,00	0,00	3.184.642,10	-73.640,75	-2,26%	-2,26%	10,27%
ALASKA BLACK INSTITUCIONAL FI AÇÕES	3.013.384,79	0,00	0,00	2.939.389,71	-73.995,08	-2,46%	-2,46%	14,30%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	9.427.868,60	0,00	0,00	9.156.532,45	-271.336,15	-2,88%	-2,88%	11,00%
XP DIVIDENDOS 30 FIC AÇÕES	0,00	1.000.000,00	0,00	969.907,19	-30.092,81	-3,01%	-4,73%	10,57%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	8.731.354,67	0,00	0,00	8.429.909,85	-301.444,82	-3,45%	-3,45%	8,79%
MOAT CAPITAL FIC AÇÕES	4.534.308,88	0,00	0,00	4.367.246,00	-167.062,88	-3,68%	-3,68%	8,78%
Total Renda Variável	71.848.103,51	3.544.898,57	0,00	74.541.167,79	-851.834,29	-1,13%		7,88%

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO E...	10.694.264,03	0,00	0,00	12.325.916,88	1.631.652,85	15,26%	15,26%	15,69%
Total Renda Variável	10.694.264,03	0,00	0,00	12.325.916,88	1.631.652,85	15,26%		15,69%