

CRÉDITO E MERCADO

Engenharia Financeira
Relatório Analítico dos Investimentos

em julho de 2020

Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2020)

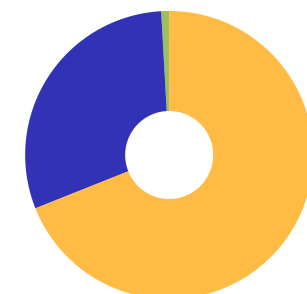
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	15.911.993,73	9,02%	791	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	4.191.505,19	2,38%	95	0,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	8.870.624,01	5,03%	959	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.167.655,13	0,66%	1.366	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVID...	D+0	15/08/2024	3.244.465,35	1,84%	31	1,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	7.310.540,50	4,14%	122	0,85%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	10.129.785,85	5,74%	918	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	8.670.843,59	4,91%	675	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	19.928.791,12	11,29%	626	0,48%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	19.949,01	0,01%	751	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	5.247.592,24	2,97%	54	5,66%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	11.196.316,08	6,34%	288	0,22%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA L...	D+1	Não há	6.258.397,08	3,55%	40	10,97%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	5.140.139,11	2,91%	109	0,44%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	9.073.531,30	5,14%	178	0,73%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	551.250,91	0,31%	319	0,11%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	D+1601	29 dias	4.552.889,86	2,58%	33	2,92%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
BBIF MASTER FIDC LP	Não se ...	27 meses	218.440,91	0,12%	13	0,93%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	2.465.274,01	1,40%	48.524	0,06%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	3.681.138,94	2,09%	111	0,49%	Artigo 8º, Inciso II, 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
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	2.532.435,38	1,44%	1.656	0,27%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	3.791.628,26	2,15%	8.139	0,38%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
HIX CAPITAL INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+63	Não há	3.569.645,97	2,02%	2.365	1,27%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	3.006.568,38	1,70%	1.708	1,04%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
FRANKLIN TEMPLETON VALOR E FVL FI AÇÕES	D+4	Não há	3.048.223,46	1,73%	5.520	0,88%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	8.782.684,02	4,98%	6.487	0,37%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	3.094.277,94	1,75%	3.285	0,61%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	D+2	Não há	1.599.373,98	0,91%	62	0,33%	Artigo 8º, Inciso III
DAYCOVAL MULTISTRATÉGIA FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	5.287.410,12	3,00%	1.706	2,89%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	6.392.298,90	3,62%	19.189	0,13%	Artigo 8º, Inciso III
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	Não se ...	Não se aplica	2.825.709,87	1,60%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	3.133.595,28	1,78%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	1.571.696,54	0,89%	483	0,13%	Artigo 9º - A, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			176.466.672,02				

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

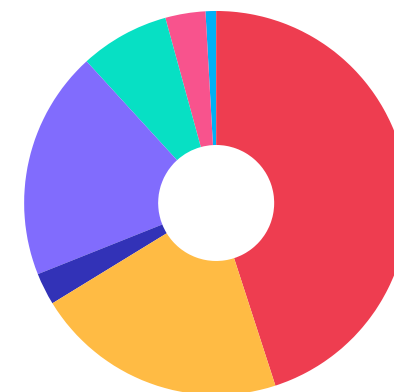
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	17.646.667,20
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	79.426.204,47	45,01%	15,00%	36,00%	76,00%	54.688.466,27
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	105.880.003,21
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	40,00%	37.487.175,73	21,24%	10,00%	30,00%	40,00%	33.099.493,08
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea 'a'	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	26.470.000,80
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'	5,00%	4.771.330,77	2,70%	0,00%	4,00%	5,00%	4.052.002,83
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	8.823.333,60
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	8.823.333,60
Total Renda Fixa	100,00%	121.684.710,97	68,96%	25,00%	70,00%	216,00%	



RENDA FIXA 121.684.710,97
RENDA VARIÁVEL 53.210.264,51
EXTERIOR 1.571.696,54

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA 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%	0,00%	10,00%	17.646.667,20
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'b'	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	17.646.667,20
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	33.971.876,36	19,25%	7,00%	10,00%	20,00%	1.321.458,04
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	13.279.083,00	7,52%	7,00%	10,00%	10,00%	4.367.584,20
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	5,00%	5.959.305,15	3,38%	0,00%	5,00%	5,00%	2.864.028,45
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	8.823.333,60
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	8.823.333,60
Total Renda Variável	30,00%	53.210.264,51	30,15%	14,00%	30,00%	65,00%	



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%	0,00%	5,00%	8.823.333,60
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	17.646.667,20
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	1.571.696,54	0,89%	0,00%	0,00%	5,00%	7.251.637,06
Total Exterior	10,00%	1.571.696,54	0,89%	0,00%	0,00%	20,00%	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	43.023.608,53	24,38	0,01
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	34.396.484,45	19,49	0,00
ITAÚ UNIBANCO	18.801.729,20	10,65	0,00
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	16.384.071,80	9,28	0,00
INFINITY ASSET MANAGEMENT	11.505.989,32	6,52	2,21
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	8.782.684,02	4,98	0,01
BANCO J. SAFRA S/A	7.362.575,71	4,17	0,00
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	5.287.410,12	3,00	0,13
AURORA CAPITAL	4.552.889,86	2,58	5,39
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	3.791.628,26	2,15	0,24
VINCI PARTNERS	3.681.138,94	2,09	0,00
HIX CAPITAL	3.569.645,97	2,02	0,14
A5 CAPITAL PARTNERS	3.133.595,28	1,78	-
PERFIN INVESTIMENTOS	3.094.277,94	1,75	0,04
FRANKLIN TEMPLETON INVESTIMENT...	3.048.223,46	1,73	0,07
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	3.006.568,38	1,70	0,00
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	2.825.709,87	1,60	0,00
BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUT...	218.440,91	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 '	79.426.204,47	45,01	15,00	76,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	37.487.175,73	21,24	10,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	4.771.330,77	2,70	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 '	33.971.876,36	19,25	7,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	13.279.083,00	7,52	7,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5.959.305,15	3,38	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	1.571.696,54	0,89	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
IDKA PRÉ 2 ANOS (Benchmark)	0,89%	7,55%	2,91%	6,54%	11,53%	28,08%	-	-
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	0,90%	7,46%	2,83%	6,45%	11,23%	27,43%	0,01%	0,02%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,94%	4,31%	3,72%	3,76%	8,68%	22,37%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,83%	3,98%	3,96%	3,50%	8,10%	20,93%	0,01%	0,03%
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	0,98%	4,47%	1,98%	3,64%	9,50%	20,87%	-	-
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	-8,75%	-22,99%	-8,26%	-18,85%	-26,20%	-28,70%	0,15%	0,10%
IMA-B 5+ (Benchmark)	7,32%	1,68%	11,51%	1,64%	7,81%	49,37%	-	-
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	3,45%	2,48%	6,56%	2,58%	5,47%	17,24%	0,02%	0,09%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,24%	2,84%	0,94%	2,39%	5,51%	13,20%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,24%	2,73%	0,90%	2,30%	5,30%	12,79%	0,00%	0,00%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,99%	4,19%	4,28%	3,61%	8,83%	24,16%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,97%	4,05%	4,23%	3,48%	8,54%	23,61%	0,01%	0,04%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,97%	4,08%	4,21%	3,51%	8,59%	23,64%	0,01%	0,04%
IMA-B (Benchmark)	4,39%	2,65%	8,14%	2,38%	8,16%	37,86%	-	-

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
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4,36%	2,54%	8,07%	2,27%	7,94%	37,20%	0,02%	0,10%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	4,78%	4,07%	8,64%	3,74%	9,92%	42,84%	0,03%	0,11%

CDI (Benchmark)	0,19%	1,95%	0,64%	1,57%	4,21%	10,83%	-	-
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	2,15%	3,41%	3,31%	3,13%	5,61%	12,99%	0,01%	0,03%
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%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA LP	0,39%	3,28%	1,16%	2,95%	-	-	0,00%	-

IPCA (Benchmark)	0,36%	0,46%	0,24%	0,25%	2,31%	5,60%	-	-
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%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,55%	2,83%	1,54%	2,48%	5,21%	19,22%	0,00%	0,01%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,98%	5,65%	3,14%	4,79%	9,68%	28,24%	0,01%	0,03%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	1,71%	3,52%	3,83%	3,08%	7,06%	23,05%	0,01%	0,04%

Não Possui (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BBIF MASTER FIDC LP	15,47%	11,57%	14,08%	12,16%	7,96%	-21,28%	0,25%	0,16%

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
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	1,28%	6,44%	2,81%	5,30%	13,09%	28,89%	-	-
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	-	-

S&P 500 (Benchmark)	5,51%	1,25%	12,32%	1,41%	9,76%	16,15%	-	-
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	5,58%	-0,63%	12,07%	-0,99%	8,83%	19,18%	0,06%	0,23%

IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	1,07%	5,04%	2,22%	4,12%	10,52%	23,14%	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	-	-	-	-	-	-	-	-

Ibovespa (Benchmark)	8,27%	-11,01%	27,83%	-9,54%	1,08%	29,91%	-	-
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8,34%	-5,72%	27,43%	-7,68%	11,51%	54,52%	0,08%	0,42%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8,38%	-0,65%	31,79%	-2,63%	12,75%	62,07%	0,09%	0,42%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	8,46%	-11,68%	23,19%	-13,17%	7,17%	56,52%	0,08%	0,39%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	7,74%	-9,28%	26,10%	-8,58%	3,46%	33,73%	0,10%	0,38%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	6,38%	-12,84%	22,84%	-11,57%	0,02%	50,60%	0,10%	0,35%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	7,54%	-16,38%	23,82%	-16,23%	-0,92%	38,66%	0,09%	0,41%

CDI (Benchmark)	0,19%	1,95%	0,64%	1,57%	4,21%	10,83%	-	-
DAYCOVAL MULTISTRATÉGIA FI MULTIMERCADO	0,49%	3,42%	1,52%	2,84%	5,97%	15,28%	0,01%	0,00%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,41%	0,36%	4,15%	-0,32%	6,35%	24,98%	0,01%	0,07%

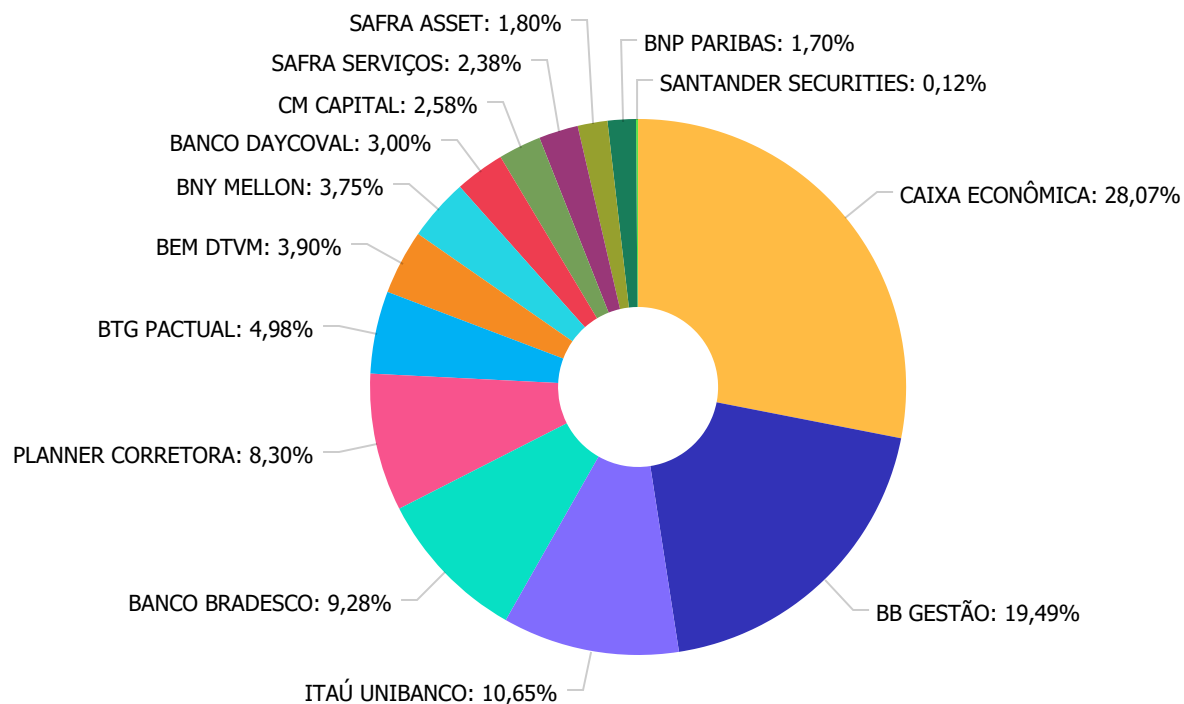
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	8,86%	-8,47%	27,39%	-10,22%	11,49%	61,50%	0,09%	0,40%
FRANKLIN TEMPLETON VALOR E FVL FI AÇÕES	8,45%	-14,76%	24,24%	-14,77%	-0,93%	28,66%	0,10%	0,40%
HIX CAPITAL INSTITUCIONAL FI AÇÕES	4,99%	-5,09%	20,58%	-6,76%	24,71%	77,55%	0,07%	0,40%

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

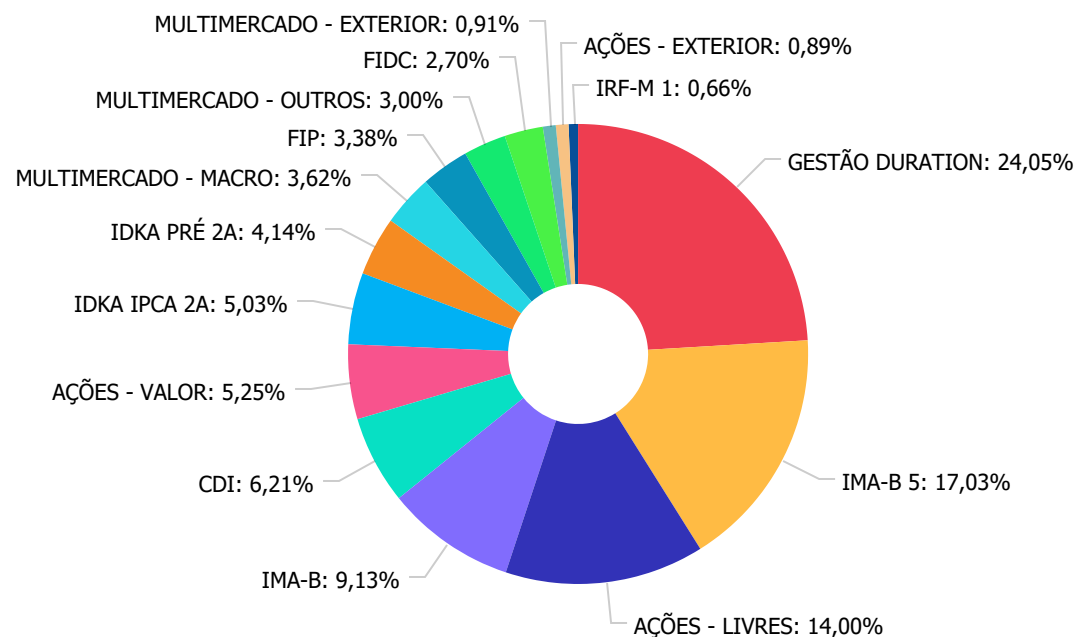
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	1,77%	34,78%	9,44%	26,60%	55,42%	70,67%	-	-
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	2,02%	26,09%	6,36%	17,87%	40,24%	67,08%	0,10%	0,20%

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



CAIXA ECONÔMICA	49.530.457,34
BB GESTÃO	34.396.484,45
ITAÚ UNIBANCO	18.801.729,20
BANCO BRADESCO	16.384.071,80
PLANNER CORRETORA	14.639.584,60
BTG PACTUAL	8.782.684,02
BEM DTVM	6.885.906,20
BNY MELLON	6.617.869,43
BANCO DAYCOVAL	5.287.410,12
CM CAPITAL	4.552.889,86
SAFRA SERVIÇOS	4.191.505,19
SAFRA ASSET	3.171.070,52
BNP PARIBAS	3.006.568,38
SANTANDER SECURITIES	218.440,91

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

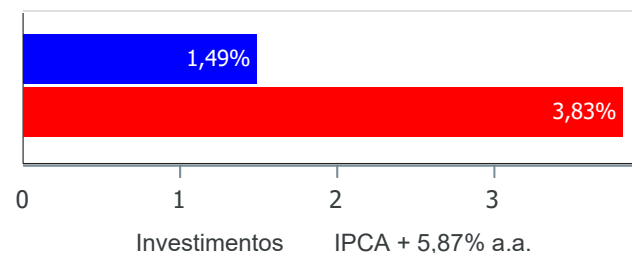


GESTÃO DURATION	42.440.238,19
IMA-B 5	30.058.576,97
AÇÕES - LIVRES	24.710.078,58
IMA-B	16.106.814,13
CDI	10.958.931,27
AÇÕES - VALOR	9.261.797,78
IDKA IPCA 2A	8.870.624,01
IDKA PRÉ 2A	7.310.540,50
MULTIMERCADO - MACRO	6.392.298,90
FIP	5.959.305,15
MULTIMERCADO - OUTROS	5.287.410,12
FIDC	4.771.330,77
MULTIMERCADO - EXTERIOR	1.599.373,98
AÇÕES - EXTERIOR	1.571.696,54
IRF-M 1	1.167.655,13

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%

Investimentos x Meta Atuarial



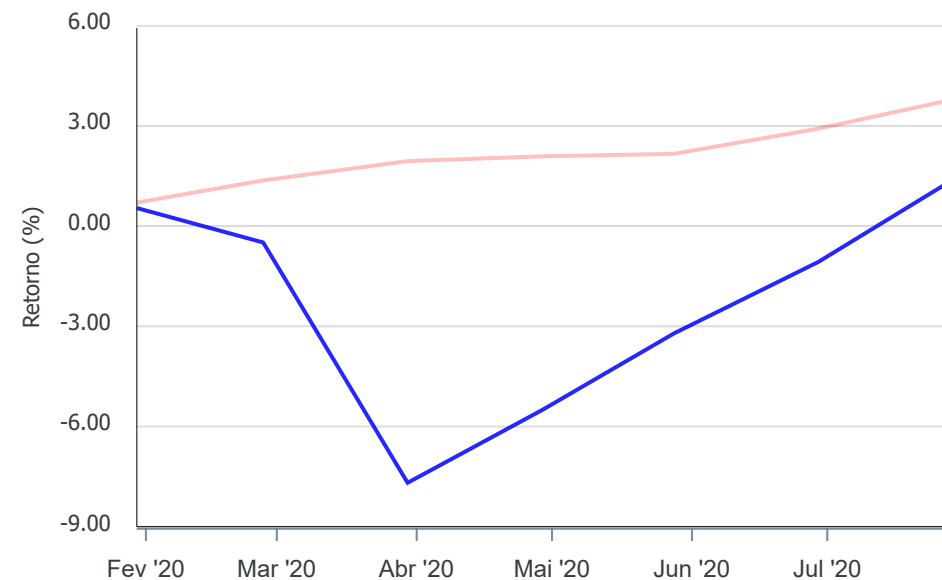
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
BBIF MASTER FIDC LP	189.171,24	0,00	0,00	218.440,91	29.269,67	15,47%	15,47%	25,41%
SAFRA IMA FIC RENDA FIXA	4.000.401,83	0,00	0,00	4.191.505,19	191.103,36	4,78%	4,78%	2,56%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	8.308.393,72	0,00	0,00	8.670.843,59	362.449,87	4,36%	4,36%	2,27%
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	6.049.436,17	0,00	0,00	6.258.397,08	208.960,91	3,45%	3,45%	1,84%
INFINITY LÔTUS FI RENDA FIXA LP	5.136.971,46	0,00	0,00	5.247.592,24	110.620,78	2,15%	2,15%	0,88%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	8.921.072,18	0,00	0,00	9.073.531,30	152.459,12	1,71%	1,71%	1,05%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA VI FI RENDA FIXA PREVIDEN...	3.208.610,37	0,00	0,00	3.244.465,35	35.854,98	1,12%	1,12%	1,01%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	15.757.990,68	0,00	0,00	15.911.993,73	154.003,05	0,98%	0,98%	0,92%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	10.088.771,01	22.633,24	80.000,00	10.129.785,85	98.381,60	0,97%	0,97%	0,83%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	19.737.881,50	0,00	0,00	19.928.791,12	190.909,62	0,97%	0,97%	0,81%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	7.245.581,36	0,00	0,00	7.310.540,50	64.959,14	0,90%	0,90%	1,06%
GGR PRIME I FIDC SÊNIOR 1	4.989.413,00	0,00	466.765,01	4.552.889,86	30.241,87	0,61%	-8,75%	14,75%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	6.715.759,55	3.190.000,00	1.095.000,00	8.870.624,01	59.864,46	0,60%	0,83%	0,77%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	11.134.907,84	0,00	0,00	11.196.316,08	61.408,24	0,55%	0,55%	0,26%
ITAÚ INSTITUCIONAL GLOBAL DINÂMICO FIC RENDA FIXA ...	5.120.356,74	0,00	0,00	5.140.139,11	19.782,37	0,39%	0,39%	0,28%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.164.847,25	0,00	0,00	1.167.655,13	2.807,88	0,24%	0,24%	0,15%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	22.607,88	20.609,38	23.283,13	19.949,01	14,88	0,03%	0,10%	0,00%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	257.439,00	3.017.144,24	2.723.585,60	551.250,91	253,27	0,01%	0,12%	0,00%
Total Renda Fixa	118.049.612,78	6.250.386,86	4.388.633,74	121.684.710,97	1.773.345,07	1,48%		1,56%

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
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	3.381.407,12	0,00	0,00	3.681.138,94	299.731,82	8,86%	8,86%	8,78%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	3.495.977,36	0,00	0,00	3.791.628,26	295.650,90	8,46%	8,46%	8,07%
FRANKLIN TEMPLETON VALOR E FVL FI AÇÕES	2.810.727,39	0,00	0,00	3.048.223,46	237.496,07	8,45%	8,45%	10,24%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8.103.881,15	0,00	0,00	8.782.684,02	678.802,87	8,38%	8,38%	8,98%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.856.014,47	0,00	0,00	3.094.277,94	238.263,47	8,34%	8,34%	7,62%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	2.790.625,09	0,00	0,00	3.006.568,38	215.943,29	7,74%	7,74%	9,77%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	2.292.478,86	0,00	0,00	2.465.274,01	172.795,15	7,54%	7,54%	8,75%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	2.380.623,17	0,00	0,00	2.532.435,38	151.812,21	6,38%	6,38%	9,60%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	1.514.795,70	0,00	0,00	1.599.373,98	84.578,28	5,58%	5,58%	6,38%
HIX CAPITAL INSTITUCIONAL FI AÇÕES	3.399.887,86	0,00	0,00	3.569.645,97	169.758,11	4,99%	4,99%	6,57%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	6.303.671,78	0,00	0,00	6.392.298,90	88.627,12	1,41%	1,41%	1,46%
DAYCOVAL MULTISTRATÉGIA FI MULTIMERCADO	5.261.845,48	0,00	0,00	5.287.410,12	25.564,64	0,49%	0,49%	0,56%
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	3.139.264,46	0,00	0,00	3.133.595,28	-5.669,18	-0,18%	-	-
BTG PACTUAL TIMBERLAND FUND I FICFIP	2.832.489,85	0,00	0,00	2.825.709,87	-6.779,98	-0,24%	-	-
Total Renda Variável	50.563.689,74	0,00	0,00	53.210.264,51	2.646.574,77	5,23%		6,72%

CRÉDITO E MERCADO

Engenharia Financeira

INSTITUTO MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS DE ITAÚNA - IMP
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/07/2020

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
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	1.540.538,66	0,00	0,00	1.571.696,54	31.157,88	2,02%	2,02%	9,83%
Total Renda Variável	1.540.538,66	0,00	0,00	1.571.696,54	31.157,88	2,02%		9,83%