

Relatório Analítico dos Investimentos

em janeiro de 2020

Este relatório atende a Portaria MTP Nº 1.467, de 2 de junho de 2022.

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2020)

CNPJ	Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Lei
25.078.994/0001-90	BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	2.495.145,56	5,25%	583	0,02%	7º I b
13.322.205/0001-35	BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REN...	D+1	Não há	114.197,50	0,24%	888	0,00%	7º I b
13.327.340/0001-73	BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF R...	D+2	Não há	2.544.496,82	5,36%	332	0,11%	7º I b
07.442.078/0001-05	BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REND...	D+1	Não há	1.353.060,67	2,85%	674	0,02%	7º I b
32.161.826/0001-29	BB IRF-M 1+ RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	665.496,08	1,40%	56	0,68%	7º I b
07.111.384/0001-69	BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REND...	D+1	Não há	46.393,91	0,10%	709	0,00%	7º I b
20.734.937/0001-06	BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	D+0	15/08/2018	292.021,56	0,61%	67	0,37%	7º I b
19.523.305/0001-06	BB TÍTULOS PÚBLICOS VII RESP LIMITADA FIF RENDA ...	D+0	15/08/2022	398.431,55	0,84%	165	0,06%	7º I b
25.069.955/0001-26	BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	18/08/2018	1.598.835,74	3,37%	24	1,66%	7º I b
23.215.097/0001-55	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FI...	D+0	Não há	1.073.458,62	2,26%	717	0,01%	7º I b
14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RESP ...	D+0	Não há	861.025,29	1,81%	969	0,01%	7º I b
10.577.503/0001-88	CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMI...	D+0	Não há	1.476.899,67	3,11%	359	0,07%	7º I b
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITAD...	D+0	Não há	2.514.618,06	5,29%	941	0,04%	7º I b
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMIT...	D+0	Não há	219.760,45	0,46%	1.361	0,00%	7º I b
14.508.605/0001-00	CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITAD...	D+0	Não há	378.452,78	0,80%	435	0,00%	7º I b
09.093.819/0001-15	ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC...	D+1	Não há	149.220,32	0,31%	57	0,01%	7º I b
13.077.415/0001-05	BB FLUXO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SIMPLE...	D+0	Não há	196.853,79	0,41%	737	0,01%	7º IV a
13.077.418/0001-49	BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFER...	D+0	Não há	7.009,50	0,01%	651	0,00%	7º IV a
20.216.216/0001-04	BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF...	D+1	Não há	298.196,07	0,63%	119	0,04%	7º IV a
14.508.643/0001-55	CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RESP LIMITADA FIF ...	D+0	Não há	590.709,08	1,24%	324	0,12%	7º IV a

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2020)

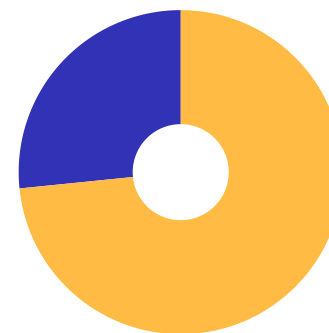
CNPJ	Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Lei
03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERE...	D+0	Não há	26.091,90	0,05%	684	0,00%	7º IV a
12.402.646/0001-84	IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	D+1002	Não há	2.115.599,24	4,45%	12	5,92%	7º IV a
05.073.656/0001-58	ITAÚ IMA-B ATIVO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIX...	D+1	Não há	146.030,57	0,31%	91	0,04%	7º IV a
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITA...	D+1	Não há	176.717,39	0,37%	288	0,00%	7º IV a
15.153.656/0001-11	MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1800	Não há	2.895.566,26	6,10%	11	2,70%	7º IV a
13.594.673/0001-69	TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	D+31 ou...	Não há	7.609.905,62	16,02%	15	3,64%	7º IV a
01.181.521/0001-55	CDB - BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.	S/Info	Não Informado	1.242.571,54	2,62%		0,00%	7º VI a
06.018.364/0001-85	PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	151.428,99	0,32%	98	0,18%	7º VII a
21.918.896/0001-62	CAIXA BRASIL IPCA XVI RESP LIMITADA FIF RENDA FI...	D+0	18/04/2018	878.398,50	1,85%	75	0,47%	7º VII b
73.899.759/0001-21	BB IBOVESPA INDEXADO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+4	Não há	1.792.231,49	3,77%	8.127	0,74%	8º I a
15.154.236/0001-50	CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA RESP LIMITADA FIF AÇÃO...	D+4	Não há	522.769,93	1,10%	36	0,00%	8º I b
08.973.942/0001-68	BB CONSUMO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+4	Não há	429.732,66	0,90%	14.868	0,11%	8º II a
05.100.191/0001-87	BB DIVIDENDOS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+4	Não há	763.917,78	1,61%	35.271	0,06%	8º II a
17.502.937/0001-68	CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR ...	D+4	Não há	617.786,63	1,30%	74	0,08%	8º II a
15.154.220/0001-47	CAIXA SMALL CAPS ATIVO RESP LIMITADA FIF AÇÕES	D+4	Não há	620.378,02	1,31%	18.810	0,04%	8º II a
13.155.995/0001-01	DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	D+15	Não há	580.324,94	1,22%	1.502	0,43%	8º II a
08.817.414/0001-10	ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	1.220.790,27	2,57%	51	0,00%	8º II a
23.731.629/0001-07	ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX RESP LIMITADA FIF CIC...	D+24	Não há	1.002.054,77	2,11%	165	0,00%	8º II a
18.366.002/0001-64	AUSTRO MULTIPAR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+1	96 meses	592.152,71	1,25%	33	0,61%	8º III
29.388.994/0001-47	CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MUL...	D+2	01/10/2020	579.747,08	1,22%	955	0,12%	8º III

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2020)

CNPJ	Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Lei
20.886.575/0001-60	FP2 FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	826.909,43	1,74%		0,00%	8º IV a
11.490.580/0001-69	GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	1.581.738,14	3,33%	33	0,59%	8º IV a
16.720.629/0001-46	IMOBILIÁRIO PARANÁ REC FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	31.399,46	0,07%	11	0,41%	8º IV a
13.584.584/0001-31	BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES RESP...	Não se ...	Não se aplica	65.713,30	0,14%		0,03%	8º IV b
17.098.794/0001-70	CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	46.642,09	0,10%		0,02%	8º IV b
14.631.148/0001-39	HAZ FII - ATCR11	Não se ...	Não se aplica	946.865,11	1,99%		1,35%	8º IV b
15.538.445/0001-05	SP DOWNTOWN FII - SPTW11	Não se ...	Não se aplica	86.920,00	0,18%		0,05%	8º IV b
14.410.722/0001-29	TIVIO RENDA IMOBILIÁRIA RESP LIMITADA FII - TVRI...	Não se ...	Não se aplica	16.409,00	0,03%		0,00%	8º IV b
20.887.259/0001-03	SINGAPORE FIC RENDA FIXA	D+31 ou...	1800 dias	2.350.260,43	4,95%	8	4,58%	NE
28.319.463/0001-30	AUSTRO INSTITUCIONAL PIPE BANCOS FIC AÇÕES	D+31	30/04/2021	314.173,26	0,66%	22	0,45%	NE
Total para cálculo dos limites da Resolução			47.505.509,53					
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			51.494,36	Artigo 6º				
PL Total			47.557.003,89					

Enquadramento e Política de Investimento (RENTA FIXA) - base (Janeiro / 2020)

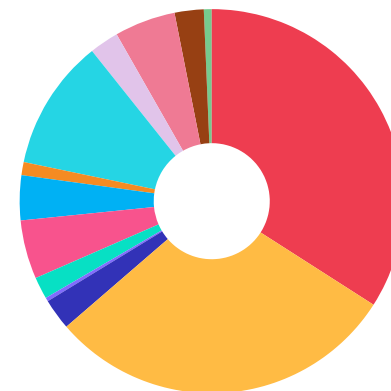
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	100,00%	16.181.514,58	34,06%	20,00%	30,00%	90,00%	26.573.444,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	28.503.305,72
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea a	40,00%	14.062.679,42	29,60%	10,00%	30,00%	40,00%	4.939.524,39
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea a	15,00%	1.242.571,54	2,62%	0,00%	0,00%	15,00%	5.883.254,89
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea a	5,00%	151.428,99	0,32%	0,00%	0,00%	5,00%	2.223.846,49
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea b	5,00%	878.398,50	1,85%	0,00%	0,00%	5,00%	1.496.876,98
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea c	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.375.275,48
Desenquadrado - RF	0,00%	2.350.260,43	4,95%	0,00%	0,00%	0,00%	-2.350.260,43
Total Renda Fixa	100,00%	34.866.853,46	73,40%	30,00%	70,00%	220,00%	



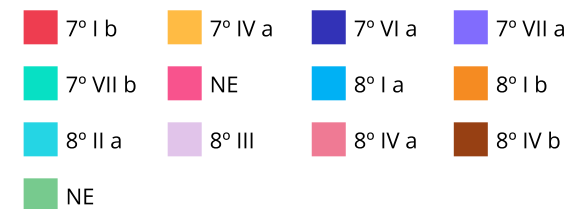
RENTA FIXA 34.866.853,46
RENTA VARIÁVEL 12.638.656,07

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Janeiro / 2020)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea a	30,00%	1.792.231,49	3,77%	0,00%	0,00%	5,00%	583.043,99
Artigo 8º, Inciso I, Alínea b	30,00%	522.769,93	1,10%	0,00%	0,00%	5,00%	1.852.505,55
Artigo 8º, Inciso II, Alínea a	20,00%	5.234.985,07	11,02%	7,00%	15,00%	20,00%	4.266.116,84
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	1.171.899,79	2,47%	3,00%	10,00%	10,00%	3.578.651,16
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea a	5,00%	2.440.047,03	5,14%	0,00%	0,00%	5,00%	-64.771,55
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea b	5,00%	1.162.549,50	2,45%	0,00%	5,00%	5,00%	1.212.725,98
Desenquadrado - RV	0,00%	314.173,26	0,66%	0,00%	0,00%	0,00%	-314.173,26
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	12.638.656,07	26,60%	10,00%	30,00%	50,00%	



Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2020			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.375.275,48
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2020		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	1.890.857,30	3,98	20,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea a	0,00	0,00	10,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea a	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	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	5,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea b	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea a	0,00	0,00	7,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	579.747,08	1,22	3,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea a	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea b	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	5,00

Enquadramento por Gestores - base (Janeiro / 2020)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
VERITAS CAPITAL MANAGEMENT	15.563.484,26	32,76	0,73
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	12.697.824,61	26,73	0,00
CAIXA DTVM S.A	10.406.738,10	21,91	0,00
GENIAL GESTÃO LTDA	1.668.658,14	3,51	0,02
SICREDI	1.242.571,54	2,62	0,00
ITAÚ DTVM	1.220.790,27	2,57	0,00
ITAÚ UNIBANCO	1.148.085,34	2,42	0,00
GRAPHEN INVESTIMENTOS	1.129.693,56	2,38	1,14
ARENA CAPITAL	826.909,43	1,74	-
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	580.324,94	1,22	0,02
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	325.937,71	0,69	0,00
AUSTRO CAPITAL	314.173,26	0,66	0,06
BANCO BRADESCO	298.196,07	0,63	-
ZION INVEST	65.713,30	0,14	0,01
TIVIO CAPITAL DISTRIBUIDORA DE...	16.409,00	0,03	0,00

Artigo 20º - 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) - (Resolução 4963)

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,54%	0,54%	1,76%	4,74%	11,02%	22,45%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,35%	0,35%	1,07%	2,47%	5,51%	12,80%	0,00%	0,22%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,35%	0,35%	1,07%	2,47%	5,51%	12,78%	0,00%	0,22%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REND...	0,46%	0,46%	1,57%	4,44%	10,30%	20,93%	0,55%	1,60%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENC...	0,39%	0,39%	1,75%	4,52%	10,29%	20,76%	0,55%	1,50%
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	0,72%	0,72%	3,37%	5,14%	10,47%	21,46%	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	0,81%	0,81%	1,16%	5,80%	15,24%	25,27%	0,97%	3,92%
IRF-M 1+ (Benchmark)	1,11%	1,11%	0,99%	5,27%	13,57%	27,70%	-	-
BB IRF-M 1+ RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,06%	1,06%	0,89%	5,03%	-	-	0,96%	-
IMA-B 5+ (Benchmark)	0,03%	0,03%	-1,54%	6,07%	22,33%	43,41%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FI...	-0,04%	-0,04%	-1,75%	5,77%	21,74%	42,13%	2,62%	9,49%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDE...	0,05%	0,05%	-1,45%	6,13%	22,08%	42,79%	2,59%	9,49%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,44%	0,44%	1,20%	3,05%	6,61%	14,04%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIX...	0,42%	0,42%	1,14%	2,93%	6,40%	13,64%	0,09%	0,40%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,56%	0,56%	1,51%	5,04%	12,06%	23,36%	-	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	0,56%	0,56%	1,40%	4,93%	11,79%	22,86%	0,66%	2,38%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,05%	0,05%	-0,63%	-6,45%	-23,75%	-14,88%	3,71%	18,04%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	0,54%	0,54%	1,47%	4,94%	11,80%	22,57%	0,64%	2,26%

IMA-B (Benchmark)	0,26%	0,26%	-0,24%	5,64%	18,11%	34,79%	-	-
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	0,55%	0,55%	0,79%	4,24%	10,67%	5,04%	1,53%	5,03%
ITAÚ IMA-B ATIVO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	0,21%	0,21%	-0,59%	5,76%	19,42%	35,88%	1,70%	7,17%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA ...	0,25%	0,25%	-0,36%	5,44%	17,72%	34,14%	1,67%	6,45%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCI...	0,26%	0,26%	-0,30%	5,54%	17,83%	34,11%	1,65%	6,42%
CDB - BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.	-	-	-	-	-	-	-	-
IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	-0,83%	-0,83%	-3,84%	-3,13%	1,73%	4,29%	3,25%	7,29%

IRF-M (Benchmark)	0,88%	0,88%	1,04%	4,50%	11,47%	23,54%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA ...	0,84%	0,84%	0,96%	4,33%	11,12%	22,99%	0,64%	2,63%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCI...	0,85%	0,85%	0,98%	4,39%	11,22%	23,04%	0,65%	2,60%

CDI (Benchmark)	0,38%	0,38%	1,14%	2,60%	5,78%	12,53%	-	-
SINGAPORE FIC RENDA FIXA	-0,50%	-0,50%	-1,03%	-6,39%	-18,44%	-12,08%	12,96%	12,26%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,49%	0,49%	0,50%	3,93%	11,38%	-	0,72%	3,08%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SI...	0,30%	0,30%	0,92%	2,17%	4,90%	10,67%	0,00%	0,22%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVID...	0,35%	0,35%	1,05%	2,45%	5,55%	12,19%	0,01%	0,24%
BB FLUXO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,29%	0,29%	0,87%	2,05%	4,65%	10,14%	0,00%	0,21%
CAIXA BRASIL RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,37%	0,37%	1,03%	2,44%	5,55%	12,08%	0,01%	0,26%
IPCA (Benchmark)	0,21%	0,21%	1,88%	2,05%	4,19%	8,13%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	0,82%	0,82%	0,91%	4,67%	14,10%	25,30%	0,64%	3,59%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA ...	0,34%	0,34%	1,04%	2,66%	9,69%	19,74%	0,00%	2,43%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	0,20%	0,20%	1,55%	3,91%	9,21%	20,11%	0,38%	1,15%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	-0,54%	-0,54%	-0,90%	-1,39%	-9,49%	-16,62%	0,56%	6,01%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2020 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
SMLL (Benchmark)	0,45%	0,45%	18,98%	24,82%	45,25%	64,69%	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO RESP LIMITADA FIF AÇÕES	0,50%	0,50%	18,51%	24,23%	41,26%	56,18%	9,31%	13,95%
IPCA + 9,00% ao ano (Benchmark)	0,97%	0,97%	4,10%	6,66%	13,61%	28,42%	-	-
FP2 FIP MULTIESTRATÉGIA	-	-	-	-	-	-	-	-
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	1,09%	1,09%	4,45%	7,40%	15,18%	31,97%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	-	-	-	-	-	-	0,01%	0,39%
IPCA (Benchmark)	0,21%	0,21%	1,88%	2,05%	4,19%	8,13%	-	-
AUSTRO MULTIPAR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-0,14%	-0,14%	-0,40%	-0,81%	-1,76%	-10,25%	0,09%	0,18%
IMOBILIÁRIO PARANÁ REC FIP MULTIESTRATÉGIA	-	-	-	-	-	-	16,52%	0,38%
IFIX (Benchmark)	-3,76%	-3,76%	10,22%	15,71%	27,70%	34,66%	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES RESP LIMITADA FII - C...	-10,85%	-10,85%	-14,18%	-27,67%	-34,29%	-48,89%	9,86%	45,74%
SP DOWNTOWN FII - SPTW11	-28,18%	-28,18%	-4,92%	0,23%	-	-	32,49%	43,91%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	17,46%	17,46%	46,57%	62,49%	67,46%	-84,98%	22,09%	23,44%
TIVIO RENDA IMOBILIÁRIA RESP LIMITADA FII - TVRI11	-4,37%	-4,37%	6,08%	9,76%	17,23%	14,35%	8,13%	9,59%
HAZ FII - ATCR11	-0,08%	-0,08%	373,73%	373,73%	373,73%	373,73%	-	-

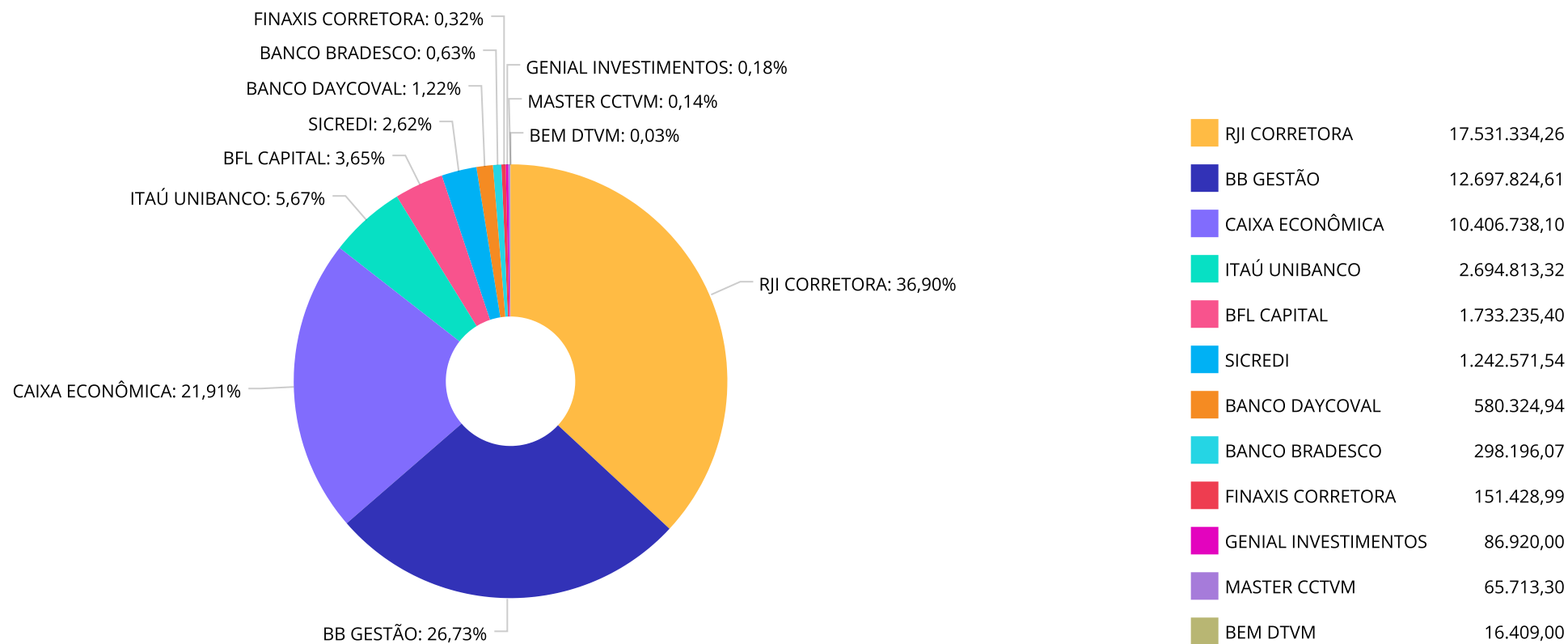
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2020 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDIV (Benchmark)	-1,58%	-1,58%	10,79%	17,15%	27,01%	50,76%	-	-
BB DIVIDENDOS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	-0,42%	-0,42%	7,87%	11,61%	18,23%	36,18%	8,34%	9,18%

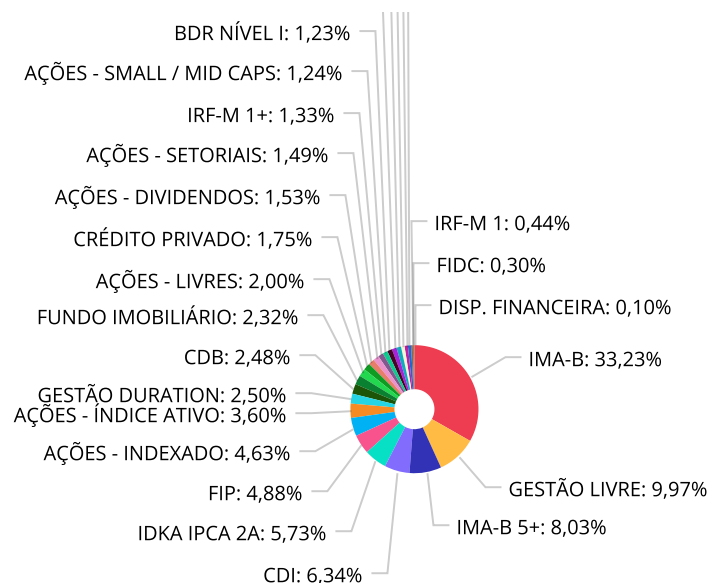
Ibovespa (Benchmark)	-1,63%	-1,63%	6,10%	11,74%	16,80%	33,97%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	1,47%	1,47%	15,18%	17,49%	31,03%	65,96%	9,71%	11,12%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA RESP LIMITADA FIF AÇÕES	-1,71%	-1,71%	5,96%	11,27%	16,13%	32,41%	9,61%	8,64%
BB CONSUMO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	3,73%	3,73%	14,87%	20,96%	41,94%	40,39%	10,15%	14,26%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	-1,56%	-1,56%	5,35%	12,35%	19,54%	42,43%	9,98%	8,07%
BB IBOVESPA INDEXADO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	-1,82%	-1,82%	5,51%	10,51%	14,13%	28,33%	9,95%	8,70%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	0,68%	0,68%	10,42%	16,16%	23,73%	43,87%	9,13%	9,05%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	0,32%	0,32%	1,50%	3,09%	7,26%	-	0,13%	1,11%
AUSTRO INSTITUCIONAL PIPE BANCOS FIC AÇÕES	-3,37%	-3,37%	-3,09%	-7,22%	-2,50%	-	5,38%	10,52%

Global BDRX (Benchmark)	6,47%	6,47%	14,32%	22,76%	43,40%	59,20%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR NÍVEL I	6,52%	6,52%	13,98%	22,36%	42,28%	55,39%	5,77%	15,49%

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



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



IMA-B	16.634.780,42	GESTÃO LIVRE	4.990.291,12	IMA-B 5+	4.021.396,49
CDI	3.170.924,70	IDKA IPCA 2A	2.866.080,09	FIP	2.440.047,03
AÇÕES - INDEXADO	2.315.001,42	AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	1.801.115,21	GESTÃO DURATION	1.250.176,01
CDB	1.242.571,54	FUNDO IMOBILIÁRIO	1.162.549,50	AÇÕES - LIVRES	1.002.054,77
CRÉDITO PRIVADO	878.398,50	AÇÕES - DIVIDENDOS	763.917,78	AÇÕES - SETORIAIS	743.905,92
IRF-M 1+	665.496,08	AÇÕES - SMALL / MID CAPS	620.378,02	BDR NÍVEL I	617.786,63
MULTIMERCADO - CRÉDITO PRIVADO	592.152,71	MULTIMERCADO - CONSERVADOR	579.747,08	IMA-B 5	447.416,39
IRF-M	424.846,69	VÉRTICE LONGO	398.431,55	IRF-M 1	219.760,45
FIDC	151.428,99	DISP. FINANCEIRA	51.494,36		

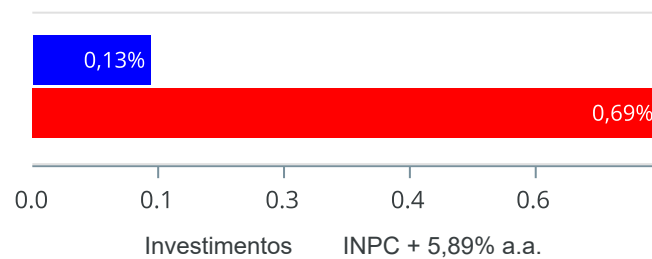
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Janeiro / 2020)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
------------------	------------	--------	------	-------------	------------	---------	----------	----------

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2020

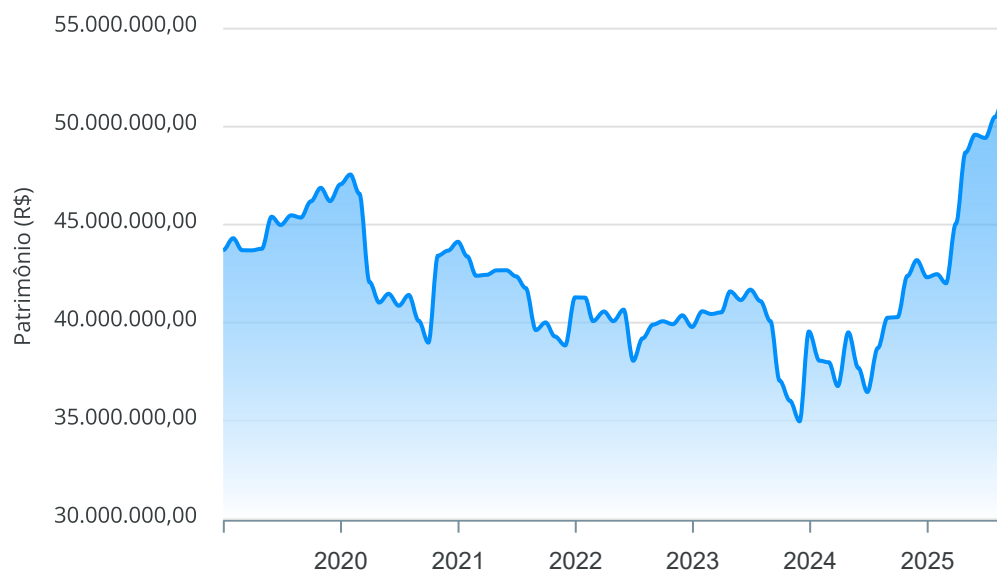
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	47.055.425,39	2.422.019,00	2.034.188,91	47.505.509,53	62.254,05	62.254,05	0,13%	0,13%	0,69%	0,69%	18,97%	3,57%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



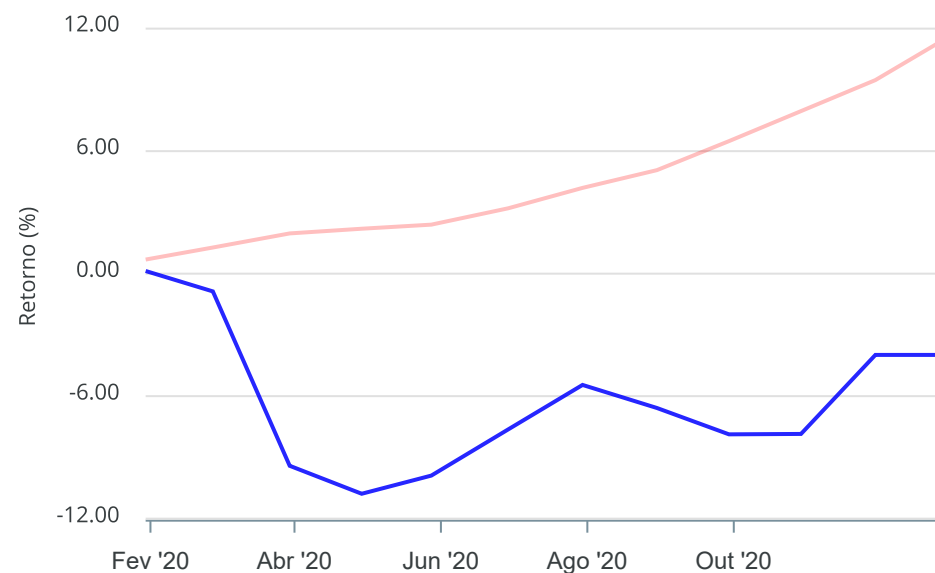
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



Investimentos Meta de Rentabilidade ☐ CDI ☐ IMA-B

☐ IMA-B 5 ☐ IMA-B 5+ ☐ IMA Geral ☐ IRF-M ☐ IRF-M 1

☐ IRF-M 1+ ☐ Ibovespa ☐ IBX ☐ SMLL ☐ IDIV

Investimentos Meta de Rentabilidade ☐ 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 Janeiro/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB IRF-M 1+ RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENC...	658.538,15	0,00	0,00	665.496,08	6.957,93	1,06%	1,06%	0,96%
CDB - BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.	730.689,44	500.000,00	0,00	1.242.571,54	11.882,10	0,97%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA ...	46.000,93	0,00	0,00	46.393,91	392,98	0,85%	0,85%	0,65%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA ...	375.309,15	0,00	0,00	378.452,78	3.143,63	0,84%	0,84%	0,64%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FIF ...	1.064.735,23	0,00	0,00	1.073.458,62	8.723,39	0,82%	0,82%	0,64%
CAIXA BRASIL IPCA XVI RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA...	871.338,00	0,00	0,00	878.398,50	7.060,50	0,81%	0,81%	0,97%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF C...	296.541,04	0,00	0,00	298.196,07	1.655,03	0,56%	0,56%	0,66%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	7.568.482,34	0,00	0,00	7.609.905,62	41.423,28	0,55%	0,55%	1,53%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC R...	148.418,84	0,00	0,00	149.220,32	801,48	0,54%	0,54%	0,64%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.483.081,74	0,00	0,00	2.495.145,56	12.063,82	0,49%	0,49%	0,72%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RESP LI...	857.106,99	0,00	0,00	861.025,29	3.918,30	0,46%	0,46%	0,55%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITAD...	218.835,71	0,00	0,00	219.760,45	924,74	0,42%	0,42%	0,09%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA...	113.759,54	0,00	0,00	114.197,50	437,96	0,38%	0,38%	0,55%
CAIXA BRASIL RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERENC...	25.995,51	0,00	0,00	26.091,90	96,39	0,37%	0,37%	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	1.593.195,68	0,00	0,00	1.598.835,74	5.640,06	0,35%	0,35%	0,00%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRI...	290.992,55	0,00	0,00	292.021,56	1.029,01	0,35%	0,35%	0,00%
BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFEREN...	6.985,06	0,00	0,00	7.009,50	24,44	0,35%	0,35%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA...	176.117,25	0,00	0,00	176.717,39	600,14	0,34%	0,34%	0,00%
BB FLUXO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SIMPLES ...	147.813,37	48.511,63	0,00	196.853,79	528,79	0,27%	0,29%	0,00%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA ...	1.349.552,00	0,00	0,00	1.353.060,67	3.508,67	0,26%	0,26%	1,65%

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA ...	2.508.430,74	0,00	0,00	2.514.618,06	6.187,32	0,25%	0,25%	1,67%
ITAÚ IMA-B ATIVO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	145.731,72	0,00	0,00	146.030,57	298,85	0,21%	0,21%	1,70%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII RESP LIMITADA FIF RENDA FI...	397.649,73	0,00	0,00	398.431,55	781,82	0,20%	0,20%	0,38%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RESP LIMITADA FIF CI...	180.209,07	1.873.507,37	1.464.214,45	590.709,08	1.207,09	0,06%	0,30%	0,00%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REN...	2.543.291,44	0,00	0,00	2.544.496,82	1.205,38	0,05%	0,05%	2,59%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2.894.228,36	0,00	0,00	2.895.566,26	1.337,90	0,05%	0,05%	3,71%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITA...	1.477.469,21	0,00	0,00	1.476.899,67	-569,54	-0,04%	-0,04%	2,62%
SINGAPORE FIC RENDA FIXA	2.362.137,71	0,00	0,00	2.350.260,43	-11.877,28	-0,50%	-0,50%	12,96%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	152.249,16	0,00	0,00	151.428,99	-820,17	-0,54%	-0,54%	0,56%
IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	2.133.232,21	0,00	0,00	2.115.599,24	-17.632,97	-0,83%	-0,32%	3,25%
Total Renda Fixa	33.818.117,87	2.422.019,00	1.464.214,45	34.866.853,46	90.931,04	0,26%		2,44%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB CONSUMO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	414.299,67	0,00	0,00	429.732,66	15.432,99	3,73%	3,73%	10,15%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX RESP LIMITADA FIF CIC A...	987.566,40	0,00	0,00	1.002.054,77	14.488,37	1,47%	1,47%	9,71%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	1.212.594,53	0,00	0,00	1.220.790,27	8.195,74	0,68%	0,68%	9,13%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO RESP LIMITADA FIF AÇÕES	617.279,24	0,00	0,00	620.378,02	3.098,78	0,50%	0,50%	9,31%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTI...	577.917,00	0,00	0,00	579.747,08	1.830,08	0,32%	0,32%	0,13%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MUL...	565.235,00	0,00	565.862,50	0,00	627,50	0,11%	-	-
HAZ FII - ATCR11	947.587,88	0,00	1.116,18	946.865,11	393,41	0,04%	0,00%	-
FP2 FIP MULTIESTRATÉGIA	826.874,91	0,00	0,00	826.909,43	34,52	0,00%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	1.582.243,92	0,00	0,00	1.581.738,14	-505,78	-0,03%	-0,03%	0,01%
AUSTRO MULTIPAR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	592.977,13	0,00	0,00	592.152,71	-824,42	-0,14%	-0,08%	0,09%
BB DIVIDENDOS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	767.131,64	0,00	0,00	763.917,78	-3.213,86	-0,42%	-0,42%	8,34%
IMOBILIÁRIO PARANÁ REC FIP MULTIESTRATÉGIA	31.539,66	0,00	0,00	31.399,46	-140,20	-0,44%	-0,44%	16,52%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	589.538,02	0,00	0,00	580.324,94	-9.213,08	-1,56%	-1,56%	9,98%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA RESP LIMITADA FIF AÇÕES	531.884,04	0,00	0,00	522.769,93	-9.114,11	-1,71%	-1,71%	9,61%
BB IBOVESPA INDEXADO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	1.825.396,17	0,00	0,00	1.792.231,49	-33.164,68	-1,82%	-1,82%	9,95%
AUSTRO INSTITUCIONAL PIPE BANCOS FIC AÇÕES	325.131,80	0,00	0,00	314.173,26	-10.958,54	-3,37%	-3,37%	5,38%
TIVIO RENDA IMOBILIÁRIA RESP LIMITADA FII - TVRI11	17.111,00	0,00	105,78	16.409,00	-596,22	-3,48%	-4,36%	8,13%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	50.007,12	0,00	1.620,00	46.642,09	-1.745,03	-3,49%	17,45%	22,09%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES RESP L...	73.713,18	0,00	0,00	65.713,30	-7.999,88	-10,85%	-10,85%	9,86%
SP DOWNTOWN FII - SPTW11	121.300,00	0,00	1.270,00	86.920,00	-33.110,00	-27,30%	-28,18%	32,49%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
Total Renda Variável	12.657.328,31	0,00	569.974,46	12.020.869,44	-66.484,41	-0,53%		7,12%

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR NÍ...	579.979,21	0,00	0,00	617.786,63	37.807,42	6,52%	6,52%	5,77%
Total Exterior	579.979,21	0,00	0,00	617.786,63	37.807,42	6,52%		5,77%

Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da CRÉDITO E MERCADO CONSULTORIA DE INVESTIMENTOS.. As informações aqui contidas, tem por somente, o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre o(s) produto(s) mencionado(s), entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros exigidos legalmente. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas aos objetivos, aos riscos e à política de investimento do(s) produto(s). Todas as informações podem ser obtidas com os responsáveis pela distribuição, administração, gestão ou no próprio site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários) através do link: <https://www.gov.br/cvm/pt-br>.

Sua elaboração buscou atender os objetivos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil de investidor.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas aos investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de Consultoria de Valores Mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe a Consultoria de Valores Mobiliários a prestação dos serviços de ORIENTAÇÃO, RECOMENDAÇÃO E ACONSELHAMENTO, DE FORMA PROFISSIONAL, INDEPENDENTE E INDIVIDUALIZADA, SOBRE INVESTIMENTOS NO MERCADO DE VALORES MOBILIÁRIOS, CUJA ADOÇÃO E IMPLEMENTAÇÃO SEJAM EXCLUSIVAS DO CLIENTE (Resolução CVM nº 19/2021).

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no Art. 3º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria MTP nº 1.467/2022, art. 84, inciso III, alínea "a".

Os RPPS DEVEM, independente da contratação de Consultoria de Valores Mobiliários, se adequar às normativas pertinentes e principalmente a Portaria MTP nº 1.467/2022 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963/2021, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.

Relatório Analítico dos Investimentos

em fevereiro de 2020

Este relatório atende a Portaria MTP Nº 1.467, de 2 de junho de 2022.

Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 2020)

CNPJ	Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Lei
25.078.994/0001-90	BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	2.506.523,22	5,39%	593	0,02%	7º I b
13.322.205/0001-35	BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REN...	D+1	Não há	114.914,85	0,25%	888	0,00%	7º I b
13.327.340/0001-73	BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF R...	D+2	Não há	2.552.105,67	5,48%	316	0,11%	7º I b
07.442.078/0001-05	BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REND...	D+1	Não há	1.358.971,66	2,92%	679	0,02%	7º I b
32.161.826/0001-29	BB IRF-M 1+ RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	670.655,25	1,44%	70	0,46%	7º I b
07.111.384/0001-69	BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REND...	D+1	Não há	46.687,49	0,10%	707	0,00%	7º I b
20.734.937/0001-06	BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	D+0	15/08/2018	292.824,13	0,63%	66	0,39%	7º I b
19.523.305/0001-06	BB TÍTULOS PÚBLICOS VII RESP LIMITADA FIF RENDA ...	D+0	15/08/2022	389.596,11	0,84%	165	0,06%	7º I b
25.069.955/0001-26	BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	18/08/2018	1.603.240,15	3,45%	24	1,95%	7º I b
23.215.097/0001-55	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FI...	D+0	Não há	579.938,44	1,25%	731	0,01%	7º I b
14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RESP ...	D+0	Não há	866.203,97	1,86%	968	0,01%	7º I b
10.577.503/0001-88	CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMI...	D+0	Não há	1.481.203,29	3,18%	351	0,06%	7º I b
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITAD...	D+0	Não há	2.525.655,27	5,43%	941	0,04%	7º I b
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMIT...	D+0	Não há	220.558,74	0,47%	1.359	0,00%	7º I b
14.508.605/0001-00	CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITAD...	D+0	Não há	380.846,23	0,82%	429	0,00%	7º I b
09.093.819/0001-15	ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC...	D+1	Não há	150.156,97	0,32%	57	0,01%	7º I b
13.077.415/0001-05	BB FLUXO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SIMPLE...	D+0	Não há	512.895,72	1,10%	740	0,04%	7º IV a
13.077.418/0001-49	BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFER...	D+0	Não há	7.028,64	0,02%	644	0,00%	7º IV a
20.216.216/0001-04	BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF...	D+1	Não há	300.147,66	0,64%	118	0,04%	7º IV a
14.508.643/0001-55	CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RESP LIMITADA FIF ...	D+0	Não há	295.757,73	0,64%	321	0,06%	7º IV a

Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 2020)

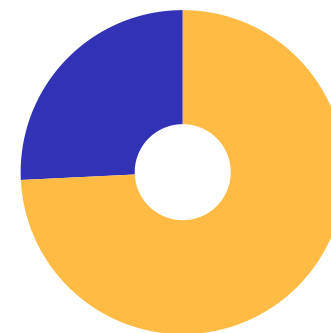
CNPJ	Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Lei
03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERE...	D+0	Não há	26.163,35	0,06%	684	0,00%	7º IV a
12.402.646/0001-84	IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	D+1002	Não há	2.118.181,44	4,55%	12	5,95%	7º IV a
05.073.656/0001-58	ITAÚ IMA-B ATIVO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIX...	D+1	Não há	147.051,89	0,32%	95	0,04%	7º IV a
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITA...	D+1	Não há	177.172,66	0,38%	283	0,00%	7º IV a
15.153.656/0001-11	MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1800	Não há	2.903.767,08	6,24%	11	2,70%	7º IV a
13.594.673/0001-69	TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	D+31 ou...	Não há	7.674.753,66	16,49%	15	3,65%	7º IV a
01.181.521/0001-55	CDB - BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.	S/Info	Não Informado	1.252.616,73	2,69%		0,00%	7º VI a
06.018.364/0001-85	PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	151.150,57	0,32%	98	0,18%	7º VII a
21.918.896/0001-62	CAIXA BRASIL IPCA XVI RESP LIMITADA FIF RENDA FI...	D+0	18/04/2018	884.864,50	1,90%	75	0,47%	7º VII b
73.899.759/0001-21	BB IBOVESPA INDEXADO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+4	Não há	1.639.376,92	3,52%	7.913	0,73%	8º I a
15.154.236/0001-50	CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA RESP LIMITADA FIF AÇÃO...	D+4	Não há	478.674,16	1,03%	37	0,00%	8º I b
08.973.942/0001-68	BB CONSUMO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+4	Não há	387.328,32	0,83%	16.087	0,10%	8º II a
05.100.191/0001-87	BB DIVIDENDOS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+4	Não há	697.260,71	1,50%	34.960	0,06%	8º II a
17.502.937/0001-68	CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR ...	D+4	Não há	582.664,82	1,25%	83	0,07%	8º II a
15.154.220/0001-47	CAIXA SMALL CAPS ATIVO RESP LIMITADA FIF AÇÕES	D+4	Não há	567.028,88	1,22%	20.282	0,04%	8º II a
13.155.995/0001-01	DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	D+15	Não há	527.883,26	1,13%	2.252	0,36%	8º II a
08.817.414/0001-10	ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	1.125.862,83	2,42%	53	0,00%	8º II a
23.731.629/0001-07	ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX RESP LIMITADA FIF CIC...	D+24	Não há	909.203,37	1,95%	165	0,00%	8º II a
18.366.002/0001-64	AUSTRO MULTIPAR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+1	96 meses	586.936,72	1,26%	33	0,61%	8º III
29.388.994/0001-47	CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MUL...	D+2	01/10/2020	581.293,95	1,25%	955	0,12%	8º III

Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 2020)

CNPJ	Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Lei
20.886.575/0001-60	FP2 FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	826.853,21	1,78%		0,00%	8º IV a
11.490.580/0001-69	GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	1.581.738,14	3,40%		0,00%	8º IV a
16.720.629/0001-46	IMOBILIÁRIO PARANÁ REC FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	31.259,63	0,07%	11	0,41%	8º IV a
13.584.584/0001-31	BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES RESP...	Não se ...	Não se aplica	67.998,98	0,15%		0,03%	8º IV b
17.098.794/0001-70	CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	44.764,03	0,10%		0,02%	8º IV b
14.631.148/0001-39	HAZ FII - ATCR11	Não se ...	Não se aplica	948.410,34	2,04%		1,35%	8º IV b
15.538.445/0001-05	SP DOWNTOWN FII - SPTW11	Não se ...	Não se aplica	85.690,00	0,18%		0,05%	8º IV b
14.410.722/0001-29	TIVIO RENDA IMOBILIÁRIA RESP LIMITADA FII - TVRI...	Não se ...	Não se aplica	16.170,00	0,03%		0,00%	8º IV b
20.887.259/0001-03	SINGAPORE FIC RENDA FIXA	D+31 ou...	1800 dias	2.352.532,40	5,06%	8	4,58%	NE
28.319.463/0001-30	AUSTRO INSTITUCIONAL PIPE BANCOS FIC AÇÕES	D+31	30/04/2021	305.816,55	0,66%	22	0,45%	NE
Total para cálculo dos limites da Resolução			46.536.380,29					
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			43.137,77	Artigo 6º				
PL Total			46.579.518,06					

Enquadramento e Política de Investimento (RENTA FIXA) - base (Fevereiro / 2020)

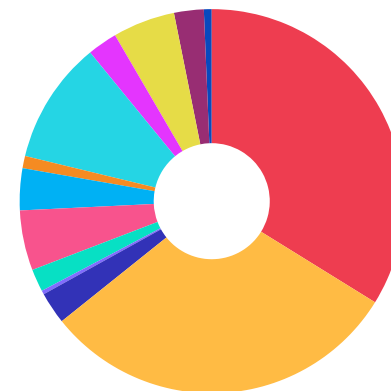
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	100,00%	15.740.081,44	33,82%	20,00%	30,00%	90,00%	26.142.660,82
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	27.921.828,17
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea a	40,00%	14.162.919,83	30,43%	10,00%	30,00%	40,00%	4.451.632,29
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea a	15,00%	1.252.616,73	2,69%	0,00%	0,00%	15,00%	5.727.840,31
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea a	5,00%	151.150,57	0,32%	0,00%	0,00%	5,00%	2.175.668,44
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea b	5,00%	884.864,50	1,90%	0,00%	0,00%	5,00%	1.441.954,51
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea c	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.326.819,01
Desenquadrado - RF	0,00%	2.352.532,40	5,06%	0,00%	0,00%	0,00%	-2.352.532,40
Total Renda Fixa	100,00%	34.544.165,47	74,23%	30,00%	70,00%	220,00%	



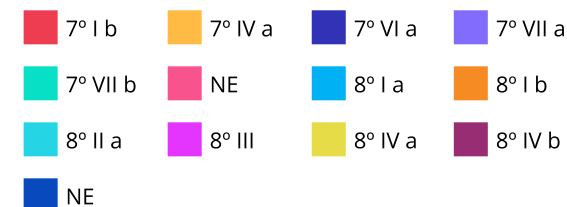
RENTA FIXA 34.544.165,47
RENTA VARIÁVEL 11.992.214,82

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Fevereiro / 2020)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea a	30,00%	1.639.376,92	3,52%	0,00%	0,00%	5,00%	687.442,09
Artigo 8º, Inciso I, Alínea b	30,00%	478.674,16	1,03%	0,00%	0,00%	5,00%	1.848.144,85
Artigo 8º, Inciso II, Alínea a	20,00%	4.797.232,19	10,31%	7,00%	15,00%	20,00%	4.510.043,87
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	1.168.230,67	2,51%	3,00%	10,00%	10,00%	3.485.407,36
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea a	5,00%	2.439.850,98	5,24%	0,00%	0,00%	5,00%	-113.031,97
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea b	5,00%	1.163.033,35	2,50%	0,00%	5,00%	5,00%	1.163.785,66
Desenquadrado - RV	0,00%	305.816,55	0,66%	0,00%	0,00%	0,00%	-305.816,55
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	11.992.214,82	25,77%	10,00%	30,00%	50,00%	



Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2020			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.326.819,01
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2020		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	1.896.064,28	4,07	20,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea a	0,00	0,00	10,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea a	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	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	5,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea b	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea a	0,00	0,00	7,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	581.293,95	1,25	3,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea a	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea b	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	5,00

Enquadramento por Gestores - base (Fevereiro / 2020)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
VERITAS CAPITAL MANAGEMENT	15.636.171,30	33,60	0,65
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	12.779.408,84	27,46	0,00
CAIXA DTVM S.A	9.515.617,36	20,45	0,00
GENIAL GESTÃO LTDA	1.667.428,14	3,58	0,03
SICREDI	1.252.616,73	2,69	0,00
GRAPHEN INVESTIMENTOS	1.130.820,54	2,43	1,14
ITAÚ DTVM	1.125.862,83	2,42	0,00
ITAÚ UNIBANCO	1.056.255,26	2,27	0,00
ARENA CAPITAL	826.853,21	1,78	-
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	527.883,26	1,13	0,02
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	327.329,63	0,70	0,00
AUSTRO CAPITAL	305.816,55	0,66	0,12
BANCO BRADESCO	300.147,66	0,64	-
ZION INVEST	67.998,98	0,15	0,01
TIVIO CAPITAL DISTRIBUIDORA DE...	16.170,00	0,03	0,00

Artigo 20º - 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) - (Resolução 4963)

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,69%	1,22%	2,44%	5,37%	11,19%	22,52%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,28%	0,63%	0,99%	2,26%	5,31%	12,84%	0,00%	0,28%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,28%	0,63%	0,98%	2,26%	5,30%	12,81%	0,00%	0,28%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REND...	0,60%	1,06%	2,17%	4,96%	10,35%	20,98%	0,69%	1,59%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENC...	0,63%	1,02%	2,18%	5,13%	10,31%	20,85%	0,67%	1,50%
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	0,67%	1,39%	3,06%	5,19%	10,22%	21,38%	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	0,74%	1,55%	3,04%	6,60%	15,62%	25,66%	1,46%	3,86%
IRF-M 1+ (Benchmark)	0,80%	1,92%	2,66%	6,01%	14,22%	27,05%	-	-
BB IRF-M 1+ RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,78%	1,84%	2,55%	5,83%	-	-	1,40%	-
IMA-B 5+ (Benchmark)	0,32%	0,35%	2,96%	7,23%	22,04%	43,07%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FI...	0,29%	0,25%	2,82%	6,92%	21,46%	41,77%	3,75%	9,52%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDE...	0,30%	0,35%	3,08%	7,29%	21,88%	42,45%	3,74%	9,51%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,38%	0,82%	1,25%	2,87%	6,52%	13,85%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIX...	0,36%	0,79%	1,19%	2,77%	6,31%	13,44%	0,07%	0,43%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,64%	1,20%	2,45%	5,66%	12,17%	23,49%	-	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	0,65%	1,22%	2,46%	5,61%	11,98%	22,96%	0,92%	2,35%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,28%	0,33%	-0,04%	-2,04%	-23,83%	-15,06%	0,69%	18,03%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	0,63%	1,17%	2,40%	5,56%	11,93%	22,72%	0,85%	2,24%

IMA-B (Benchmark)	0,45%	0,71%	2,73%	6,54%	18,00%	34,65%	-	-
CDB - BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.	-	-	-	-	-	-	-	-
IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	0,12%	-0,71%	-0,23%	-0,32%	2,23%	4,05%	4,32%	7,32%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	0,85%	1,40%	3,05%	5,46%	13,50%	5,39%	2,38%	4,27%
ITAÚ IMA-B ATIVO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	0,70%	0,91%	2,97%	6,97%	19,63%	36,12%	2,66%	7,14%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA ...	0,44%	0,69%	2,69%	6,35%	17,63%	34,01%	2,42%	6,46%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCI...	0,44%	0,70%	2,69%	6,44%	17,76%	33,99%	2,42%	6,43%

IRF-M (Benchmark)	0,65%	1,53%	2,17%	4,91%	11,86%	22,99%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA ...	0,63%	1,48%	2,10%	4,79%	11,51%	22,34%	0,91%	2,56%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCI...	0,63%	1,49%	2,11%	4,80%	11,62%	22,46%	0,92%	2,53%

CDI (Benchmark)	0,29%	0,67%	1,05%	2,39%	5,57%	12,34%	-	-
BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVID...	0,27%	0,62%	0,98%	2,23%	5,33%	11,98%	0,02%	0,30%
BB FLUXO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,22%	0,50%	0,79%	1,85%	4,45%	9,95%	0,01%	0,26%
CAIXA BRASIL RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,27%	0,65%	1,00%	2,22%	5,33%	11,90%	0,02%	0,31%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
SINGAPORE FIC RENDA FIXA	0,10%	-0,41%	-0,64%	-2,04%	-18,70%	-13,59%	1,08%	12,21%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,46%	0,94%	1,91%	4,31%	11,46%	-	1,08%	3,06%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SI...	0,23%	0,53%	0,84%	1,97%	4,70%	10,48%	0,00%	0,27%
IPCA (Benchmark)	0,25%	0,46%	1,62%	2,20%	4,00%	8,05%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	0,62%	1,44%	2,04%	5,45%	14,23%	25,27%	0,91%	3,57%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA ...	0,26%	0,60%	0,95%	2,60%	9,60%	19,17%	0,01%	2,45%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	0,41%	0,61%	1,53%	4,15%	9,09%	20,06%	0,39%	1,18%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	-0,18%	-0,72%	-0,88%	-1,40%	-9,51%	-13,94%	0,04%	6,01%

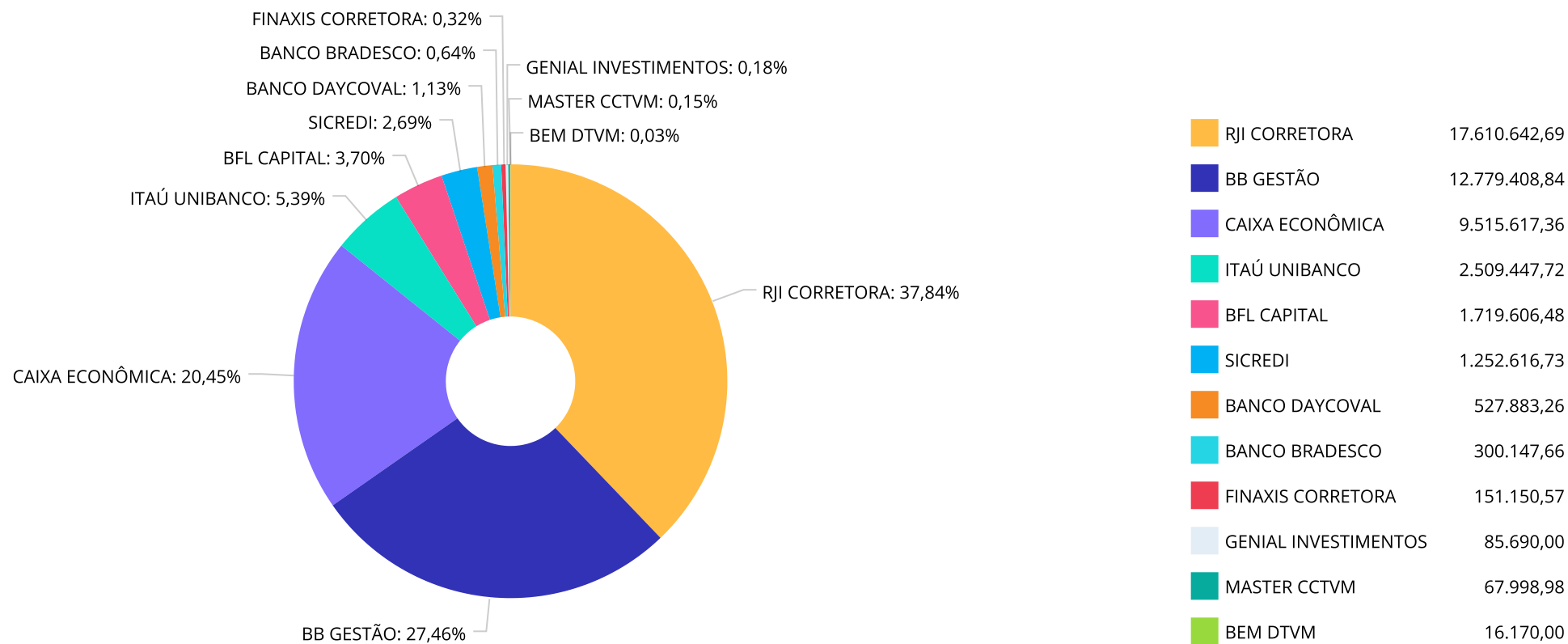
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2020 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	-5,70%	0,39%	-1,13%	9,15%	27,61%	52,03%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR NÍVEL I	-5,69%	0,46%	-1,31%	8,85%	26,84%	48,66%	13,66%	17,42%
Ibovespa (Benchmark)	-8,43%	-9,92%	-3,75%	3,00%	8,98%	22,05%	-	-
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	-9,04%	-10,46%	-4,50%	1,84%	10,24%	27,32%	15,61%	13,13%
BB IBOVESPA INDEXADO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	-8,53%	-10,19%	-4,18%	1,87%	6,52%	16,92%	15,52%	12,77%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	-7,78%	-7,15%	0,53%	6,88%	15,97%	31,15%	15,11%	12,89%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	0,27%	0,58%	0,91%	2,99%	7,33%	-	0,09%	1,09%
AUSTRO INSTITUCIONAL PIPE BANCOS FIC AÇÕES	-2,66%	-5,94%	-5,22%	-8,85%	-10,94%	-	11,48%	7,76%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	-9,27%	-7,94%	1,46%	4,94%	20,69%	47,79%	15,43%	15,77%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA RESP LIMITADA FIF AÇÕES	-8,44%	-10,00%	-3,94%	2,67%	8,29%	20,64%	15,07%	12,78%
BB CONSUMO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	-9,87%	-6,51%	0,67%	4,13%	33,63%	31,23%	16,21%	18,00%
IDIV (Benchmark)	-6,18%	-7,66%	1,56%	7,52%	21,63%	42,31%	-	-
BB DIVIDENDOS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	-8,73%	-9,11%	-1,64%	1,17%	10,05%	23,89%	14,56%	13,43%
IFIX (Benchmark)	-3,69%	-7,31%	2,54%	11,56%	21,74%	28,23%	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES RESP LIMITADA FII - C...	3,48%	-7,75%	13,33%	-23,72%	-30,00%	-41,95%	12,26%	46,15%
SP DOWNTOWN FII - SPTW11	-2,22%	-29,77%	-13,13%	0,81%	-	-	13,30%	44,03%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	-15,77%	-1,07%	8,78%	34,37%	42,66%	-87,05%	34,34%	31,08%

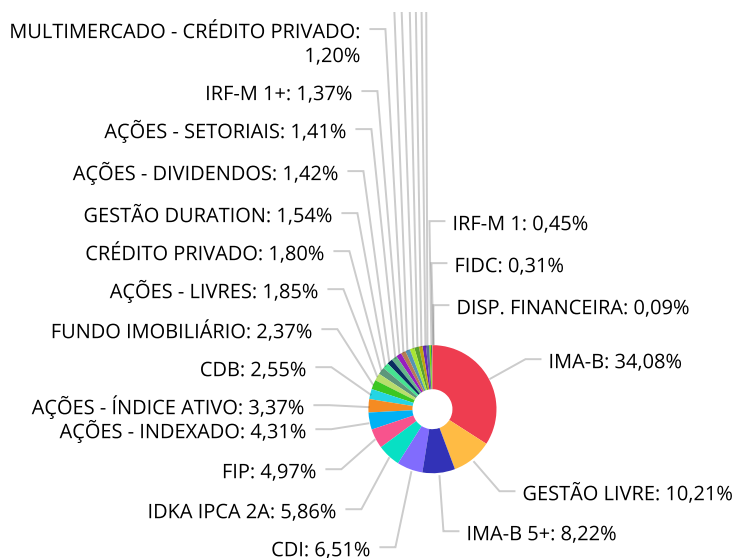
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Fevereiro/2020 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
TIVIO RENDA IMOBILIÁRIA RESP LIMITADA FII - TVRI11	-1,60%	-5,89%	1,00%	6,94%	16,34%	10,04%	4,32%	9,83%
HAZ FII - ATCR11	0,16%	0,09%	374,50%	374,50%	374,50%	374,50%	-	-
IPCA (Benchmark)	0,25%	0,46%	1,62%	2,20%	4,00%	8,05%	-	-
AUSTRO MULTIPAR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-0,88%	-1,02%	-1,15%	-1,55%	-2,33%	-11,18%	2,25%	0,23%
IMOBILIÁRIO PARANÁ REC FIP MULTIESTRATÉGIA	-	-	-	-	-	-	0,04%	0,36%
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	0,97%	2,07%	4,10%	7,38%	14,88%	31,88%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	-	-	-	-	-	-	-	-
IPCA + 9,00% ao ano (Benchmark)	0,87%	1,84%	3,76%	6,66%	13,33%	28,33%	-	-
FP2 FIP MULTIESTRATÉGIA	-	-	-	-	-	-	-	-
SMLL (Benchmark)	-8,27%	-7,86%	3,80%	13,95%	35,70%	51,63%	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO RESP LIMITADA FIF AÇÕES	-8,60%	-8,14%	3,39%	12,78%	32,42%	43,20%	18,15%	17,46%

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



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



IMA-B	16.728.381,00	GESTÃO LIVRE	5.013.046,44	IMA-B 5+	4.033.308,96
CDI	3.194.377,84	IDKA IPCA 2A	2.877.183,10	FIP	2.439.850,98
AÇÕES - INDEXADO	2.118.051,08	AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	1.653.746,09	CDB	1.252.616,73
FUNDO IMOBILIÁRIO	1.163.033,35	AÇÕES - LIVRES	909.203,37	CRÉDITO PRIVADO	884.864,50
GESTÃO DURATION	757.111,10	AÇÕES - DIVIDENDOS	697.260,71	AÇÕES - SETORIAIS	693.144,87
IRF-M 1+	670.655,25	MULTIMERCADO - CRÉDITO PRIVADO	586.936,72	BDR NÍVEL I	582.664,82
MULTIMERCADO - CONSERVADOR	581.293,95	AÇÕES - SMALL / MID CAPS	567.028,88	IMA-B 5	450.304,63
IRF-M	427.533,72	VÉRTICE LONGO	389.596,11	IRF-M 1	220.558,74
FIDC	151.150,57	DISP. FINANCEIRA	43.137,77		

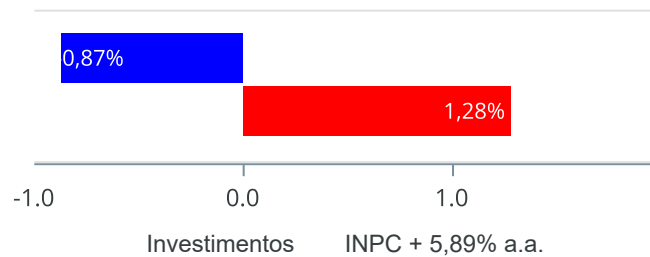
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Fevereiro / 2020)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
------------------	------------	--------	------	-------------	------------	---------	----------	----------

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2020

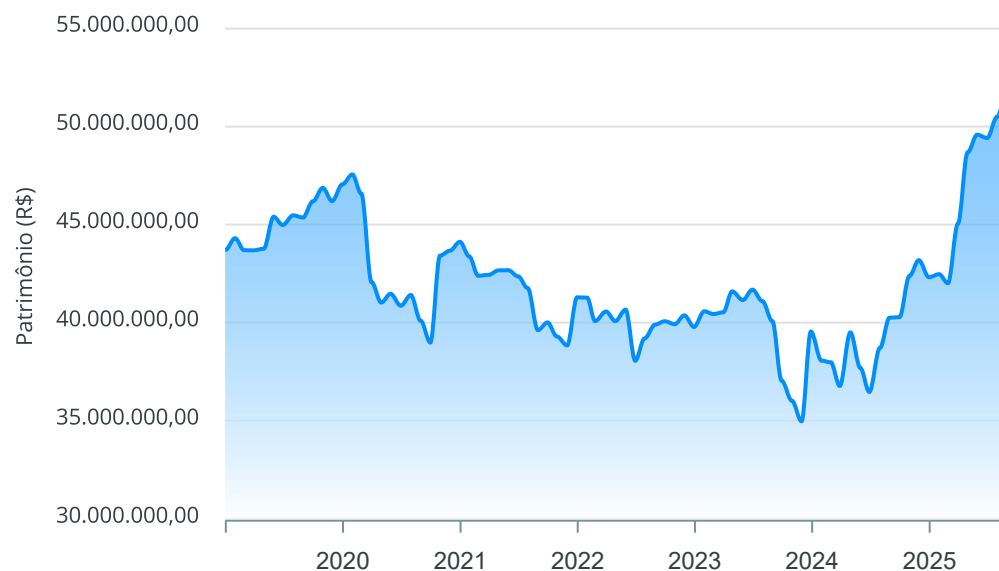
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	47.055.425,39	2.422.019,00	2.034.188,91	47.505.509,53	62.254,05	62.254,05	0,13%	0,13%	0,69%	0,69%	18,97%	3,57%
Fevereiro	47.505.509,53	741.998,43	1.235.261,87	46.536.380,29	-475.865,80	-413.611,75	-1,00%	-0,87%	0,58%	1,28%	-68,31%	4,27%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



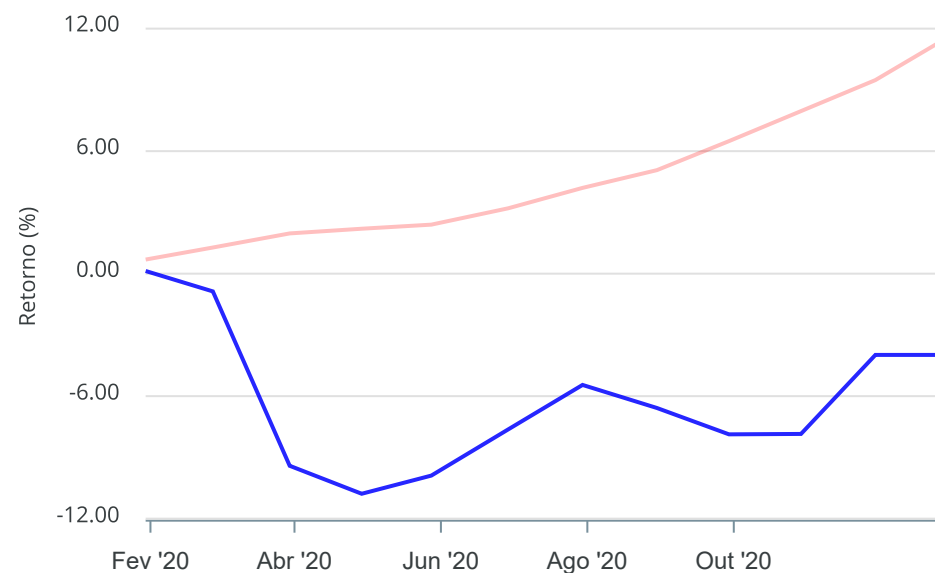
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



Investimentos Meta de Rentabilidade ☐ CDI ☐ IMA-B

☐ IMA-B 5 ☐ IMA-B 5+ ☐ IMA Geral ☐ IRF-M ☐ IRF-M 1

☐ IRF-M 1+ ☐ Ibovespa ☐ IBX ☐ SMLL ☐ IDIV

Investimentos Meta de Rentabilidade ☐ 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 Fevereiro/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	7.609.905,62	0,00	0,00	7.674.753,66	64.848,04	0,85%	0,40%	2,38%
CDB - BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.	1.242.571,54	0,00	0,00	1.252.616,73	10.045,19	0,81%	-	-
BB IRF-M 1+ RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENC...	665.496,08	0,00	0,00	670.655,25	5.159,17	0,78%	0,78%	1,40%
CAIXA BRASIL IPCA XVI RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA...	878.398,50	0,00	0,00	884.864,50	6.466,00	0,74%	0,74%	1,46%
ITAÚ IMA-B ATIVO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	146.030,57	0,00	0,00	147.051,89	1.021,32	0,70%	0,70%	2,66%
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF C...	298.196,07	0,00	0,00	300.147,66	1.951,59	0,65%	0,65%	0,92%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA ...	46.393,91	0,00	0,00	46.687,49	293,58	0,63%	0,63%	0,92%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA ...	378.452,78	0,00	0,00	380.846,23	2.393,45	0,63%	0,63%	0,91%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA...	114.197,50	0,00	0,00	114.914,85	717,35	0,63%	0,63%	0,67%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC R...	149.220,32	0,00	0,00	150.156,97	936,65	0,63%	0,63%	0,85%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FIF ...	1.073.458,62	0,00	500.000,00	579.938,44	6.479,82	0,60%	0,62%	0,91%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RESP LI...	861.025,29	0,00	0,00	866.203,97	5.178,68	0,60%	0,60%	0,69%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.495.145,56	0,00	0,00	2.506.523,22	11.377,66	0,46%	0,46%	1,08%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA ...	2.514.618,06	0,00	0,00	2.525.655,27	11.037,21	0,44%	0,44%	2,42%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA ...	1.353.060,67	0,00	0,00	1.358.971,66	5.910,99	0,44%	0,44%	2,42%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII RESP LIMITADA FIF RENDA FI...	398.431,55	0,00	10.469,24	389.596,11	1.633,80	0,41%	0,41%	0,39%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITAD...	219.760,45	0,00	0,00	220.558,74	798,29	0,36%	0,36%	0,07%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REN...	2.544.496,82	0,00	0,00	2.552.105,67	7.608,85	0,30%	0,30%	3,74%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITA...	1.476.899,67	0,00	0,00	1.481.203,29	4.303,62	0,29%	0,29%	3,75%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2.895.566,26	0,00	0,00	2.903.767,08	8.200,82	0,28%	0,28%	0,69%

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	1.598.835,74	0,00	0,00	1.603.240,15	4.404,41	0,28%	0,28%	0,00%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRI...	292.021,56	0,00	0,00	292.824,13	802,57	0,27%	0,27%	0,00%
CAIXA BRASIL RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERENC...	26.091,90	0,00	0,00	26.163,35	71,45	0,27%	0,27%	0,02%
BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFEREN...	7.009,50	0,00	0,00	7.028,64	19,14	0,27%	0,27%	0,02%
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA...	176.717,39	0,00	0,00	177.172,66	455,27	0,26%	0,26%	0,01%
BB FLUXO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SIMPLES ...	196.853,79	315.147,54	0,00	512.895,72	894,39	0,17%	0,22%	0,01%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RESP LIMITADA FIF CI...	590.709,08	426.850,89	723.046,85	295.757,73	1.244,61	0,12%	0,23%	0,00%
IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	2.115.599,24	0,00	0,00	2.118.181,44	2.582,20	0,12%	0,12%	4,32%
SINGAPORE FIC RENDA FIXA	2.350.260,43	0,00	0,00	2.352.532,40	2.271,97	0,10%	0,10%	1,08%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	151.428,99	0,00	0,00	151.150,57	-278,42	-0,18%	-0,18%	0,04%
Total Renda Fixa	34.866.853,46	741.998,43	1.233.516,09	34.544.165,47	168.829,67	0,48%		1,92%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES RESP L...	65.713,30	0,00	0,00	67.998,98	2.285,68	3,48%	3,48%	12,26%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTI...	579.747,08	0,00	0,00	581.293,95	1.546,87	0,27%	0,27%	0,09%
HAZ FII - ATCR11	946.865,11	0,00	0,00	948.410,34	1.545,23	0,16%	0,00%	-
SP DOWNTOWN FII - SPTW11	86.920,00	0,00	1.300,00	85.690,00	70,00	0,08%	-2,22%	13,30%
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	1.581.738,14	0,00	0,00	1.581.738,14	0,00	0,00%	-	-
FP2 FIP MULTIESTRATÉGIA	826.909,43	0,00	0,00	826.853,21	-56,22	-0,01%	-	-
IMOBILIÁRIO PARANÁ REC FIP MULTIESTRATÉGIA	31.399,46	0,00	0,00	31.259,63	-139,83	-0,45%	-0,45%	0,04%
TIVIO RENDA IMOBILIÁRIA RESP LIMITADA FII - TVRI11	16.409,00	0,00	105,78	16.170,00	-133,22	-0,81%	-1,60%	4,32%
AUSTRO MULTIPAR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	592.152,71	0,00	0,00	586.936,72	-5.215,99	-0,88%	0,09%	2,25%
AUSTRO INSTITUCIONAL PIPE BANCOS FIC AÇÕES	314.173,26	0,00	0,00	305.816,55	-8.356,71	-2,66%	-2,66%	11,48%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	46.642,09	0,00	340,00	44.764,03	-1.538,06	-3,30%	-15,77%	34,34%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPAATIVO FIC AÇÕES	1.220.790,27	0,00	0,00	1.125.862,83	-94.927,44	-7,78%	-7,78%	15,11%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA RESP LIMITADA FIF AÇÕES	522.769,93	0,00	0,00	478.674,16	-44.095,77	-8,44%	-8,44%	15,07%
BB IBOVESPA INDEXADO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	1.792.231,49	0,00	0,00	1.639.376,92	-152.854,57	-8,53%	-8,53%	15,52%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO RESP LIMITADA FIF AÇÕES	620.378,02	0,00	0,00	567.028,88	-53.349,14	-8,60%	-8,60%	18,15%
BB DIVIDENDOS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	763.917,78	0,00	0,00	697.260,71	-66.657,07	-8,73%	-8,73%	14,56%
DAYCOVAL IBOVESPAATIVO FI AÇÕES	580.324,94	0,00	0,00	527.883,26	-52.441,68	-9,04%	-9,04%	15,61%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX RESP LIMITADA FIF CIC A...	1.002.054,77	0,00	0,00	909.203,37	-92.851,40	-9,27%	-9,27%	15,43%
BB CONSUMO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	429.732,66	0,00	0,00	387.328,32	-42.404,34	-9,87%	-9,87%	16,21%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
Total Renda Variável	12.020.869,44	0,00	1.745,78	11.409.550,00	-609.573,66	-5,07%		13,30%

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR NÍ...	617.786,63	0,00	0,00	582.664,82	-35.121,81	-5,69%	-5,69%	13,66%
Total Exterior	617.786,63	0,00	0,00	582.664,82	-35.121,81	-5,69%		13,66%

Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da CRÉDITO E MERCADO CONSULTORIA DE INVESTIMENTOS.. As informações aqui contidas, tem por somente, o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre o(s) produto(s) mencionado(s), entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros exigidos legalmente. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas aos objetivos, aos riscos e à política de investimento do(s) produto(s). Todas as informações podem ser obtidas com os responsáveis pela distribuição, administração, gestão ou no próprio site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários) através do link: <https://www.gov.br/cvm/pt-br>.

Sua elaboração buscou atender os objetivos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil de investidor.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas aos investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de Consultoria de Valores Mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe a Consultoria de Valores Mobiliários a prestação dos serviços de ORIENTAÇÃO, RECOMENDAÇÃO E ACONSELHAMENTO, DE FORMA PROFISSIONAL, INDEPENDENTE E INDIVIDUALIZADA, SOBRE INVESTIMENTOS NO MERCADO DE VALORES MOBILIÁRIOS, CUJA ADOÇÃO E IMPLEMENTAÇÃO SEJAM EXCLUSIVAS DO CLIENTE (Resolução CVM nº 19/2021).

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no Art. 3º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria MTP nº 1.467/2022, art. 84, inciso III, alínea "a".

Os RPPS DEVEM, independente da contratação de Consultoria de Valores Mobiliários, se adequar às normativas pertinentes e principalmente a Portaria MTP nº 1.467/2022 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963/2021, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.

Relatório Analítico dos Investimentos

em março e 1º trimestre de 2020

Este relatório atende a Portaria MTP Nº 1.467, de 2 de junho de 2022.

Carteira consolidada de investimentos - base (Março / 2020)

CNPJ	Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Lei
25.078.994/0001-90	BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	2.453.854,89	5,84%	596	0,02%	7º I b
13.322.205/0001-35	BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REN...	D+1	Não há	113.004,22	0,27%	882	0,00%	7º I b
13.327.340/0001-73	BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF R...	D+2	Não há	2.274.269,80	5,41%	324	0,12%	7º I b
07.442.078/0001-05	BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REND...	D+1	Não há	1.264.074,90	3,01%	673	0,02%	7º I b
32.161.826/0001-29	BB IRF-M 1+ RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	667.795,95	1,59%	88	0,32%	7º I b
07.111.384/0001-69	BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REND...	D+1	Não há	46.635,76	0,11%	703	0,00%	7º I b
20.734.937/0001-06	BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	D+0	15/08/2018	293.737,80	0,70%	64	0,78%	7º I b
19.523.305/0001-06	BB TÍTULOS PÚBLICOS VII RESP LIMITADA FIF RENDA ...	D+0	15/08/2022	384.370,53	0,91%	165	0,06%	7º I b
25.069.955/0001-26	BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	18/08/2018	1.608.291,43	3,83%	23	2,01%	7º I b
23.215.097/0001-55	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FI...	D+0	Não há	579.180,61	1,38%	733	0,01%	7º I b
14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RESP ...	D+0	Não há	475.321,60	1,13%	962	0,01%	7º I b
10.577.503/0001-88	CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMI...	D+0	Não há	1.319.624,59	3,14%	354	0,07%	7º I b
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITAD...	D+0	Não há	2.346.279,89	5,58%	913	0,04%	7º I b
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMIT...	D+0	Não há	221.855,20	0,53%	1.357	0,00%	7º I b
14.508.605/0001-00	CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITAD...	D+0	Não há	380.415,10	0,91%	428	0,00%	7º I b
09.093.819/0001-15	ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC...	D+1	Não há	147.588,39	0,35%	58	0,01%	7º I b
13.077.415/0001-05	BB FLUXO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SIMPLE...	D+0	Não há	614.070,81	1,46%	744	0,04%	7º IV a
13.077.418/0001-49	BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFER...	D+0	Não há	7.026,31	0,02%	637	0,00%	7º IV a
20.216.216/0001-04	BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF...	D+1	Não há	294.795,93	0,70%	118	0,03%	7º IV a
14.508.643/0001-55	CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RESP LIMITADA FIF ...	D+0	Não há	74.545,35	0,18%	319	0,01%	7º IV a

Carteira consolidada de investimentos - base (Março / 2020)

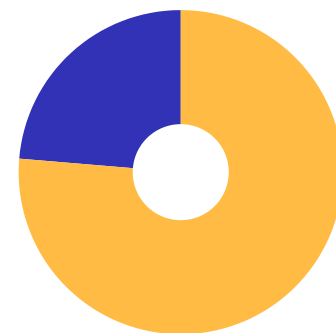
CNPJ	Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Lei
03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERE...	D+0	Não há	26.200,57	0,06%	689	0,00%	7º IV a
12.402.646/0001-84	IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	D+1002	Não há	1.776.516,05	4,23%	12	5,92%	7º IV a
05.073.656/0001-58	ITAÚ IMA-B ATIVO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIX...	D+1	Não há	138.058,02	0,33%	93	0,04%	7º IV a
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITA...	D+1	Não há	178.109,40	0,42%	279	0,00%	7º IV a
15.153.656/0001-11	MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1800	Não há	2.967.794,31	7,06%	11	2,70%	7º IV a
13.594.673/0001-69	TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	D+31 ou...	Não há	6.721.293,87	15,99%	15	3,64%	7º IV a
01.181.521/0001-55	CDB - BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.	S/Info	Não Informado	1.246.538,42	2,97%		0,00%	7º VI a
06.018.364/0001-85	PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	150.768,18	0,36%	98	0,18%	7º VII a
21.918.896/0001-62	CAIXA BRASIL IPCA XVI RESP LIMITADA FIF RENDA FI...	D+0	18/04/2018	859.120,00	2,04%	75	0,47%	7º VII b
73.899.759/0001-21	BB IBOVESPA INDEXADO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+4	Não há	1.148.706,69	2,73%	7.396	0,76%	8º I a
15.154.236/0001-50	CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA RESP LIMITADA FIF AÇÃO...	D+4	Não há	338.098,87	0,80%	59	0,00%	8º I b
08.973.942/0001-68	BB CONSUMO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+4	Não há	267.750,49	0,64%	13.264	0,11%	8º II a
05.100.191/0001-87	BB DIVIDENDOS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+4	Não há	492.427,21	1,17%	32.861	0,07%	8º II a
17.502.937/0001-68	CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR ...	D+4	Não há	619.395,26	1,47%	93	0,07%	8º II a
15.154.220/0001-47	CAIXA SMALL CAPS ATIVO RESP LIMITADA FIF AÇÕES	D+4	Não há	368.239,77	0,88%	16.314	0,04%	8º II a
13.155.995/0001-01	DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	D+15	Não há	363.223,21	0,86%	1.373	0,36%	8º II a
08.817.414/0001-10	ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	772.999,20	1,84%	53	0,00%	8º II a
23.731.629/0001-07	ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX RESP LIMITADA FIF CIC...	D+24	Não há	528.397,70	1,26%	165	0,00%	8º II a
18.366.002/0001-64	AUSTRO MULTIPAR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+1	96 meses	585.927,20	1,39%	33	0,61%	8º III
29.388.994/0001-47	CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MUL...	D+2	01/10/2020	584.620,69	1,39%	956	0,12%	8º III

Carteira consolidada de investimentos - base (Março / 2020)

CNPJ	Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Lei
20.886.575/0001-60	FP2 FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	826.796,98	1,97%		0,00%	8º IV a
11.490.580/0001-69	GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	1.581.738,14	3,76%		0,00%	8º IV a
16.720.629/0001-46	IMOBILIÁRIO PARANÁ REC FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	31.119,43	0,07%	11	0,41%	8º IV a
13.584.584/0001-31	BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES RESP...	Não se ...	Não se aplica	61.141,94	0,15%		0,03%	8º IV b
17.098.794/0001-70	CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	38.872,47	0,09%		0,02%	8º IV b
14.631.148/0001-39	HAZ FII - ATCR11	Não se ...	Não se aplica	948.979,55	2,26%		1,35%	8º IV b
15.538.445/0001-05	SP DOWNTOWN FII - SPTW11	Não se ...	Não se aplica	69.490,00	0,17%		0,05%	8º IV b
14.410.722/0001-29	TIVIO RENDA IMOBILIÁRIA RESP LIMITADA FII - TVRI...	Não se ...	Não se aplica	13.925,00	0,03%		0,00%	8º IV b
20.887.259/0001-03	SINGAPORE FIC RENDA FIXA	D+31 ou...	1800 dias	2.450.058,24	5,83%	8	4,58%	NE
28.319.463/0001-30	AUSTRO INSTITUCIONAL PIPE BANCOS FIC AÇÕES	D+31	30/04/2021	305.816,55	0,73%	22	0,61%	NE
Total para cálculo dos limites da Resolução			42.028.862,47					
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			37.575,34	Artigo 6º				
PL Total			42.066.437,81					

Enquadramento e Política de Investimento (RENTA FIXA) - base (Março / 2020)

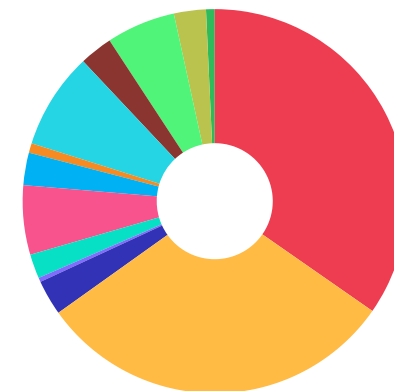
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	100,00%	14.576.300,66	34,68%	20,00%	30,00%	90,00%	23.249.675,56
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	25.217.317,48
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea a	40,00%	12.798.410,62	30,45%	10,00%	30,00%	40,00%	4.013.134,37
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea a	15,00%	1.246.538,42	2,97%	0,00%	0,00%	15,00%	5.057.790,95
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea a	5,00%	150.768,18	0,36%	0,00%	0,00%	5,00%	1.950.674,94
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea b	5,00%	859.120,00	2,04%	0,00%	0,00%	5,00%	1.242.323,12
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea c	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.101.443,12
Desenquadrado - RF	0,00%	2.450.058,24	5,83%	0,00%	0,00%	0,00%	-2.450.058,24
Total Renda Fixa	100,00%	32.081.196,12	76,33%	30,00%	70,00%	220,00%	



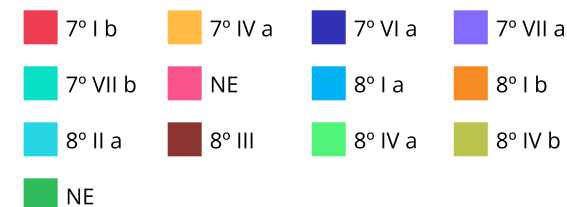
RENTA FIXA 32.081.196,12
RENTA VARIÁVEL 9.947.666,35

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Março / 2020)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea a	30,00%	1.148.706,69	2,73%	0,00%	0,00%	5,00%	952.736,43
Artigo 8º, Inciso I, Alínea b	30,00%	338.098,87	0,80%	0,00%	0,00%	5,00%	1.763.344,25
Artigo 8º, Inciso II, Alínea a	20,00%	3.412.432,84	8,12%	7,00%	15,00%	20,00%	4.993.339,65
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	1.170.547,89	2,79%	3,00%	10,00%	10,00%	3.032.338,36
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea a	5,00%	2.439.654,55	5,80%	0,00%	0,00%	5,00%	-338.211,43
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea b	5,00%	1.132.408,96	2,69%	0,00%	5,00%	5,00%	969.034,16
Desenquadrado - RV	0,00%	305.816,55	0,73%	0,00%	0,00%	0,00%	-305.816,55
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	9.947.666,35	23,67%	10,00%	30,00%	50,00%	



Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2020			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.101.443,12
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2020		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	1.902.029,23	4,53	20,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea a	0,00	0,00	10,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea a	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	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	5,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea b	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea a	0,00	0,00	7,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	584.620,69	1,39	3,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea a	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea b	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	5,00

Enquadramento por Gestores - base (Março / 2020)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
VERITAS CAPITAL MANAGEMENT	14.501.589,67	34,50	0,54
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	11.636.016,79	27,69	0,00
CAIXA DTVM S.A	8.231.769,97	19,59	0,00
GENIAL GESTÃO LTDA	1.651.228,14	3,93	0,03
SICREDI	1.246.538,42	2,97	0,00
GRAPHEN INVESTIMENTOS	1.130.867,16	2,69	0,49
ARENA CAPITAL	826.796,98	1,97	-
ITAÚ DTVM	772.999,20	1,84	0,00
ITAÚ UNIBANCO	666.455,72	1,59	0,00
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	363.223,21	0,86	0,01
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	325.697,79	0,77	0,00
AUSTRO CAPITAL	305.816,55	0,73	0,05
BANCO BRADESCO	294.795,93	0,70	-
ZION INVEST	61.141,94	0,15	0,01
TIVIO CAPITAL DISTRIBUIDORA DE...	13.925,00	0,03	0,00

Artigo 20º - 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) - (Resolução 4963)

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	-1,21%	0,00%	0,00%	2,46%	9,11%	19,14%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,31%	0,94%	0,94%	2,13%	5,16%	12,52%	0,01%	0,30%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REND...	-1,45%	-0,41%	-0,41%	1,98%	8,03%	17,44%	5,46%	2,79%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENC...	-1,66%	-0,66%	-0,66%	1,94%	7,78%	17,10%	5,67%	2,91%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,32%	0,95%	0,95%	2,13%	5,17%	12,54%	0,01%	0,30%
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	0,58%	1,98%	1,98%	5,33%	9,55%	21,38%	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	-2,91%	-1,40%	-1,40%	1,20%	11,23%	21,29%	10,97%	5,67%
IRF-M 1+ (Benchmark)	-0,47%	1,44%	1,44%	3,57%	12,96%	24,50%	-	-
BB IRF-M 1+ RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,43%	1,41%	1,41%	3,48%	12,45%	-	11,53%	3,74%
IMA-B 5+ (Benchmark)	-10,93%	-10,62%	-10,62%	-7,92%	8,24%	26,94%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FI...	-10,91%	-10,68%	-10,68%	-8,14%	7,75%	25,87%	25,40%	15,81%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDE...	-10,89%	-10,58%	-10,58%	-7,81%	8,17%	26,53%	25,25%	15,81%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,60%	1,43%	1,43%	2,83%	6,66%	13,79%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIX...	0,59%	1,38%	1,38%	2,73%	6,46%	13,39%	0,62%	0,43%
IMA-B 5 (Benchmark)	-1,75%	-0,57%	-0,57%	2,03%	9,34%	19,39%	-	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	-1,78%	-0,59%	-0,59%	1,93%	9,18%	18,81%	7,31%	3,61%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2,21%	2,54%	2,54%	1,96%	-22,63%	-15,71%	6,72%	18,36%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	-1,71%	-0,56%	-0,56%	1,99%	9,19%	18,74%	6,76%	3,48%

IMA-B (Benchmark)	-6,97%	-6,31%	-6,31%	-3,64%	9,14%	24,10%	-	-
CDB - BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.	-	-	-	-	-	-	-	-
IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	-16,13%	-16,72%	-16,72%	-17,49%	-14,91%	-13,95%	43,43%	17,53%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	-12,42%	-11,19%	-11,19%	-9,38%	-1,51%	-9,06%	17,87%	14,15%
ITAÚ IMA-B ATIVO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	-6,12%	-5,27%	-5,27%	-2,63%	11,82%	26,66%	19,52%	10,47%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA ...	-7,10%	-6,46%	-6,46%	-3,94%	8,67%	23,36%	16,65%	10,68%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCI...	-6,98%	-6,33%	-6,33%	-3,73%	8,93%	23,52%	16,57%	10,57%

IRF-M (Benchmark)	-0,11%	1,42%	1,42%	3,31%	11,09%	21,25%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA ...	-0,11%	1,36%	1,36%	3,20%	10,78%	20,64%	7,66%	2,74%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCI...	-0,11%	1,38%	1,38%	3,22%	10,87%	20,76%	7,68%	2,71%

CDI (Benchmark)	0,34%	1,01%	1,01%	2,26%	5,44%	12,12%	-	-
SINGAPORE FIC RENDA FIXA	4,15%	3,72%	3,72%	3,09%	-15,40%	-12,10%	11,25%	13,45%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-2,10%	-1,18%	-1,18%	0,61%	8,55%	-	8,04%	4,30%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SI...	0,27%	0,80%	0,80%	1,83%	4,55%	10,26%	0,01%	0,29%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVID...	-0,03%	0,59%	0,59%	1,74%	4,81%	11,34%	0,18%	0,55%
BB FLUXO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,25%	0,75%	0,75%	1,73%	4,31%	9,74%	0,01%	0,29%
CAIXA BRASIL RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,14%	0,79%	0,79%	1,91%	4,99%	11,48%	0,11%	0,42%
IPCA (Benchmark)	0,07%	0,53%	0,53%	2,31%	3,30%	8,03%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	-0,13%	1,31%	1,31%	3,13%	13,46%	23,65%	7,65%	3,74%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA ...	0,53%	1,13%	1,13%	2,34%	9,75%	18,59%	0,36%	2,43%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	-1,34%	-0,74%	-0,74%	1,66%	6,93%	16,97%	3,11%	2,39%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	-0,25%	-0,97%	-0,97%	-1,50%	-9,59%	-13,76%	0,13%	6,00%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Março/2020 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	5,47%	5,88%	5,88%	12,08%	26,75%	64,72%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR NÍVEL I	6,30%	6,80%	6,80%	12,71%	27,06%	62,46%	29,56%	17,47%

Ibovespa (Benchmark)	-29,90%	-36,86%	-36,86%	-30,29%	-23,47%	-14,46%	-	-
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA RESP LIMITADA FIF AÇÕES	-29,37%	-36,43%	-36,43%	-29,95%	-23,37%	-14,82%	56,27%	32,76%
BB CONSUMO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	-30,87%	-35,37%	-35,37%	-29,78%	-6,83%	-8,67%	59,14%	38,07%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	-31,19%	-38,39%	-38,39%	-31,99%	-24,14%	-12,83%	61,01%	34,72%
BB IBOVESPA INDEXADO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	-29,93%	-37,07%	-37,07%	-30,92%	-25,08%	-17,94%	57,64%	33,15%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	-31,34%	-36,25%	-36,25%	-28,09%	-19,74%	-9,77%	57,80%	35,20%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	0,57%	1,16%	1,16%	2,71%	7,54%	-	0,87%	1,07%
AUSTRO INSTITUCIONAL PIPE BANCOS FIC AÇÕES	-27,25%	-31,57%	-31,57%	-33,24%	-35,92%	-	38,23%	27,16%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	-41,88%	-46,50%	-46,50%	-38,72%	-29,21%	-15,65%	66,66%	46,46%

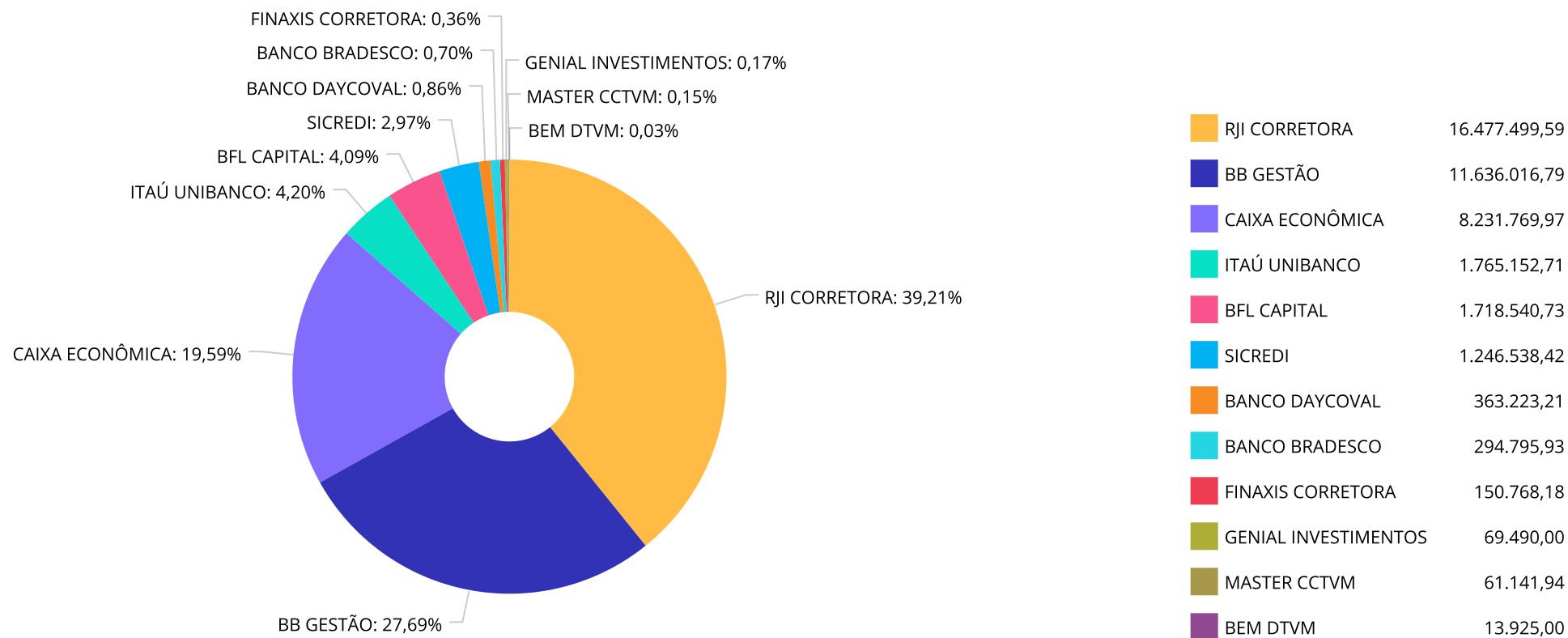
IDIV (Benchmark)	-25,53%	-31,24%	-31,24%	-21,42%	-7,78%	4,87%	-	-
BB DIVIDENDOS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	-29,38%	-35,81%	-35,81%	-29,79%	-21,20%	-13,42%	48,27%	33,19%

IFIX (Benchmark)	-15,85%	-22,00%	-22,00%	-7,08%	0,45%	5,79%	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES RESP LIMITADA FII - C...	-10,08%	-17,05%	-17,05%	-30,07%	-27,70%	-54,47%	54,05%	45,50%
SP DOWNTOWN FII - SPTW11	-20,59%	-44,24%	-44,24%	-22,73%	-	-	54,32%	48,04%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	-21,22%	-22,06%	-22,06%	4,61%	13,62%	-89,99%	32,70%	39,48%

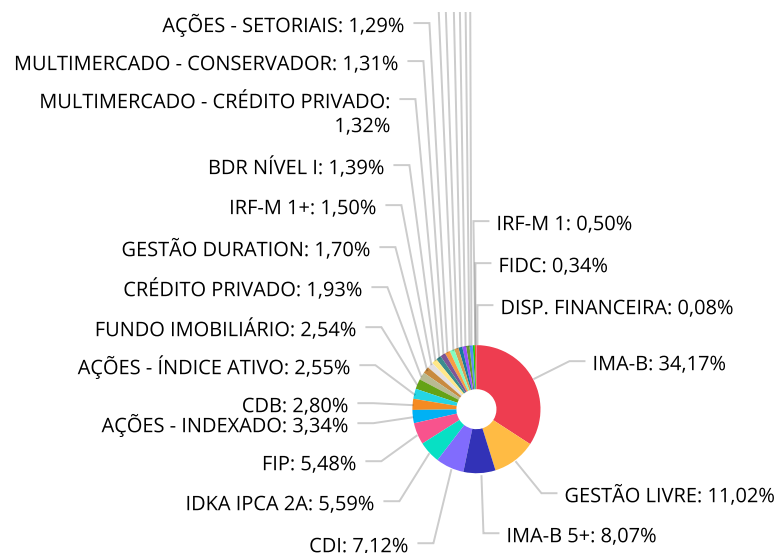
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Março/2020 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
TIVIO RENDA IMOBILIÁRIA RESP LIMITADA FII - TVRI11	-14,76%	-19,78%	-19,78%	-8,82%	-1,80%	-7,86%	26,94%	18,41%
HAZ FII - ATCR11	0,06%	0,15%	0,15%	374,79%	374,79%	374,79%	-	-
IPCA (Benchmark)	0,07%	0,53%	0,53%	2,31%	3,30%	8,03%	-	-
AUSTRO MULTIPAR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-0,17%	-1,19%	-1,19%	-1,59%	-2,38%	-11,10%	0,10%	0,75%
IMOBILIÁRIO PARANÁ REC FIP MULTIESTRATÉGIA	-	-	-	-	-	-	0,03%	0,35%
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	0,95%	3,03%	3,03%	7,54%	14,24%	31,91%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	-	-	-	-	-	-	-	-
IPCA + 9,00% ao ano (Benchmark)	0,83%	2,69%	2,69%	6,81%	12,68%	28,35%	-	-
FP2 FIP MULTIESTRATÉGIA	-	-	-	-	-	-	-	-
SMLL (Benchmark)	-35,07%	-40,17%	-40,17%	-27,52%	-11,98%	-1,62%	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO RESP LIMITADA FIF AÇÕES	-35,06%	-40,35%	-40,35%	-28,21%	-13,79%	-6,52%	60,61%	41,52%

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



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



IMA-B	15.214.017,04	GESTÃO LIVRE	4.907.709,78	IMA-B 5+	3.593.894,39
CDI	3.171.901,28	IDKA IPCA 2A	2.490.355,05	FIP	2.439.654,55
AÇÕES - INDEXADO	1.486.805,56	CDB	1.246.538,42	AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	1.136.222,41
FUNDO IMOBILIÁRIO	1.132.408,96	CRÉDITO PRIVADO	859.120,00	GESTÃO DURATION	757.290,01
IRF-M 1+	667.795,95	BDR NÍVEL I	619.395,26	MULTIMERCADO - CRÉDITO PRIVADO	585.927,20
MULTIMERCADO - CONSERVADOR	584.620,69	AÇÕES - SETORIAIS	573.567,04	AÇÕES - LIVRES	528.397,70
AÇÕES - DIVIDENDOS	492.427,21	IMA-B 5	442.384,32	IRF-M	427.050,86
VÉRTICE LONGO	384.370,53	AÇÕES - SMALL / MID CAPS	368.239,77	IRF-M 1	221.855,20
FIDC	150.768,18	DISP. FINANCEIRA	37.575,34		

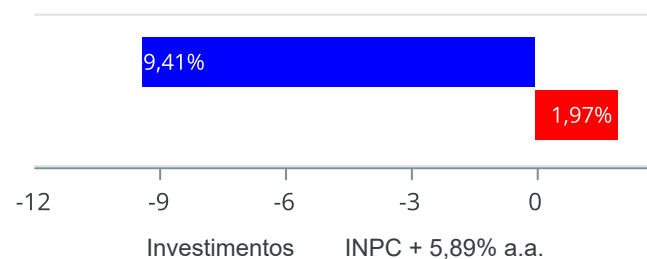
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Março / 2020)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
------------------	------------	--------	------	-------------	------------	---------	----------	----------

Retorno e Meta de Rentabilidade 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	47.055.425,39	2.422.019,00	2.034.188,91	47.505.509,53	62.254,05	62.254,05	0,13%	0,13%	0,69%	0,69%	18,97%	3,57%
Fevereiro	47.505.509,53	741.998,43	1.235.261,87	46.536.380,29	-475.865,80	-413.611,75	-1,00%	-0,87%	0,58%	1,28%	-68,31%	4,27%
Março	46.536.380,29	900.214,98	1.398.061,94	42.028.862,47	-4.009.670,86	-4.423.282,61	-8,62%	-9,41%	0,68%	1,97%	-478,62%	19,75%

Investimentos x Meta de Rentabilidade

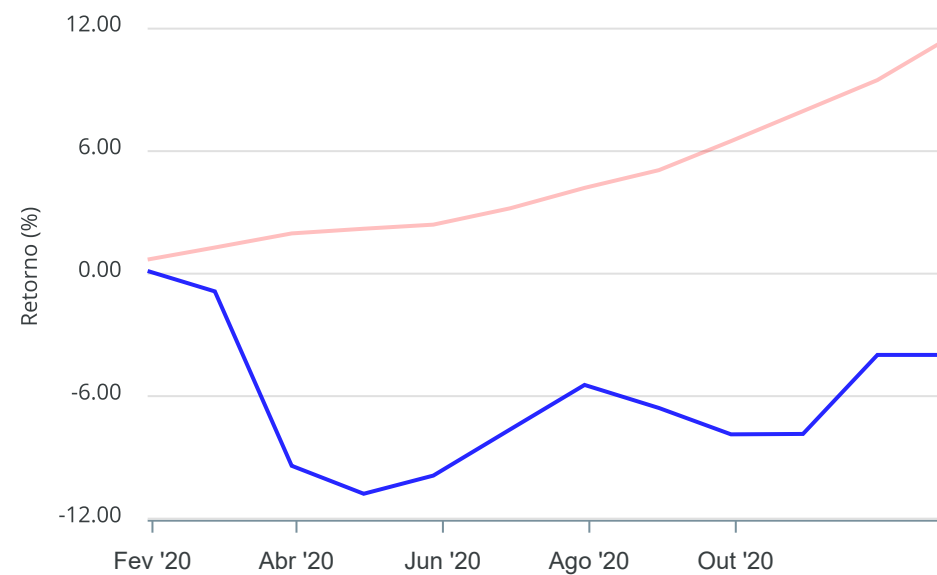


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Comparativo

ANO

36M



Investimentos Meta de Rentabilidade ☐ CDI ☐ IMA-B

☐ IMA-B 5 ☐ IMA-B 5+ ☐ IMA Geral ☐ IRF-M ☐ IRF-M 1

☐ IRF-M 1+ ☐ Ibovespa ☐ IBX ☐ SMLL ☐ IDIV

Investimentos Meta de Rentabilidade ☐ 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 Março/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
SINGAPORE FIC RENDA FIXA	2.352.532,40	0,00	0,00	2.450.058,24	97.525,84	4,15%	4,15%	11,25%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2.903.767,08	0,00	0,00	2.967.794,31	64.027,23	2,20%	2,20%	6,72%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITAD...	220.558,74	0,00	0,00	221.855,20	1.296,46	0,59%	0,59%	0,62%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA...	177.172,66	0,00	0,00	178.109,40	936,74	0,53%	0,53%	0,36%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	1.603.240,15	0,00	0,00	1.608.291,43	5.051,28	0,32%	0,32%	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRI...	292.824,13	0,00	0,00	293.737,80	913,67	0,31%	0,31%	0,01%
BB FLUXO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SIMPLES ...	512.895,72	99.711,34	0,00	614.070,81	1.463,75	0,24%	0,25%	0,01%
CAIXA BRASIL RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERENC...	26.163,35	0,00	0,00	26.200,57	37,22	0,14%	0,14%	0,11%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RESP LIMITADA FIF CI...	295.757,73	800.503,64	1.022.900,16	74.545,35	1.184,14	0,11%	0,26%	0,01%
BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFEREN...	7.028,64	0,00	0,00	7.026,31	-2,33	-0,03%	-0,03%	0,18%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA ...	46.687,49	0,00	0,00	46.635,76	-51,73	-0,11%	-0,11%	7,68%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA ...	380.846,23	0,00	0,00	380.415,10	-431,13	-0,11%	-0,11%	7,66%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FIF ...	579.938,44	0,00	0,00	579.180,61	-757,83	-0,13%	-0,13%	7,65%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	151.150,57	0,00	0,00	150.768,18	-382,39	-0,25%	-0,25%	0,13%
BB IRF-M 1+ RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENC...	670.655,25	0,00	0,00	667.795,95	-2.859,30	-0,43%	-0,43%	11,53%
CDB - BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.	1.252.616,73	0,00	0,00	1.246.538,42	-6.078,31	-0,49%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII RESP LIMITADA FIF RENDA FI...	389.596,11	0,00	0,00	384.370,53	-5.225,58	-1,34%	-1,34%	3,11%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA...	114.914,85	0,00	0,00	113.004,22	-1.910,63	-1,66%	-1,66%	5,67%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC R...	150.156,97	0,00	0,00	147.588,39	-2.568,58	-1,71%	-1,71%	6,76%
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF C...	300.147,66	0,00	0,00	294.795,93	-5.351,73	-1,78%	-1,78%	7,31%

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RESP LI...	866.203,97	0,00	375.056,00	475.321,60	-15.826,37	-1,83%	-1,45%	5,46%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.506.523,22	0,00	0,00	2.453.854,89	-52.668,33	-2,10%	-2,10%	8,04%
CAIXA BRASIL IPCA XVI RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA...	884.864,50	0,00	0,00	859.120,00	-25.744,50	-2,91%	-2,91%	10,97%
ITAÚ IMA-B ATIVO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	147.051,89	0,00	0,00	138.058,02	-8.993,87	-6,12%	-6,12%	19,52%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA ...	1.358.971,66	0,00	0,00	1.264.074,90	-94.896,76	-6,98%	-6,98%	16,57%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA ...	2.525.655,27	0,00	0,00	2.346.279,89	-179.375,38	-7,10%	-7,10%	16,65%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REN...	2.552.105,67	0,00	0,00	2.274.269,80	-277.835,87	-10,89%	-10,89%	25,25%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITA...	1.481.203,29	0,00	0,00	1.319.624,59	-161.578,70	-10,91%	-10,91%	25,40%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	7.674.753,66	0,00	0,00	6.721.293,87	-953.459,79	-12,42%	-12,42%	17,87%
IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	2.118.181,44	0,00	0,00	1.776.516,05	-341.665,39	-16,13%	-15,79%	43,43%
Total Renda Fixa	34.544.165,47	900.214,98	1.397.956,16	32.081.196,12	-1.965.228,17	-5,69%		14,62%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTI...	581.293,95	0,00	0,00	584.620,69	3.326,74	0,57%	0,57%	0,87%
HAZ FII - ATCR11	948.410,34	0,00	0,00	948.979,55	569,21	0,06%	0,00%	-
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTISTRATÉGIA	1.581.738,14	0,00	0,00	1.581.738,14	0,00	0,00%	-	-
AUSTRO INSTITUCIONAL PIPE BANCOS FIC AÇÕES	305.816,55	0,00	0,00	305.816,55	0,00	0,00%	-27,24%	38,23%
FP2 FIP MULTISTRATÉGIA	826.853,21	0,00	0,00	826.796,98	-56,23	-0,01%	-	-
AUSTRO MULTIPAR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	586.936,72	0,00	0,00	585.927,20	-1.009,52	-0,17%	-0,13%	0,10%
IMOBILIÁRIO PARANÁ REC FIP MULTISTRATÉGIA	31.259,63	0,00	0,00	31.119,43	-140,20	-0,45%	-0,45%	0,03%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES RESP L...	67.998,98	0,00	0,00	61.141,94	-6.857,04	-10,08%	-10,08%	54,05%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	44.764,03	0,00	0,00	38.872,47	-5.891,56	-13,16%	-20,62%	32,70%
TIVIO RENDA IMOBILIÁRIA RESP LIMITADA FII - TVRI11	16.170,00	0,00	105,78	13.925,00	-2.139,22	-13,23%	-14,10%	26,94%
SP DOWNTOWN FII - SPTW11	85.690,00	0,00	0,00	69.490,00	-16.200,00	-18,91%	-19,07%	54,32%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA RESP LIMITADA FIF AÇÕES	478.674,16	0,00	0,00	338.098,87	-140.575,29	-29,37%	-29,37%	56,27%
BB DIVIDENDOS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	697.260,71	0,00	0,00	492.427,21	-204.833,50	-29,38%	-29,38%	48,27%
BB IBOVESPA INDEXADO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	1.639.376,92	0,00	0,00	1.148.706,69	-490.670,23	-29,93%	-29,93%	57,64%
BB CONSUMO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	387.328,32	0,00	0,00	267.750,49	-119.577,83	-30,87%	-30,87%	59,14%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	527.883,26	0,00	0,00	363.223,21	-164.660,05	-31,19%	-31,19%	61,01%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	1.125.862,83	0,00	0,00	772.999,20	-352.863,63	-31,34%	-31,34%	57,80%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO RESP LIMITADA FIF AÇÕES	567.028,88	0,00	0,00	368.239,77	-198.789,11	-35,06%	-35,06%	60,61%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX RESP LIMITADA FIF CIC A...	909.203,37	0,00	0,00	528.397,70	-380.805,67	-41,88%	-41,88%	66,66%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
Total Renda Variável	11.409.550,00	0,00	105,78	9.328.271,09	-2.081.173,13	-18,24%		45,25%

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR NÍ...	582.664,82	0,00	0,00	619.395,26	36.730,44	6,30%	6,30%	29,56%
Total Exterior	582.664,82	0,00	0,00	619.395,26	36.730,44	6,30%		29,56%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
SINGAPORE FIC RENDA FIXA	2.362.137,71	0,00	0,00	2.450.058,24	87.920,53	3,72%	3,72%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2.894.228,36	0,00	0,00	2.967.794,31	73.565,95	2,54%	2,54%
CDB - BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.	730.689,44	500.000,00	0,00	1.246.538,42	15.848,98	1,29%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	1.593.195,68	0,00	0,00	1.608.291,43	15.095,75	0,95%	0,95%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FIF ...	1.064.735,23	0,00	500.000,00	579.180,61	14.445,38	1,36%	1,31%
BB IRF-M 1+ RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENC...	658.538,15	0,00	0,00	667.795,95	9.257,80	1,41%	1,41%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA ...	375.309,15	0,00	0,00	380.415,10	5.105,95	1,36%	1,36%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RESP LIMITADA FIF CI...	180.209,07	3.100.861,90	3.210.161,46	74.545,35	3.635,84	0,11%	0,80%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITAD...	218.835,71	0,00	0,00	221.855,20	3.019,49	1,38%	1,38%
BB FLUXO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SIMPLES ...	147.813,37	463.370,51	0,00	614.070,81	2.886,93	0,47%	0,75%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRI...	290.992,55	0,00	0,00	293.737,80	2.745,25	0,94%	0,94%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA...	176.117,25	0,00	0,00	178.109,40	1.992,15	1,13%	1,13%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA ...	46.000,93	0,00	0,00	46.635,76	634,83	1,38%	1,38%
CAIXA BRASIL RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERENC...	25.995,51	0,00	0,00	26.200,57	205,06	0,79%	0,79%
BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFEREN...	6.985,06	0,00	0,00	7.026,31	41,25	0,59%	0,59%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA...	113.759,54	0,00	0,00	113.004,22	-755,32	-0,66%	-0,66%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC R...	148.418,84	0,00	0,00	147.588,39	-830,45	-0,56%	-0,56%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	152.249,16	0,00	0,00	150.768,18	-1.480,98	-0,97%	-0,97%
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF C...	296.541,04	0,00	0,00	294.795,93	-1.745,11	-0,59%	-0,59%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII RESP LIMITADA FIF RENDA FI...	397.649,73	0,00	10.469,24	384.370,53	-2.809,96	-0,71%	-0,74%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RESP LI...	857.106,99	0,00	375.056,00	475.321,60	-6.729,39	-0,79%	-0,41%
ITAÚ IMA-B ATIVO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	145.731,72	0,00	0,00	138.058,02	-7.673,70	-5,27%	-5,27%
CAIXA BRASIL IPCA XVI RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA...	871.338,00	0,00	0,00	859.120,00	-12.218,00	-1,40%	-1,40%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.483.081,74	0,00	0,00	2.453.854,89	-29.226,85	-1,18%	-1,18%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA ...	1.349.552,00	0,00	0,00	1.264.074,90	-85.477,10	-6,33%	-6,33%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITA...	1.477.469,21	0,00	0,00	1.319.624,59	-157.844,62	-10,68%	-10,68%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA ...	2.508.430,74	0,00	0,00	2.346.279,89	-162.150,85	-6,46%	-6,46%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REN...	2.543.291,44	0,00	0,00	2.274.269,80	-269.021,64	-10,58%	-10,58%
IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	2.133.232,21	0,00	0,00	1.776.516,05	-356.716,16	-16,72%	-16,72%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	7.568.482,34	0,00	0,00	6.721.293,87	-847.188,47	-11,19%	-11,19%
Total Renda Fixa	33.818.117,87	4.064.232,41	4.095.686,70	32.081.196,12	-1.705.467,46	-4,50%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Trimestre/2020

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR NÍ...	579.979,21	0,00	0,00	619.395,26	39.416,05	6,80%	6,80%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTI...	577.917,00	0,00	0,00	584.620,69	6.703,69	1,16%	1,16%
HAZ FII - ATCR11	947.587,88	0,00	1.116,18	948.979,55	2.507,85	0,26%	0,15%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MUL...	565.235,00	0,00	565.862,50	0,00	627,50	0,11%	-
FP2 FIP MULTIESTRATÉGIA	826.874,91	0,00	0,00	826.796,98	-77,93	-0,01%	-
IMOBILIÁRIO PARANÁ REC FIP MULTIESTRATÉGIA	31.539,66	0,00	0,00	31.119,43	-420,23	-1,33%	-
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	1.582.243,92	0,00	0,00	1.581.738,14	-505,78	-0,03%	-
TIVIO RENDA IMOBILIÁRIA RESP LIMITADA FII - TVRI11	17.111,00	0,00	317,34	13.925,00	-2.868,66	-16,77%	-19,78%
AUSTRO MULTIPAR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	592.977,13	0,00	0,00	585.927,20	-7.049,93	-1,19%	-1,19%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	50.007,12	0,00	1.960,00	38.872,47	-9.174,65	-18,35%	-22,06%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES RESP L...	73.713,18	0,00	0,00	61.141,94	-12.571,24	-17,05%	-17,05%
AUSTRO INSTITUCIONAL PIPE BANCOS FIC AÇÕES	325.131,80	0,00	0,00	305.816,55	-19.315,25	-5,94%	-31,57%
SP DOWNTOWN FII - SPTW11	121.300,00	0,00	2.570,00	69.490,00	-49.240,00	-40,59%	-44,23%
BB CONSUMO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	414.299,67	0,00	0,00	267.750,49	-146.549,18	-35,37%	-35,37%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA RESP LIMITADA FIF AÇÕES	531.884,04	0,00	0,00	338.098,87	-193.785,17	-36,43%	-36,43%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	589.538,02	0,00	0,00	363.223,21	-226.314,81	-38,39%	-38,39%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO RESP LIMITADA FIF AÇÕES	617.279,24	0,00	0,00	368.239,77	-249.039,47	-40,34%	-40,34%
BB DIVIDENDOS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	767.131,64	0,00	0,00	492.427,21	-274.704,43	-35,81%	-35,81%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	1.212.594,53	0,00	0,00	772.999,20	-439.595,33	-36,25%	-36,25%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX RESP LIMITADA FIF CIC A...	987.566,40	0,00	0,00	528.397,70	-459.168,70	-46,49%	-46,49%
Total Renda Variável	11.411.911,35	0,00	571.826,02	8.798.959,66	-2.041.125,67	-17,89%	

Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da CRÉDITO E MERCADO CONSULTORIA DE INVESTIMENTOS.. As informações aqui contidas, tem por somente, o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre o(s) produto(s) mencionado(s), entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros exigidos legalmente. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas aos objetivos, aos riscos e à política de investimento do(s) produto(s). Todas as informações podem ser obtidas com os responsáveis pela distribuição, administração, gestão ou no próprio site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários) através do link: <https://www.gov.br/cvm/pt-br>.

Sua elaboração buscou atender os objetivos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil de investidor.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas aos investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de Consultoria de Valores Mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe a Consultoria de Valores Mobiliários a prestação dos serviços de ORIENTAÇÃO, RECOMENDAÇÃO E ACONSELHAMENTO, DE FORMA PROFISSIONAL, INDEPENDENTE E INDIVIDUALIZADA, SOBRE INVESTIMENTOS NO MERCADO DE VALORES MOBILIÁRIOS, CUJA ADOÇÃO E IMPLEMENTAÇÃO SEJAM EXCLUSIVAS DO CLIENTE (Resolução CVM nº 19/2021).

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no Art. 3º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria MTP nº 1.467/2022, art. 84, inciso III, alínea "a".

Os RPPS DEVEM, independente da contratação de Consultoria de Valores Mobiliários, se adequar às normativas pertinentes e principalmente a Portaria MTP nº 1.467/2022 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963/2021, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.

Relatório Analítico dos Investimentos

em abril de 2020

Este relatório atende a Portaria MTP Nº 1.467, de 2 de junho de 2022.

Carteira consolidada de investimentos - base (Abril / 2020)

CNPJ	Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Lei
25.078.994/0001-90	BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	2.476.248,71	6,04%	595	0,02%	7º I b
13.322.205/0001-35	BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REN...	D+1	Não há	113.370,02	0,28%	883	0,00%	7º I b
13.327.340/0001-73	BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF R...	D+2	Não há	2.317.912,55	5,66%	320	0,12%	7º I b
07.442.078/0001-05	BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REND...	D+1	Não há	1.280.485,17	3,12%	670	0,02%	7º I b
32.161.826/0001-29	BB IRF-M 1+ RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	676.260,66	1,65%	95	0,26%	7º I b
07.111.384/0001-69	BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REND...	D+1	Não há	47.135,71	0,12%	700	0,00%	7º I b
20.734.937/0001-06	BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	D+0	15/08/2018	294.515,99	0,72%	63	0,91%	7º I b
19.523.305/0001-06	BB TÍTULOS PÚBLICOS VII RESP LIMITADA FIF RENDA ...	D+0	15/08/2022	384.920,44	0,94%	165	0,06%	7º I b
25.069.955/0001-26	BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	18/08/2018	1.612.552,94	3,93%	21	2,50%	7º I b
23.215.097/0001-55	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FI...	D+0	Não há	585.616,98	1,43%	743	0,01%	7º I b
14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RESP ...	D+0	Não há	477.345,57	1,16%	958	0,01%	7º I b
10.577.503/0001-88	CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMI...	D+0	Não há	1.345.294,75	3,28%	353	0,07%	7º I b
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITAD...	D+0	Não há	2.376.854,94	5,80%	906	0,04%	7º I b
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMIT...	D+0	Não há	222.816,39	0,54%	1.370	0,00%	7º I b
14.508.605/0001-00	CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITAD...	D+0	Não há	384.707,62	0,94%	427	0,00%	7º I b
09.093.819/0001-15	ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC...	D+1	Não há	148.307,55	0,36%	57	0,01%	7º I b
13.077.415/0001-05	BB FLUXO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SIMPLE...	D+0	Não há	69.754,79	0,17%	746	0,00%	7º IV a
13.077.418/0001-49	BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFER...	D+0	Não há	7.044,46	0,02%	631	0,00%	7º IV a
20.216.216/0001-04	BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF...	D+1	Não há	296.410,52	0,72%	118	0,03%	7º IV a
14.508.643/0001-55	CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RESP LIMITADA FIF ...	D+0	Não há	205.344,51	0,50%	317	0,04%	7º IV a

Carteira consolidada de investimentos - base (Abril / 2020)

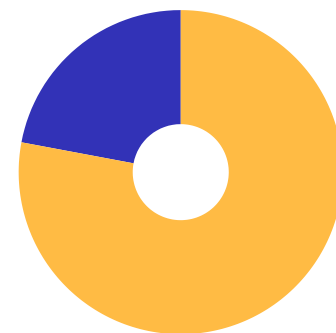
CNPJ	Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Lei
03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERE...	D+0	Não há	26.201,49	0,06%	677	0,00%	7º IV a
12.402.646/0001-84	IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	D+1002	Não há	1.814.147,70	4,43%	12	6,04%	7º IV a
05.073.656/0001-58	ITAÚ IMA-B ATIVO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIX...	D+1	Não há	140.170,67	0,34%	88	0,03%	7º IV a
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITA...	D+1	Não há	178.364,59	0,44%	284	0,00%	7º IV a
15.153.656/0001-11	MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1800	Não há	2.964.539,46	7,23%	11	2,17%	7º IV a
13.594.673/0001-69	TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	D+31 ou...	Não há	6.769.384,43	16,52%	15	3,64%	7º IV a
01.181.521/0001-55	CDB - BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.	S/Info	Não Informado	1.260.254,87	3,08%		0,00%	7º VI a
06.018.364/0001-85	PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	150.502,63	0,37%	98	0,18%	7º VII a
21.918.896/0001-62	CAIXA BRASIL IPCA XVI RESP LIMITADA FIF RENDA FI...	D+0	18/04/2018	866.604,50	2,11%	72	0,49%	7º VII b
73.899.759/0001-21	BB IBOVESPA INDEXADO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+4	Não há	1.265.962,62	3,09%	7.334	0,75%	8º I a
15.154.236/0001-50	CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA RESP LIMITADA FIF AÇÃO...	D+4	Não há	371.943,09	0,91%	61	0,00%	8º I b
08.973.942/0001-68	BB CONSUMO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+4	Não há	315.164,61	0,77%	13.548	0,11%	8º II a
05.100.191/0001-87	BB DIVIDENDOS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+4	Não há	533.684,05	1,30%	32.789	0,07%	8º II a
17.502.937/0001-68	CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR ...	D+4	Não há	718.280,49	1,75%	94	0,07%	8º II a
15.154.220/0001-47	CAIXA SMALL CAPS ATIVO RESP LIMITADA FIF AÇÕES	D+4	Não há	409.951,83	1,00%	16.228	0,04%	8º II a
13.155.995/0001-01	DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	D+15	Não há	401.522,49	0,98%	1.335	0,36%	8º II a
08.817.414/0001-10	ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	862.469,16	2,10%	53	0,00%	8º II a
23.731.629/0001-07	ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX RESP LIMITADA FIF CIC...	D+24	Não há	576.841,10	1,41%	164	0,00%	8º II a
18.366.002/0001-64	AUSTRO MULTIPAR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+1	96 meses	505.822,93	1,23%	33	0,61%	8º III
29.388.994/0001-47	CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MUL...	D+2	01/10/2020	586.075,48	1,43%	956	0,12%	8º III

Carteira consolidada de investimentos - base (Abril / 2020)

CNPJ	Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Lei
20.886.575/0001-60	FP2 FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	826.740,76	2,02%		0,00%	8º IV a
11.490.580/0001-69	GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	299.724,77	0,73%		0,00%	8º IV a
16.720.629/0001-46	IMOBILIÁRIO PARANÁ REC FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	30.975,27	0,08%	11	0,41%	8º IV a
13.584.584/0001-31	BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES RESP...	Não se ...	Não se aplica	47.427,86	0,12%		0,03%	8º IV b
17.098.794/0001-70	CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	40.271,08	0,10%		0,02%	8º IV b
14.631.148/0001-39	HAZ FII - ATCR11	Não se ...	Não se aplica	948.082,72	2,31%		1,35%	8º IV b
15.538.445/0001-05	SP DOWNTOWN FII - SPTW11	Não se ...	Não se aplica	75.300,00	0,18%		0,05%	8º IV b
14.410.722/0001-29	TIVIO RENDA IMOBILIÁRIA RESP LIMITADA FII - TVRI...	Não se ...	Não se aplica	15.260,00	0,04%		0,00%	8º IV b
20.887.259/0001-03	SINGAPORE FIC RENDA FIXA	D+31 ou...	1800 dias	2.450.954,11	5,98%	8	4,58%	NE
28.319.463/0001-30	AUSTRO INSTITUCIONAL PIPE BANCOS FIC AÇÕES	D+31	30/04/2021	204.323,06	0,50%	22	0,45%	NE
Total para cálculo dos limites da Resolução			40.979.848,09					
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			46.453,87	Artigo 6º				
PL Total			41.026.301,96					

Enquadramento e Política de Investimento (RENTA FIXA) - base (Abril / 2020)

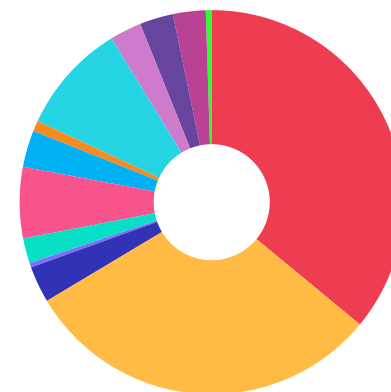
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	100,00%	14.744.345,99	35,98%	20,00%	30,00%	90,00%	22.137.517,29
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	24.587.908,85
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea a	40,00%	12.471.362,62	30,43%	10,00%	30,00%	40,00%	3.920.576,62
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea a	15,00%	1.260.254,87	3,08%	0,00%	0,00%	15,00%	4.886.722,34
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea a	5,00%	150.502,63	0,37%	0,00%	0,00%	5,00%	1.898.489,77
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea b	5,00%	866.604,50	2,11%	0,00%	0,00%	5,00%	1.182.387,90
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea c	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.048.992,40
Desenquadrado - RF	0,00%	2.450.954,11	5,98%	0,00%	0,00%	0,00%	-2.450.954,11
Total Renda Fixa	100,00%	31.944.024,72	77,95%	30,00%	70,00%	220,00%	



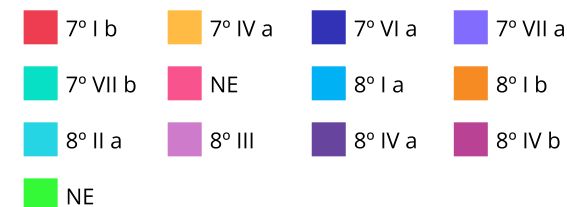
RENTA FIXA 31.944.024,72
RENTA VARIÁVEL 9.035.823,37

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Abril / 2020)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea a	30,00%	1.265.962,62	3,09%	0,00%	0,00%	5,00%	783.029,78
Artigo 8º, Inciso I, Alínea b	30,00%	371.943,09	0,91%	0,00%	0,00%	5,00%	1.677.049,31
Artigo 8º, Inciso II, Alínea a	20,00%	3.817.913,73	9,32%	7,00%	15,00%	20,00%	4.378.055,89
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	1.091.898,41	2,66%	3,00%	10,00%	10,00%	3.006.086,40
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea a	5,00%	1.157.440,80	2,82%	0,00%	0,00%	5,00%	891.551,60
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea b	5,00%	1.126.341,66	2,75%	0,00%	5,00%	5,00%	922.650,74
Desenquadrado - RV	0,00%	204.323,06	0,50%	0,00%	0,00%	0,00%	-204.323,06
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	9.035.823,37	22,05%	10,00%	30,00%	50,00%	



Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2020			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.048.992,40
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2020		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	1.907.068,93	4,65	20,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea a	0,00	0,00	10,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea a	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	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	5,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea b	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea a	0,00	0,00	7,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	586.075,48	1,43	3,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea a	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea b	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	5,00

Enquadramento por Gestores - base (Abril / 2020)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
VERITAS CAPITAL MANAGEMENT	14.504.848,63	35,40	0,84
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	11.395.012,72	27,81	0,00
CAIXA DTVM S.A	8.617.308,72	21,03	0,00
SICREDI	1.260.254,87	3,08	0,00
GRAPHEN INVESTIMENTOS	1.129.560,62	2,76	0,49
ITAÚ DTVM	862.469,16	2,10	0,00
ARENA CAPITAL	826.740,76	2,02	-
ITAÚ UNIBANCO	717.011,77	1,75	0,00
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	401.522,49	0,98	0,01
GENIAL GESTÃO LTDA	375.024,77	0,92	0,01
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	326.672,14	0,80	0,00
BANCO BRADESCO	296.410,52	0,72	-
AUSTRO CAPITAL	204.323,06	0,50	0,04
ZION INVEST	47.427,86	0,12	0,01
TIVIO CAPITAL DISTRIBUIDORA DE...	15.260,00	0,04	0,00

Artigo 20º - 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) - (Resolução 4963)

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,57%	0,57%	0,03%	1,79%	8,62%	18,84%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,27%	1,22%	0,86%	1,94%	4,92%	12,38%	0,00%	0,32%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,27%	1,21%	0,85%	1,93%	4,91%	12,35%	0,01%	0,33%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REND...	0,43%	0,02%	-0,44%	1,13%	7,34%	17,02%	2,75%	2,75%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENC...	0,32%	-0,34%	-0,73%	1,02%	6,95%	16,67%	2,68%	2,87%
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	0,15%	2,14%	1,41%	4,83%	8,57%	20,71%	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	0,87%	-0,54%	-1,34%	-0,20%	10,96%	21,81%	5,71%	5,66%
IRF-M 1+ (Benchmark)	1,50%	2,96%	1,83%	2,84%	13,92%	25,80%	-	-
BB IRF-M 1+ RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,27%	2,69%	1,62%	2,52%	13,25%	-	7,31%	3,72%
IMA-B 5+ (Benchmark)	2,01%	-8,82%	-8,85%	-10,25%	8,47%	30,32%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FI...	1,95%	-8,95%	-8,91%	-10,51%	7,94%	29,14%	14,33%	15,82%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDE...	1,92%	-8,86%	-8,91%	-10,22%	8,35%	29,79%	14,30%	15,82%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,45%	1,88%	1,44%	2,65%	6,60%	13,72%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIX...	0,43%	1,82%	1,39%	2,55%	6,39%	13,32%	0,49%	0,44%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,49%	-0,09%	-0,64%	0,86%	8,67%	19,47%	-	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	0,55%	-0,04%	-0,60%	0,79%	8,61%	19,00%	3,58%	3,59%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,11%	2,43%	2,38%	1,74%	-21,80%	-16,95%	4,88%	18,44%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	0,49%	-0,08%	-0,61%	0,84%	8,54%	18,85%	3,23%	3,46%

IMA-B (Benchmark)	1,31%	-5,08%	-5,33%	-5,55%	8,94%	25,91%	-	-
CDB - BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.	-	-	-	-	-	-	-	-
IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	2,12%	-14,96%	-14,25%	-17,54%	-13,34%	-12,04%	13,85%	17,87%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	0,72%	-10,56%	-11,05%	-10,34%	-1,78%	-6,97%	8,82%	14,13%
ITAÚ IMA-B ATIVO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	1,53%	-3,82%	-4,01%	-4,58%	11,67%	28,88%	9,95%	10,46%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA ...	1,30%	-5,25%	-5,48%	-5,82%	8,47%	25,17%	9,03%	10,67%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCI...	1,30%	-5,12%	-5,36%	-5,65%	8,71%	25,32%	8,99%	10,56%

IRF-M (Benchmark)	1,15%	2,59%	1,70%	2,75%	11,69%	22,07%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA ...	1,13%	2,50%	1,65%	2,62%	11,40%	21,57%	4,97%	2,73%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCI...	1,07%	2,47%	1,60%	2,60%	11,40%	21,53%	4,99%	2,70%

CDI (Benchmark)	0,28%	1,30%	0,92%	2,07%	5,19%	11,87%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,91%	-0,28%	-0,76%	-0,26%	8,60%	-	4,82%	4,30%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SI...	0,22%	1,02%	0,72%	1,65%	4,31%	10,01%	0,00%	0,32%
BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVID...	0,26%	0,85%	0,50%	1,55%	4,55%	11,05%	0,12%	0,55%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB FLUXO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,20%	0,95%	0,67%	1,54%	4,07%	9,49%	0,01%	0,31%
CAIXA BRASIL RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00%	0,79%	0,42%	1,46%	4,46%	10,92%	0,45%	0,57%
SINGAPORE FIC RENDA FIXA	0,04%	3,76%	4,28%	3,21%	-14,77%	-13,23%	7,43%	13,51%
IPCA (Benchmark)	-0,31%	0,22%	0,01%	1,89%	2,40%	7,46%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	1,11%	2,44%	1,60%	2,52%	13,47%	24,61%	4,96%	3,74%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA ...	0,14%	1,28%	0,93%	1,98%	9,19%	18,37%	2,58%	2,51%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	0,14%	-0,60%	-0,79%	0,75%	5,98%	16,47%	1,33%	2,36%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	-0,18%	-1,15%	-0,61%	-1,51%	-8,43%	-13,35%	0,08%	5,99%

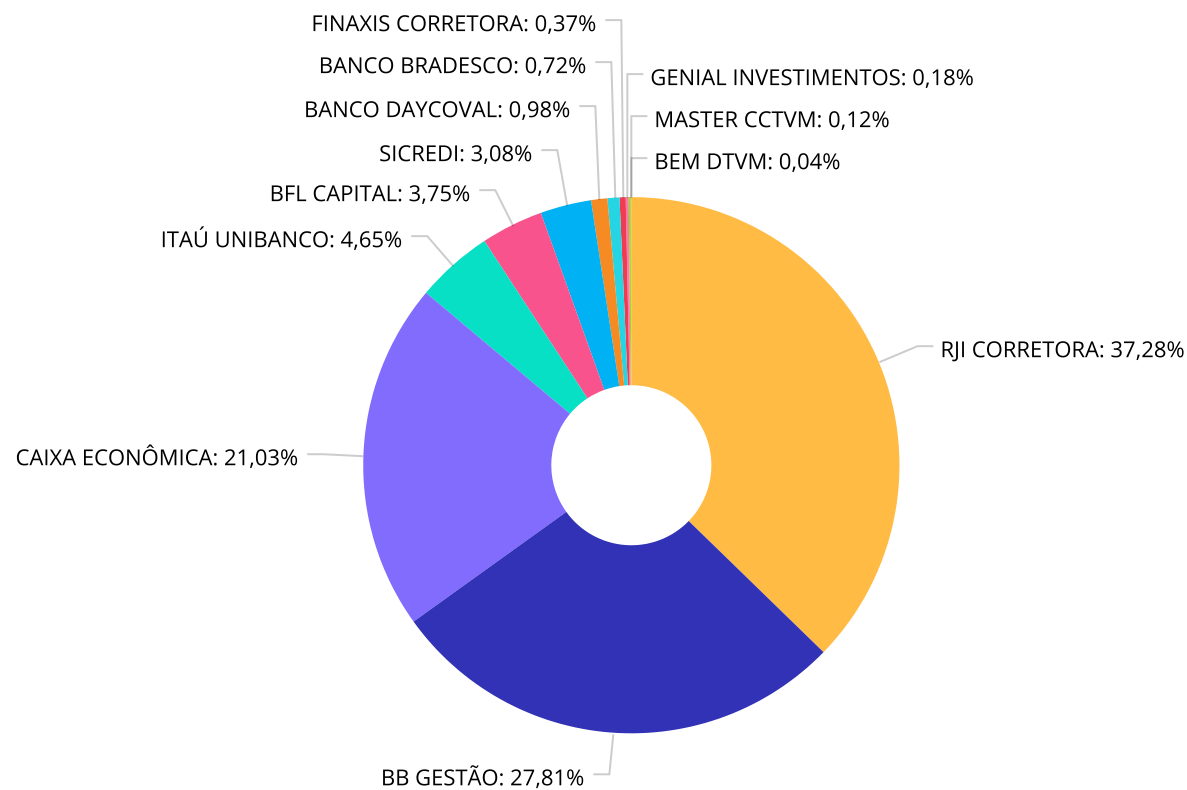
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Abril/2020 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	16,32%	23,16%	15,68%	32,24%	39,49%	79,08%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR NÍVEL I	15,97%	23,85%	16,27%	32,52%	39,65%	76,46%	16,55%	22,17%
Ibovespa (Benchmark)	10,25%	-30,39%	-29,23%	-24,92%	-16,45%	-6,51%	-	-
AUSTRO INSTITUCIONAL PIPE BANCOS FIC AÇÕES	-8,17%	-37,16%	-34,97%	-36,97%	-37,62%	-20,80%	17,18%	27,51%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	9,17%	-41,59%	-42,43%	-33,70%	-23,73%	-10,30%	26,98%	47,67%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA RESP LIMITADA FIF AÇÕES	10,01%	-30,07%	-28,85%	-24,61%	-16,46%	-7,02%	22,50%	34,75%
BB CONSUMO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	17,71%	-23,93%	-26,66%	-15,75%	1,19%	8,74%	24,55%	41,30%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	10,54%	-31,89%	-30,81%	-27,11%	-16,80%	-4,74%	23,18%	36,80%
BB IBOVESPA INDEXADO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	10,21%	-30,65%	-29,36%	-25,48%	-18,08%	-10,18%	22,61%	35,25%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	11,57%	-28,87%	-29,35%	-21,99%	-11,31%	0,22%	22,66%	37,45%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	0,25%	1,41%	1,09%	2,61%	7,30%	-	0,38%	1,12%
IDIV (Benchmark)	3,76%	-28,65%	-27,50%	-19,68%	-7,18%	10,38%	-	-
BB DIVIDENDOS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	8,38%	-30,43%	-30,14%	-24,64%	-16,90%	-6,36%	20,68%	34,42%
IFIX (Benchmark)	4,39%	-18,58%	-15,39%	-6,75%	3,79%	11,40%	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES RESP LIMITADA FII - C...	-22,43%	-35,66%	-27,83%	-38,06%	-46,10%	-62,78%	21,45%	49,28%
SP DOWNTOWN FII - SPTW11	11,29%	-37,94%	-13,59%	-17,84%	-	-	17,28%	49,22%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	7,78%	-16,00%	-28,49%	4,82%	23,31%	-88,08%	30,55%	39,68%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Abril/2020 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

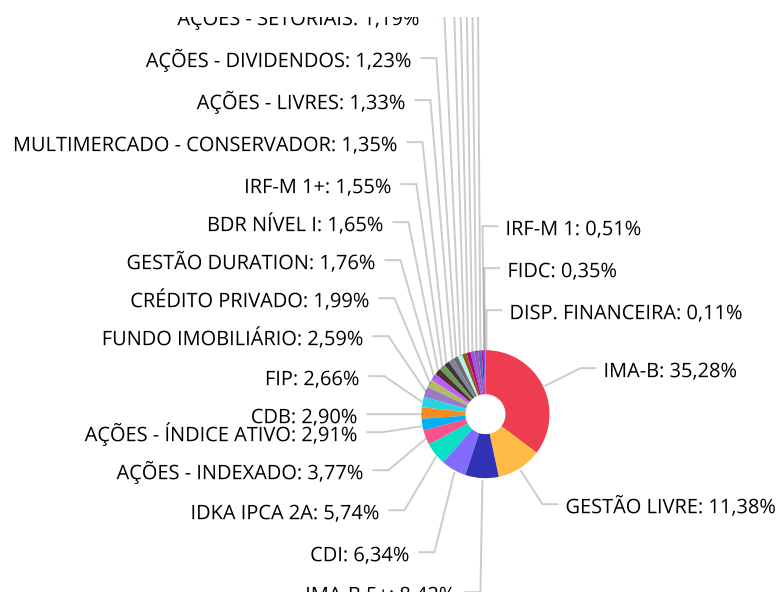
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
TIVIO RENDA IMOBILIÁRIA RESP LIMITADA FII - TVRI11	10,50%	-11,36%	-7,31%	-1,67%	7,69%	2,60%	11,80%	20,85%
HAZ FII - ATCR11	-0,10%	0,05%	0,13%	374,34%	374,34%	374,34%	-	-
IPCA (Benchmark)	-0,31%	0,22%	0,01%	1,89%	2,40%	7,46%	-	-
AUSTRO MULTIPAR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-13,67%	-14,70%	-14,58%	-14,92%	-15,61%	-23,19%	42,60%	13,49%
IMOBILIÁRIO PARANÁ REC FIP MULTIESTRATÉGIA	-	-	-	-2,66%	-5,61%	-	0,06%	0,32%
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	0,48%	3,53%	2,42%	6,98%	13,20%	31,16%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	-	-	-	-	-	-	-	-
IPCA + 9,00% ao ano (Benchmark)	0,37%	3,07%	2,08%	6,27%	11,65%	27,63%	-	-
FP2 FIP MULTIESTRATÉGIA	-	-	-	-	-	-	-	-
SMLL (Benchmark)	10,19%	-34,07%	-34,37%	-21,91%	-4,59%	5,90%	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO RESP LIMITADA FIF AÇÕES	11,33%	-33,59%	-33,92%	-21,69%	-5,18%	2,17%	24,21%	43,15%

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



RJI CORRETORA	15.277.808,46
BB GESTÃO	11.395.012,72
CAIXA ECONÔMICA	8.617.308,72
ITAÚ UNIBANCO	1.906.153,07
BFL CAPITAL	1.536.886,75
SICREDI	1.260.254,87
BANCO DAYCOVAL	401.522,49
BANCO BRADESCO	296.410,52
FINAXIS CORRETORA	150.502,63
GENIAL INVESTIMENTOS	75.300,00
MASTER CCTVM	47.427,86
BEM DTVM	15.260,00

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



IMA-B	15.345.582,37	GESTÃO LIVRE	4.952.497,42	IMA-B 5+	3.663.207,30
CDI	2.759.299,36	IDKA IPCA 2A	2.497.784,52	AÇÕES - INDEXADO	1.637.905,71
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	1.263.991,65	CDB	1.260.254,87	FIP	1.157.440,80
FUNDO IMOBILIÁRIO	1.126.341,66	CRÉDITO PRIVADO	866.604,50	GESTÃO DURATION	763.981,57
BDR NÍVEL I	718.280,49	IRF-M 1+	676.260,66	MULTIMERCADO - CONSERVADOR	586.075,48
AÇÕES - LIVRES	576.841,10	AÇÕES - DIVIDENDOS	533.684,05	AÇÕES - SETORIAIS	519.487,67
MULTIMERCADO - CRÉDITO PRIVADO	505.822,93	IMA-B 5	444.718,07	IRF-M	431.843,33
AÇÕES - SMALL / MID CAPS	409.951,83	VÉRTICE LONGO	384.920,44	IRF-M 1	222.816,39
FIDC	150.502,63	DISP. FINANCEIRA	46.453,87		

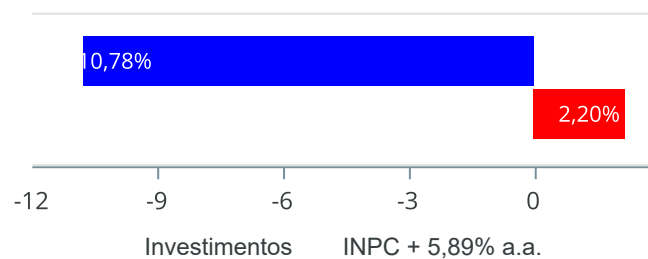
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Abril / 2020)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
------------------	------------	--------	------	-------------	------------	---------	----------	----------

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2020

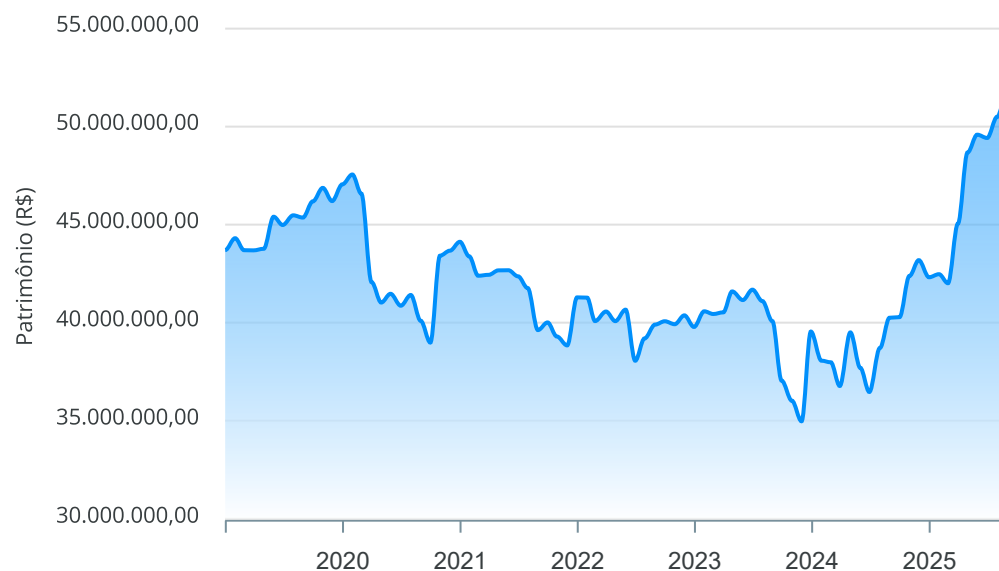
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	47.055.425,39	2.422.019,00	2.034.188,91	47.505.509,53	62.254,05	62.254,05	0,13%	0,13%	0,69%	0,69%	18,97%	3,57%
Fevereiro	47.505.509,53	741.998,43	1.235.261,87	46.536.380,29	-475.865,80	-413.611,75	-1,00%	-0,87%	0,58%	1,28%	-68,31%	4,27%
Março	46.536.380,29	900.214,98	1.398.061,94	42.028.862,47	-4.009.670,86	-4.423.282,61	-8,62%	-9,41%	0,68%	1,97%	-478,62%	19,75%
Abril	42.028.862,47	846.865,72	1.263.774,36	40.979.848,09	-632.105,74	-5.055.388,35	-1,50%	-10,78%	0,22%	2,20%	-490,84%	10,27%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



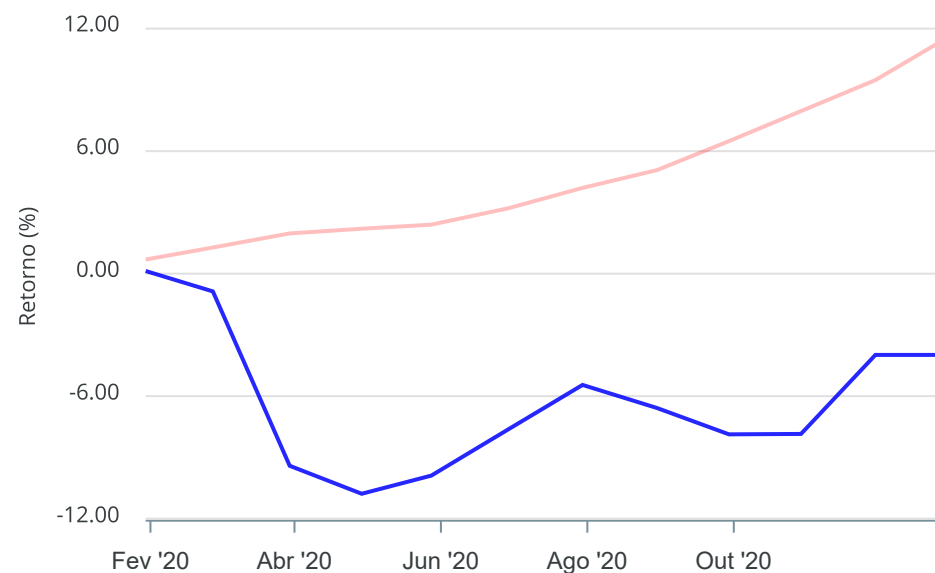
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



Investimentos Meta de Rentabilidade ☐ CDI ☐ IMA-B

☐ IMA-B 5 ☐ IMA-B 5+ ☐ IMA Geral ☐ IRF-M ☐ IRF-M 1

☐ IRF-M 1+ ☐ Ibovespa ☐ IBX ☐ SMLL ☐ IDIV

Investimentos Meta de Rentabilidade ☐ 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 Abril/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	1.776.516,05	0,00	0,00	1.814.147,70	37.631,65	2,12%	0,53%	13,85%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITA...	1.319.624,59	0,00	0,00	1.345.294,75	25.670,16	1,95%	1,95%	14,33%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REN...	2.274.269,80	0,00	0,00	2.317.912,55	43.642,75	1,92%	1,92%	14,30%
ITAÚ IMA-B ATIVO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	138.058,02	0,00	0,00	140.170,67	2.112,65	1,53%	1,53%	9,95%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA ...	2.346.279,89	0,00	0,00	2.376.854,94	30.575,05	1,30%	1,30%	9,03%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA ...	1.264.074,90	0,00	0,00	1.280.485,17	16.410,27	1,30%	1,30%	8,99%
BB IRF-M 1+ RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENC...	667.795,95	0,00	0,00	676.260,66	8.464,71	1,27%	1,27%	7,31%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA ...	380.415,10	0,00	0,00	384.707,62	4.292,52	1,13%	1,13%	4,97%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FIF ...	579.180,61	0,00	0,00	585.616,98	6.436,37	1,11%	1,11%	4,96%
CDB - BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.	1.246.538,42	0,00	0,00	1.260.254,87	13.716,45	1,10%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA ...	46.635,76	0,00	0,00	47.135,71	499,95	1,07%	1,07%	4,99%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.453.854,89	0,00	0,00	2.476.248,71	22.393,82	0,91%	0,91%	4,82%
CAIXA BRASIL IPCA XVI RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA...	859.120,00	0,00	0,00	866.604,50	7.484,50	0,87%	0,87%	5,71%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	6.721.293,87	0,00	0,00	6.769.384,43	48.090,56	0,72%	0,72%	8,82%
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF C...	294.795,93	0,00	0,00	296.410,52	1.614,59	0,55%	0,55%	3,58%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC R...	147.588,39	0,00	0,00	148.307,55	719,16	0,49%	0,49%	3,23%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITAD...	221.855,20	0,00	0,00	222.816,39	961,19	0,43%	0,43%	0,49%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RESP LI...	475.321,60	0,00	0,00	477.345,57	2.023,97	0,43%	0,43%	2,75%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA...	113.004,22	0,00	0,00	113.370,02	365,80	0,32%	0,32%	2,68%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	1.608.291,43	0,00	0,00	1.612.552,94	4.261,51	0,26%	0,26%	0,00%

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRI...	293.737,80	0,00	0,00	294.515,99	778,19	0,26%	0,26%	0,01%
BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFEREN...	7.026,31	0,00	0,00	7.044,46	18,15	0,26%	0,26%	0,12%
BB FLUXO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SIMPLES ...	614.070,81	54.526,40	600.000,00	69.754,79	1.157,58	0,17%	0,20%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA...	178.109,40	0,00	0,00	178.364,59	255,19	0,14%	0,14%	2,58%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII RESP LIMITADA FIF RENDA FI...	384.370,53	0,00	0,00	384.920,44	549,91	0,14%	0,14%	1,33%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RESP LIMITADA FIF CI...	74.545,35	792.339,32	662.018,58	205.344,51	478,42	0,06%	0,22%	0,00%
SINGAPORE FIC RENDA FIXA	2.450.058,24	0,00	0,00	2.450.954,11	895,87	0,04%	0,04%	7,43%
CAIXA BRASIL RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERENC...	26.200,57	0,00	0,00	26.201,49	0,92	0,00%	0,00%	0,45%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2.967.794,31	0,00	0,00	2.964.539,46	-3.254,85	-0,11%	-0,11%	4,88%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	150.768,18	0,00	0,00	150.502,63	-265,55	-0,18%	-0,18%	0,08%
Total Renda Fixa	32.081.196,12	846.865,72	1.262.018,58	31.944.024,72	277.981,46	0,87%		7,67%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB CONSUMO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	267.750,49	0,00	0,00	315.164,61	47.414,12	17,71%	17,71%	24,55%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPAATIVO FIC AÇÕES	772.999,20	0,00	0,00	862.469,16	89.469,96	11,57%	11,57%	22,66%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO RESP LIMITADA FIF AÇÕES	368.239,77	0,00	0,00	409.951,83	41.712,06	11,33%	11,33%	24,21%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	363.223,21	0,00	0,00	401.522,49	38.299,28	10,54%	10,54%	23,18%
TIVIO RENDA IMOBILIÁRIA RESP LIMITADA FII - TVRI11	13.925,00	0,00	105,78	15.260,00	1.440,78	10,35%	9,65%	11,80%
SP DOWNTOWN FII - SPTW11	69.490,00	0,00	1.310,00	75.300,00	7.120,00	10,25%	9,20%	17,28%
BB IBOVESPA INDEXADO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	1.148.706,69	0,00	0,00	1.265.962,62	117.255,93	10,21%	10,21%	22,61%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA RESP LIMITADA FIF AÇÕES	338.098,87	0,00	0,00	371.943,09	33.844,22	10,01%	10,01%	22,50%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX RESP LIMITADA FIF CIC A...	528.397,70	0,00	0,00	576.841,10	48.443,40	9,17%	9,17%	26,98%
BB DIVIDENDOS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	492.427,21	0,00	0,00	533.684,05	41.256,84	8,38%	8,38%	20,68%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	38.872,47	0,00	340,00	40.271,08	1.738,61	4,47%	6,97%	30,55%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTI...	584.620,69	0,00	0,00	586.075,48	1.454,79	0,25%	0,25%	0,38%
FP2 FIP MULTISTRATÉGIA	826.796,98	0,00	0,00	826.740,76	-56,22	-0,01%	-	-
HAZ FII - ATR11	948.979,55	0,00	0,00	948.082,72	-896,83	-0,09%	-0,09%	-
IMOBILIÁRIO PARANÁ REC FIP MULTISTRATÉGIA	31.119,43	0,00	0,00	30.975,27	-144,16	-0,46%	-0,46%	0,06%
AUSTRO MULTIPAR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	585.927,20	0,00	0,00	505.822,93	-80.104,27	-13,67%	-13,67%	42,60%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES RESP L...	61.141,94	0,00	0,00	47.427,86	-13.714,08	-22,43%	-22,43%	21,45%
AUSTRO INSTITUCIONAL PIPE BANCOS FIC AÇÕES	305.816,55	0,00	0,00	204.323,06	-101.493,49	-33,19%	-8,17%	17,18%
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTISTRATÉGIA	1.581.738,14	0,00	0,00	299.724,77	-1.282.013,37	-81,05%	-	-

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
Total Renda Variável	9.328.271,09	0,00	1.755,78	8.317.542,88	-1.008.972,43	-10,82%		22,28%

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR NÍ...	619.395,26	0,00	0,00	718.280,49	98.885,23	15,96%	15,96%	16,55%
Total Exterior	619.395,26	0,00	0,00	718.280,49	98.885,23	15,96%		16,55%

Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da CRÉDITO E MERCADO CONSULTORIA DE INVESTIMENTOS.. As informações aqui contidas, tem por somente, o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre o(s) produto(s) mencionado(s), entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros exigidos legalmente. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas aos objetivos, aos riscos e à política de investimento do(s) produto(s). Todas as informações podem ser obtidas com os responsáveis pela distribuição, administração, gestão ou no próprio site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários) através do link: <https://www.gov.br/cvm/pt-br>.

Sua elaboração buscou atender os objetivos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil de investidor.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas aos investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de Consultoria de Valores Mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe a Consultoria de Valores Mobiliários a prestação dos serviços de ORIENTAÇÃO, RECOMENDAÇÃO E ACONSELHAMENTO, DE FORMA PROFISSIONAL, INDEPENDENTE E INDIVIDUALIZADA, SOBRE INVESTIMENTOS NO MERCADO DE VALORES MOBILIÁRIOS, CUJA ADOÇÃO E IMPLEMENTAÇÃO SEJAM EXCLUSIVAS DO CLIENTE (Resolução CVM nº 19/2021).

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no Art. 3º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria MTP nº 1.467/2022, art. 84, inciso III, alínea "a".

Os RPPS DEVEM, independente da contratação de Consultoria de Valores Mobiliários, se adequar às normativas pertinentes e principalmente a Portaria MTP nº 1.467/2022 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963/2021, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.

Relatório Analítico dos Investimentos

em maio de 2020

Este relatório atende a Portaria MTP Nº 1.467, de 2 de junho de 2022.

Carteira consolidada de investimentos - base (Maio / 2020)

CNPJ	Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Lei
25.078.994/0001-90	BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	2.502.797,66	6,41%	595	0,02%	7º I b
13.322.205/0001-35	BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REN...	D+1	Não há	115.638,10	0,30%	882	0,00%	7º I b
13.327.340/0001-73	BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF R...	D+2	Não há	2.341.036,14	6,00%	319	0,12%	7º I b
07.442.078/0001-05	BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REND...	D+1	Não há	1.299.709,87	3,33%	669	0,02%	7º I b
32.161.826/0001-29	BB IRF-M 1+ RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	688.324,06	1,76%	97	0,26%	7º I b
07.111.384/0001-69	BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REND...	D+1	Não há	47.785,21	0,12%	709	0,00%	7º I b
20.734.937/0001-06	BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	D+0	15/08/2018	295.139,08	0,76%	63	0,91%	7º I b
19.523.305/0001-06	BB TÍTULOS PÚBLICOS VII RESP LIMITADA FIF RENDA ...	D+0	15/08/2022	389.724,30	1,00%	165	0,06%	7º I b
25.069.955/0001-26	BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	18/08/2018	1.615.989,17	4,14%	21	2,70%	7º I b
23.215.097/0001-55	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FI...	D+0	Não há	593.691,03	1,52%	752	0,00%	7º I b
14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RESP ...	D+0	Não há	318.068,21	0,81%	955	0,00%	7º I b
10.577.503/0001-88	CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMI...	D+0	Não há	1.358.748,59	3,48%	353	0,07%	7º I b
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITAD...	D+0	Não há	2.412.522,60	6,18%	904	0,04%	7º I b
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMIT...	D+0	Não há	223.692,10	0,57%	1.372	0,00%	7º I b
14.508.605/0001-00	CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITAD...	D+0	Não há	390.076,12	1,00%	441	0,00%	7º I b
09.093.819/0001-15	ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC...	D+1	Não há	151.405,80	0,39%	59	0,01%	7º I b
13.077.415/0001-05	BB FLUXO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SIMPLE...	D+0	Não há	69.742,96	0,18%	744	0,00%	7º IV a
13.077.418/0001-49	BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFER...	D+0	Não há	7.062,48	0,02%	626	0,00%	7º IV a
20.216.216/0001-04	BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF...	D+1	Não há	302.821,65	0,78%	118	0,03%	7º IV a
14.508.643/0001-55	CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RESP LIMITADA FIF ...	D+0	Não há	777.629,34	1,99%	316	0,13%	7º IV a

Carteira consolidada de investimentos - base (Maio / 2020)

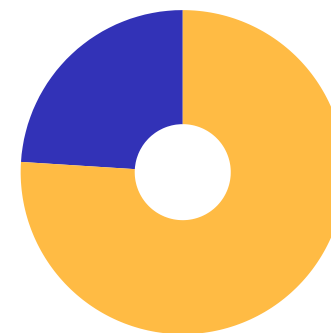
CNPJ	Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Lei
03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERE...	D+0	Não há	26.287,52	0,07%	669	0,00%	7º IV a
12.402.646/0001-84	IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	D+1002	Não há	1.813.743,52	4,65%	12	5,93%	7º IV a
05.073.656/0001-58	ITAÚ IMA-B ATIVO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIX...	D+1	Não há	142.398,74	0,36%	90	0,03%	7º IV a
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITA...	D+1	Não há	179.328,60	0,46%	285	0,00%	7º IV a
15.153.656/0001-11	MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1800	Não há	2.894.145,67	7,41%		0,00%	7º IV a
13.594.673/0001-69	TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	D+31 ou...	Não há	6.398.774,61	16,39%	15	3,64%	7º IV a
01.181.521/0001-55	CDB - BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.	S/Info	Não Informado	1.277.743,53	3,27%		0,00%	7º VI a
06.018.364/0001-85	PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	150.202,24	0,38%	98	0,18%	7º VII a
21.918.896/0001-62	CAIXA BRASIL IPCA XVI RESP LIMITADA FIF RENDA FI...	D+0	18/04/2018	891.014,50	2,28%	71	0,50%	7º VII b
73.899.759/0001-21	BB IBOVESPA INDEXADO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+4	Não há	1.371.881,99	3,51%	7.259	0,74%	8º I a
15.154.236/0001-50	CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA RESP LIMITADA FIF AÇÃO...	D+4	Não há	401.128,61	1,03%	62	0,00%	8º I b
08.973.942/0001-68	BB CONSUMO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+4	Não há	339.592,64	0,87%	13.394	0,11%	8º II a
05.100.191/0001-87	BB DIVIDENDOS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+4	Não há	559.299,47	1,43%	32.548	0,07%	8º II a
17.502.937/0001-68	CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR ...	D+4	Não há	738.259,90	1,89%	98	0,07%	8º II a
15.154.220/0001-47	CAIXA SMALL CAPS ATIVO RESP LIMITADA FIF AÇÕES	D+4	Não há	429.480,38	1,10%	15.975	0,05%	8º II a
13.155.995/0001-01	DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	D+15	Não há	436.456,97	1,12%	1.325	0,36%	8º II a
08.817.414/0001-10	ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	930.921,62	2,38%	53	0,00%	8º II a
23.731.629/0001-07	ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX RESP LIMITADA FIF CIC...	D+24	Não há	629.805,10	1,61%	163	0,00%	8º II a
32.246.546/0001-13	ITAÚ OLIMPO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+3	Não há	3.075,51	0,01%	19.376	0,00%	8º II a
18.366.002/0001-64	AUSTRO MULTIPAR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+1	96 meses	504.327,95	1,29%	33	0,61%	8º III

Carteira consolidada de investimentos - base (Maio / 2020)

CNPJ	Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Lei
29.388.994/0001-47	CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MUL...	D+2	01/10/2020	587.623,07	1,51%	956	0,12%	8º III
20.886.575/0001-60	FP2 FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	826.684,53	2,12%		0,00%	8º IV a
11.490.580/0001-69	GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	299.459,34	0,77%		0,00%	8º IV a
16.720.629/0001-46	IMOBILIÁRIO PARANÁ REC FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	30.830,25	0,08%		0,41%	8º IV a
13.584.584/0001-31	BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES RESP...	Não se ...	Não se aplica	39.427,98	0,10%		0,03%	8º IV b
17.098.794/0001-70	CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	39.531,37	0,10%		0,02%	8º IV b
14.631.148/0001-39	HAZ FII - ATCR11	Não se ...	Não se aplica	948.541,58	2,43%		1,35%	8º IV b
15.538.445/0001-05	SP DOWNTOWN FII - SPTW11	Não se ...	Não se aplica	70.920,00	0,18%		0,05%	8º IV b
14.410.722/0001-29	TIVIO RENDA IMOBILIÁRIA RESP LIMITADA FII - TVRI...	Não se ...	Não se aplica	15.671,00	0,04%		0,00%	8º IV b
28.319.463/0001-30	AUSTRO INSTITUCIONAL PIPE BANCOS FIC AÇÕES	D+31	30/04/2021	164.596,34	0,42%	22	0,45%	NE
Total para cálculo dos limites da Resolução			39.042.759,00					
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			2.428.883,38	Artigo 6º				
PL Total			41.471.642,38					

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Maio / 2020)

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	100,00%	14.744.348,04	37,76%	20,00%	30,00%	90,00%	20.394.135,06
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	23.425.655,40
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea a	40,00%	12.611.935,09	32,30%	10,00%	30,00%	40,00%	3.005.168,51
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea a	15,00%	1.277.743,53	3,27%	0,00%	0,00%	15,00%	4.578.670,32
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea a	5,00%	150.202,24	0,38%	0,00%	0,00%	5,00%	1.801.935,71
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea b	5,00%	891.014,50	2,28%	0,00%	0,00%	5,00%	1.061.123,45
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea c	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.952.137,95
Total Renda Fixa	100,00%	29.675.243,40	76,01%	30,00%	70,00%	220,00%	

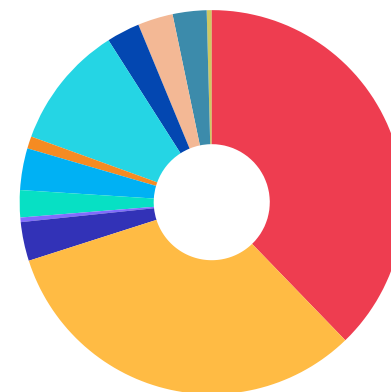


RENDA FIXA 29.675.243,40

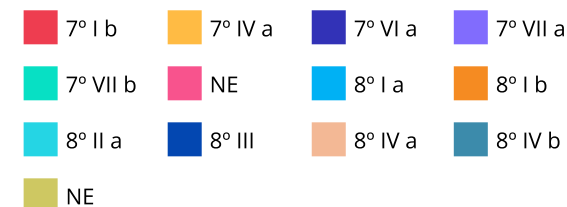
RENDA VARIÁVEL 9.367.515,60

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Maio / 2020)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea a	30,00%	1.371.881,99	3,51%	0,00%	0,00%	5,00%	580.255,96
Artigo 8º, Inciso I, Alínea b	30,00%	401.128,61	1,03%	0,00%	0,00%	5,00%	1.551.009,34
Artigo 8º, Inciso II, Alínea a	20,00%	4.066.891,59	10,42%	7,00%	15,00%	20,00%	3.741.660,21
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	1.091.951,02	2,80%	3,00%	10,00%	10,00%	2.812.324,88
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea a	5,00%	1.156.974,12	2,96%	0,00%	0,00%	5,00%	795.163,83
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea b	5,00%	1.114.091,93	2,85%	0,00%	5,00%	5,00%	838.046,02
Desenquadrado - RV	0,00%	164.596,34	0,42%	0,00%	0,00%	0,00%	-164.596,34
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	9.367.515,60	23,99%	10,00%	30,00%	50,00%	



Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2020			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.952.137,95
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2020		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	1.911.128,25	4,89	20,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea a	0,00	0,00	10,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea a	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	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	5,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea b	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea a	0,00	0,00	7,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	587.623,07	1,51	3,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea a	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea b	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	5,00

Enquadramento por Gestores - base (Maio / 2020)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	11.643.723,13	29,82	0,00
VERITAS CAPITAL MANAGEMENT	11.610.991,75	29,74	0,74
CAIXA DTVM S.A	9.187.753,34	23,53	0,00
SICREDI	1.277.743,53	3,27	0,00
GRAPHEN INVESTIMENTOS	1.129.574,07	2,89	0,80
ITAÚ DTVM	930.921,62	2,38	0,00
ARENA CAPITAL	826.684,53	2,12	-
ITAÚ UNIBANCO	775.279,35	1,99	0,00
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	436.456,97	1,12	0,01
GENIAL GESTÃO LTDA	370.379,34	0,95	0,01
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	330.734,40	0,85	0,00
BANCO BRADESCO	302.821,65	0,78	-
AUSTRO CAPITAL	164.596,34	0,42	0,04
ZION INVEST	39.427,98	0,10	0,01
TIVIO CAPITAL DISTRIBUIDORA DE...	15.671,00	0,04	0,00

Artigo 20º - 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) - (Resolução 4963)

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	1,75%	2,33%	1,10%	3,57%	9,03%	22,17%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,21%	1,43%	0,80%	1,79%	4,61%	11,72%	0,01%	0,35%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,21%	1,43%	0,79%	1,78%	4,59%	11,70%	0,01%	0,35%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REND...	1,91%	1,92%	0,85%	3,04%	8,24%	20,20%	1,06%	3,03%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENC...	2,00%	1,65%	0,63%	2,82%	8,06%	20,02%	1,00%	3,20%
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	0,08%	2,22%	0,82%	3,90%	7,97%	19,75%	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	2,82%	2,26%	0,70%	3,76%	11,39%	26,27%	2,47%	5,79%
IRF-M 1+ (Benchmark)	1,92%	4,94%	2,96%	5,70%	13,65%	31,67%	-	-
BB IRF-M 1+ RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,78%	4,52%	2,64%	5,25%	12,87%	-	2,54%	3,62%
IMA-B 5+ (Benchmark)	1,02%	-7,88%	-8,21%	-5,48%	4,17%	38,08%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FI...	1,00%	-8,04%	-8,27%	-5,69%	3,72%	36,70%	5,80%	15,10%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDE...	1,00%	-7,95%	-8,27%	-5,45%	4,10%	37,43%	5,79%	15,10%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,42%	2,31%	1,47%	2,74%	6,33%	13,97%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIX...	0,39%	2,22%	1,42%	2,63%	6,11%	13,55%	0,20%	0,42%
IMA-B 5 (Benchmark)	2,12%	2,03%	0,82%	3,29%	9,46%	23,93%	-	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	2,16%	2,12%	0,89%	3,37%	9,44%	23,69%	1,33%	3,83%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,30%	2,12%	1,79%	1,75%	-22,25%	-16,50%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	2,09%	2,01%	0,83%	3,26%	9,32%	23,30%	1,26%	3,69%

IMA-B (Benchmark)	1,52%	-3,64%	-4,32%	-1,70%	6,68%	31,99%	-	-
ITAÚ IMA-B ATIVO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	1,59%	-2,29%	-3,16%	-0,29%	9,09%	35,32%	3,82%	9,96%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA ...	1,50%	-3,82%	-4,48%	-1,91%	6,23%	31,21%	3,66%	10,24%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCI...	1,50%	-3,69%	-4,36%	-1,79%	6,48%	31,36%	3,64%	10,13%
CDB - BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.	-	-	-	-	-	-	-	-
IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	-0,02%	-14,98%	-14,37%	-14,57%	-16,69%	-8,96%	6,58%	17,34%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	-5,48%	-15,46%	-16,63%	-14,08%	-10,19%	-9,62%	12,97%	14,54%

IRF-M (Benchmark)	1,42%	4,05%	2,47%	4,69%	11,31%	26,14%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA ...	1,40%	3,94%	2,42%	4,57%	11,04%	25,67%	1,72%	2,64%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCI...	1,38%	3,88%	2,35%	4,51%	11,00%	25,54%	1,73%	2,60%

CDI (Benchmark)	0,24%	1,54%	0,86%	1,92%	4,87%	11,55%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,07%	0,79%	-0,15%	1,76%	7,59%	-	1,74%	4,08%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SI...	0,17%	1,19%	0,66%	1,50%	4,00%	9,71%	0,01%	0,34%
BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVID...	0,26%	1,11%	0,48%	1,47%	4,27%	10,77%	0,05%	0,53%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB FLUXO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,16%	1,11%	0,61%	1,40%	3,77%	9,20%	0,01%	0,33%
CAIXA BRASIL RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,33%	1,12%	0,48%	1,48%	4,25%	10,73%	0,08%	0,53%
IPCA (Benchmark)	-0,38%	-0,16%	-0,62%	0,99%	1,88%	6,62%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	1,38%	3,85%	2,37%	4,46%	11,99%	27,82%	1,72%	3,31%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA ...	0,54%	1,82%	1,22%	2,17%	7,84%	19,42%	0,70%	2,23%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	1,25%	0,64%	0,03%	1,57%	6,31%	18,52%	0,48%	2,44%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	-0,20%	-1,34%	-0,63%	-1,51%	-8,38%	-12,84%	0,04%	5,99%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Maio/2020 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	2,90%	26,74%	26,24%	24,81%	53,67%	68,19%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR NÍVEL I	2,78%	27,29%	26,70%	25,05%	53,85%	66,23%	11,11%	19,51%

Ibovespa (Benchmark)	8,57%	-24,42%	-16,10%	-19,25%	-9,92%	13,87%	-	-
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	8,70%	-25,97%	-17,32%	-21,04%	-11,13%	15,32%	14,22%	37,98%
BB IBOVESPA INDEXADO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	8,37%	-24,85%	-16,32%	-19,81%	-11,64%	9,36%	14,85%	36,49%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	7,94%	-23,23%	-17,32%	-16,88%	-5,23%	19,25%	15,19%	38,36%
ITAÚ OLIMPO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	6,86%	-23,61%	-17,95%	-17,78%	-5,11%	-	14,71%	37,25%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	0,26%	1,68%	1,09%	2,01%	6,33%	-	0,17%	0,96%
AUSTRO INSTITUCIONAL PIPE BANCOS FIC AÇÕES	-19,44%	-49,38%	-46,18%	-48,99%	-50,27%	-25,46%	18,81%	31,19%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	9,18%	-36,23%	-30,73%	-29,72%	-18,72%	6,36%	21,29%	48,68%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA RESP LIMITADA FIF AÇÕES	7,85%	-24,58%	-16,20%	-19,50%	-10,56%	12,39%	14,55%	35,84%
BB CONSUMO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	7,75%	-18,03%	-12,32%	-11,73%	8,00%	31,58%	13,43%	41,87%

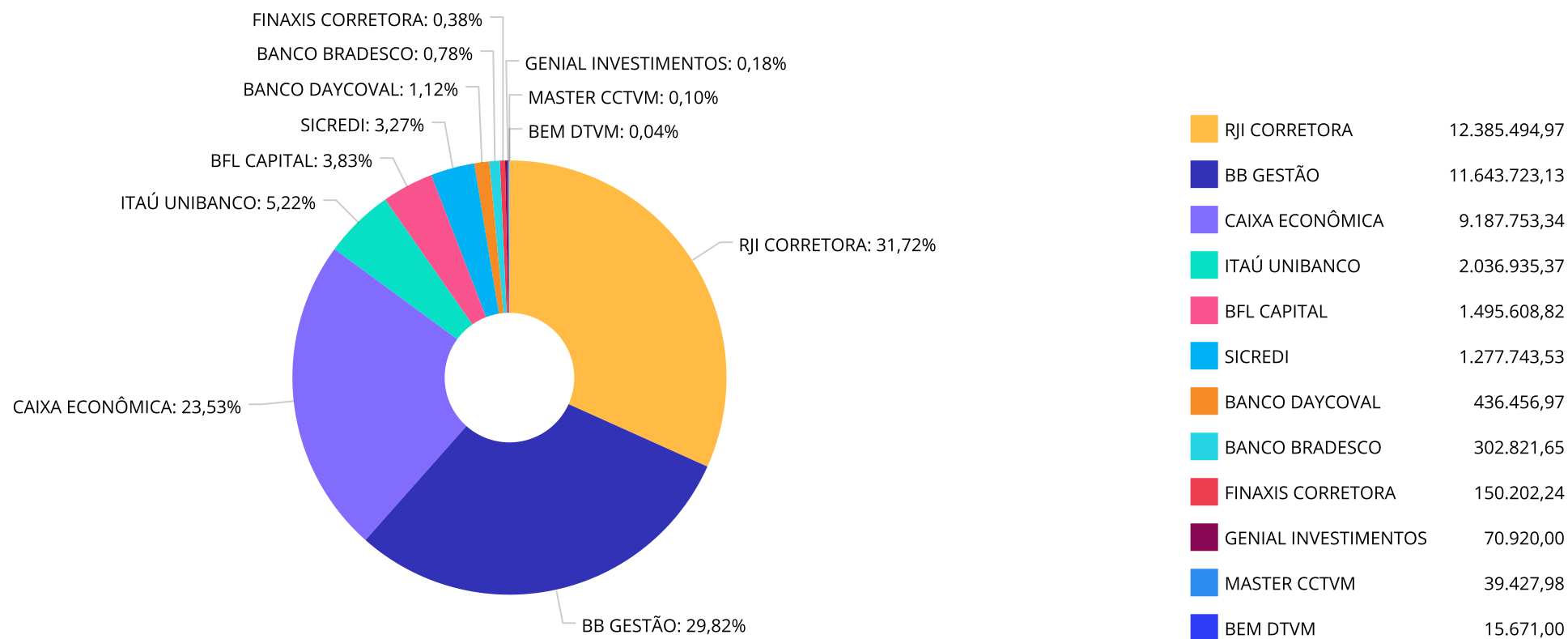
IDIV (Benchmark)	5,00%	-25,08%	-18,87%	-17,60%	-5,50%	29,54%	-	-
BB DIVIDENDOS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	4,80%	-27,09%	-19,79%	-21,10%	-15,56%	10,45%	16,17%	34,68%

IFIX (Benchmark)	2,08%	-16,88%	-10,33%	-8,05%	4,11%	20,03%	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES RESP LIMITADA FII - C...	-16,87%	-46,51%	-42,02%	-34,29%	-53,69%	-64,62%	22,76%	50,88%
SP DOWNTOWN FII - SPTW11	-8,09%	-42,96%	-18,78%	-29,44%	-21,52%	-	14,15%	49,71%

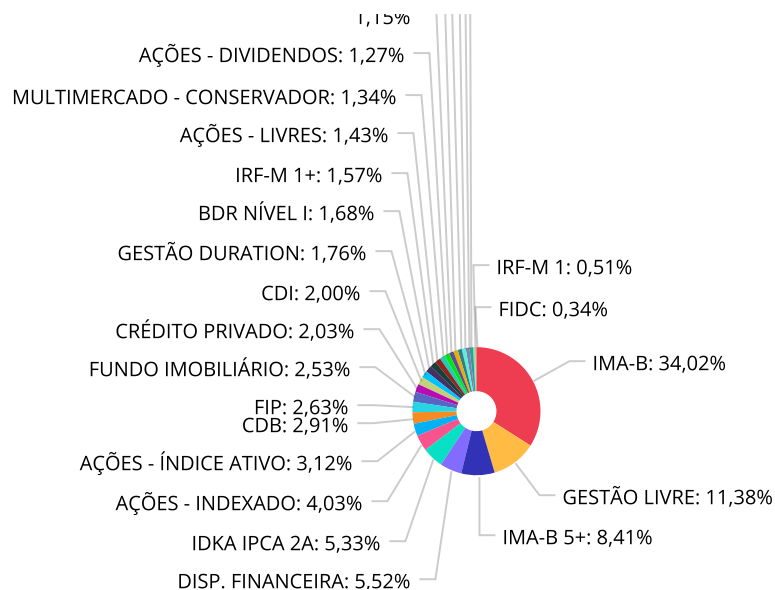
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Maio/2020 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	3,88%	-12,75%	-11,81%	-4,06%	27,46%	-87,48%	12,69%	39,63%
TIVIO RENDA IMOBILIÁRIA RESP LIMITADA FII - TVRI11	2,36%	-9,27%	-3,59%	-2,62%	9,03%	11,93%	4,64%	21,05%
HAZ FII - ATCR11	0,05%	0,10%	0,01%	374,57%	374,57%	374,57%	-	-
IPCA (Benchmark)	-0,38%	-0,16%	-0,62%	0,99%	1,88%	6,62%	-	-
AUSTRO MULTIPAR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-0,30%	-14,95%	-14,08%	-15,06%	-15,75%	-23,03%	0,00%	13,47%
IMOBILIÁRIO PARANÁ REC FIP MULTISTRATÉGIA	-0,47%	-	-	-	-5,45%	-	0,04%	0,26%
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	0,41%	3,96%	1,85%	6,03%	12,53%	30,09%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTISTRATÉGIA	-	-	-	-	-	-	-	-
IPCA + 9,00% ao ano (Benchmark)	0,30%	3,38%	1,51%	5,32%	11,01%	26,59%	-	-
FP2 FIP MULTISTRATÉGIA	-	-	-	-	-	-	-	-
SMLL (Benchmark)	5,07%	-30,73%	-24,82%	-21,96%	-1,69%	25,45%	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO RESP LIMITADA FIF AÇÕES	4,76%	-30,42%	-24,26%	-21,69%	-2,38%	20,38%	18,41%	43,36%

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



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



IMA-B	14.961.295,01	GESTÃO LIVRE	5.005.595,32	IMA-B 5+	3.699.784,73
DISP. FINANCEIRA	2.428.883,38	IDKA IPCA 2A	2.344.834,56	AÇÕES - INDEXADO	1.773.010,60
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	1.370.454,10	CDB	1.277.743,53	FIP	1.156.974,12
FUNDO IMOBILIÁRIO	1.114.091,93	CRÉDITO PRIVADO	891.014,50	CDI	880.722,30
GESTÃO DURATION	773.019,63	BDR NÍVEL I	738.259,90	IRF-M 1+	688.324,06
AÇÕES - LIVRES	629.805,10	MULTIMERCADO - CONSERVADOR	587.623,07	AÇÕES - DIVIDENDOS	559.299,47
MULTIMERCADO - CRÉDITO PRIVADO	504.327,95	AÇÕES - SETORIAIS	504.188,98	IMA-B 5	454.227,45
IRF-M	437.861,33	AÇÕES - SMALL / MID CAPS	429.480,38	VÉRTICE LONGO	389.724,30
IRF-M 1	223.692,10	FIDC	150.202,24		

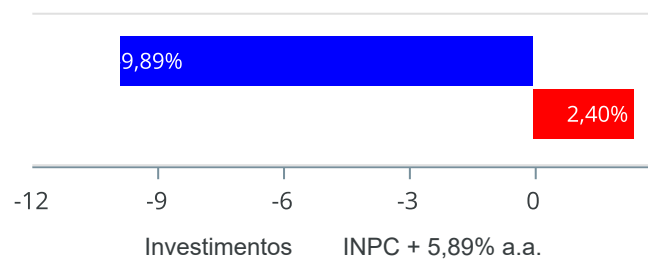
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Maio / 2020)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
------------------	------------	--------	------	-------------	------------	---------	----------	----------

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2020

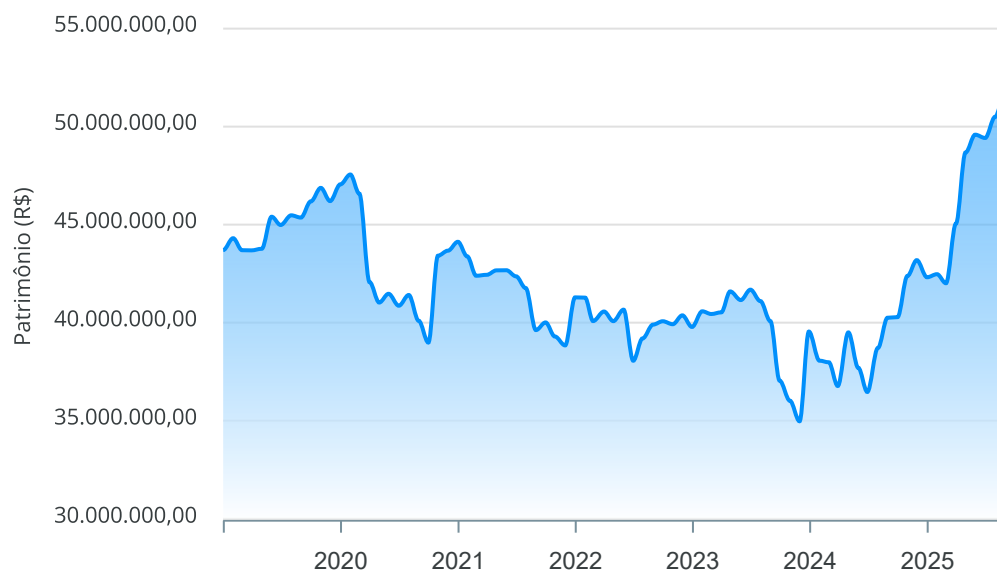
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	47.055.425,39	2.422.019,00	2.034.188,91	47.505.509,53	62.254,05	62.254,05	0,13%	0,13%	0,69%	0,69%	18,97%	3,57%
Fevereiro	47.505.509,53	741.998,43	1.235.261,87	46.536.380,29	-475.865,80	-413.611,75	-1,00%	-0,87%	0,58%	1,28%	-68,31%	4,27%
Março	46.536.380,29	900.214,98	1.398.061,94	42.028.862,47	-4.009.670,86	-4.423.282,61	-8,62%	-9,41%	0,68%	1,97%	-478,62%	19,75%
Abril	42.028.862,47	846.865,72	1.263.774,36	40.979.848,09	-632.105,74	-5.055.388,35	-1,50%	-10,78%	0,22%	2,20%	-490,84%	10,27%
Maio	40.979.848,09	1.979.674,69	4.323.488,01	39.042.759,00	406.724,23	-4.648.664,12	0,99%	-9,89%	0,20%	2,40%	-411,41%	7,24%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



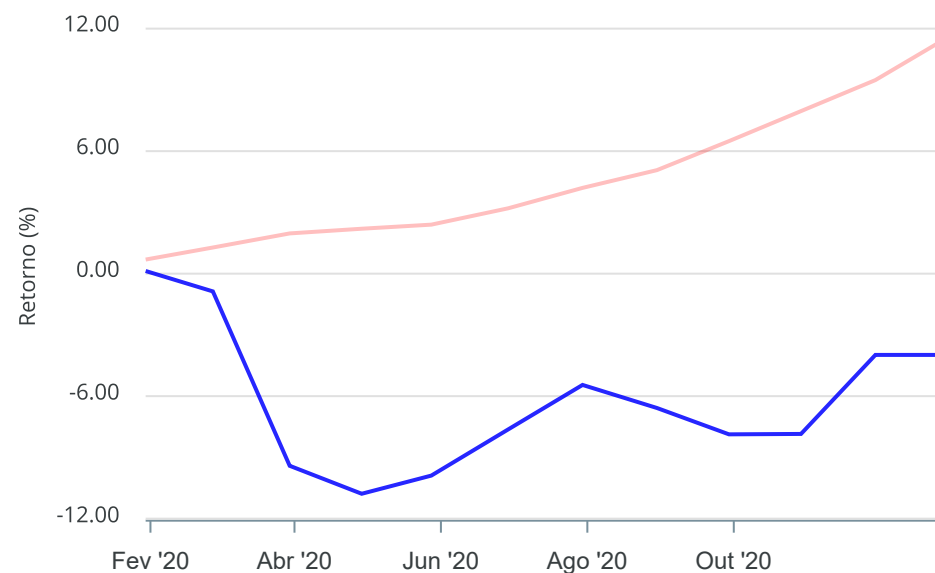
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



Investimentos Meta de Rentabilidade ☐ CDI ☐ IMA-B

☐ IMA-B 5 ☐ IMA-B 5+ ☐ IMA Geral ☐ IRF-M ☐ IRF-M 1

☐ IRF-M 1+ ☐ Ibovespa ☐ IBX ☐ SMLL ☐ IDIV

Investimentos Meta de Rentabilidade ☐ 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 Maio/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IPCA XVI RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA...	866.604,50	0,00	0,00	891.014,50	24.410,00	2,82%	2,82%	2,47%
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF C...	296.410,52	0,00	0,00	302.821,65	6.411,13	2,16%	2,16%	1,33%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC R...	148.307,55	0,00	0,00	151.405,80	3.098,25	2,09%	2,09%	1,26%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA...	113.370,02	0,00	0,00	115.638,10	2.268,08	2,00%	2,00%	1,00%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RESP LI...	477.345,57	0,00	168.000,00	318.068,21	8.722,64	1,83%	1,91%	1,06%
BB IRF-M 1+ RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENC...	676.260,66	0,00	0,00	688.324,06	12.063,40	1,78%	1,78%	2,54%
ITAÚ IMA-B ATIVO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	140.170,67	0,00	0,00	142.398,74	2.228,07	1,59%	1,59%	3,82%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA ...	1.280.485,17	0,00	0,00	1.299.709,87	19.224,70	1,50%	1,50%	3,64%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA ...	2.376.854,94	0,00	0,00	2.412.522,60	35.667,66	1,50%	1,50%	3,66%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA ...	384.707,62	0,00	0,00	390.076,12	5.368,50	1,40%	1,40%	1,72%
CDB - BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.	1.260.254,87	0,00	0,00	1.277.743,53	17.488,66	1,39%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FIF ...	585.616,98	0,00	0,00	593.691,03	8.074,05	1,38%	1,38%	1,72%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA ...	47.135,71	0,00	0,00	47.785,21	649,50	1,38%	1,38%	1,73%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII RESP LIMITADA FIF RENDA FI...	384.920,44	0,00	0,00	389.724,30	4.803,86	1,25%	1,25%	0,48%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.476.248,71	0,00	0,00	2.502.797,66	26.548,95	1,07%	1,07%	1,74%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITA...	1.345.294,75	0,00	0,00	1.358.748,59	13.453,84	1,00%	1,00%	5,80%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REN...	2.317.912,55	0,00	0,00	2.341.036,14	23.123,59	1,00%	1,00%	5,79%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA...	178.364,59	0,00	0,00	179.328,60	964,01	0,54%	0,54%	0,70%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITAD...	222.816,39	0,00	0,00	223.692,10	875,71	0,39%	0,39%	0,20%
CAIXA BRASIL RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERENC...	26.201,49	0,00	0,00	26.287,52	86,03	0,33%	0,33%	0,08%

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFEREN...	7.044,46	0,00	0,00	7.062,48	18,02	0,26%	0,26%	0,05%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	1.612.552,94	0,00	0,00	1.615.989,17	3.436,23	0,21%	0,21%	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRI...	294.515,99	0,00	0,00	295.139,08	623,09	0,21%	0,21%	0,01%
BB FLUXO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SIMPLES ...	69.754,79	447.488,86	448.000,00	69.742,96	499,31	0,10%	0,16%	0,01%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RESP LIMITADA FIF CI...	205.344,51	1.529.357,13	957.723,31	777.629,34	651,01	0,04%	0,17%	0,01%
IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	1.814.147,70	0,00	0,00	1.813.743,52	-404,18	-0,02%	0,30%	6,58%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	6.769.384,43	0,00	363.688,94	6.398.774,61	-6.920,88	-0,10%	-5,47%	12,97%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	150.502,63	0,00	0,00	150.202,24	-300,39	-0,20%	-0,20%	0,04%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2.964.539,46	0,00	0,00	2.894.145,67	-70.393,79	-2,37%	-	-
SINGAPORE FIC RENDA FIXA	2.450.954,11	0,00	2.384.619,98	0,00	-66.334,13	-2,71%	-2,71%	4,51%
Total Renda Fixa	31.944.024,72	1.976.845,99	4.322.032,23	29.675.243,40	76.404,92	0,24%		5,57%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX RESP LIMITADA FIF CIC A...	576.841,10	0,00	0,00	629.805,10	52.964,00	9,18%	9,18%	21,29%
ITAÚ OLIMPO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	0,00	2.828,70	0,00	3.075,51	246,81	8,73%	6,86%	14,71%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	401.522,49	0,00	0,00	436.456,97	34.934,48	8,70%	8,70%	14,22%
BB IBOVESPA INDEXADO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	1.265.962,62	0,00	0,00	1.371.881,99	105.919,37	8,37%	8,37%	14,85%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	862.469,16	0,00	0,00	930.921,62	68.452,46	7,94%	7,94%	15,19%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA RESP LIMITADA FIF AÇÕES	371.943,09	0,00	0,00	401.128,61	29.185,52	7,85%	7,85%	14,55%
BB CONSUMO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	315.164,61	0,00	0,00	339.592,64	24.428,03	7,75%	7,75%	13,43%
BB DIVIDENDOS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	533.684,05	0,00	0,00	559.299,47	25.615,42	4,80%	4,80%	16,17%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO RESP LIMITADA FIF AÇÕES	409.951,83	0,00	0,00	429.480,38	19.528,55	4,76%	4,76%	18,41%
TIVIO RENDA IMOBILIÁRIA RESP LIMITADA FII - TVRI11	15.260,00	0,00	105,78	15.671,00	516,78	3,39%	2,36%	4,64%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTI...	586.075,48	0,00	0,00	587.623,07	1.547,59	0,26%	0,26%	0,17%
HAZ FII - ATCR11	948.082,72	0,00	0,00	948.541,58	458,86	0,05%	0,05%	-
FP2 FIP MULTIESTRATÉGIA	826.740,76	0,00	0,00	826.684,53	-56,23	-0,01%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	299.724,77	0,00	0,00	299.459,34	-265,43	-0,09%	-	-
AUSTRO MULTIPAR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	505.822,93	0,00	0,00	504.327,95	-1.494,98	-0,30%	-0,30%	0,00%
IMOBILIÁRIO PARANÁ REC FIP MULTIESTRATÉGIA	30.975,27	0,00	0,00	30.830,25	-145,02	-0,47%	-0,47%	0,04%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	40.271,08	0,00	340,00	39.531,37	-399,71	-0,99%	3,87%	12,69%
SP DOWNTOWN FII - SPTW11	75.300,00	0,00	1.010,00	70.920,00	-3.370,00	-4,48%	-8,09%	14,15%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES RESP L...	47.427,86	0,00	0,00	39.427,98	-7.999,88	-16,87%	-16,87%	22,76%
AUSTRO INSTITUCIONAL PIPE BANCOS FIC AÇÕES	204.323,06	0,00	0,00	164.596,34	-39.726,72	-19,44%	-19,44%	18,81%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
Total Renda Variável	8.317.542,88	2.828,70	1.455,78	8.629.255,70	310.339,90	3,73%		13,30%

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR NÍ...	718.280,49	0,00	0,00	738.259,90	19.979,41	2,78%	2,78%	11,11%
Total Exterior	718.280,49	0,00	0,00	738.259,90	19.979,41	2,78%		11,11%

Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da CRÉDITO E MERCADO CONSULTORIA DE INVESTIMENTOS.. As informações aqui contidas, tem por somente, o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre o(s) produto(s) mencionado(s), entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros exigidos legalmente. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas aos objetivos, aos riscos e à política de investimento do(s) produto(s). Todas as informações podem ser obtidas com os responsáveis pela distribuição, administração, gestão ou no próprio site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários) através do link: <https://www.gov.br/cvm/pt-br>.

Sua elaboração buscou atender os objetivos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil de investidor.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas aos investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de Consultoria de Valores Mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe a Consultoria de Valores Mobiliários a prestação dos serviços de ORIENTAÇÃO, RECOMENDAÇÃO E ACONSELHAMENTO, DE FORMA PROFISSIONAL, INDEPENDENTE E INDIVIDUALIZADA, SOBRE INVESTIMENTOS NO MERCADO DE VALORES MOBILIÁRIOS, CUJA ADOÇÃO E IMPLEMENTAÇÃO SEJAM EXCLUSIVAS DO CLIENTE (Resolução CVM nº 19/2021).

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no Art. 3º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria MTP nº 1.467/2022, art. 84, inciso III, alínea "a".

Os RPPS DEVEM, independente da contratação de Consultoria de Valores Mobiliários, se adequar às normativas pertinentes e principalmente a Portaria MTP nº 1.467/2022 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963/2021, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.

Relatório Analítico dos Investimentos

em junho, 2º trimestre e 1º semestre de 2020

Este relatório atende a Portaria MTP Nº 1.467, de 2 de junho de 2022.

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2020)

CNPJ	Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Lei
25.078.994/0001-90	BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	2.526.541,50	6,19%	600	0,02%	7º I b
13.322.205/0001-35	BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REN...	D+1	Não há	117.040,81	0,29%	884	0,00%	7º I b
13.327.340/0001-73	BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF R...	D+2	Não há	2.406.586,28	5,90%	310	0,12%	7º I b
07.442.078/0001-05	BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REND...	D+1	Não há	1.325.958,15	3,25%	670	0,02%	7º I b
32.161.826/0001-29	BB IRF-M 1+ RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	695.414,83	1,70%	106	0,21%	7º I b
07.111.384/0001-69	BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REND...	D+1	Não há	48.154,10	0,12%	714	0,00%	7º I b
20.734.937/0001-06	BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	D+0	15/08/2018	295.692,37	0,72%	60	0,94%	7º I b
19.523.305/0001-06	BB TÍTULOS PÚBLICOS VII RESP LIMITADA FIF RENDA ...	D+0	15/08/2022	393.591,54	0,96%	165	0,06%	7º I b
25.069.955/0001-26	BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	18/08/2018	1.619.045,49	3,97%	21	2,70%	7º I b
23.215.097/0001-55	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FI...	D+0	Não há	598.141,40	1,47%	763	0,00%	7º I b
14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RESP ...	D+0	Não há	321.806,39	0,79%	956	0,00%	7º I b
10.577.503/0001-88	CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMI...	D+0	Não há	1.397.163,70	3,42%	340	0,07%	7º I b
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITAD...	D+0	Não há	2.461.380,89	6,03%	901	0,04%	7º I b
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMIT...	D+0	Não há	19.223,93	0,05%	1.364	0,00%	7º I b
09.093.819/0001-15	ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC...	D+1	Não há	153.026,38	0,37%	59	0,01%	7º I b
13.077.415/0001-05	BB FLUXO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SIMPLE...	D+0	Não há	266.941,31	0,65%	742	0,02%	7º IV a
13.077.418/0001-49	BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFER...	D+0	Não há	7.080,84	0,02%	608	0,00%	7º IV a
20.216.216/0001-04	BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF...	D+1	Não há	306.124,08	0,75%	119	0,04%	7º IV a
14.508.643/0001-55	CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RESP LIMITADA FIF ...	D+0	Não há	183.881,07	0,45%	318	0,04%	7º IV a
03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERE...	D+0	Não há	26.351,33	0,06%	678	0,00%	7º IV a

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2020)

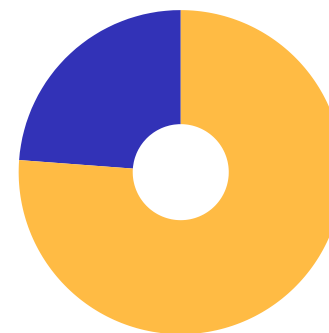
CNPJ	Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Lei
12.402.646/0001-84	IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	D+1002	Não há	1.555.917,86	3,81%	12	6,00%	7º IV a
05.073.656/0001-58	ITAÚ IMA-B ATIVO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIX...	D+1	Não há	145.237,45	0,36%	91	0,03%	7º IV a
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITA...	D+1	Não há	180.110,18	0,44%	287	0,00%	7º IV a
15.153.656/0001-11	MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1800	Não há	5.408.808,60	13,25%	14	3,98%	7º IV a
13.594.673/0001-69	TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	D+31 ou...	Não há	6.298.659,38	15,43%	15	3,64%	7º IV a
01.181.521/0001-55	CDB - BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.	S/Info	Não Informado	1.289.984,34	3,16%		0,00%	7º VI a
06.018.364/0001-85	PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	149.883,36	0,37%	98	0,18%	7º VII a
21.918.896/0001-62	CAIXA BRASIL IPCA XVI RESP LIMITADA FIF RENDA FI...	D+0	18/04/2018	902.269,00	2,21%	71	0,50%	7º VII b
73.899.759/0001-21	BB IBOVESPA INDEXADO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+4	Não há	1.487.184,20	3,64%	7.184	0,76%	8º I a
15.154.236/0001-50	CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA RESP LIMITADA FIF AÇÃO...	D+4	Não há	437.670,37	1,07%	62	0,00%	8º I b
08.973.942/0001-68	BB CONSUMO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+4	Não há	373.274,94	0,91%	13.821	0,10%	8º II a
05.100.191/0001-87	BB DIVIDENDOS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+4	Não há	596.135,38	1,46%	32.608	0,07%	8º II a
17.502.937/0001-68	CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR ...	D+4	Não há	770.517,73	1,89%	104	0,07%	8º II a
15.154.220/0001-47	CAIXA SMALL CAPS ATIVO RESP LIMITADA FIF AÇÕES	D+4	Não há	484.854,53	1,19%	16.254	0,04%	8º II a
13.155.995/0001-01	DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	D+15	Não há	479.920,43	1,18%	1.309	0,34%	8º II a
08.817.414/0001-10	ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	1.011.152,51	2,48%	53	0,12%	8º II a
23.731.629/0001-07	ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX RESP LIMITADA FIF CIC...	D+24	Não há	705.999,37	1,73%	162	0,02%	8º II a
32.246.546/0001-13	ITAÚ OLIMPO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+3	Não há	3.984,82	0,01%	19.852	0,00%	8º II a
18.366.002/0001-64	AUSTRO MULTIPAR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+1	96 meses	502.762,70	1,23%	33	0,61%	8º III
29.388.994/0001-47	CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MUL...	D+2	01/10/2020	588.267,97	1,44%	956	0,12%	8º III

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 2020)

CNPJ	Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Lei
20.886.575/0001-60	FP2 FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	826.628,31	2,03%		0,00%	8º IV a
11.490.580/0001-69	GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	123.657,04	0,30%		0,00%	8º IV a
16.720.629/0001-46	IMOBILIÁRIO PARANÁ REC FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	30.685,82	0,08%		0,41%	8º IV a
13.584.584/0001-31	BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES RESP...	Não se ...	Não se aplica	40.570,82	0,10%		0,03%	8º IV b
17.098.794/0001-70	CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	40.327,11	0,10%		0,02%	8º IV b
14.631.148/0001-39	HAZ FII - ATCR11	Não se ...	Não se aplica	969.932,78	2,38%		1,35%	8º IV b
15.538.445/0001-05	SP DOWNTOWN FII - SPTW11	Não se ...	Não se aplica	71.210,00	0,17%		0,05%	8º IV b
14.410.722/0001-29	TIVIO RENDA IMOBILIÁRIA RESP LIMITADA FII - TVRI...	Não se ...	Não se aplica	16.376,00	0,04%		0,00%	8º IV b
28.319.463/0001-30	AUSTRO INSTITUCIONAL PIPE BANCOS FIC AÇÕES	D+31	30/04/2021	158.319,45	0,39%	22	0,45%	NE
Total para cálculo dos limites da Resolução			40.819.448,84					
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			44.813,72	Artigo 6º				
PL Total			40.864.262,56					

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Junho / 2020)

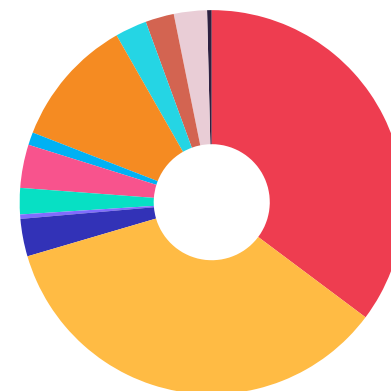
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	100,00%	14.378.767,76	35,23%	20,00%	30,00%	90,00%	22.358.736,20
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	24.491.669,30
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea a	40,00%	14.379.112,10	35,23%	10,00%	30,00%	40,00%	1.948.667,44
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea a	15,00%	1.289.984,34	3,16%	0,00%	0,00%	15,00%	4.832.932,99
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea a	5,00%	149.883,36	0,37%	0,00%	0,00%	5,00%	1.891.089,08
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea b	5,00%	902.269,00	2,21%	0,00%	0,00%	5,00%	1.138.703,44
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea c	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.040.972,44
Total Renda Fixa	100,00%	31.100.016,56	76,19%	30,00%	70,00%	220,00%	



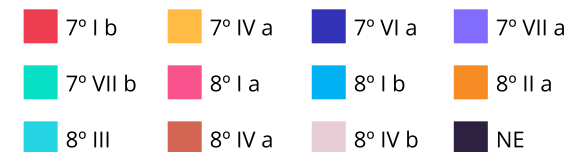
RENDA FIXA 31.100.016,56
RENDA VARIÁVEL 9.719.432,28

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Junho / 2020)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea a	30,00%	1.487.184,20	3,64%	0,00%	0,00%	5,00%	553.788,24
Artigo 8º, Inciso I, Alínea b	30,00%	437.670,37	1,07%	0,00%	0,00%	5,00%	1.603.302,07
Artigo 8º, Inciso II, Alínea a	20,00%	4.425.839,71	10,84%	7,00%	15,00%	20,00%	3.738.050,06
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	1.091.030,67	2,67%	3,00%	10,00%	10,00%	2.990.914,21
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea a	5,00%	980.971,17	2,40%	0,00%	0,00%	5,00%	1.060.001,27
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea b	5,00%	1.138.416,71	2,79%	0,00%	5,00%	5,00%	902.555,73
Desenquadrado - RV	0,00%	158.319,45	0,39%	0,00%	0,00%	0,00%	-158.319,45
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	9.719.432,28	23,81%	10,00%	30,00%	50,00%	



Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2020			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.040.972,44
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2020		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	1.914.737,86	4,69	20,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea a	0,00	0,00	10,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea a	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	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	5,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea b	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea a	0,00	0,00	7,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	588.267,97	1,44	3,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea a	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea b	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	5,00

Enquadramento por Gestores - base (Junho / 2020)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
VERITAS CAPITAL MANAGEMENT	13.766.148,54	33,72	0,83
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	12.158.641,74	29,79	0,00
CAIXA DTVM S.A	8.231.855,42	20,17	0,00
SICREDI	1.289.984,34	3,16	0,00
GRAPHEN INVESTIMENTOS	1.150.501,96	2,82	0,82
ITAÚ DTVM	1.011.152,51	2,48	0,00
ITAÚ UNIBANCO	855.221,64	2,10	0,00
ARENA CAPITAL	826.628,31	2,03	-
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	479.920,43	1,18	0,01
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	333.136,56	0,82	0,00
BANCO BRADESCO	306.124,08	0,75	-
GENIAL GESTÃO LTDA	194.867,04	0,48	0,00
AUSTRO CAPITAL	158.319,45	0,39	0,02
ZION INVEST	40.570,82	0,10	0,01
TIVIO CAPITAL DISTRIBUIDORA DE...	16.376,00	0,04	0,00

Artigo 20º - 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) - (Resolução 4963)

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,99%	3,35%	3,35%	3,35%	8,68%	23,17%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,19%	1,62%	0,67%	1,62%	4,34%	10,69%	0,01%	0,38%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,19%	1,62%	0,67%	1,62%	4,32%	10,68%	0,01%	0,38%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REND...	1,18%	3,12%	3,54%	3,12%	8,19%	21,36%	0,86%	3,02%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENC...	1,21%	2,88%	3,57%	2,88%	8,18%	21,13%	0,81%	3,22%
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	0,75%	2,99%	0,98%	2,99%	8,25%	18,56%	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	1,26%	3,55%	5,02%	3,55%	9,75%	27,65%	1,61%	5,45%
IRF-M 1+ (Benchmark)	1,04%	6,03%	4,53%	6,03%	11,57%	33,23%	-	-
BB IRF-M 1+ RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,03%	5,60%	4,14%	5,60%	11,16%	-	1,75%	3,20%
IMA-B 5+ (Benchmark)	2,84%	-5,26%	5,99%	-5,26%	1,68%	43,55%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FI...	2,83%	-5,44%	5,88%	-5,44%	1,57%	42,12%	4,98%	14,52%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDE...	2,80%	-5,38%	5,82%	-5,38%	1,88%	42,80%	4,98%	14,51%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,28%	2,60%	1,15%	2,60%	5,98%	13,67%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIX...	0,26%	2,48%	1,09%	2,48%	5,78%	13,28%	0,05%	0,48%
IMA-B 5 (Benchmark)	1,12%	3,17%	3,77%	3,17%	8,73%	24,75%	-	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	1,09%	3,23%	3,84%	3,23%	8,75%	24,57%	0,94%	3,71%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,40%	1,71%	-0,81%	1,71%	-5,46%	-17,39%	8,75%	5,23%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	1,07%	3,10%	3,69%	3,10%	8,64%	24,11%	0,90%	3,56%

IMA-B (Benchmark)	2,05%	-1,66%	4,96%	-1,66%	4,73%	35,13%	-	-
ITAÚ IMA-B ATIVO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	1,99%	-0,34%	5,20%	-0,34%	6,72%	38,42%	3,03%	9,33%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA ...	2,03%	-1,88%	4,91%	-1,88%	4,52%	34,35%	2,99%	9,81%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCI...	2,02%	-1,75%	4,90%	-1,75%	4,74%	34,48%	2,98%	9,69%
CDB - BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.	-	-	-	-	-	-	-	-
IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	-15,00%	-27,73%	-13,22%	-27,73%	-30,24%	-22,48%	25,72%	21,63%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	-1,57%	-16,78%	-6,29%	-16,78%	-13,33%	-10,36%	2,83%	14,22%

IRF-M (Benchmark)	0,79%	4,86%	3,39%	4,86%	9,64%	27,08%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCI...	0,77%	4,68%	3,26%	4,68%	9,51%	26,49%	1,17%	2,21%

CDI (Benchmark)	0,21%	1,75%	0,73%	1,75%	4,58%	11,21%	-	-
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SI...	0,15%	1,34%	0,54%	1,34%	3,73%	9,38%	0,01%	0,37%
BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVID...	0,26%	1,37%	0,78%	1,37%	4,06%	10,51%	0,03%	0,52%
BB FLUXO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,13%	1,24%	0,49%	1,24%	3,50%	8,88%	0,01%	0,36%
CAIXA BRASIL RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,24%	1,37%	0,58%	1,37%	4,03%	10,44%	0,03%	0,53%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,95%	1,75%	2,96%	1,75%	6,31%	-	1,27%	3,75%
IPCA (Benchmark)	0,26%	0,10%	-0,43%	0,10%	2,12%	5,57%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	0,75%	4,63%	3,27%	4,63%	9,82%	28,20%	1,17%	2,68%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA ...	0,44%	2,27%	1,12%	2,27%	5,62%	19,25%	0,38%	0,78%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	0,99%	1,64%	2,40%	1,64%	6,28%	19,00%	0,45%	2,44%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	-0,21%	-1,55%	-0,59%	-1,55%	-8,44%	-12,07%	0,05%	5,98%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2020 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	4,50%	32,44%	25,08%	32,44%	52,91%	68,50%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR NÍVEL I	4,37%	32,85%	24,40%	32,85%	54,59%	66,72%	12,44%	19,52%

Ibovespa (Benchmark)	8,76%	-17,80%	30,18%	-17,80%	-6,20%	30,64%	-	-
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	9,96%	-18,59%	32,13%	-18,59%	-5,81%	32,56%	11,13%	39,19%
BB IBOVESPA INDEXADO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	8,41%	-18,53%	29,47%	-18,53%	-7,76%	25,22%	12,48%	37,35%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	8,62%	-16,61%	30,81%	-16,61%	-1,66%	35,75%	11,52%	39,06%
ITAÚ OLIMPO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	10,79%	-15,37%	31,18%	-15,37%	-0,38%	-	11,00%	38,42%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	0,11%	1,79%	0,62%	1,79%	5,40%	-	0,03%	0,88%
AUSTRO INSTITUCIONAL PIPE BANCOS FIC AÇÕES	-3,81%	-51,31%	-28,84%	-51,31%	-52,41%	-20,03%	22,65%	30,62%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	12,10%	-28,51%	33,61%	-28,51%	-13,13%	23,01%	14,62%	50,07%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA RESP LIMITADA FIF AÇÕES	9,11%	-17,71%	29,45%	-17,71%	-6,12%	29,35%	12,43%	36,87%
BB CONSUMO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	9,92%	-9,90%	39,41%	-9,90%	14,49%	51,41%	11,30%	42,70%

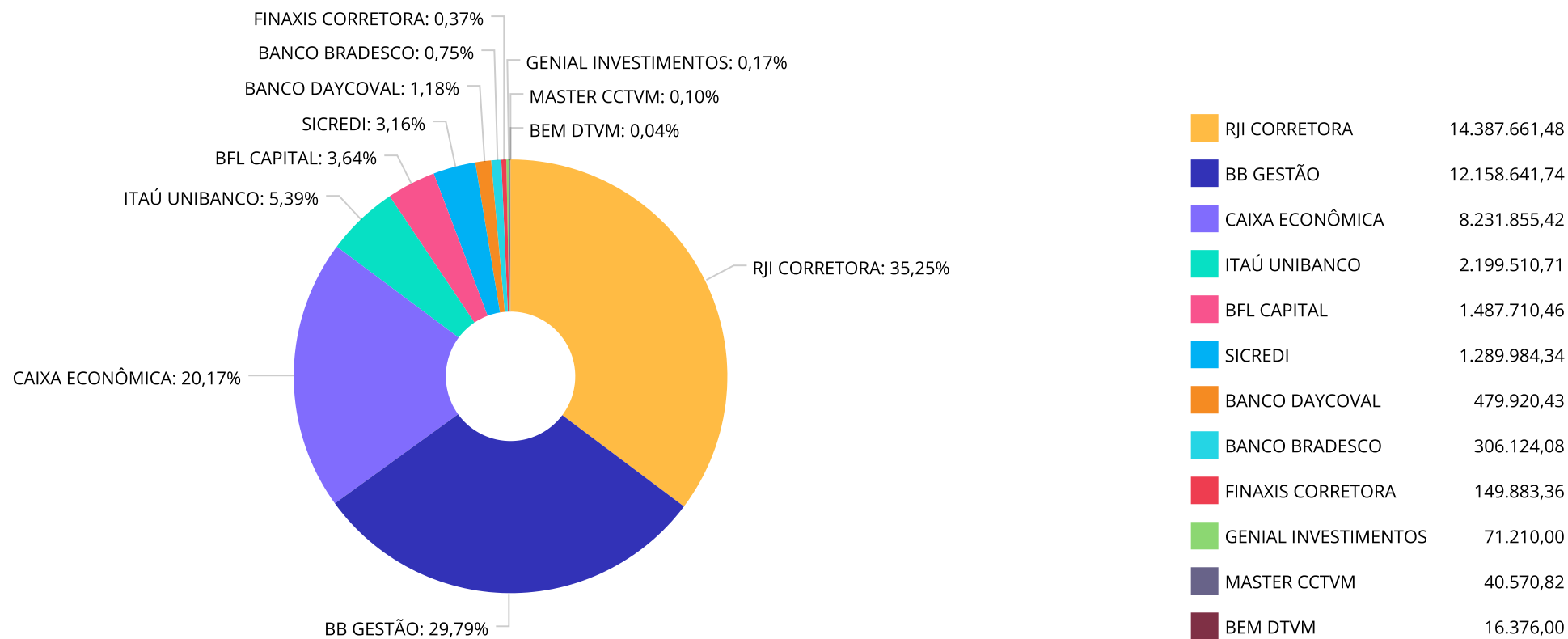
IDIV (Benchmark)	8,95%	-18,38%	18,70%	-18,38%	0,08%	47,52%	-	-
BB DIVIDENDOS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	6,59%	-22,29%	21,06%	-22,29%	-12,10%	24,15%	12,04%	35,35%

IFIX (Benchmark)	5,59%	-12,24%	12,52%	-12,24%	6,76%	32,05%	-	-
SP DOWNTOWN FII - SPTW11	1,93%	-41,86%	4,26%	-41,86%	-19,12%	-	7,27%	49,74%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	20,00%	4,71%	34,34%	4,71%	51,16%	-82,97%	15,34%	43,15%

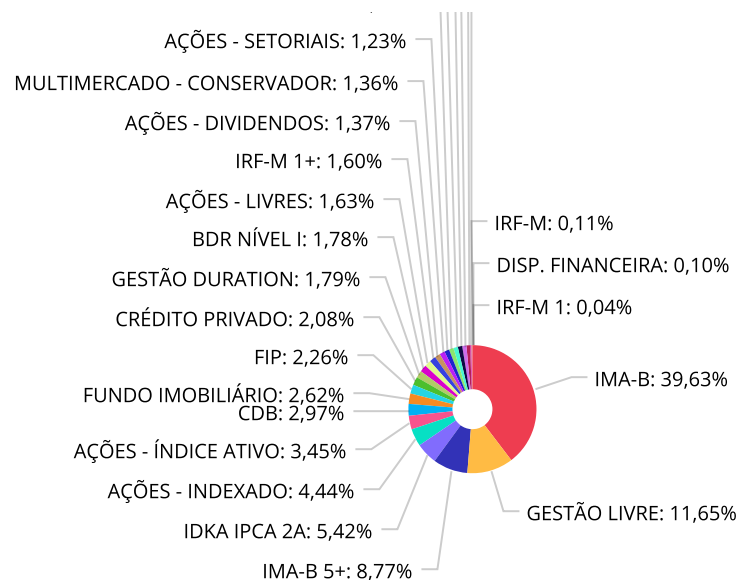
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2020 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
TIVIO RENDA IMOBILIÁRIA RESP LIMITADA FII - TVRI11	5,33%	-4,43%	19,13%	-4,43%	12,33%	31,21%	4,52%	21,24%
HAZ FII - ATCR11	2,26%	2,36%	2,21%	2,36%	385,27%	385,27%	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES RESP LIMITADA FII - C...	2,90%	-44,96%	-33,65%	-44,96%	-60,34%	-71,02%	16,11%	43,95%
IPCA (Benchmark)	0,26%	0,10%	-0,43%	0,10%	2,12%	5,57%	-	-
AUSTRO MULTIPAR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-0,31%	-15,21%	-14,19%	-15,21%	-15,91%	-23,00%	0,00%	13,45%
IMOBILIÁRIO PARANÁ REC FIP MULTISTRATÉGIA	-0,47%	-	-	-	-5,22%	-	0,04%	0,05%
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	1,10%	5,10%	2,01%	5,10%	12,85%	28,80%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTISTRATÉGIA	-	-	-	-	-96,85%	-96,83%	-	-
IPCA + 9,00% ao ano (Benchmark)	0,98%	4,40%	1,67%	4,40%	11,32%	25,34%	-	-
FP2 FIP MULTISTRATÉGIA	-	-	-	-	-	-	-	-
SMLL (Benchmark)	14,43%	-20,73%	32,49%	-20,73%	5,76%	49,01%	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO RESP LIMITADA FIF AÇÕES	12,89%	-21,45%	31,67%	-21,45%	3,57%	42,14%	16,18%	44,76%

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



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



IMA-B	17.195.962,33	GESTÃO LIVRE	5.053.083,00	IMA-B 5+	3.803.749,98
IDKA IPCA 2A	2.353.585,06	AÇÕES - INDEXADO	1.924.854,57	AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	1.495.057,76
CDB	1.289.984,34	FUNDO IMOBILIÁRIO	1.138.416,71	FIP	980.971,17
CRÉDITO PRIVADO	902.269,00	GESTÃO DURATION	778.251,58	BDR NÍVEL I	770.517,73
AÇÕES - LIVRES	705.999,37	IRF-M 1+	695.414,83	AÇÕES - DIVIDENDOS	596.135,38
MULTIMERCADO - CONSERVADOR	588.267,97	AÇÕES - SETORIAIS	531.594,39	MULTIMERCADO - CRÉDITO PRIVADO	502.762,70
AÇÕES - SMALL / MID CAPS	484.854,53	CDI	484.254,55	IMA-B 5	459.150,46
VÉRTICE LONGO	393.591,54	FIDC	149.883,36	IRF-M	48.154,10
DISP. FINANCEIRA	44.813,72	IRF-M 1	19.223,93		

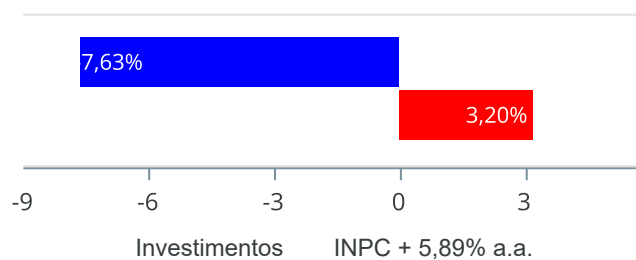
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Junho / 2020)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
------------------	------------	--------	------	-------------	------------	---------	----------	----------

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2020

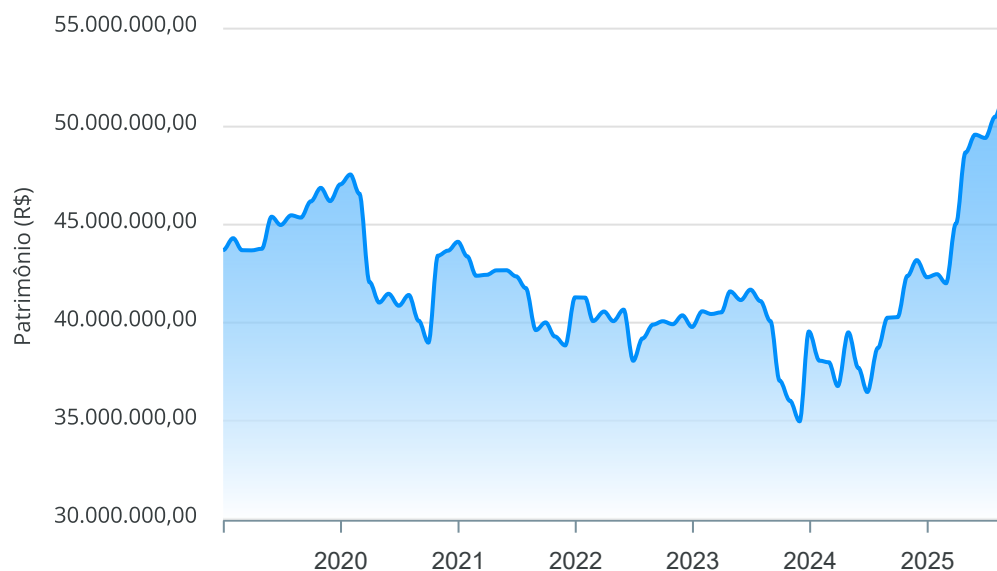
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	47.055.425,39	2.422.019,00	2.034.188,91	47.505.509,53	62.254,05	62.254,05	0,13%	0,13%	0,69%	0,69%	18,97%	3,57%
Fevereiro	47.505.509,53	741.998,43	1.235.261,87	46.536.380,29	-475.865,80	-413.611,75	-1,00%	-0,87%	0,58%	1,28%	-68,31%	4,27%
Março	46.536.380,29	900.214,98	1.398.061,94	42.028.862,47	-4.009.670,86	-4.423.282,61	-8,62%	-9,41%	0,68%	1,97%	-478,62%	19,75%
Abril	42.028.862,47	846.865,72	1.263.774,36	40.979.848,09	-632.105,74	-5.055.388,35	-1,50%	-10,78%	0,22%	2,20%	-490,84%	10,27%
Maio	40.979.848,09	1.979.674,69	4.323.488,01	39.042.759,00	406.724,23	-4.648.664,12	0,99%	-9,89%	0,20%	2,40%	-411,41%	7,24%
Junho	39.042.759,00	3.019.229,14	2.240.179,17	40.819.448,84	997.639,87	-3.651.024,25	2,51%	-7,63%	0,78%	3,20%	-238,35%	6,10%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



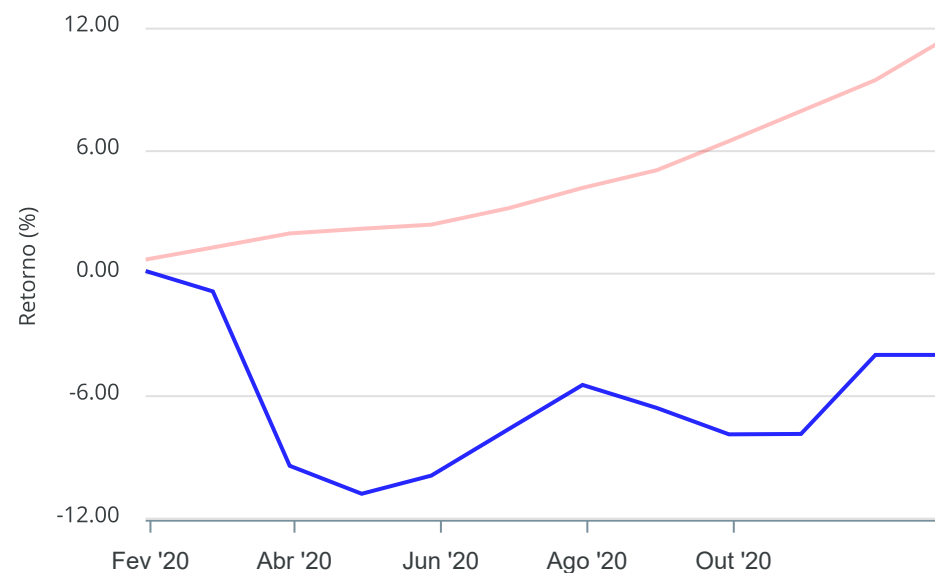
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



Investimentos Meta de Rentabilidade ☐ CDI ☐ IMA-B

☐ IMA-B 5 ☐ IMA-B 5+ ☐ IMA Geral ☐ IRF-M ☐ IRF-M 1

☐ IRF-M 1+ ☐ Ibovespa ☐ IBX ☐ SMLL ☐ IDIV

Investimentos Meta de Rentabilidade ☐ 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 Junho/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	6.398.774,61	0,00	297.274,47	6.298.659,38	197.159,24	3,08%	-1,56%	2,83%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITA...	1.358.748,59	0,00	0,00	1.397.163,70	38.415,11	2,83%	2,83%	4,98%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REN...	2.341.036,14	0,00	0,00	2.406.586,28	65.550,14	2,80%	2,80%	4,98%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2.894.145,67	2.369.407,85	0,00	5.408.808,60	145.255,08	2,76%	0,38%	8,75%
IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	1.813.743,52	0,00	297.274,47	1.555.917,86	39.448,81	2,17%	-15,00%	25,72%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA ...	2.412.522,60	0,00	0,00	2.461.380,89	48.858,29	2,03%	2,03%	2,99%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA ...	1.299.709,87	0,00	0,00	1.325.958,15	26.248,28	2,02%	2,02%	2,98%
ITAÚ IMA-B ATIVO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	142.398,74	0,00	0,00	145.237,45	2.838,71	1,99%	1,99%	3,03%
CAIXA BRASIL IPCA XVI RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA...	891.014,50	0,00	0,00	902.269,00	11.254,50	1,26%	1,26%	1,61%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA...	115.638,10	0,00	0,00	117.040,81	1.402,71	1,21%	1,21%	0,81%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RESP LI...	318.068,21	0,00	0,00	321.806,39	3.738,18	1,18%	1,18%	0,86%
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF C...	302.821,65	0,00	0,00	306.124,08	3.302,43	1,09%	1,09%	0,94%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC R...	151.405,80	0,00	0,00	153.026,38	1.620,58	1,07%	1,07%	0,90%
BB IRF-M 1+ RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENC...	688.324,06	0,00	0,00	695.414,83	7.090,77	1,03%	1,03%	1,75%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII RESP LIMITADA FIF RENDA FI...	389.724,30	0,00	0,00	393.591,54	3.867,24	0,99%	0,99%	0,45%
CDB - BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.	1.277.743,53	0,00	0,00	1.289.984,34	12.240,81	0,96%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.502.797,66	0,00	0,00	2.526.541,50	23.743,84	0,95%	0,95%	1,27%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA ...	47.785,21	0,00	0,00	48.154,10	368,89	0,77%	0,77%	1,17%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FIF ...	593.691,03	0,00	0,00	598.141,40	4.450,37	0,75%	0,75%	1,17%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA ...	390.076,12	0,00	391.973,98	0,00	1.897,86	0,49%	0,77%	1,18%

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA...	179.328,60	0,00	0,00	180.110,18	781,58	0,44%	0,44%	0,38%
BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFEREN...	7.062,48	0,00	0,00	7.080,84	18,36	0,26%	0,26%	0,03%
CAIXA BRASIL RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERENC...	26.287,52	0,00	0,00	26.351,33	63,81	0,24%	0,24%	0,03%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITAD...	223.692,10	0,00	205.000,00	19.223,93	531,83	0,24%	0,26%	0,05%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	1.615.989,17	0,00	0,00	1.619.045,49	3.056,32	0,19%	0,19%	0,01%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRI...	295.139,08	0,00	0,00	295.692,37	553,29	0,19%	0,19%	0,01%
BB FLUXO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SIMPLES ...	69.742,96	196.926,31	0,00	266.941,31	272,04	0,10%	0,13%	0,01%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RESP LIMITADA FIF CI...	777.629,34	452.344,31	1.047.280,47	183.881,07	1.187,89	0,10%	0,14%	0,01%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	150.202,24	0,00	0,00	149.883,36	-318,88	-0,21%	-0,21%	0,05%
Total Renda Fixa	29.675.243,40	3.018.678,47	2.238.803,39	31.100.016,56	644.898,08	2,12%		4,82%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA SMALL CAPS ATIVO RESP LIMITADA FIF AÇÕES	429.480,38	0,00	0,00	484.854,53	55.374,15	12,89%	12,89%	16,18%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX RESP LIMITADA FIF CIC A...	629.805,10	0,00	0,00	705.999,37	76.194,27	12,10%	12,10%	14,62%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	436.456,97	0,00	0,00	479.920,43	43.463,46	9,96%	9,96%	11,13%
BB CONSUMO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	339.592,64	0,00	0,00	373.274,94	33.682,30	9,92%	9,92%	11,30%
ITAÚ OLIMPO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	3.075,51	550,67	0,00	3.984,82	358,64	9,89%	10,78%	11,00%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA RESP LIMITADA FIF AÇÕES	401.128,61	0,00	0,00	437.670,37	36.541,76	9,11%	9,11%	12,43%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	930.921,62	0,00	0,00	1.011.152,51	80.230,89	8,62%	8,62%	11,52%
BB IBOVESPA INDEXADO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	1.371.881,99	0,00	0,00	1.487.184,20	115.302,21	8,40%	8,40%	12,48%
BB DIVIDENDOS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	559.299,47	0,00	0,00	596.135,38	36.835,91	6,59%	6,59%	12,04%
TIVIO RENDA IMOBILIÁRIA RESP LIMITADA FII - TVRI11	15.671,00	0,00	105,78	16.376,00	810,78	5,17%	5,33%	4,52%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	39.531,37	0,00	400,00	40.327,11	1.195,74	3,02%	20,00%	15,34%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES RESP L...	39.427,98	0,00	0,00	40.570,82	1.142,84	2,90%	2,90%	16,11%
HAZ FII - ATCR11	948.541,58	0,00	0,00	969.932,78	21.391,20	2,26%	2,26%	-
SP DOWNTOWN FII - SPTW11	70.920,00	0,00	870,00	71.210,00	1.160,00	1,64%	1,93%	7,27%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTI...	587.623,07	0,00	0,00	588.267,97	644,90	0,11%	0,11%	0,03%
FP2 FIP MULTIESTRATÉGIA	826.684,53	0,00	0,00	826.628,31	-56,22	-0,01%	-	-
AUSTRO MULTIPAR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	504.327,95	0,00	0,00	502.762,70	-1.565,25	-0,31%	-0,31%	0,00%
IMOBILIÁRIO PARANÁ REC FIP MULTIESTRATÉGIA	30.830,25	0,00	0,00	30.685,82	-144,43	-0,47%	-0,47%	0,04%
AUSTRO INSTITUCIONAL PIPE BANCOS FIC AÇÕES	164.596,34	0,00	0,00	158.319,45	-6.276,89	-3,81%	-3,81%	22,65%
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	299.459,34	0,00	0,00	123.657,04	-175.802,30	-58,71%	-	-

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
Total Renda Variável	8.629.255,70	550,67	1.375,78	8.948.914,55	320.483,96	3,71%		10,82%

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR NÍ...	738.259,90	0,00	0,00	770.517,73	32.257,83	4,37%	4,37%	12,44%
Total Exterior	738.259,90	0,00	0,00	770.517,73	32.257,83	4,37%		12,44%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	6.721.293,87	0,00	660.963,41	6.298.659,38	238.328,92	3,55%	-6,29%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REN...	2.274.269,80	0,00	0,00	2.406.586,28	132.316,48	5,82%	5,82%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA ...	2.346.279,89	0,00	0,00	2.461.380,89	115.101,00	4,91%	4,91%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITA...	1.319.624,59	0,00	0,00	1.397.163,70	77.539,11	5,88%	5,88%
IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	1.776.516,05	0,00	297.274,47	1.555.917,86	76.676,28	4,32%	-13,22%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.453.854,89	0,00	0,00	2.526.541,50	72.686,61	2,96%	2,96%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2.967.794,31	2.369.407,85	0,00	5.408.808,60	71.606,44	1,34%	-0,81%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA ...	1.264.074,90	0,00	0,00	1.325.958,15	61.883,25	4,90%	4,90%
CDB - BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.	1.246.538,42	0,00	0,00	1.289.984,34	43.445,92	3,49%	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA...	859.120,00	0,00	0,00	902.269,00	43.149,00	5,02%	5,02%
BB IRF-M 1+ RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENC...	667.795,95	0,00	0,00	695.414,83	27.618,88	4,14%	4,14%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FIF ...	579.180,61	0,00	0,00	598.141,40	18.960,79	3,27%	3,27%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RESP LI...	475.321,60	0,00	168.000,00	321.806,39	14.484,79	3,05%	3,54%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA ...	380.415,10	0,00	391.973,98	0,00	11.558,88	3,04%	3,33%
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF C...	294.795,93	0,00	0,00	306.124,08	11.328,15	3,84%	3,84%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	1.608.291,43	0,00	0,00	1.619.045,49	10.754,06	0,67%	0,67%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII RESP LIMITADA FIF RENDA FI...	384.370,53	0,00	0,00	393.591,54	9.221,01	2,40%	2,40%
ITAÚ IMA-B ATIVO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	138.058,02	0,00	0,00	145.237,45	7.179,43	5,20%	5,20%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC R...	147.588,39	0,00	0,00	153.026,38	5.437,99	3,68%	3,68%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA...	113.004,22	0,00	0,00	117.040,81	4.036,59	3,57%	3,57%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITAD...	221.855,20	0,00	205.000,00	19.223,93	2.368,73	1,07%	1,09%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RESP LIMITADA FIF CI...	74.545,35	2.774.040,76	2.667.022,36	183.881,07	2.317,32	0,08%	0,54%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA...	178.109,40	0,00	0,00	180.110,18	2.000,78	1,12%	1,12%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRI...	293.737,80	0,00	0,00	295.692,37	1.954,57	0,67%	0,67%
BB FLUXO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SIMPLES ...	614.070,81	698.941,57	1.048.000,00	266.941,31	1.928,93	0,15%	0,49%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA ...	46.635,76	0,00	0,00	48.154,10	1.518,34	3,26%	3,26%
CAIXA BRASIL RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERENC...	26.200,57	0,00	0,00	26.351,33	150,76	0,58%	0,58%
BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFEREN...	7.026,31	0,00	0,00	7.080,84	54,53	0,78%	0,78%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	150.768,18	0,00	0,00	149.883,36	-884,82	-0,59%	-0,59%
SINGAPORE FIC RENDA FIXA	2.450.058,24	0,00	2.384.619,98	0,00	-65.438,26	-2,67%	-
Total Renda Fixa	32.081.196,12	5.842.390,18	7.822.854,20	31.100.016,56	999.284,46	2,63%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2020

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB IBOVESPA INDEXADO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	1.148.706,69	0,00	0,00	1.487.184,20	338.477,51	29,47%	29,47%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	772.999,20	0,00	0,00	1.011.152,51	238.153,31	30,81%	30,81%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX RESP LIMITADA FIF CIC A...	528.397,70	0,00	0,00	705.999,37	177.601,67	33,61%	33,61%
CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR NÍ...	619.395,26	0,00	0,00	770.517,73	151.122,47	24,40%	24,40%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	363.223,21	0,00	0,00	479.920,43	116.697,22	32,13%	32,13%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO RESP LIMITADA FIF AÇÕES	368.239,77	0,00	0,00	484.854,53	116.614,76	31,67%	31,67%
BB CONSUMO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	267.750,49	0,00	0,00	373.274,94	105.524,45	39,41%	39,41%
BB DIVIDENDOS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	492.427,21	0,00	0,00	596.135,38	103.708,17	21,06%	21,06%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA RESP LIMITADA FIF AÇÕES	338.098,87	0,00	0,00	437.670,37	99.571,50	29,45%	29,45%
HAZ FII - ATR11	948.979,55	0,00	0,00	969.932,78	20.953,23	2,21%	2,21%
SP DOWNTOWN FII - SPTW11	69.490,00	0,00	3.190,00	71.210,00	4.910,00	7,07%	4,26%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTI...	584.620,69	0,00	0,00	588.267,97	3.647,28	0,62%	0,62%
TIVIO RENDA IMOBILIÁRIA RESP LIMITADA FII - TVRI11	13.925,00	0,00	317,34	16.376,00	2.768,34	19,88%	19,13%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	38.872,47	0,00	1.080,00	40.327,11	2.534,64	6,52%	34,34%
ITAÚ OLIMPO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	0,00	3.379,37	0,00	3.984,82	605,45	17,92%	31,18%
FP2 FIP MULTISTRATÉGIA	826.796,98	0,00	0,00	826.628,31	-168,67	-0,02%	-
IMOBILIÁRIO PARANÁ REC FIP MULTISTRATÉGIA	31.119,43	0,00	0,00	30.685,82	-433,61	-1,39%	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES RESP L...	61.141,94	0,00	0,00	40.570,82	-20.571,12	-33,64%	-33,64%
AUSTRO MULTIPAR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	585.927,20	0,00	0,00	502.762,70	-83.164,50	-14,19%	-14,19%
AUSTRO INSTITUCIONAL PIPE BANCOS FIC AÇÕES	305.816,55	0,00	0,00	158.319,45	-147.497,10	-48,23%	-28,84%
Total Renda Variável	8.365.928,21	3.379,37	4.587,34	9.595.775,24	1.231.055,00	14,71%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2.894.228,36	2.369.407,85	0,00	5.408.808,60	145.172,39	-1,55%	1,71%
CDB - BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.	730.689,44	500.000,00	0,00	1.289.984,34	59.294,90	6,73%	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.483.081,74	0,00	0,00	2.526.541,50	43.459,76	3,26%	1,75%
BB IRF-M 1+ RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENC...	658.538,15	0,00	0,00	695.414,83	36.876,68	7,81%	5,60%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FIF ...	1.064.735,23	0,00	500.000,00	598.141,40	33.406,17	6,80%	4,63%
CAIXA BRASIL IPCA XVI RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA...	871.338,00	0,00	0,00	902.269,00	30.931,00	7,59%	3,55%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	1.593.195,68	0,00	0,00	1.619.045,49	25.849,81	1,95%	1,62%
SINGAPORE FIC RENDA FIXA	2.362.137,71	0,00	2.384.619,98	0,00	22.482,27	0,96%	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA ...	375.309,15	0,00	391.973,98	0,00	16.664,83	4,45%	4,73%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF C...	296.541,04	0,00	0,00	306.124,08	9.583,04	7,31%	3,23%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RESP LI...	857.106,99	0,00	543.056,00	321.806,39	7.755,40	6,67%	3,12%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII RESP LIMITADA FIF RENDA FI...	397.649,73	0,00	10.469,24	393.591,54	6.411,05	5,50%	1,64%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RESP LIMITADA FIF CI...	180.209,07	5.874.902,66	5.877.183,82	183.881,07	5.953,16	0,70%	1,34%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITAD...	218.835,71	0,00	205.000,00	19.223,93	5.388,22	3,27%	2,48%
BB FLUXO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SIMPLES ...	147.813,37	1.162.312,08	1.048.000,00	266.941,31	4.815,86	1,30%	1,24%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRI...	290.992,55	0,00	0,00	295.692,37	4.699,82	1,92%	1,62%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC R...	148.418,84	0,00	0,00	153.026,38	4.607,54	7,16%	3,10%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA...	176.117,25	0,00	0,00	180.110,18	3.992,93	2,86%	2,27%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA...	113.759,54	0,00	0,00	117.040,81	3.281,27	6,53%	2,88%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA ...	46.000,93	0,00	0,00	48.154,10	2.153,17	6,38%	4,68%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA BRASIL RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERENC...	25.995,51	0,00	0,00	26.351,33	355,82	2,37%	1,37%
BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFEREN...	6.985,06	0,00	0,00	7.080,84	95,78	2,41%	1,37%
ITAÚ IMA-B ATIVO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	145.731,72	0,00	0,00	145.237,45	-494,27	4,26%	-0,34%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	152.249,16	0,00	0,00	149.883,36	-2.365,80	-4,84%	-1,55%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA ...	1.349.552,00	0,00	0,00	1.325.958,15	-23.593,85	6,15%	-1,75%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA ...	2.508.430,74	0,00	0,00	2.461.380,89	-47.049,85	6,07%	-1,88%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITA...	1.477.469,21	0,00	0,00	1.397.163,70	-80.305,51	0,55%	-5,44%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REN...	2.543.291,44	0,00	0,00	2.406.586,28	-136.705,16	1,02%	-5,38%
IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	2.133.232,21	0,00	297.274,47	1.555.917,86	-280.039,88	-14,74%	-27,73%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	7.568.482,34	0,00	660.963,41	6.298.659,38	-608.859,55	-8,19%	-16,78%
Total Renda Fixa	33.818.117,87	9.906.622,59	11.918.540,90	31.100.016,56	-706.183,00	-1,62%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre/2020

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR NÍ...	579.979,21	0,00	0,00	770.517,73	190.538,52	54,75%	32,85%
HAZ FII - ATCR11	947.587,88	0,00	1.116,18	969.932,78	23.461,08	2,50%	2,36%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTI...	577.917,00	0,00	0,00	588.267,97	10.350,97	0,99%	1,79%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MUL...	565.235,00	0,00	565.862,50	0,00	627,50	0,11%	-
ITAÚ OLIMPO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	0,00	3.379,37	0,00	3.984,82	605,45	47,14%	-15,37%
TIVIO RENDA IMOBILIÁRIA RESP LIMITADA FII - TVRI11	17.111,00	0,00	634,68	16.376,00	-100,32	-21,55%	-4,43%
FP2 FIP MULTISTRATÉGIA	826.874,91	0,00	0,00	826.628,31	-246,60	-0,07%	-
IMOBILIÁRIO PARANÁ REC FIP MULTISTRATÉGIA	31.539,66	0,00	0,00	30.685,82	-853,84	-5,74%	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	50.007,12	0,00	3.040,00	40.327,11	-6.640,01	-12,45%	4,71%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES RESP L...	73.713,18	0,00	0,00	40.570,82	-33.142,36	-44,99%	-44,96%
BB CONSUMO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	414.299,67	0,00	0,00	373.274,94	-41.024,73	1,59%	-9,90%
SP DOWNTOWN FII - SPTW11	121.300,00	0,00	5.760,00	71.210,00	-44.330,00	-18,84%	-41,86%
AUSTRO MULTIPAR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	592.977,13	0,00	0,00	502.762,70	-90.214,43	-16,75%	-15,21%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA RESP LIMITADA FIF AÇÕES	531.884,04	0,00	0,00	437.670,37	-94.213,67	-10,05%	-17,71%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	589.538,02	0,00	0,00	479.920,43	-109.617,59	1,24%	-18,59%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO RESP LIMITADA FIF AÇÕES	617.279,24	0,00	0,00	484.854,53	-132.424,71	-3,24%	-21,45%
AUSTRO INSTITUCIONAL PIPE BANCOS FIC AÇÕES	325.131,80	0,00	0,00	158.319,45	-166.812,35	-62,35%	-51,31%
BB DIVIDENDOS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	767.131,64	0,00	0,00	596.135,38	-170.996,26	-18,09%	-22,29%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	1.212.594,53	0,00	0,00	1.011.152,51	-201.442,02	2,14%	-16,61%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX RESP LIMITADA FIF CIC A...	987.566,40	0,00	0,00	705.999,37	-281.567,03	-29,23%	-28,51%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre/2020

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB IBOVESPA INDEXADO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	1.825.396,17	0,00	0,00	1.487.184,20	-338.211,97	-12,08%	-18,53%
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTISTRATÉGIA	1.582.243,92	0,00	0,00	123.657,04	-1.458.586,88	-92,27%	-
Total Renda Variável	13.237.307,52	3.379,37	576.413,36	9.719.432,28	-2.944.841,25	-22,24%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre/2020

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
Total Exterior	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	

Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da CRÉDITO E MERCADO CONSULTORIA DE INVESTIMENTOS.. As informações aqui contidas, tem por somente, o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre o(s) produto(s) mencionado(s), entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros exigidos legalmente. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas aos objetivos, aos riscos e à política de investimento do(s) produto(s). Todas as informações podem ser obtidas com os responsáveis pela distribuição, administração, gestão ou no próprio site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários) através do link: <https://www.gov.br/cvm/pt-br>.

Sua elaboração buscou atender os objetivos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil de investidor.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas aos investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de Consultoria de Valores Mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe a Consultoria de Valores Mobiliários a prestação dos serviços de ORIENTAÇÃO, RECOMENDAÇÃO E ACONSELHAMENTO, DE FORMA PROFISSIONAL, INDEPENDENTE E INDIVIDUALIZADA, SOBRE INVESTIMENTOS NO MERCADO DE VALORES MOBILIÁRIOS, CUJA ADOÇÃO E IMPLEMENTAÇÃO SEJAM EXCLUSIVAS DO CLIENTE (Resolução CVM nº 19/2021).

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no Art. 3º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria MTP nº 1.467/2022, art. 84, inciso III, alínea "a".

Os RPPS DEVEM, independente da contratação de Consultoria de Valores Mobiliários, se adequar às normativas pertinentes e principalmente a Portaria MTP nº 1.467/2022 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963/2021, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.

Relatório Analítico dos Investimentos

em julho de 2020

Este relatório atende a Portaria MTP Nº 1.467, de 2 de junho de 2022.

Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2020)

CNPJ	Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Lei
25.078.994/0001-90	BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	2.571.204,91	6,22%	593	0,02%	7º I b
13.322.205/0001-35	BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REN...	D+1	Não há	117.984,92	0,29%	885	0,00%	7º I b
13.327.340/0001-73	BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF R...	D+2	Não há	2.581.738,52	6,24%	312	0,12%	7º I b
07.442.078/0001-05	BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REND...	D+1	Não há	1.383.802,46	3,35%	675	0,02%	7º I b
32.161.826/0001-29	BB IRF-M 1+ RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	706.332,96	1,71%	112	0,21%	7º I b
07.111.384/0001-69	BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REND...	D+1	Não há	48.696,41	0,12%	718	0,00%	7º I b
20.734.937/0001-06	BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	D+0	15/08/2018	296.189,74	0,72%	60	0,94%	7º I b
19.523.305/0001-06	BB TÍTULOS PÚBLICOS VII RESP LIMITADA FIF RENDA ...	D+0	15/08/2022	394.851,38	0,95%	165	0,06%	7º I b
25.069.955/0001-26	BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	18/08/2018	1.621.796,56	3,92%	21	2,74%	7º I b
23.215.097/0001-55	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FI...	D+0	Não há	603.987,04	1,46%	791	0,00%	7º I b
14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RESP ...	D+0	Não há	324.474,73	0,78%	959	0,00%	7º I b
10.577.503/0001-88	CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMI...	D+0	Não há	1.499.042,01	3,62%	342	0,07%	7º I b
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITAD...	D+0	Não há	2.569.066,63	6,21%	905	0,04%	7º I b
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMIT...	D+0	Não há	19.270,27	0,05%	1.366	0,00%	7º I b
09.093.819/0001-15	ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC...	D+1	Não há	154.516,27	0,37%	61	0,01%	7º I b
13.077.415/0001-05	BB FLUXO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SIMPLE...	D+0	Não há	604.777,88	1,46%	751	0,04%	7º IV a
13.077.418/0001-49	BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFER...	D+0	Não há	7.097,55	0,02%	600	0,00%	7º IV a
20.216.216/0001-04	BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF...	D+1	Não há	309.103,76	0,75%	119	0,04%	7º IV a
14.508.643/0001-55	CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RESP LIMITADA FIF ...	D+0	Não há	1.125.701,25	2,72%	319	0,22%	7º IV a
03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERE...	D+0	Não há	26.416,80	0,06%	707	0,00%	7º IV a

Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2020)

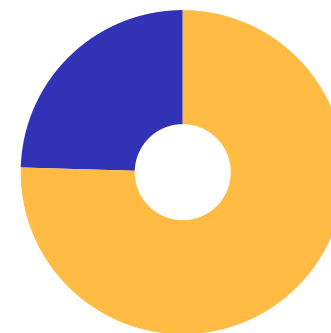
CNPJ	Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Lei
12.402.646/0001-84	IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	D+1002	Não há	1.528.563,71	3,70%	12	5,84%	7º IV a
05.073.656/0001-58	ITAÚ IMA-B ATIVO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIX...	D+1	Não há	151.677,94	0,37%	97	0,03%	7º IV a
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITA...	D+1	Não há	181.103,47	0,44%	288	0,00%	7º IV a
15.153.656/0001-11	MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1800	Não há	5.208.679,44	12,59%	18	2,74%	7º IV a
13.594.673/0001-69	TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	D+31 ou...	Não há	4.815.847,01	11,64%	15	3,64%	7º IV a
01.181.521/0001-55	CDB - BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.	S/Info	Não Informado	1.307.142,23	3,16%		0,00%	7º VI a
06.018.364/0001-85	PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	136.788,77	0,33%	98	0,18%	7º VII a
21.918.896/0001-62	CAIXA BRASIL IPCA XVI RESP LIMITADA FIF RENDA FI...	D+0	18/04/2018	919.013,50	2,22%	71	0,50%	7º VII b
73.899.759/0001-21	BB IBOVESPA INDEXADO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+4	Não há	1.606.798,24	3,88%	7.103	0,75%	8º I a
15.154.236/0001-50	CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA RESP LIMITADA FIF AÇÃO...	D+4	Não há	473.039,64	1,14%	61	0,00%	8º I b
08.973.942/0001-68	BB CONSUMO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+4	Não há	400.864,56	0,97%	14.902	0,10%	8º II a
05.100.191/0001-87	BB DIVIDENDOS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+4	Não há	636.482,86	1,54%	32.664	0,07%	8º II a
17.502.937/0001-68	CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR ...	D+4	Não há	784.965,00	1,90%	115	0,06%	8º II a
15.154.220/0001-47	CAIXA SMALL CAPS ATIVO RESP LIMITADA FIF AÇÕES	D+4	Não há	529.822,94	1,28%	16.819	0,04%	8º II a
13.155.995/0001-01	DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	D+15	Não há	521.490,35	1,26%	1.277	0,34%	8º II a
08.817.414/0001-10	ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	1.096.727,32	2,65%	53	0,12%	8º II a
23.731.629/0001-07	ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX RESP LIMITADA FIF CIC...	D+24	Não há	746.930,51	1,81%	160	0,02%	8º II a
32.246.546/0001-13	ITAÚ OLIMPO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+3	Não há	4.752,90	0,01%	20.645	0,00%	8º II a
18.366.002/0001-64	AUSTRO MULTIPAR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+1	96 meses	500.989,12	1,21%	33	0,61%	8º III
29.388.994/0001-47	CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MUL...	D+2	01/10/2020	588.590,01	1,42%	956	0,12%	8º III

Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2020)

CNPJ	Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Lei
20.886.575/0001-60	FP2 FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	826.866,83	2,00%		0,00%	8º IV a
11.490.580/0001-69	GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	123.418,40	0,30%		0,00%	8º IV a
16.720.629/0001-46	IMOBILIÁRIO PARANÁ REC FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	30.541,47	0,07%	11	0,41%	8º IV a
13.584.584/0001-31	BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES RESP...	Não se ...	Não se aplica	54.284,90	0,13%		0,03%	8º IV b
17.098.794/0001-70	CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	39.053,14	0,09%		0,01%	8º IV b
14.631.148/0001-39	HAZ FII - ATCR11	Não se ...	Não se aplica	970.220,19	2,35%		1,35%	8º IV b
15.538.445/0001-05	SP DOWNTOWN FII - SPTW11	Não se ...	Não se aplica	74.250,00	0,18%		0,05%	8º IV b
14.410.722/0001-29	TIVIO RENDA IMOBILIÁRIA RESP LIMITADA FII - TVRI...	Não se ...	Não se aplica	13.952,00	0,03%		0,00%	8º IV b
28.319.463/0001-30	AUSTRO INSTITUCIONAL PIPE BANCOS FIC AÇÕES	D+31	30/04/2021	126.052,23	0,30%	22	0,45%	NE
Total para cálculo dos limites da Resolução			41.364.960,73					
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			45.349,52	Artigo 6º				
PL Total			41.410.310,25					

Enquadramento e Política de Investimento (RENTA FIXA) - base (Julho / 2020)

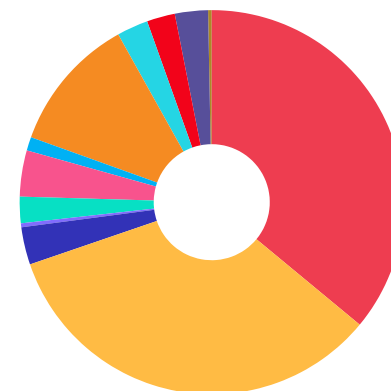
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	100,00%	14.892.954,81	36,00%	20,00%	30,00%	90,00%	22.335.509,85
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	24.818.976,44
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea a	40,00%	13.958.968,81	33,75%	10,00%	30,00%	40,00%	2.587.015,48
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea a	15,00%	1.307.142,23	3,16%	0,00%	0,00%	15,00%	4.897.601,88
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea a	5,00%	136.788,77	0,33%	0,00%	0,00%	5,00%	1.931.459,27
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea b	5,00%	919.013,50	2,22%	0,00%	0,00%	5,00%	1.149.234,54
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea c	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.068.248,04
Total Renda Fixa	100,00%	31.214.868,12	75,46%	30,00%	70,00%	220,00%	



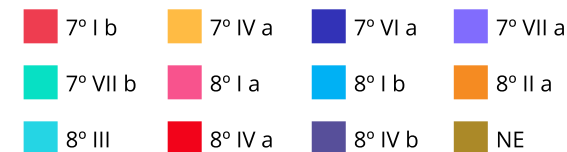
RENTA FIXA 31.214.868,12
RENTA VARIÁVEL 10.150.092,61

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Julho / 2020)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea a	30,00%	1.606.798,24	3,88%	0,00%	0,00%	5,00%	461.449,80
Artigo 8º, Inciso I, Alínea b	30,00%	473.039,64	1,14%	0,00%	0,00%	5,00%	1.595.208,40
Artigo 8º, Inciso II, Alínea a	20,00%	4.722.036,44	11,42%	7,00%	15,00%	20,00%	3.550.955,71
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	1.089.579,13	2,63%	3,00%	10,00%	10,00%	3.046.916,94
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea a	5,00%	980.826,70	2,37%	0,00%	0,00%	5,00%	1.087.421,34
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea b	5,00%	1.151.760,23	2,78%	0,00%	5,00%	5,00%	916.487,81
Desenquadrado - RV	0,00%	126.052,23	0,30%	0,00%	0,00%	0,00%	-126.052,23
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	10.150.092,61	24,54%	10,00%	30,00%	50,00%	



Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2020			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.068.248,04
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2020		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	1.917.986,30	4,64	20,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea a	0,00	0,00	10,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea a	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	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	5,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea b	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea a	0,00	0,00	7,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	588.590,01	1,42	3,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea a	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea b	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	5,00

Enquadramento por Gestores - base (Julho / 2020)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	12.978.618,95	31,38	0,00
VERITAS CAPITAL MANAGEMENT	12.054.079,28	29,14	0,80
CAIXA DTVM S.A	9.502.442,96	22,97	0,00
SICREDI	1.307.142,23	3,16	0,00
GRAPHEN INVESTIMENTOS	1.137.550,43	2,75	0,85
ITAÚ DTVM	1.096.727,32	2,65	0,00
ITAÚ UNIBANCO	903.361,35	2,18	0,00
ARENA CAPITAL	826.866,83	2,00	-
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	521.490,35	1,26	0,01
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	335.619,74	0,81	0,00
BANCO BRADESCO	309.103,76	0,75	-
GENIAL GESTÃO LTDA	197.668,40	0,48	0,00
AUSTRO CAPITAL	126.052,23	0,30	0,01
ZION INVEST	54.284,90	0,13	0,01
TIVIO CAPITAL DISTRIBUIDORA DE...	13.952,00	0,03	0,00

Artigo 20º - 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) - (Resolução 4963)

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 IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,94%	4,31%	3,72%	3,76%	8,68%	22,37%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,17%	1,80%	0,57%	1,44%	3,95%	10,32%	0,00%	0,36%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,17%	1,79%	0,57%	1,43%	3,93%	10,31%	0,00%	0,36%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REND...	0,83%	3,98%	3,96%	3,50%	8,10%	20,93%	0,77%	3,01%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENC...	0,81%	3,71%	4,07%	3,32%	7,99%	20,62%	0,74%	3,21%
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	0,90%	3,91%	1,73%	3,16%	8,47%	18,63%	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	1,86%	5,47%	6,05%	4,62%	10,69%	28,48%	1,42%	5,55%
IRF-M 1+ (Benchmark)	1,47%	7,59%	4,50%	6,40%	12,02%	32,81%	-	-
BB IRF-M 1+ RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,57%	7,26%	4,45%	6,14%	11,47%	-	1,44%	3,25%
IMA-B 5+ (Benchmark)	7,32%	1,68%	11,51%	1,64%	7,81%	49,37%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FI...	7,29%	1,46%	11,43%	1,50%	7,35%	47,92%	3,79%	16,14%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDE...	7,28%	1,51%	11,38%	1,46%	7,68%	48,58%	3,80%	16,12%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,24%	2,84%	0,94%	2,39%	5,51%	13,20%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIX...	0,24%	2,73%	0,90%	2,30%	5,30%	12,79%	0,15%	0,45%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,99%	4,19%	4,28%	3,61%	8,83%	24,16%	-	-

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
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	0,97%	4,24%	4,28%	3,66%	8,77%	23,92%	0,87%	3,71%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-2,95%	-1,29%	-3,63%	-1,33%	-7,70%	-20,45%	47,28%	6,20%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	0,97%	4,11%	4,19%	3,55%	8,66%	23,54%	0,82%	3,56%

IMA-B (Benchmark)	4,39%	2,65%	8,14%	2,38%	8,16%	37,86%	-	-
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	-23,54%	-36,37%	-28,86%	-36,72%	-34,03%	-32,69%	22,27%	26,39%
ITAÚ IMA-B ATIVO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	4,43%	4,08%	8,21%	3,87%	9,85%	41,29%	2,30%	10,08%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA ...	4,38%	2,42%	8,09%	2,17%	7,73%	37,07%	2,27%	10,57%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCI...	4,36%	2,54%	8,07%	2,27%	7,94%	37,20%	2,27%	10,45%
CDB - BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.	-	-	-	-	-	-	-	-
IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	-0,85%	-28,35%	-15,74%	-27,75%	-30,01%	-23,88%	8,68%	21,90%

IRF-M (Benchmark)	1,08%	6,00%	3,32%	5,08%	9,81%	26,59%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCI...	1,13%	5,86%	3,31%	4,96%	9,57%	26,04%	1,03%	2,22%

CDI (Benchmark)	0,19%	1,95%	0,64%	1,57%	4,21%	10,83%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,77%	3,55%	3,84%	3,05%	7,10%	-	1,05%	3,93%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SI...	0,12%	1,46%	0,43%	1,15%	3,35%	8,99%	0,00%	0,36%
BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVID...	0,24%	1,61%	0,75%	1,26%	3,74%	10,19%	0,03%	0,47%
BB FLUXO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,10%	1,35%	0,39%	1,06%	3,13%	8,50%	0,00%	0,35%

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
CAIXA BRASIL RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,25%	1,62%	0,82%	1,25%	3,72%	10,14%	0,03%	0,48%
IPCA (Benchmark)	0,36%	0,46%	0,24%	0,25%	2,31%	5,60%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	0,98%	5,65%	3,14%	4,79%	9,68%	28,24%	0,92%	2,67%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA ...	0,55%	2,83%	1,54%	2,48%	5,21%	19,22%	0,26%	0,58%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	0,32%	1,97%	2,58%	1,77%	5,74%	18,19%	0,32%	2,42%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	-8,74%	-10,16%	-9,11%	-9,67%	-10,93%	-19,35%	13,55%	8,52%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2020 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	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%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR NÍVEL I	1,88%	35,34%	9,28%	27,06%	55,47%	69,34%	8,52%	19,45%

Ibovespa (Benchmark)	8,27%	-11,01%	27,83%	-9,54%	1,08%	29,91%	-	-
BB CONSUMO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	7,39%	-3,24%	27,19%	-6,72%	12,83%	52,78%	11,07%	42,44%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	8,66%	-11,54%	29,88%	-10,14%	0,96%	34,25%	9,45%	40,10%
BB IBOVESPA INDEXADO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	8,04%	-11,98%	26,92%	-10,35%	-0,93%	24,54%	10,26%	38,22%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	8,46%	-9,56%	27,16%	-10,16%	4,36%	37,47%	9,25%	39,84%
ITAÚ OLIMPO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	9,11%	-7,66%	29,17%	-8,08%	7,01%	-	8,93%	39,35%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	0,06%	1,85%	0,43%	1,53%	4,66%	-	0,02%	0,88%
AUSTRO INSTITUCIONAL PIPE BANCOS FIC AÇÕES	-20,38%	-61,23%	-38,31%	-59,88%	-62,77%	-45,95%	14,58%	32,76%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	5,80%	-24,37%	29,49%	-25,46%	-12,43%	22,51%	11,66%	50,17%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA RESP LIMITADA FIF AÇÕES	8,08%	-11,06%	27,18%	-9,51%	0,68%	28,59%	9,80%	37,74%

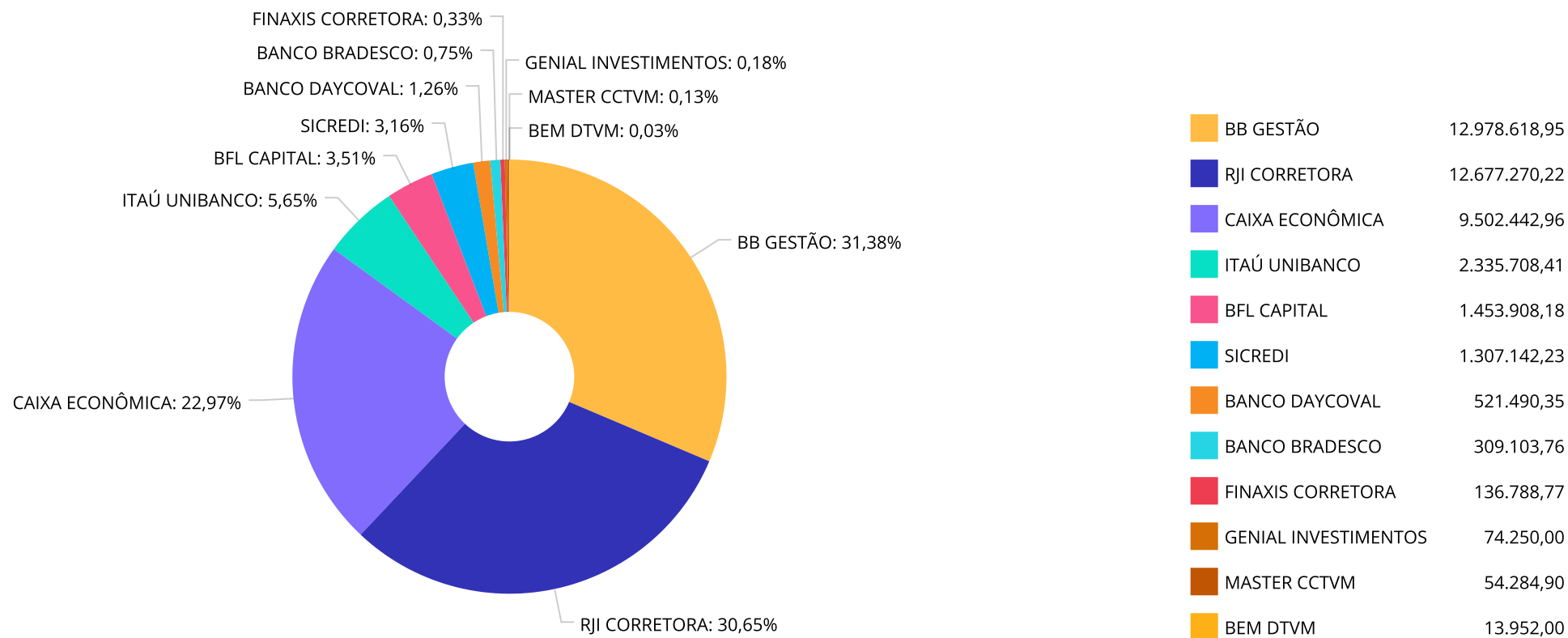
IDIV (Benchmark)	6,53%	-13,05%	21,87%	-11,65%	3,50%	46,49%	-	-
BB DIVIDENDOS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	6,77%	-17,03%	19,26%	-16,68%	-7,01%	24,01%	8,54%	36,09%

IFIX (Benchmark)	-2,61%	-14,53%	4,97%	-11,18%	2,77%	26,86%	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES RESP LIMITADA FII - C...	33,80%	-26,36%	14,46%	-17,39%	-40,25%	-52,50%	34,23%	60,07%
SP DOWNTOWN FII - SPTW11	3,51%	-39,82%	-3,03%	-16,20%	-16,01%	-	14,78%	49,95%

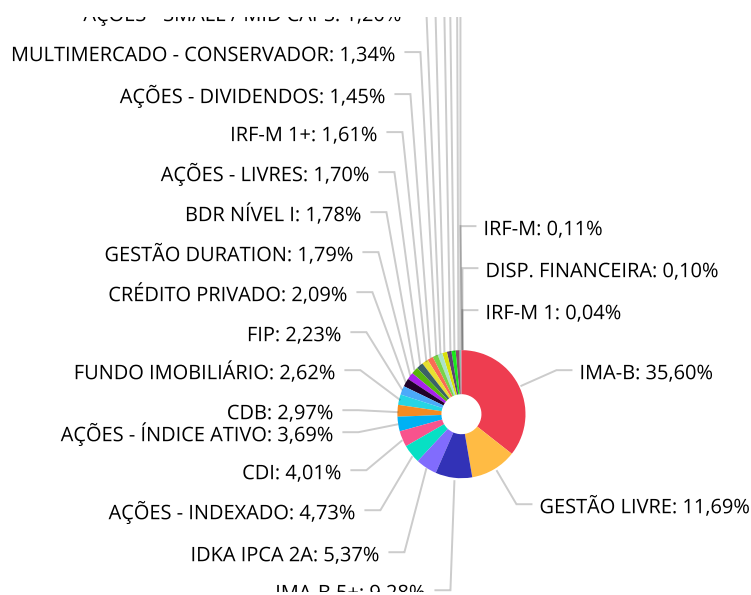
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2020 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	10,90%	16,12%	38,23%	-1,14%	60,63%	-82,35%	11,49%	43,75%
TIVIO RENDA IMOBILIÁRIA RESP LIMITADA FII - TVRI11	-15,42%	-19,17%	-8,81%	-15,48%	-7,23%	5,89%	16,60%	26,92%
HAZ FII - ATR11	0,03%	2,39%	2,34%	2,47%	385,41%	385,41%	-	-
IPCA (Benchmark)	0,36%	0,46%	0,24%	0,25%	2,31%	5,60%	-	-
AUSTRO MULTIPAR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-0,35%	-15,51%	-0,96%	-15,40%	-16,08%	-17,22%	0,01%	13,43%
IMOBILIÁRIO PARANÁ REC FIP MULTISTRATÉGIA	-0,47%	-	-1,40%	-	-5,28%	-18,12%	0,04%	0,04%
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	1,28%	6,44%	2,81%	5,30%	13,09%	28,89%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTISTRATÉGIA	-	-	-	-	-	-	-	-
IPCA + 9,00% ao ano (Benchmark)	1,15%	5,60%	2,46%	4,59%	11,55%	25,42%	-	-
FP2 FIP MULTISTRATÉGIA	-	-	-	-	-	-	-	-
SMLL (Benchmark)	9,50%	-13,20%	31,66%	-13,59%	7,86%	55,28%	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO RESP LIMITADA FIF AÇÕES	9,28%	-14,17%	29,24%	-14,60%	6,10%	47,15%	9,90%	45,18%

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



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



IMA-B	15.657.637,19	GESTÃO LIVRE	5.142.409,82	IMA-B 5+	4.080.780,53
IDKA IPCA 2A	2.360.445,95	AÇÕES - INDEXADO	2.079.837,88	CDI	1.763.993,48
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	1.622.970,57	CDB	1.307.142,23	FUNDO IMOBILIÁRIO	1.151.760,23
FIP	980.826,70	CRÉDITO PRIVADO	919.013,50	GESTÃO DURATION	785.090,51
BDR NÍVEL I	784.965,00	AÇÕES - LIVRES	746.930,51	IRF-M 1+	706.332,96
AÇÕES - DIVIDENDOS	636.482,86	MULTIMERCADO - CONSERVADOR	588.590,01	AÇÕES - SMALL / MID CAPS	529.822,94
AÇÕES - SETORIAIS	526.916,79	MULTIMERCADO - CRÉDITO PRIVADO	500.989,12	IMA-B 5	463.620,03
VÉRTICE LONGO	394.851,38	FIDC	136.788,77	IRF-M	48.696,41
DISP. FINANCEIRA	45.349,52	IRF-M 1	19.270,27		

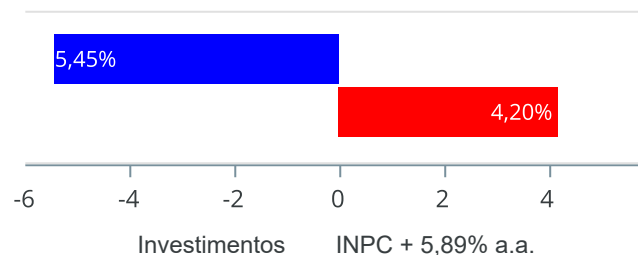
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Julho / 2020)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
------------------	------------	--------	------	-------------	------------	---------	----------	----------

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2020

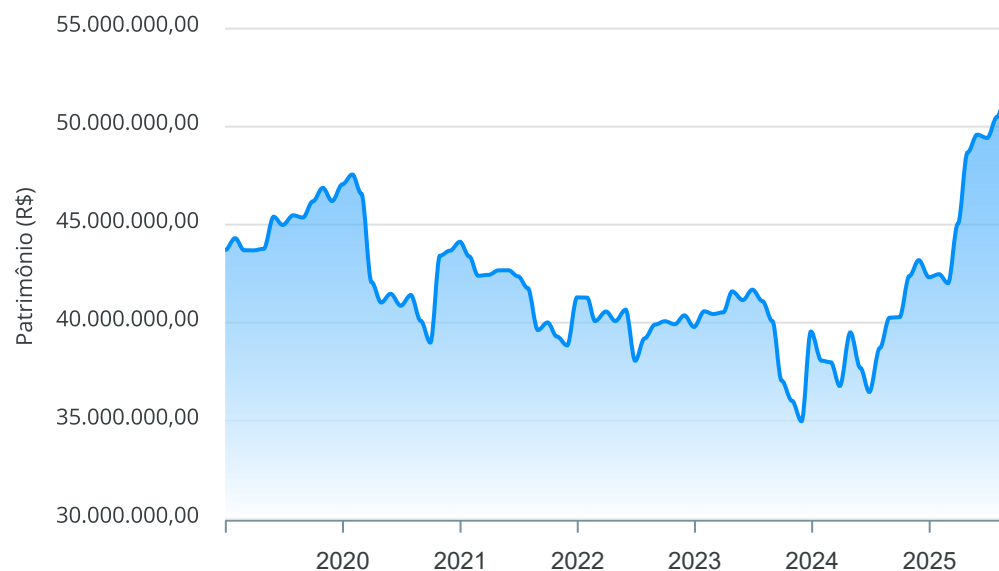
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	47.055.425,39	2.422.019,00	2.034.188,91	47.505.509,53	62.254,05	62.254,05	0,13%	0,13%	0,69%	0,69%	18,97%	3,57%
Fevereiro	47.505.509,53	741.998,43	1.235.261,87	46.536.380,29	-475.865,80	-413.611,75	-1,00%	-0,87%	0,58%	1,28%	-68,31%	4,27%
Março	46.536.380,29	900.214,98	1.398.061,94	42.028.862,47	-4.009.670,86	-4.423.282,61	-8,62%	-9,41%	0,68%	1,97%	-478,62%	19,75%
Abril	42.028.862,47	846.865,72	1.263.774,36	40.979.848,09	-632.105,74	-5.055.388,35	-1,50%	-10,78%	0,22%	2,20%	-490,84%	10,27%
Maiο	40.979.848,09	1.979.674,69	4.323.488,01	39.042.759,00	406.724,23	-4.648.664,12	0,99%	-9,89%	0,20%	2,40%	-411,41%	7,24%
Junho	39.042.759,00	3.019.229,14	2.240.179,17	40.819.448,84	997.639,87	-3.651.024,25	2,51%	-7,63%	0,78%	3,20%	-238,35%	6,10%
Julho	40.819.448,84	1.955.081,28	2.373.941,74	41.364.960,73	964.372,35	-2.686.651,90	2,36%	-5,45%	0,97%	4,20%	-129,79%	12,38%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



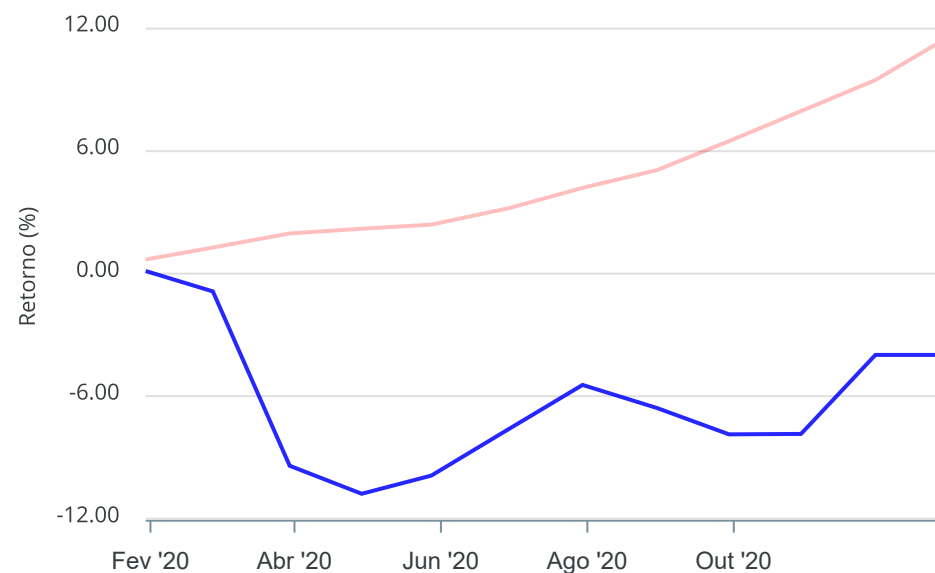
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



Investimentos Meta de Rentabilidade ☐ 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
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITA...	1.397.163,70	0,00	0,00	1.499.042,01	101.878,31	7,29%	7,29%	3,79%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REN...	2.406.586,28	0,00	0,00	2.581.738,52	175.152,24	7,28%	7,28%	3,80%
ITAÚ IMA-B ATIVO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	145.237,45	0,00	0,00	151.677,94	6.440,49	4,43%	4,43%	2,30%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA ...	2.461.380,89	0,00	0,00	2.569.066,63	107.685,74	4,38%	4,38%	2,27%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA ...	1.325.958,15	0,00	0,00	1.383.802,46	57.844,31	4,36%	4,36%	2,27%
IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	1.555.917,86	0,00	71.345,85	1.528.563,71	43.991,70	2,83%	0,92%	8,68%
CAIXA BRASIL IPCA XVI RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA...	902.269,00	0,00	0,00	919.013,50	16.744,50	1,86%	1,86%	1,42%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.526.541,50	0,00	0,00	2.571.204,91	44.663,41	1,77%	1,77%	1,05%
BB IRF-M 1+ RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENC...	695.414,83	0,00	0,00	706.332,96	10.918,13	1,57%	1,57%	1,44%
CDB - BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.	1.289.984,34	0,00	0,00	1.307.142,23	17.157,89	1,33%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA ...	48.154,10	0,00	0,00	48.696,41	542,31	1,13%	1,13%	1,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FIF ...	598.141,40	0,00	0,00	603.987,04	5.845,64	0,98%	0,98%	0,92%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC R...	153.026,38	0,00	0,00	154.516,27	1.489,89	0,97%	0,97%	0,82%
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF C...	306.124,08	0,00	0,00	309.103,76	2.979,68	0,97%	0,97%	0,87%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RESP LI...	321.806,39	0,00	0,00	324.474,73	2.668,34	0,83%	0,83%	0,77%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA...	117.040,81	0,00	0,00	117.984,92	944,11	0,81%	0,81%	0,74%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA...	180.110,18	0,00	0,00	181.103,47	993,29	0,55%	0,55%	0,26%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	6.298.659,38	0,00	1.513.673,38	4.815.847,01	30.861,01	0,49%	-23,54%	22,27%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII RESP LIMITADA FIF RENDA FI...	393.591,54	0,00	0,00	394.851,38	1.259,84	0,32%	0,32%	0,32%
CAIXA BRASIL RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERENC...	26.351,33	0,00	0,00	26.416,80	65,47	0,25%	0,25%	0,03%

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
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITAD...	19.223,93	0,00	0,00	19.270,27	46,34	0,24%	0,24%	0,15%
BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFEREN...	7.080,84	0,00	0,00	7.097,55	16,71	0,24%	0,24%	0,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	1.619.045,49	0,00	0,00	1.621.796,56	2.751,07	0,17%	0,17%	0,00%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRI...	295.692,37	0,00	0,00	296.189,74	497,37	0,17%	0,17%	0,00%
BB FLUXO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SIMPLES ...	266.941,31	337.298,00	0,00	604.777,88	538,57	0,09%	0,10%	0,00%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RESP LIMITADA FIF CI...	183.881,07	1.617.378,22	676.678,64	1.125.701,25	1.120,60	0,06%	0,12%	0,00%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	5.408.808,60	0,00	109.779,52	5.208.679,44	-90.349,64	-1,67%	-3,70%	47,28%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	149.883,36	0,00	0,00	136.788,77	-13.094,59	-8,74%	-8,74%	13,55%
Total Renda Fixa	31.100.016,56	1.954.676,22	2.371.477,39	31.214.868,12	531.652,73	1,71%		13,37%

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
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES RESP L...	40.570,82	0,00	352,97	54.284,90	14.067,05	34,67%	33,80%	34,23%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO RESP LIMITADA FIF AÇÕES	484.854,53	0,00	0,00	529.822,94	44.968,41	9,27%	9,27%	9,90%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	479.920,43	0,00	0,00	521.490,35	41.569,92	8,66%	8,66%	9,45%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	1.011.152,51	0,00	0,00	1.096.727,32	85.574,81	8,46%	8,46%	9,25%
ITAÚ OLIMPO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	3.984,82	405,06	0,00	4.752,90	363,02	8,27%	9,11%	8,93%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA RESP LIMITADA FIF AÇÕES	437.670,37	0,00	0,00	473.039,64	35.369,27	8,08%	8,08%	9,80%
BB IBOVESPA INDEXADO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	1.487.184,20	0,00	0,00	1.606.798,24	119.614,04	8,04%	8,04%	10,26%
BB CONSUMO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	373.274,94	0,00	0,00	400.864,56	27.589,62	7,39%	7,39%	11,07%
BB DIVIDENDOS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	596.135,38	0,00	0,00	636.482,86	40.347,48	6,77%	6,77%	8,54%
SP DOWNTOWN FII - SPTW11	71.210,00	0,00	1.120,00	74.250,00	4.160,00	5,84%	3,51%	14,78%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX RESP LIMITADA FIF CIC A...	705.999,37	0,00	0,00	746.930,51	40.931,14	5,80%	5,80%	11,66%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTI...	588.267,97	0,00	0,00	588.590,01	322,04	0,05%	0,05%	0,02%
HAZ FII - ATCR11	969.932,78	0,00	0,00	970.220,19	287,41	0,03%	0,03%	-
FP2 FIP MULTISTRATÉGIA	826.628,31	0,00	0,00	826.866,83	238,52	0,03%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTISTRATÉGIA	123.657,04	0,00	0,00	123.418,40	-238,64	-0,19%	-	-
AUSTRO MULTIPAR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	502.762,70	0,00	0,00	500.989,12	-1.773,58	-0,35%	-0,35%	0,01%
IMOBILIÁRIO PARANÁ REC FIP MULTISTRATÉGIA	30.685,82	0,00	0,00	30.541,47	-144,35	-0,47%	-0,47%	0,04%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	40.327,11	0,00	885,60	39.053,14	-388,37	-0,96%	10,90%	11,49%
TIVIO RENDA IMOBILIÁRIA RESP LIMITADA FII - TVRI11	16.376,00	0,00	105,78	13.952,00	-2.318,22	-14,16%	-15,42%	16,60%
AUSTRO INSTITUCIONAL PIPE BANCOS FIC AÇÕES	158.319,45	0,00	0,00	126.052,23	-32.267,22	-20,38%	-20,38%	14,58%

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
Total Renda Variável	8.948.914,55	405,06	2.464,35	9.365.127,61	418.272,35	4,67%		8,81%

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
CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR NÍ...	770.517,73	0,00	0,00	784.965,00	14.447,27	1,88%	1,88%	8,52%
Total Exterior	770.517,73	0,00	0,00	784.965,00	14.447,27	1,88%		8,52%

Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da CRÉDITO E MERCADO CONSULTORIA DE INVESTIMENTOS.. As informações aqui contidas, tem por somente, o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre o(s) produto(s) mencionado(s), entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros exigidos legalmente. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas aos objetivos, aos riscos e à política de investimento do(s) produto(s). Todas as informações podem ser obtidas com os responsáveis pela distribuição, administração, gestão ou no próprio site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários) através do link: <https://www.gov.br/cvm/pt-br>.

Sua elaboração buscou atender os objetivos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil de investidor.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas aos investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de Consultoria de Valores Mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe a Consultoria de Valores Mobiliários a prestação dos serviços de ORIENTAÇÃO, RECOMENDAÇÃO E ACONSELHAMENTO, DE FORMA PROFISSIONAL, INDEPENDENTE E INDIVIDUALIZADA, SOBRE INVESTIMENTOS NO MERCADO DE VALORES MOBILIÁRIOS, CUJA ADOÇÃO E IMPLEMENTAÇÃO SEJAM EXCLUSIVAS DO CLIENTE (Resolução CVM nº 19/2021).

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no Art. 3º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria MTP nº 1.467/2022, art. 84, inciso III, alínea "a".

Os RPPS DEVEM, independente da contratação de Consultoria de Valores Mobiliários, se adequar às normativas pertinentes e principalmente a Portaria MTP nº 1.467/2022 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963/2021, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.

Relatório Analítico dos Investimentos

em agosto de 2020

Este relatório atende a Portaria MTP Nº 1.467, de 2 de junho de 2022.

Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2020)

CNPJ	Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Lei
13.322.205/0001-35	BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REN...	D+1	Não há	118.794,44	0,30%	892	0,00%	7º I b
07.442.078/0001-05	BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REND...	D+1	Não há	1.358.151,53	3,44%	673	0,02%	7º I b
32.161.826/0001-29	BB IRF-M 1+ RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	697.516,90	1,77%	117	0,14%	7º I b
07.111.384/0001-69	BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REND...	D+1	Não há	48.305,34	0,12%	717	0,00%	7º I b
20.734.937/0001-06	BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	D+0	15/08/2018	296.589,84	0,75%	58	0,94%	7º I b
19.523.305/0001-06	BB TÍTULOS PÚBLICOS VII RESP LIMITADA FIF RENDA ...	D+0	15/08/2022	137.289,51	0,35%	165	0,06%	7º I b
25.069.955/0001-26	BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	18/08/2018	1.624.021,57	4,11%	21	2,74%	7º I b
23.215.097/0001-55	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FI...	D+0	Não há	2.732.052,86	6,92%	852	0,02%	7º I b
14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RESP ...	D+0	Não há	327.043,07	0,83%	970	0,00%	7º I b
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITAD...	D+0	Não há	2.522.042,70	6,39%	905	0,04%	7º I b
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMIT...	D+0	Não há	19.288,86	0,05%	1.359	0,00%	7º I b
09.093.819/0001-15	ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC...	D+1	Não há	155.146,18	0,39%	64	0,01%	7º I b
35.292.588/0001-89	BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL RESP LIMITADA FI...	D+3	Não há	5.047.029,86	12,78%	361	0,26%	7º IV a
13.077.415/0001-05	BB FLUXO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SIMPLE...	D+0	Não há	380.785,36	0,96%	755	0,02%	7º IV a
13.077.418/0001-49	BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFER...	D+0	Não há	7.110,41	0,02%	590	0,00%	7º IV a
20.216.216/0001-04	BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF...	D+1	Não há	310.415,00	0,79%	125	0,04%	7º IV a
14.508.643/0001-55	CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RESP LIMITADA FIF ...	D+0	Não há	169.074,89	0,43%	316	0,03%	7º IV a
03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERE...	D+0	Não há	26.455,10	0,07%	696	0,00%	7º IV a
12.402.646/0001-84	IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	D+1002	Não há	759.616,14	1,92%	12	5,95%	7º IV a
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITA...	D+1	Não há	180.877,61	0,46%	289	0,00%	7º IV a

Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2020)

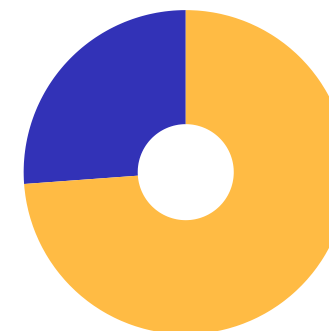
CNPJ	Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Lei
15.153.656/0001-11	MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1800	Não há	5.139.058,71	13,01%		0,00%	7º IV a
13.594.673/0001-69	TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	D+31 ou...	Não há	4.745.087,51	12,02%	15	3,64%	7º IV a
01.181.521/0001-55	CDB - BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.	S/Info	Não Informado	1.295.222,31	3,28%		0,00%	7º VI a
06.018.364/0001-85	PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	145.806,63	0,37%	98	0,18%	7º VII a
21.918.896/0001-62	CAIXA BRASIL IPCA XVI RESP LIMITADA FIF RENDA FI...	D+0	18/04/2018	917.026,50	2,32%	74	0,50%	7º VII b
08.973.942/0001-68	BB CONSUMO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+4	Não há	1.018.503,97	2,58%	14.673	0,26%	8º II a
07.882.792/0001-14	BB SELEÇÃO FATORIAL RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+3	Não há	1.575.010,53	3,99%	8.978	0,57%	8º II a
30.068.224/0001-04	CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR RESP LIMITADA FIF CIC AÇ...	D+25	Não há	483.279,03	1,22%	2.497	0,06%	8º II a
17.502.937/0001-68	CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR ...	D+4	Não há	903.987,47	2,29%	137	0,06%	8º II a
15.154.220/0001-47	CAIXA SMALL CAPS ATIVO RESP LIMITADA FIF AÇÕES	D+4	Não há	522.484,95	1,32%	16.747	0,04%	8º II a
13.155.995/0001-01	DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	D+15	Não há	513.382,51	1,30%	1.227	0,34%	8º II a
08.817.414/0001-10	ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	1.242.171,38	3,15%	55	0,14%	8º II a
23.731.629/0001-07	ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX RESP LIMITADA FIF CIC...	D+24	Não há	717.613,80	1,82%	158	0,02%	8º II a
32.246.546/0001-13	ITAÚ OLIMPO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+3	Não há	4.659,61	0,01%	21.339	0,00%	8º II a
18.366.002/0001-64	AUSTRO MULTIPAR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+1	96 meses	499.431,65	1,26%	33	0,61%	8º III
29.388.994/0001-47	CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MUL...	D+2	01/10/2020	588.723,73	1,49%	956	0,12%	8º III
20.886.575/0001-60	FP2 FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	826.797,73	2,09%		0,00%	8º IV a
11.490.580/0001-69	GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	123.193,51	0,31%		0,00%	8º IV a
16.720.629/0001-46	IMOBILIÁRIO PARANÁ REC FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	30.443,19	0,08%		0,41%	8º IV a
13.584.584/0001-31	BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES RESP...	Não se ...	Não se aplica	51.427,80	0,13%		0,03%	8º IV b

Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2020)

CNPJ	Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Lei
17.098.794/0001-70	CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	39.181,14	0,10%		0,02%	8º IV b
14.631.148/0001-39	HAZ FII - ATCR11	Não se ...	Não se aplica	970.475,17	2,46%		1,35%	8º IV b
15.538.445/0001-05	SP DOWNTOWN FII - SPTW11	Não se ...	Não se aplica	83.420,00	0,21%		0,05%	8º IV b
14.410.722/0001-29	TIVIO RENDA IMOBILIÁRIA RESP LIMITADA FII - TVRI...	Não se ...	Não se aplica	13.903,00	0,04%		0,00%	8º IV b
28.319.463/0001-30	AUSTRO INSTITUCIONAL PIPE BANCOS FIC AÇÕES	D+31	30/04/2021	124.662,37	0,32%	22	0,45%	NE
Total para cálculo dos limites da Resolução			39.492.561,37					
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			600.374,40	Artigo 6º				
PL Total			40.092.935,77					

Enquadramento e Política de Investimento (RENTA FIXA) - base (Agosto / 2020)

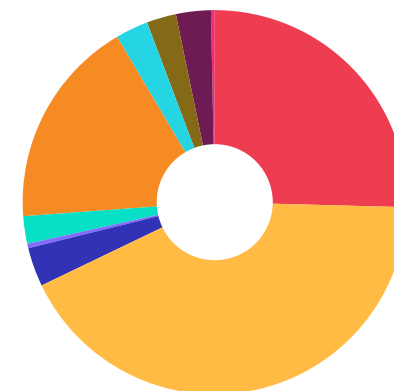
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	100,00%	10.036.242,80	25,41%	20,00%	30,00%	90,00%	25.507.062,43
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	23.695.536,82
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea a	40,00%	16.765.510,59	42,45%	10,00%	30,00%	40,00%	-968.486,04
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea a	15,00%	1.295.222,31	3,28%	0,00%	0,00%	15,00%	4.628.661,90
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea a	5,00%	145.806,63	0,37%	0,00%	0,00%	5,00%	1.828.821,44
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea b	5,00%	917.026,50	2,32%	0,00%	0,00%	5,00%	1.057.601,57
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea c	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.974.628,07
Total Renda Fixa	100,00%	29.159.808,83	73,84%	30,00%	70,00%	220,00%	



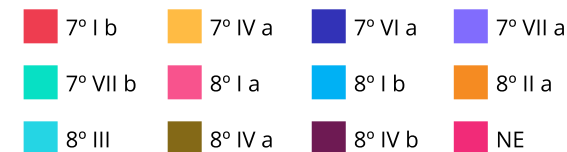
RENTA FIXA 29.159.808,83
RENTA VARIÁVEL 10.332.752,54

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Agosto / 2020)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	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%	5,00%	1.974.628,07
Artigo 8º, Inciso I, Alínea b	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.974.628,07
Artigo 8º, Inciso II, Alínea a	20,00%	6.981.093,25	17,68%	7,00%	15,00%	20,00%	917.419,02
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	1.088.155,38	2,76%	3,00%	10,00%	10,00%	2.861.100,76
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea a	5,00%	980.434,43	2,48%	0,00%	0,00%	5,00%	994.193,64
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea b	5,00%	1.158.407,11	2,93%	0,00%	5,00%	5,00%	816.220,96
Desenquadrado - RV	0,00%	124.662,37	0,32%	0,00%	0,00%	0,00%	-124.662,37
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	10.332.752,54	26,16%	10,00%	30,00%	50,00%	



Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2020			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.974.628,07
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2020		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	1.920.611,41	4,86	20,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea a	0,00	0,00	10,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea a	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	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	5,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea b	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea a	0,00	0,00	7,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	588.723,73	1,49	3,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea a	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea b	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	5,00

Enquadramento por Gestores - base (Agosto / 2020)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	12.309.109,26	31,17	0,00
VERITAS CAPITAL MANAGEMENT	11.143.194,01	28,22	0,53
CAIXA DTVM S.A	9.250.640,30	23,42	0,00
SICREDI	1.295.222,31	3,28	0,94
ITAÚ DTVM	1.242.171,38	3,15	0,00
GRAPHEN INVESTIMENTOS	1.146.724,99	2,90	2,19
ARENA CAPITAL	826.797,73	2,09	-
ITAÚ UNIBANCO	722.273,41	1,83	0,00
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	513.382,51	1,30	0,01
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	336.023,79	0,85	0,00
BANCO BRADESCO	310.415,00	0,79	-
GENIAL GESTÃO LTDA	206.613,51	0,52	0,00
AUSTRO CAPITAL	124.662,37	0,32	0,01
ZION INVEST	51.427,80	0,13	0,01
TIVIO CAPITAL DISTRIBUIDORA DE...	13.903,00	0,04	0,00

Artigo 20º - 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) - (Resolução 4963)

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
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	1,03%	5,39%	2,99%	4,11%	9,71%	23,52%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,14%	1,94%	0,50%	1,30%	3,59%	9,81%	0,00%	0,36%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,14%	1,92%	0,49%	1,29%	3,57%	9,79%	0,00%	0,36%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REND...	0,79%	4,80%	2,82%	3,70%	8,84%	21,88%	0,77%	2,95%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENC...	0,69%	4,43%	2,73%	3,38%	8,67%	21,54%	0,74%	3,14%
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	0,73%	4,66%	2,39%	3,22%	8,58%	18,96%	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	-0,22%	5,24%	2,92%	3,64%	10,47%	28,20%	1,42%	5,59%
IRF-M 1+ (Benchmark)	-1,13%	6,37%	1,36%	4,37%	10,64%	33,26%	-	-
BB IRF-M 1+ RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,25%	5,92%	1,34%	4,01%	10,07%	-	1,44%	3,83%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,12%	2,96%	0,64%	2,12%	5,06%	12,83%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIX...	0,10%	2,83%	0,60%	2,03%	4,85%	12,44%	0,15%	0,55%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,43%	4,63%	2,55%	3,39%	9,24%	25,01%	-	-
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	0,42%	4,68%	2,51%	3,42%	9,22%	24,87%	0,87%	3,65%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-1,34%	-2,61%	-4,63%	-2,93%	-4,91%	-21,87%	4,59%	-
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	0,41%	4,53%	2,47%	3,32%	9,06%	24,40%	0,82%	3,51%

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-B (Benchmark)	-1,80%	0,80%	4,61%	0,09%	6,64%	36,00%	-	-
CDB - BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.	-	-	-	-	-	-	-	-
IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	-50,31%	-64,39%	-58,12%	-64,14%	-64,25%	-62,01%	8,15%	52,27%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	-1,47%	-37,31%	-25,84%	-38,17%	-34,80%	-33,60%	22,27%	26,28%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA ...	-1,83%	0,54%	4,54%	-0,14%	6,20%	35,19%	2,27%	10,82%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCI...	-1,85%	0,64%	4,50%	-0,06%	6,38%	35,28%	2,27%	10,71%

IRF-M (Benchmark)	-0,75%	5,20%	1,11%	3,62%	8,70%	26,82%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCI...	-0,80%	5,01%	1,09%	3,47%	8,43%	26,24%	1,03%	2,68%

CDI (Benchmark)	0,16%	2,12%	0,57%	1,43%	3,86%	10,38%	-	-
BB FLUXO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,08%	1,42%	0,31%	0,92%	2,78%	8,08%	0,00%	0,35%
CAIXA BRASIL RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,15%	1,77%	0,64%	1,12%	3,36%	9,69%	0,03%	0,45%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA ...	-1,05%	-	1,81%	-	-	-	1,19%	-
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SI...	0,09%	1,55%	0,35%	1,01%	3,00%	8,56%	0,00%	0,36%
BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVID...	0,18%	1,80%	0,68%	1,16%	3,42%	9,79%	0,03%	0,44%

IPCA (Benchmark)	0,24%	0,70%	0,86%	0,24%	2,44%	5,95%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	-0,56%	5,06%	1,17%	3,57%	9,21%	27,35%	0,92%	2,86%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA ...	-0,13%	2,70%	0,86%	2,09%	4,74%	18,63%	0,26%	0,80%

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
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	0,47%	2,45%	1,79%	1,83%	6,06%	18,80%	0,32%	2,40%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	6,59%	-4,23%	-2,93%	-3,54%	-4,88%	-13,80%	13,55%	11,38%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2020 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	14,62%	54,49%	21,89%	53,88%	67,96%	72,96%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR NÍVEL I	15,16%	55,87%	22,45%	55,15%	68,87%	72,76%	8,52%	22,46%

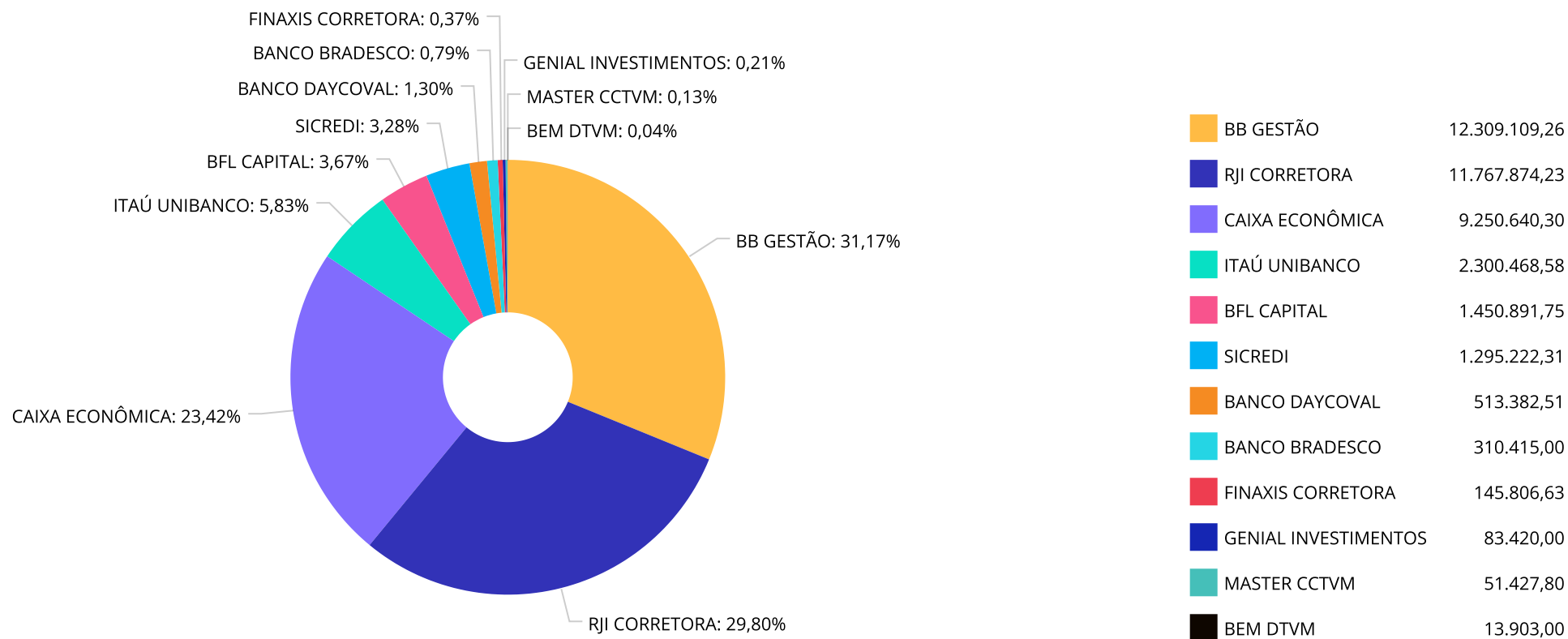
Ibovespa (Benchmark)	-3,44%	-14,07%	13,69%	-4,61%	-1,75%	29,59%	-	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	0,02%	1,87%	0,19%	1,28%	4,31%	16,69%	0,02%	0,95%
AUSTRO INSTITUCIONAL PIPE BANCOS FIC AÇÕES	-1,10%	-61,66%	-24,26%	-59,23%	-62,84%	-47,25%	14,58%	32,72%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	-3,93%	-27,34%	13,94%	-21,07%	-17,17%	22,23%	11,66%	50,30%
BB SELEÇÃO FATORIAL RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	-1,31%	-6,39%	18,38%	-0,20%	8,03%	57,84%	9,54%	42,50%
BB CONSUMO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	-1,74%	-4,92%	16,00%	1,70%	5,90%	58,04%	11,07%	42,45%
DAYCOVAL IBOVESPAATIVO FI AÇÕES	-1,56%	-12,92%	17,63%	-2,75%	-0,96%	36,85%	9,45%	40,17%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPAATIVO FIC AÇÕES	-3,01%	-12,28%	14,26%	-5,52%	0,98%	39,22%	9,25%	40,04%
ITAÚ OLIMPO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	-1,96%	-9,47%	18,51%	-2,77%	4,62%	-	8,93%	39,48%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	-3,45%	-10,02%	15,87%	-4,39%	6,16%	-	8,79%	41,87%

IFIX (Benchmark)	1,79%	-12,99%	4,68%	-6,13%	4,72%	30,04%	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES RESP LIMITADA FII - C...	-5,26%	-30,23%	30,44%	-24,37%	-42,31%	-52,38%	34,23%	60,09%
SP DOWNTOWN FII - SPTW11	11,94%	-32,63%	18,11%	-4,07%	-3,29%	-	14,78%	51,86%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	-10,41%	4,03%	19,23%	5,16%	41,29%	-83,62%	11,49%	46,49%
TIVIO RENDA IMOBILIÁRIA RESP LIMITADA FII - TVRI11	-0,08%	-19,23%	-10,98%	-14,17%	-8,22%	9,29%	16,60%	26,90%
HAZ FII - ATCR11	0,03%	2,42%	2,31%	2,33%	385,54%	385,54%	-	-

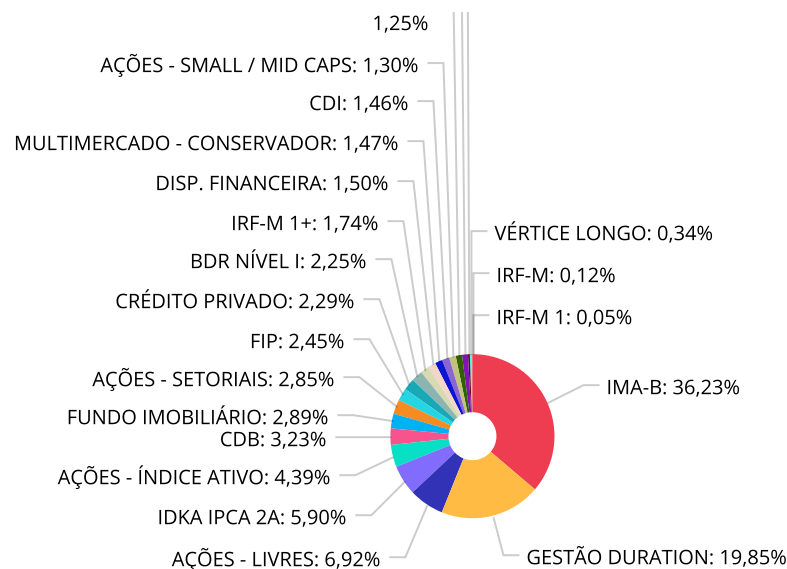
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2020 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA (Benchmark)	0,24%	0,70%	0,86%	0,24%	2,44%	5,95%	-	-
AUSTRO MULTIPAR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-0,31%	-15,78%	-0,97%	-14,91%	-16,23%	-17,17%	0,01%	13,42%
IMOBILIÁRIO PARANÁ REC FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,32%	-	-1,26%	-	-5,17%	-18,06%	0,04%	-
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	1,08%	7,59%	3,49%	5,41%	13,19%	29,21%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	-	-	-	-	-96,89%	-96,86%	-	-
IPCA + 9,00% ao ano (Benchmark)	0,96%	6,62%	3,13%	4,69%	11,66%	25,75%	-	-
FP2 FIP MULTIESTRATÉGIA	-	-	-	-	-	-	-	-
SMLL (Benchmark)	-1,23%	-14,27%	23,76%	-6,96%	6,02%	60,17%	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO RESP LIMITADA FIF AÇÕES	-1,39%	-15,36%	21,66%	-7,86%	3,92%	51,07%	9,90%	45,26%

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



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



IMA-B	14.523.956,59	GESTÃO DURATION	7.959.960,33	AÇÕES - LIVRES	2.775.903,36
IDKA IPCA 2A	2.366.448,92	AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	1.760.213,50	CDB	1.295.222,31
FUNDO IMOBILIÁRIO	1.158.407,11	AÇÕES - SETORIAIS	1.143.166,34	FIP	980.434,43
CRÉDITO PRIVADO	917.026,50	BDR NÍVEL I	903.987,47	IRF-M 1+	697.516,90
DISP. FINANCEIRA	600.374,40	MULTIMERCADO - CONSERVADOR	588.723,73	CDI	583.425,76
AÇÕES - SMALL / MID CAPS	522.484,95	MULTIMERCADO - CRÉDITO PRIVADO	499.431,65	IMA-B 5	465.561,18
FIDC	145.806,63	VÉRTICE LONGO	137.289,51	IRF-M	48.305,34
IRF-M 1	19.288,86				

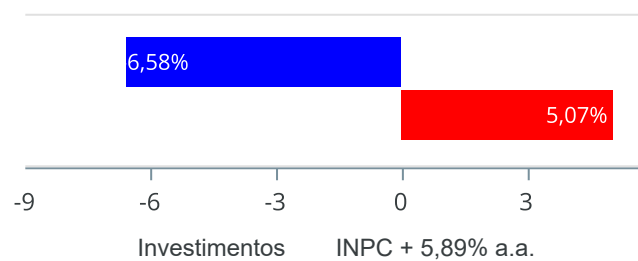
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Agosto / 2020)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
------------------	------------	--------	------	-------------	------------	---------	----------	----------

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2020

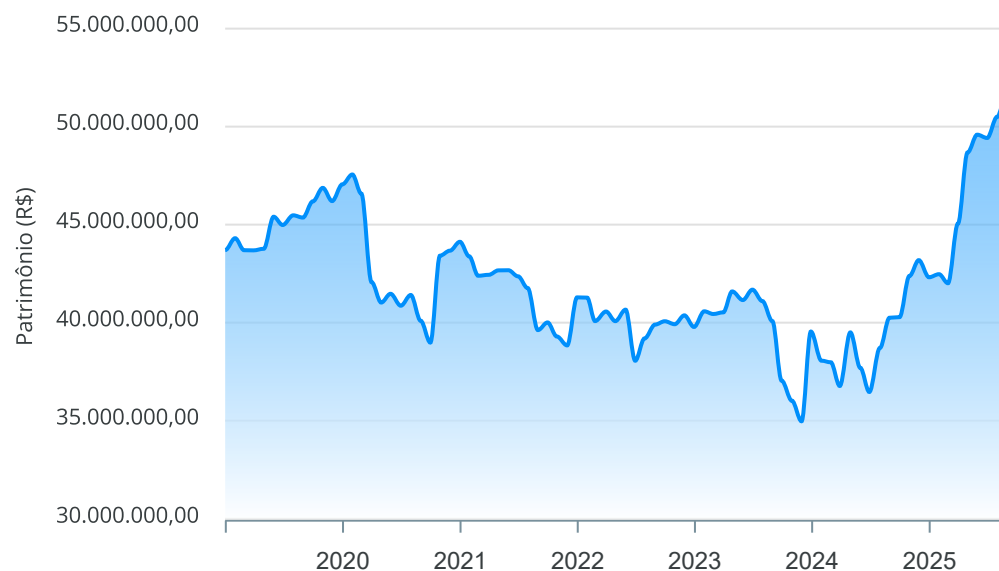
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	47.055.425,39	2.422.019,00	2.034.188,91	47.505.509,53	62.254,05	62.254,05	0,13%	0,13%	0,69%	0,69%	18,97%	3,57%
Fevereiro	47.505.509,53	741.998,43	1.235.261,87	46.536.380,29	-475.865,80	-413.611,75	-1,00%	-0,87%	0,58%	1,28%	-68,31%	4,27%
Março	46.536.380,29	900.214,98	1.398.061,94	42.028.862,47	-4.009.670,86	-4.423.282,61	-8,62%	-9,41%	0,68%	1,97%	-478,62%	19,75%
Abril	42.028.862,47	846.865,72	1.263.774,36	40.979.848,09	-632.105,74	-5.055.388,35	-1,50%	-10,78%	0,22%	2,20%	-490,84%	10,27%
Maio	40.979.848,09	1.979.674,69	4.323.488,01	39.042.759,00	406.724,23	-4.648.664,12	0,99%	-9,89%	0,20%	2,40%	-411,41%	7,24%
Junho	39.042.759,00	3.019.229,14	2.240.179,17	40.819.448,84	997.639,87	-3.651.024,25	2,51%	-7,63%	0,78%	3,20%	-238,35%	6,10%
Julho	40.819.448,84	1.955.081,28	2.373.941,74	41.364.960,73	964.372,35	-2.686.651,90	2,36%	-5,45%	0,97%	4,20%	-129,79%	12,38%
Agosto	41.364.960,73	14.318.226,11	15.879.181,36	39.309.419,58	-494.585,90	-3.181.237,80	-1,20%	-6,58%	0,84%	5,07%	-129,69%	6,38%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Investimentos

Meta de Rentabilidade

☐ CDI

☐ IMA-B

ANO

36M

☐ IMA-B 5

☐ IMA-B 5+

☐ IMA Geral

☐ IRF-M

☐ IRF-M 1

☐ IRF-M 1+

☐ Ibovespa

☐ IBX

☐ SMLL

☐ IDIV

Investimentos

Meta de Rentabilidade

☐ 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
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	136.788,77	0,00	0,00	145.806,63	9.017,86	6,59%	6,59%	13,55%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RESP LI...	324.474,73	0,00	0,00	327.043,07	2.568,34	0,79%	0,79%	0,77%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA...	117.984,92	0,00	0,00	118.794,44	809,52	0,69%	0,69%	0,74%
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF C...	309.103,76	0,00	0,00	310.415,00	1.311,24	0,42%	0,42%	0,87%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC R...	154.516,27	0,00	0,00	155.146,18	629,91	0,41%	0,41%	0,82%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII RESP LIMITADA FIF RENDA FI...	394.851,38	0,00	258.982,30	137.289,51	1.420,43	0,36%	0,47%	0,32%
BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFEREN...	7.097,55	0,00	0,00	7.110,41	12,86	0,18%	0,18%	0,03%
ITAÚ IMA-B ATIVO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	151.677,94	0,00	151.950,83	0,00	272,89	0,18%	-1,92%	2,30%
CAIXA BRASIL RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERENC...	26.416,80	0,00	0,00	26.455,10	38,30	0,14%	0,14%	0,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	1.621.796,56	0,00	0,00	1.624.021,57	2.225,01	0,14%	0,14%	0,00%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRI...	296.189,74	0,00	0,00	296.589,84	400,10	0,14%	0,14%	0,00%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITAD...	19.270,27	0,00	0,00	19.288,86	18,59	0,10%	0,10%	0,15%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RESP LIMITADA FIF CI...	1.125.701,25	2.699.952,56	3.657.762,97	169.074,89	1.184,05	0,03%	0,09%	0,00%
BB FLUXO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SIMPLES ...	604.777,88	1.533.070,87	1.757.477,31	380.785,36	413,92	0,02%	0,08%	0,00%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA...	181.103,47	0,00	0,00	180.877,61	-225,86	-0,12%	-0,12%	0,26%
CAIXA BRASIL IPCA XVI RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA...	919.013,50	0,00	0,00	917.026,50	-1.987,00	-0,22%	-0,22%	1,42%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.571.204,91	0,00	2.563.696,80	0,00	-7.508,11	-0,29%	-0,89%	1,05%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FIF ...	603.987,04	2.139.714,37	0,00	2.732.052,86	-11.648,55	-0,42%	-0,56%	0,92%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REN...	2.581.738,52	0,00	2.569.070,87	0,00	-12.667,65	-0,49%	-3,69%	3,80%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL RESP LIMITADA FIF ...	0,00	5.086.327,23	0,00	5.047.029,86	-39.297,37	-0,77%	-1,05%	1,19%

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 IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA ...	48.696,41	0,00	0,00	48.305,34	-391,07	-0,80%	-0,80%	1,03%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITA...	1.499.042,01	0,00	1.485.531,78	0,00	-13.510,23	-0,90%	-3,64%	3,79%
CDB - BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.	1.307.142,23	0,00	0,00	1.295.222,31	-11.919,92	-0,91%	-	-
BB IRF-M 1+ RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENC...	706.332,96	0,00	0,00	697.516,90	-8.816,06	-1,25%	-1,25%	1,44%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	5.208.679,44	0,00	0,00	5.139.058,71	-69.620,73	-1,34%	-	4,59%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	4.815.847,01	0,00	0,00	4.745.087,51	-70.759,50	-1,47%	-1,47%	22,27%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA ...	2.569.066,63	0,00	0,00	2.522.042,70	-47.023,93	-1,83%	-1,83%	2,27%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA ...	1.383.802,46	0,00	0,00	1.358.151,53	-25.650,93	-1,85%	-1,85%	2,27%
IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	1.528.563,71	0,00	720.593,27	759.616,14	-48.354,30	-3,16%	-50,31%	8,15%
Total Renda Fixa	31.214.868,12	11.459.065,03	13.165.066,13	29.159.808,83	-349.058,19	-1,12%		5,67%

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
SP DOWNTOWN FII - SPTW11	74.250,00	0,00	1.620,00	83.420,00	10.790,00	14,53%	11,94%	14,78%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA RESP LIMITADA FIF AÇÕES	473.039,64	0,00	478.435,38	0,00	5.395,74	1,14%	-3,37%	9,80%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	39.053,14	0,00	280,00	39.181,14	408,00	1,04%	-10,40%	11,49%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR RESP LIMITADA FIF CIC AÇÃO...	0,00	478.435,38	0,00	483.279,03	4.843,65	1,01%	-3,45%	8,79%
TIVIO RENDA IMOBILIÁRIA RESP LIMITADA FII - TVRI11	13.952,00	0,00	105,78	13.903,00	56,78	0,41%	-0,08%	16,60%
HAZ FII - ATCR11	970.220,19	0,00	0,00	970.475,17	254,98	0,03%	0,03%	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTI...	588.590,01	0,00	0,00	588.723,73	133,72	0,02%	0,02%	0,02%
FP2 FIP MULTIESTRATÉGIA	826.866,83	0,00	0,00	826.797,73	-69,10	-0,01%	-	-
BB IBOVESPA INDEXADO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	1.606.798,24	0,00	1.605.026,89	0,00	-1.771,35	-0,11%	-3,59%	10,26%
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	123.418,40	0,00	0,00	123.193,51	-224,89	-0,18%	-	-
AUSTRO MULTIPAR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	500.989,12	0,00	0,00	499.431,65	-1.557,47	-0,31%	-0,31%	0,01%
IMOBILIÁRIO PARANÁ REC FIP MULTIESTRATÉGIA	30.541,47	0,00	0,00	30.443,19	-98,28	-0,32%	-0,32%	0,04%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	1.096.727,32	151.950,83	0,00	1.242.171,38	-6.506,77	-0,52%	-3,01%	9,25%
BB CONSUMO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	400.864,56	628.407,59	0,00	1.018.503,97	-10.768,18	-1,05%	-1,73%	11,07%
AUSTRO INSTITUCIONAL PIPE BANCOS FIC AÇÕES	126.052,23	0,00	0,00	124.662,37	-1.389,86	-1,10%	-1,10%	14,58%
BB DIVIDENDOS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	636.482,86	0,00	628.407,59	0,00	-8.075,27	-1,27%	-3,41%	8,54%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO RESP LIMITADA FIF AÇÕES	529.822,94	0,00	0,00	522.484,95	-7.337,99	-1,38%	-1,38%	9,90%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	521.490,35	0,00	0,00	513.382,51	-8.107,84	-1,55%	-1,55%	9,45%
BB SELEÇÃO FATORIAL RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	0,00	1.605.026,89	0,00	1.575.010,53	-30.016,36	-1,87%	-1,31%	9,54%
ITAÚ OLIMPO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	4.752,90	0,00	0,00	4.659,61	-93,29	-1,96%	-1,96%	8,93%

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 INSTITUCIONAL PHOENIX RESP LIMITADA FIF CIC A...	746.930,51	0,00	0,00	717.613,80	-29.316,71	-3,92%	-3,92%	11,66%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES RESP L...	54.284,90	0,00	239,59	51.427,80	-2.617,51	-4,82%	-8,42%	34,23%
Total Renda Variável	9.365.127,61	2.863.820,69	2.714.115,23	9.428.765,07	-86.068,00	-0,90%		8,79%

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
CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR NÍ...	784.965,00	0,00	0,00	903.987,47	119.022,47	15,16%	15,16%	8,52%
Total Exterior	784.965,00	0,00	0,00	903.987,47	119.022,47	15,16%		8,52%

Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da CRÉDITO E MERCADO CONSULTORIA DE INVESTIMENTOS.. As informações aqui contidas, tem por somente, o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre o(s) produto(s) mencionado(s), entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros exigidos legalmente. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas aos objetivos, aos riscos e à política de investimento do(s) produto(s). Todas as informações podem ser obtidas com os responsáveis pela distribuição, administração, gestão ou no próprio site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários) através do link: <https://www.gov.br/cvm/pt-br>.

Sua elaboração buscou atender os objetivos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil de investidor.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas aos investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de Consultoria de Valores Mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe a Consultoria de Valores Mobiliários a prestação dos serviços de ORIENTAÇÃO, RECOMENDAÇÃO E ACONSELHAMENTO, DE FORMA PROFISSIONAL, INDEPENDENTE E INDIVIDUALIZADA, SOBRE INVESTIMENTOS NO MERCADO DE VALORES MOBILIÁRIOS, CUJA ADOÇÃO E IMPLEMENTAÇÃO SEJAM EXCLUSIVAS DO CLIENTE (Resolução CVM nº 19/2021).

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no Art. 3º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria MTP nº 1.467/2022, art. 84, inciso III, alínea "a".

Os RPPS DEVEM, independente da contratação de Consultoria de Valores Mobiliários, se adequar às normativas pertinentes e principalmente a Portaria MTP nº 1.467/2022 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963/2021, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.

Relatório Analítico dos Investimentos

em setembro e 3º trimestre de 2020

Este relatório atende a Portaria MTP Nº 1.467, de 2 de junho de 2022.

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2020)

CNPJ	Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Lei
13.322.205/0001-35	BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REN...	D+1	Não há	118.930,00	0,31%	903	0,00%	7º I b
07.442.078/0001-05	BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REND...	D+1	Não há	1.337.026,24	3,47%	676	0,02%	7º I b
32.161.826/0001-29	BB IRF-M 1+ RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	689.430,93	1,79%	118	0,15%	7º I b
07.111.384/0001-69	BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REND...	D+1	Não há	47.987,78	0,12%	714	0,00%	7º I b
19.523.305/0001-06	BB TÍTULOS PÚBLICOS VII RESP LIMITADA FIF RENDA ...	D+0	15/08/2022	137.551,67	0,36%	165	0,06%	7º I b
23.215.097/0001-55	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FI...	D+0	Não há	2.718.306,31	7,05%	868	0,02%	7º I b
14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RESP ...	D+0	Não há	327.163,18	0,85%	982	0,00%	7º I b
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITAD...	D+0	Não há	2.483.371,77	6,44%	905	0,04%	7º I b
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMIT...	D+0	Não há	19.314,58	0,05%	1.361	0,00%	7º I b
09.093.819/0001-15	ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC...	D+1	Não há	154.912,87	0,40%	69	0,01%	7º I b
35.292.588/0001-89	BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL RESP LIMITADA FI...	D+3	Não há	5.002.701,71	12,98%	387	0,24%	7º IV a
13.077.415/0001-05	BB FLUXO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SIMPLE...	D+0	Não há	2.369.702,99	6,15%	755	0,13%	7º IV a
13.077.418/0001-49	BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFER...	D+0	Não há	7.112,12	0,02%	586	0,00%	7º IV a
20.216.216/0001-04	BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF...	D+1	Não há	309.834,89	0,80%	126	0,04%	7º IV a
14.508.643/0001-55	CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RESP LIMITADA FIF ...	D+0	Não há	420.525,64	1,09%	301	0,09%	7º IV a
03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERE...	D+0	Não há	26.454,40	0,07%	677	0,00%	7º IV a
12.402.646/0001-84	IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	D+1002	Não há	606.574,08	1,57%	12	5,95%	7º IV a
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITA...	D+1	Não há	180.462,95	0,47%	290	0,00%	7º IV a
15.153.656/0001-11	MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1800	Não há	4.928.064,08	12,79%	18	2,74%	7º IV a
13.594.673/0001-69	TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	D+31 ou...	Não há	4.289.065,50	11,13%	15	3,64%	7º IV a

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2020)

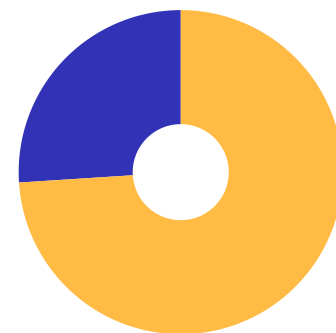
CNPJ	Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Lei
01.181.521/0001-55	CDB - BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.	S/Info	Não Informado	1.281.482,57	3,32%		0,00%	7º VI a
06.018.364/0001-85	PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	145.560,15	0,38%	98	0,18%	7º VII a
21.918.896/0001-62	CAIXA BRASIL IPCA XVI RESP LIMITADA FIF RENDA FI...	D+0	18/04/2018	911.250,00	2,36%	75	0,49%	7º VII b
08.973.942/0001-68	BB CONSUMO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+4	Não há	976.923,10	2,53%	14.234	0,25%	8º II a
07.882.792/0001-14	BB SELEÇÃO FATORIAL RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+3	Não há	1.497.172,44	3,88%	9.414	0,54%	8º II a
30.068.224/0001-04	CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR RESP LIMITADA FIF CIC AÇ...	D+25	Não há	457.289,77	1,19%	2.486	0,06%	8º II a
17.502.937/0001-68	CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR ...	D+4	Não há	885.959,38	2,30%	158	0,05%	8º II a
15.154.220/0001-47	CAIXA SMALL CAPS ATIVO RESP LIMITADA FIF AÇÕES	D+4	Não há	491.518,34	1,28%	16.425	0,04%	8º II a
13.155.995/0001-01	DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	D+15	Não há	486.049,25	1,26%	1.184	0,34%	8º II a
08.817.414/0001-10	ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	1.210.945,09	3,14%	55	0,14%	8º II a
23.731.629/0001-07	ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX RESP LIMITADA FIF CIC...	D+24	Não há	659.965,50	1,71%	155	0,02%	8º II a
32.246.546/0001-13	ITAÚ OLIMPO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+3	Não há	4.463,84	0,01%	21.365	0,00%	8º II a
18.366.002/0001-64	AUSTRO MULTIPAR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+1	96 meses	497.954,58	1,29%	33	0,61%	8º III
29.388.994/0001-47	CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MUL...	D+2	01/10/2020	586.093,49	1,52%	956	0,12%	8º III
20.886.575/0001-60	FP2 FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	826.739,88	2,15%		0,00%	8º IV a
11.490.580/0001-69	GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	122.980,88	0,32%		0,00%	8º IV a
16.720.629/0001-46	IMOBILIÁRIO PARANÁ REC FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	30.166,89	0,08%		0,41%	8º IV a
13.584.584/0001-31	BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES RESP...	Não se ...	Não se aplica	44.570,76	0,12%		0,03%	8º IV b
17.098.794/0001-70	CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	39.647,60	0,10%		0,01%	8º IV b
14.631.148/0001-39	HAZ FII - ATCR11	Não se ...	Não se aplica	971.681,95	2,52%		1,35%	8º IV b

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2020)

CNPJ	Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Lei
15.538.445/0001-05	SP DOWNTOWN FII - SPTW11	Não se ...	Não se aplica	90.690,00	0,24%		0,05%	8º IV b
14.410.722/0001-29	TIVIO RENDA IMOBILIÁRIA RESP LIMITADA FII - TVRI...	Não se ...	Não se aplica	13.870,00	0,04%		0,00%	8º IV b
28.319.463/0001-30	AUSTRO INSTITUCIONAL PIPE BANCOS FIC AÇÕES	D+31	30/04/2021	133.863,73	0,35%	22	0,45%	NE
Total para cálculo dos limites da Resolução			38.541.332,88					
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			442.984,49	Artigo 6º				
PL Total			38.984.317,37					

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Setembro / 2020)

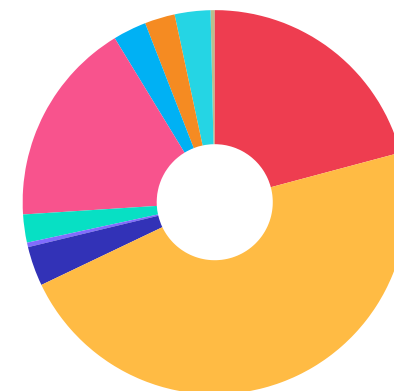
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	100,00%	8.033.995,33	20,85%	20,00%	30,00%	90,00%	26.653.204,26
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	23.124.799,73
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea a	40,00%	18.140.498,36	47,07%	10,00%	30,00%	40,00%	-2.723.965,21
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea a	15,00%	1.281.482,57	3,32%	0,00%	0,00%	15,00%	4.499.717,36
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea a	5,00%	145.560,15	0,38%	0,00%	0,00%	5,00%	1.781.506,49
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea b	5,00%	911.250,00	2,36%	0,00%	0,00%	5,00%	1.015.816,64
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea c	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.927.066,64
Total Renda Fixa	100,00%	28.512.786,41	73,98%	30,00%	70,00%	220,00%	



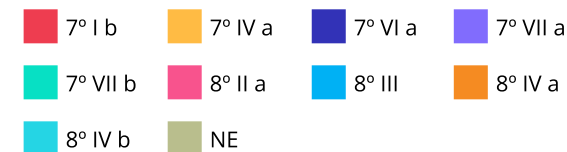
RENDA FIXA 28.512.786,41
RENDA VARIÁVEL 10.028.546,47

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Setembro / 2020)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	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%	5,00%	1.927.066,64
Artigo 8º, Inciso I, Alínea b	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.927.066,64
Artigo 8º, Inciso II, Alínea a	20,00%	6.670.286,71	17,31%	7,00%	15,00%	20,00%	1.037.979,87
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	1.084.048,07	2,81%	3,00%	10,00%	10,00%	2.770.085,22
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea a	5,00%	979.887,65	2,54%	0,00%	0,00%	5,00%	947.178,99
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea b	5,00%	1.160.460,31	3,01%	0,00%	5,00%	5,00%	766.606,33
Desenquadrado - RV	0,00%	133.863,73	0,35%	0,00%	0,00%	0,00%	-133.863,73
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	10.028.546,47	26,02%	10,00%	30,00%	50,00%	



Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2020			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.927.066,64
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2020		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	0,00	0,00	20,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea a	0,00	0,00	10,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea a	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	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	5,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea b	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea a	0,00	0,00	7,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	586.093,49	1,52	3,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea a	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea b	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	5,00

Enquadramento por Gestores - base (Setembro / 2020)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	12.184.538,98	31,61	0,00
VERITAS CAPITAL MANAGEMENT	10.321.658,24	26,78	0,45
CAIXA DTVM S.A	9.366.894,46	24,30	0,00
SICREDI	1.281.482,57	3,32	0,93
ITAÚ DTVM	1.210.945,09	3,14	0,00
GRAPHEN INVESTIMENTOS	1.147.408,99	2,98	4,35
ARENA CAPITAL	826.739,88	2,15	-
ITAÚ UNIBANCO	664.429,34	1,72	0,00
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	486.049,25	1,26	0,01
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	335.375,82	0,87	0,00
BANCO BRADESCO	309.834,89	0,80	-
GENIAL GESTÃO LTDA	213.670,88	0,55	0,00
AUSTRO CAPITAL	133.863,73	0,35	0,01
ZION INVEST	44.570,76	0,12	0,58
TIVIO CAPITAL DISTRIBUIDORA DE...	13.870,00	0,04	0,00

Artigo 20º - 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) - (Resolução 4963)

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,02%	5,41%	1,99%	5,41%	8,00%	21,88%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REND...	0,04%	4,84%	1,67%	5,27%	7,35%	20,53%	1,38%	2,91%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENC...	0,11%	4,55%	1,61%	5,24%	7,28%	20,27%	1,35%	3,09%
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	1,13%	5,85%	2,78%	3,79%	9,32%	19,21%	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	-0,63%	4,58%	1,00%	6,07%	7,34%	25,93%	2,41%	5,53%
IRF-M 1+ (Benchmark)	-0,91%	5,40%	-0,59%	3,90%	7,61%	30,00%	-	-
BB IRF-M 1+ RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,16%	4,69%	-0,86%	3,24%	6,83%	-	2,60%	4,11%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,15%	3,12%	0,51%	1,66%	4,54%	12,32%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIX...	0,13%	2,97%	0,47%	1,57%	4,34%	11,93%	0,12%	0,54%
IMA-B 5 (Benchmark)	-0,12%	4,51%	1,30%	5,11%	7,24%	23,75%	-	-
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	-0,19%	4,48%	1,21%	5,10%	7,13%	23,57%	1,69%	3,57%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-4,11%	-6,61%	-8,18%	-8,92%	-7,14%	-25,11%	5,67%	5,57%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	-0,15%	4,38%	1,23%	4,96%	7,06%	23,16%	1,65%	3,43%
IMA-B (Benchmark)	-1,51%	-0,72%	0,96%	5,97%	2,11%	34,14%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCI...	-1,56%	-0,93%	0,84%	5,77%	1,83%	33,39%	4,15%	10,59%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDB - BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.	-	-	-	-	-	-	-	-
IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	-20,15%	-71,57%	-60,66%	-65,86%	-71,83%	-69,56%	32,56%	53,08%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	-9,61%	-43,33%	-31,91%	-36,19%	-42,18%	-39,52%	14,62%	26,36%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA ...	-1,53%	-1,00%	0,89%	5,84%	1,68%	33,36%	4,14%	10,69%

IRF-M (Benchmark)	-0,56%	4,62%	-0,24%	3,15%	6,56%	24,50%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCI...	-0,66%	4,32%	-0,35%	2,90%	6,21%	23,82%	1,79%	2,86%

CDI (Benchmark)	0,16%	2,28%	0,51%	1,25%	3,54%	10,04%	-	-
CAIXA BRASIL RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00%	1,77%	0,39%	0,97%	2,90%	9,20%	0,10%	0,49%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA ...	-0,88%	-	-0,03%	2,85%	-	-	2,33%	-
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SI...	0,09%	1,64%	0,29%	0,83%	2,68%	8,21%	0,00%	0,35%
BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVID...	0,02%	1,82%	0,44%	1,22%	2,98%	9,27%	0,06%	0,47%
BB FLUXO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,00%	1,42%	0,18%	0,66%	2,40%	7,66%	0,03%	0,38%

IPCA (Benchmark)	0,64%	1,34%	1,24%	0,81%	3,14%	6,12%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	-0,50%	4,53%	-0,09%	3,18%	6,41%	25,88%	1,68%	2,67%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA ...	-0,23%	2,47%	0,20%	1,32%	3,69%	17,87%	0,49%	0,89%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	0,19%	2,64%	0,98%	3,41%	5,12%	17,74%	1,15%	2,32%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	-0,17%	-4,39%	-2,88%	-3,45%	-4,90%	-13,75%	0,01%	11,38%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2020 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	-1,97%	51,44%	14,34%	43,02%	60,30%	70,28%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR NÍVEL I	-1,99%	52,76%	14,98%	43,04%	61,21%	70,33%	15,53%	23,37%

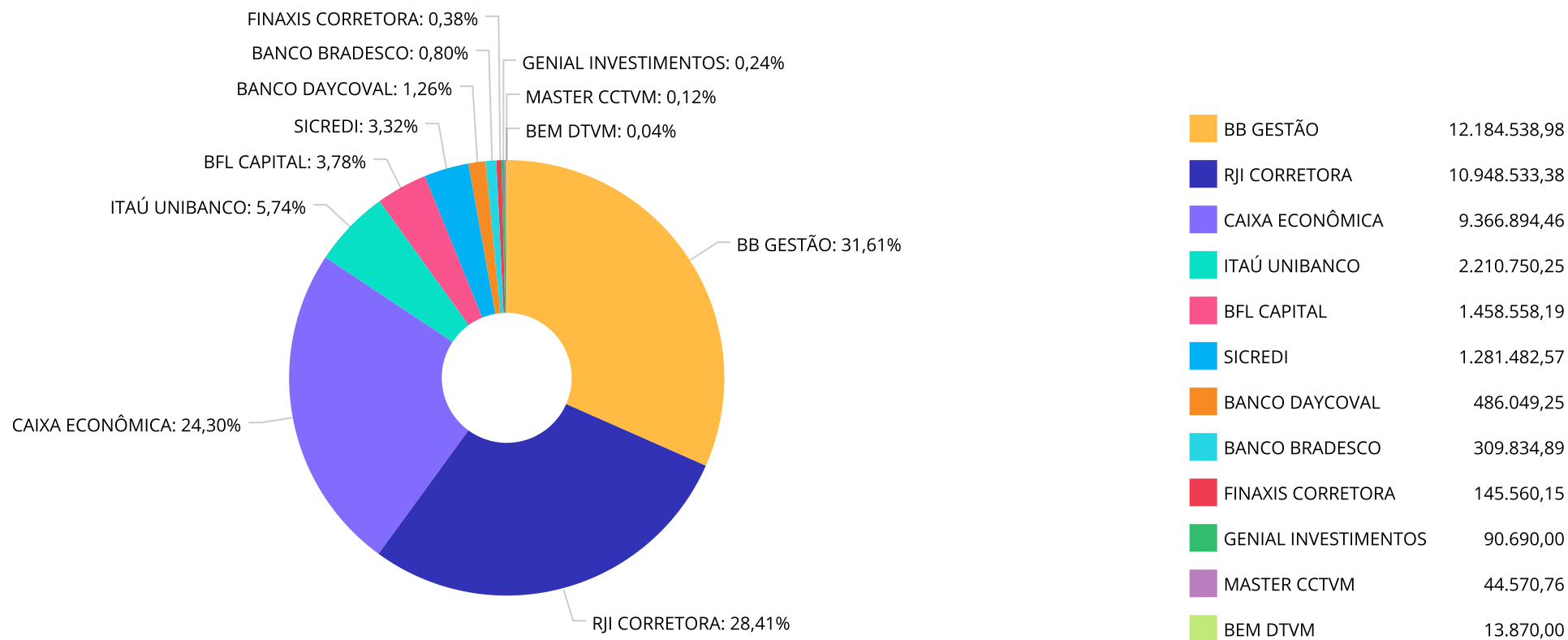
Ibovespa (Benchmark)	-4,80%	-18,20%	-0,48%	29,56%	-9,68%	19,23%	-	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	-0,45%	1,42%	-0,37%	0,25%	2,97%	15,39%	0,18%	1,09%
AUSTRO INSTITUCIONAL PIPE BANCOS FIC AÇÕES	7,38%	-58,83%	-15,45%	-39,84%	-59,84%	-44,05%	19,17%	35,41%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	-8,03%	-33,17%	-6,52%	24,90%	-23,46%	13,87%	11,91%	50,89%
BB SELEÇÃO FATORIAL RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	-4,94%	-11,01%	3,01%	39,99%	0,91%	53,79%	10,55%	42,97%
BB CONSUMO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	-4,08%	-8,80%	1,22%	41,11%	-0,91%	50,93%	12,21%	42,75%
DAYCOVAL IBOVESPAATIVO FI AÇÕES	-5,32%	-17,55%	1,28%	33,82%	-9,00%	25,35%	11,00%	40,49%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPAATIVO FIC AÇÕES	-4,26%	-16,02%	0,71%	31,74%	-5,26%	30,94%	10,31%	40,33%
ITAÚ OLIMPO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	-4,20%	-13,27%	2,47%	34,42%	-3,26%	-	11,53%	39,70%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	-5,38%	-14,86%	-0,22%	32,93%	-2,46%	-	9,30%	42,33%

IFIX (Benchmark)	0,46%	-12,59%	-0,41%	12,06%	4,12%	30,92%	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES RESP LIMITADA FII - C...	-13,33%	-39,54%	9,86%	-27,10%	-49,02%	-58,73%	11,86%	60,93%
SP DOWNTOWN FII - SPTW11	11,50%	-24,88%	29,20%	34,71%	4,09%	-	5,91%	52,73%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	19,35%	24,16%	18,58%	59,31%	66,66%	-80,63%	16,02%	48,72%
TIVIO RENDA IMOBILIÁRIA RESP LIMITADA FII - TVRI11	-0,07%	-19,29%	-15,55%	0,61%	-8,27%	9,31%	4,05%	26,89%
HAZ FII - ATCR11	0,12%	2,54%	0,18%	2,39%	386,15%	386,15%	-	-

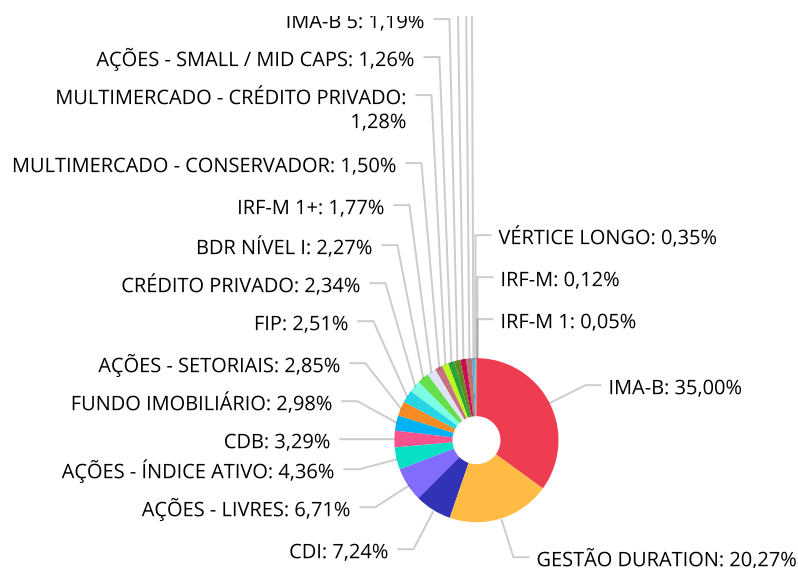
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2020 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA (Benchmark)	0,64%	1,34%	1,24%	0,81%	3,14%	6,12%	-	-
AUSTRO MULTIPAR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-0,30%	-16,03%	-0,96%	-15,01%	-16,36%	-8,47%	0,00%	13,40%
IMOBILIÁRIO PARANÁ REC FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,91%	-	-1,69%	-	-5,62%	-18,07%	-	-
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	1,48%	9,18%	3,89%	5,97%	13,96%	29,52%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,43%	-	-1,35%	-	-	-96,87%	-	-
IPCA + 9,00% ao ano (Benchmark)	1,37%	8,07%	3,52%	5,25%	12,42%	26,04%	-	-
FP2 FIP MULTIESTRATÉGIA	-	-	-	-	-	-	-	-
SMLL (Benchmark)	-5,44%	-18,93%	2,27%	35,50%	-1,78%	54,49%	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO RESP LIMITADA FIF AÇÕES	-5,93%	-20,37%	1,37%	33,48%	-4,18%	45,25%	10,89%	45,81%

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



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



IMA-B	13.644.101,67	GESTÃO DURATION	7.901.470,97	CDI	2.823.795,15
AÇÕES - LIVRES	2.614.427,71	AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	1.701.458,18	CDB	1.281.482,57
FUNDO IMOBILIÁRIO	1.160.460,31	AÇÕES - SETORIAIS	1.110.786,83	FIP	979.887,65
CRÉDITO PRIVADO	911.250,00	BDR NÍVEL I	885.959,38	IRF-M 1+	689.430,93
MULTIMERCADO - CONSERVADOR	586.093,49	MULTIMERCADO - CRÉDITO PRIVADO	497.954,58	AÇÕES - SMALL / MID CAPS	491.518,34
IMA-B 5	464.747,76	IDKA IPCA 2A	446.093,18	DISP. FINANCEIRA	442.984,49
FIDC	145.560,15	VÉRTICE LONGO	137.551,67	IRF-M	47.987,78
IRF-M 1	19.314,58				

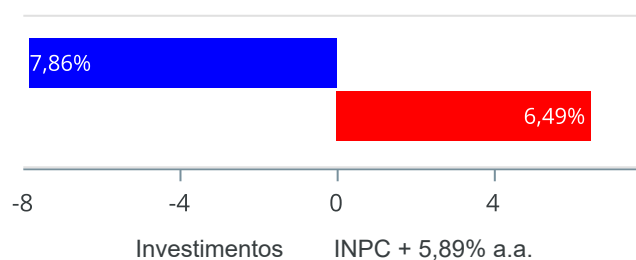
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Setembro / 2020)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
------------------	------------	--------	------	-------------	------------	---------	----------	----------

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2020

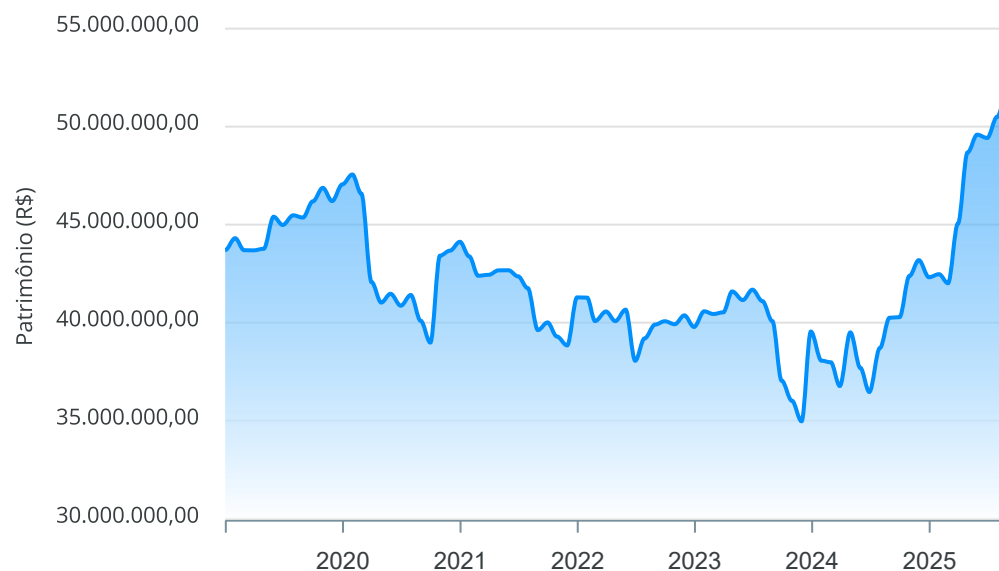
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	47.055.425,39	2.422.019,00	2.034.188,91	47.505.509,53	62.254,05	62.254,05	0,13%	0,13%	0,69%	0,69%	18,97%	3,57%
Fevereiro	47.505.509,53	741.998,43	1.235.261,87	46.536.380,29	-475.865,80	-413.611,75	-1,00%	-0,87%	0,58%	1,28%	-68,31%	4,27%
Março	46.536.380,29	900.214,98	1.398.061,94	42.028.862,47	-4.009.670,86	-4.423.282,61	-8,62%	-9,41%	0,68%	1,97%	-478,62%	19,75%
Abril	42.028.862,47	846.865,72	1.263.774,36	40.979.848,09	-632.105,74	-5.055.388,35	-1,50%	-10,78%	0,22%	2,20%	-490,84%	10,27%
Maio	40.979.848,09	1.979.674,69	4.323.488,01	39.042.759,00	406.724,23	-4.648.664,12	0,99%	-9,89%	0,20%	2,40%	-411,41%	7,24%
Junho	39.042.759,00	3.019.229,14	2.240.179,17	40.819.448,84	997.639,87	-3.651.024,25	2,51%	-7,63%	0,78%	3,20%	-238,35%	6,10%
Julho	40.819.448,84	1.955.081,28	2.373.941,74	41.364.960,73	964.372,35	-2.686.651,90	2,36%	-5,45%	0,97%	4,20%	-129,79%	12,38%
Agosto	41.364.960,73	14.318.226,11	15.879.181,36	39.309.419,58	-494.585,90	-3.181.237,80	-1,20%	-6,58%	0,84%	5,07%	-129,69%	6,38%
Setembro	39.309.419,58	2.423.096,08	2.714.917,60	38.479.771,76	-537.826,30	-3.719.064,10	-1,37%	-7,86%	1,35%	6,49%	-121,00%	6,50%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



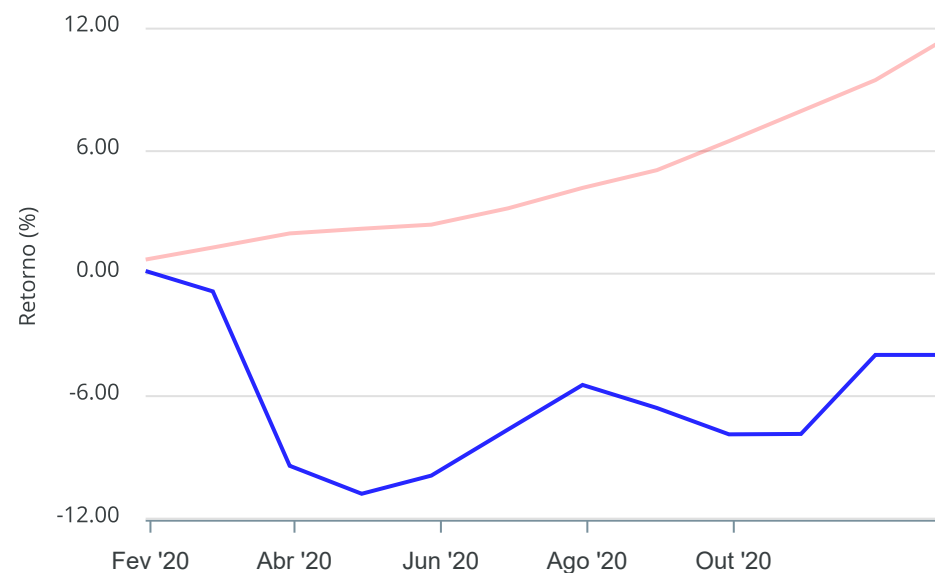
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



Investimentos Meta de Rentabilidade ☐ CDI ☐ IMA-B

☐ IMA-B 5 ☐ IMA-B 5+ ☐ IMA Geral ☐ IRF-M ☐ IRF-M 1

☐ IRF-M 1+ ☐ Ibovespa ☐ IBX ☐ SMLL ☐ IDIV

Investimentos Meta de Rentabilidade ☐ CDI ☐ IMA-B

☐ IMA-B 5

☐ IMA-B 5+ ☐ IMA Geral ☐ IRF-M ☐ IRF-M 1 ☐ IRF-M 1+

☐ Ibovespa ☐ IBX ☐ SMLL ☐ IDIV

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII RESP LIMITADA FIF RENDA FI...	137.289,51	0,00	0,00	137.551,67	262,16	0,19%	0,19%	1,15%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITAD...	19.288,86	0,00	0,00	19.314,58	25,72	0,13%	0,13%	0,12%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA...	118.794,44	0,00	0,00	118.930,00	135,56	0,11%	0,11%	1,35%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RESP LI...	327.043,07	0,00	0,00	327.163,18	120,11	0,04%	0,04%	1,38%
BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFEREN...	7.110,41	0,00	0,00	7.112,12	1,71	0,02%	0,02%	0,06%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RESP LIMITADA FIF CI...	169.074,89	506.119,61	254.817,36	420.525,64	148,50	0,02%	0,09%	0,00%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	1.624.021,57	0,00	1.624.205,94	0,00	184,37	0,01%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRI...	296.589,84	0,00	296.598,35	0,00	8,51	0,00%	-	-
CAIXA BRASIL RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERENC...	26.455,10	0,00	0,00	26.454,40	-0,70	0,00%	0,00%	0,10%
BB FLUXO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SIMPLES ...	380.785,36	1.989.202,80	0,00	2.369.702,99	-285,17	-0,01%	0,00%	0,03%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC R...	155.146,18	0,00	0,00	154.912,87	-233,31	-0,15%	-0,15%	1,65%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	145.806,63	0,00	0,00	145.560,15	-246,48	-0,17%	-0,17%	0,01%
BRASESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF C...	310.415,00	0,00	0,00	309.834,89	-580,11	-0,19%	-0,19%	1,69%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA...	180.877,61	0,00	0,00	180.462,95	-414,66	-0,23%	-0,23%	0,49%
IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	759.616,14	0,00	149.826,32	606.574,08	-3.215,74	-0,42%	-20,15%	32,56%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FIF ...	2.732.052,86	0,00	0,00	2.718.306,31	-13.746,55	-0,50%	-0,50%	1,68%
CAIXA BRASIL IPCA XVI RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA...	917.026,50	0,00	0,00	911.250,00	-5.776,50	-0,63%	-0,63%	2,41%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA ...	48.305,34	0,00	0,00	47.987,78	-317,56	-0,66%	-0,66%	1,79%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	4.745.087,51	0,00	416.787,52	4.289.065,50	-39.234,49	-0,83%	-9,61%	14,62%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL RESP LIMITADA FIF ...	5.047.029,86	0,00	0,00	5.002.701,71	-44.328,15	-0,88%	-0,88%	2,33%

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	5.139.058,71	0,00	164.669,32	4.928.064,08	-46.325,31	-0,90%	-4,11%	5,67%
CDB - BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.	1.295.222,31	0,00	0,00	1.281.482,57	-13.739,74	-1,06%	-	-
BB IRF-M 1+ RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENC...	697.516,90	0,00	0,00	689.430,93	-8.085,97	-1,16%	-1,16%	2,60%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA ...	2.522.042,70	0,00	0,00	2.483.371,77	-38.670,93	-1,53%	-1,53%	4,14%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA ...	1.358.151,53	0,00	0,00	1.337.026,24	-21.125,29	-1,56%	-1,56%	4,15%
Total Renda Fixa	29.159.808,83	2.495.322,41	2.906.904,81	28.512.786,41	-235.440,02	-0,81%		5,44%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
SP DOWNTOWN FII - SPTW11	83.420,00	0,00	1.350,00	90.690,00	8.620,00	10,33%	11,50%	5,91%
AUSTRO INSTITUCIONAL PIPE BANCOS FIC AÇÕES	124.662,37	0,00	0,00	133.863,73	9.201,36	7,38%	7,37%	19,17%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	39.181,14	0,00	280,00	39.647,60	746,46	1,91%	19,35%	16,02%
TIVIO RENDA IMOBILIÁRIA RESP LIMITADA FII - TVRI11	13.903,00	0,00	108,23	13.870,00	75,23	0,54%	-0,07%	4,05%
HAZ FII - ATCR11	970.475,17	0,00	0,00	971.681,95	1.206,78	0,12%	0,12%	-
FP2 FIP MULTIESTRATÉGIA	826.797,73	0,00	0,00	826.739,88	-57,85	-0,01%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	123.193,51	0,00	0,00	122.980,88	-212,63	-0,17%	-	-
AUSTRO MULTIPAR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	499.431,65	0,00	0,00	497.954,58	-1.477,07	-0,30%	-0,30%	0,00%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTI...	588.723,73	0,00	0,00	586.093,49	-2.630,24	-0,45%	-0,45%	0,18%
IMOBILIÁRIO PARANÁ REC FIP MULTIESTRATÉGIA	30.443,19	0,00	0,00	30.166,89	-276,30	-0,91%	-0,91%	-
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	1.242.171,38	0,00	0,00	1.210.945,09	-31.226,29	-2,51%	-4,26%	10,31%
BB CONSUMO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	1.018.503,97	0,00	0,00	976.923,10	-41.580,87	-4,08%	-4,08%	12,21%
ITAÚ OLIMPO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	4.659,61	0,00	0,00	4.463,84	-195,77	-4,20%	-4,20%	11,53%
BB SELEÇÃO FATORIAL RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	1.575.010,53	0,00	0,00	1.497.172,44	-77.838,09	-4,94%	-4,94%	10,55%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	513.382,51	0,00	0,00	486.049,25	-27.333,26	-5,32%	-5,32%	11,00%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR RESP LIMITADA FIF CIC AÇÃO...	483.279,03	0,00	0,00	457.289,77	-25.989,26	-5,38%	-5,38%	9,30%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO RESP LIMITADA FIF AÇÕES	522.484,95	0,00	0,00	491.518,34	-30.966,61	-5,93%	-5,93%	10,89%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX RESP LIMITADA FIF CIC A...	717.613,80	0,00	0,00	659.965,50	-57.648,30	-8,03%	-8,03%	11,91%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES RESP L...	51.427,80	0,00	0,00	44.570,76	-6.857,04	-13,33%	-10,34%	11,86%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
Total Renda Variável	9.428.765,07	0,00	1.738,23	9.142.587,09	-284.439,75	-3,02%		9,39%

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR NÍ...	903.987,47	0,00	0,00	885.959,38	-18.028,09	-1,99%	-1,99%	15,53%
Total Exterior	903.987,47	0,00	0,00	885.959,38	-18.028,09	-1,99%		15,53%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REN...	2.406.586,28	0,00	2.569.070,87	0,00	162.484,59	6,75%	0,59%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITA...	1.397.163,70	0,00	1.485.531,78	0,00	88.368,08	6,32%	0,65%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.526.541,50	0,00	2.563.696,80	0,00	37.155,30	1,47%	0,10%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA ...	2.461.380,89	0,00	0,00	2.483.371,77	21.990,88	0,89%	0,89%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA ...	1.325.958,15	0,00	0,00	1.337.026,24	11.068,09	0,83%	0,83%
CAIXA BRASIL IPCA XVI RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA...	902.269,00	0,00	0,00	911.250,00	8.981,00	1,00%	1,00%
ITAÚ IMA-B ATIVO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	145.237,45	0,00	151.950,83	0,00	6.713,38	4,62%	0,72%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RESP LI...	321.806,39	0,00	0,00	327.163,18	5.356,79	1,66%	1,66%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	1.619.045,49	0,00	1.624.205,94	0,00	5.160,45	0,32%	-
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF C...	306.124,08	0,00	0,00	309.834,89	3.710,81	1,21%	1,21%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII RESP LIMITADA FIF RENDA FI...	393.591,54	0,00	258.982,30	137.551,67	2.942,43	0,75%	0,98%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RESP LIMITADA FIF CI...	183.881,07	4.823.450,39	4.589.258,97	420.525,64	2.453,15	0,05%	0,29%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA...	117.040,81	0,00	0,00	118.930,00	1.889,19	1,61%	1,61%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC R...	153.026,38	0,00	0,00	154.912,87	1.886,49	1,23%	1,23%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRI...	295.692,37	0,00	296.598,35	0,00	905,98	0,31%	-
BB FLUXO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SIMPLES ...	266.941,31	3.859.571,67	1.757.477,31	2.369.702,99	667,32	0,02%	0,18%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA...	180.110,18	0,00	0,00	180.462,95	352,77	0,20%	0,20%
CAIXA BRASIL RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERENC...	26.351,33	0,00	0,00	26.454,40	103,07	0,39%	0,39%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITAD...	19.223,93	0,00	0,00	19.314,58	90,65	0,47%	0,47%
BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFEREN...	7.080,84	0,00	0,00	7.112,12	31,28	0,44%	0,44%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA ...	48.154,10	0,00	0,00	47.987,78	-166,32	-0,35%	-0,35%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	149.883,36	0,00	0,00	145.560,15	-4.323,21	-2,88%	-2,88%
BB IRF-M 1+ RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENC...	695.414,83	0,00	0,00	689.430,93	-5.983,90	-0,86%	-0,86%
IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	1.555.917,86	0,00	941.765,44	606.574,08	-7.578,34	-0,49%	-60,66%
CDB - BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.	1.289.984,34	0,00	0,00	1.281.482,57	-8.501,77	-0,66%	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FIF ...	598.141,40	2.139.714,37	0,00	2.718.306,31	-19.549,46	-0,71%	-0,09%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	6.298.659,38	0,00	1.930.460,90	4.289.065,50	-79.132,98	-1,26%	-31,91%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL RESP LIMITADA FIF ...	0,00	5.086.327,23	0,00	5.002.701,71	-83.625,52	-1,64%	-0,03%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	5.408.808,60	0,00	274.448,84	4.928.064,08	-206.295,68	-3,81%	-8,17%
Total Renda Fixa	31.100.016,56	15.909.063,66	18.443.448,33	28.512.786,41	-52.845,48	-0,11%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre/2020

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB IBOVESPA INDEXADO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	1.487.184,20	0,00	1.605.026,89	0,00	117.842,69	7,92%	-0,95%
CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR NÍ...	770.517,73	0,00	0,00	885.959,38	115.441,65	14,98%	14,98%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	1.011.152,51	151.950,83	0,00	1.210.945,09	47.841,75	4,11%	0,71%
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA RESP LIMITADA FIF AÇÕES	437.670,37	0,00	478.435,38	0,00	40.765,01	9,31%	-0,46%
BB DIVIDENDOS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	596.135,38	0,00	628.407,59	0,00	32.272,21	5,41%	-1,71%
SP DOWNTOWN FII - SPTW11	71.210,00	0,00	4.090,00	90.690,00	23.570,00	33,10%	29,20%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO RESP LIMITADA FIF AÇÕES	484.854,53	0,00	0,00	491.518,34	6.663,81	1,37%	1,37%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	479.920,43	0,00	0,00	486.049,25	6.128,82	1,28%	1,28%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES RESP L...	40.570,82	0,00	592,56	44.570,76	4.592,50	11,32%	9,86%
HAZ FII - ATR11	969.932,78	0,00	0,00	971.681,95	1.749,17	0,18%	0,18%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	40.327,11	0,00	1.445,60	39.647,60	766,09	1,90%	18,58%
FP2 FIP MULTISTRATÉGIA	826.628,31	0,00	0,00	826.739,88	111,57	0,01%	-
ITAÚ OLIMPO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	3.984,82	405,06	0,00	4.463,84	73,96	1,68%	2,47%
IMOBILIÁRIO PARANÁ REC FIP MULTISTRATÉGIA	30.685,82	0,00	0,00	30.166,89	-518,93	-1,69%	-1,69%
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTISTRATÉGIA	123.657,04	0,00	0,00	122.980,88	-676,16	-0,55%	-1,35%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTI...	588.267,97	0,00	0,00	586.093,49	-2.174,48	-0,37%	-0,37%
TIVIO RENDA IMOBILIÁRIA RESP LIMITADA FII - TVRI11	16.376,00	0,00	319,79	13.870,00	-2.186,21	-13,35%	-15,55%
AUSTRO MULTIPAR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	502.762,70	0,00	0,00	497.954,58	-4.808,12	-0,96%	-0,96%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR RESP LIMITADA FIF CIC AÇÃOE...	0,00	478.435,38	0,00	457.289,77	-21.145,61	-4,42%	-0,22%
AUSTRO INSTITUCIONAL PIPE BANCOS FIC AÇÕES	158.319,45	0,00	0,00	133.863,73	-24.455,72	-15,45%	-15,45%
Total Renda Variável	8.640.157,97	630.791,27	2.718.317,81	6.894.485,43	341.854,00	3,69%	

Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da CRÉDITO E MERCADO CONSULTORIA DE INVESTIMENTOS.. As informações aqui contidas, tem por somente, o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre o(s) produto(s) mencionado(s), entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros exigidos legalmente. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas aos objetivos, aos riscos e à política de investimento do(s) produto(s). Todas as informações podem ser obtidas com os responsáveis pela distribuição, administração, gestão ou no próprio site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários) através do link: <https://www.gov.br/cvm/pt-br>.

Sua elaboração buscou atender os objetivos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil de investidor.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas aos investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de Consultoria de Valores Mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe a Consultoria de Valores Mobiliários a prestação dos serviços de ORIENTAÇÃO, RECOMENDAÇÃO E ACONSELHAMENTO, DE FORMA PROFISSIONAL, INDEPENDENTE E INDIVIDUALIZADA, SOBRE INVESTIMENTOS NO MERCADO DE VALORES MOBILIÁRIOS, CUJA ADOÇÃO E IMPLEMENTAÇÃO SEJAM EXCLUSIVAS DO CLIENTE (Resolução CVM nº 19/2021).

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no Art. 3º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria MTP nº 1.467/2022, art. 84, inciso III, alínea "a".

Os RPPS DEVEM, independente da contratação de Consultoria de Valores Mobiliários, se adequar às normativas pertinentes e principalmente a Portaria MTP nº 1.467/2022 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963/2021, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.

Relatório Analítico dos Investimentos

em outubro de 2020

Este relatório atende a Portaria MTP Nº 1.467, de 2 de junho de 2022.

Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 2020)

CNPJ	Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Lei
13.322.205/0001-35	BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REN...	D+1	Não há	119.320,79	0,31%	910	0,00%	7º I b
07.442.078/0001-05	BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REND...	D+1	Não há	1.339.644,22	3,49%	675	0,02%	7º I b
32.161.826/0001-29	BB IRF-M 1+ RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	685.665,03	1,79%	116	0,15%	7º I b
07.111.384/0001-69	BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REND...	D+1	Não há	47.837,15	0,12%	705	0,00%	7º I b
19.523.305/0001-06	BB TÍTULOS PÚBLICOS VII RESP LIMITADA FIF RENDA ...	D+0	15/08/2022	138.229,11	0,36%	165	0,06%	7º I b
23.215.097/0001-55	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FI...	D+0	Não há	2.715.375,66	7,08%	874	0,02%	7º I b
14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RESP ...	D+0	Não há	327.663,02	0,85%	988	0,00%	7º I b
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITAD...	D+0	Não há	2.488.177,73	6,49%	902	0,04%	7º I b
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMIT...	D+0	Não há	19.342,18	0,05%	1.366	0,00%	7º I b
09.093.819/0001-15	ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC...	D+1	Não há	155.185,02	0,40%	69	0,01%	7º I b
35.292.588/0001-89	BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL RESP LIMITADA FI...	D+3	Não há	4.999.095,33	13,04%	397	0,25%	7º IV a
13.077.415/0001-05	BB FLUXO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SIMPLE...	D+0	Não há	2.443.159,24	6,37%	762	0,15%	7º IV a
13.077.418/0001-49	BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFER...	D+0	Não há	7.123,46	0,02%	582	0,00%	7º IV a
20.216.216/0001-04	BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF...	D+1	Não há	310.223,14	0,81%	129	0,04%	7º IV a
14.508.643/0001-55	CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RESP LIMITADA FIF ...	D+0	Não há	423.871,15	1,11%	297	0,07%	7º IV a
03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERE...	D+0	Não há	26.486,22	0,07%	664	0,00%	7º IV a
00.834.074/0001-23	CAIXA PRÁTICO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA C...	D+0	Não há	127.471,89	0,33%	16.142	0,00%	7º IV a
12.402.646/0001-84	IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	D+1002	Não há	548.184,92	1,43%	12	5,95%	7º IV a
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITA...	D+1	Não há	180.602,99	0,47%	276	0,00%	7º IV a
15.153.656/0001-11	MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1800	Não há	4.982.157,34	12,99%	18	2,74%	7º IV a

Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 2020)

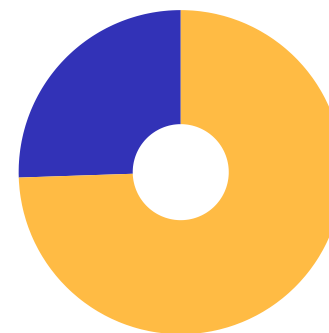
CNPJ	Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Lei
13.594.673/0001-69	TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	D+31 ou...	Não há	4.142.491,07	10,80%	15	3,64%	7º IV a
01.181.521/0001-55	CDB - BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.	S/Info	Não Informado	1.276.134,38	3,33%		0,00%	7º VI a
06.018.364/0001-85	PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	145.333,48	0,38%	98	0,18%	7º VII a
21.918.896/0001-62	CAIXA BRASIL IPCA XVI RESP LIMITADA FIF RENDA FI...	D+0	18/04/2018	910.069,50	2,37%	74	0,48%	7º VII b
08.973.942/0001-68	BB CONSUMO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+4	Não há	948.015,50	2,47%	13.705	0,25%	8º II a
07.882.792/0001-14	BB SELEÇÃO FATORIAL RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+3	Não há	1.487.277,12	3,88%	9.635	0,48%	8º II a
30.068.224/0001-04	CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR RESP LIMITADA FIF CIC AÇ...	D+25	Não há	448.576,85	1,17%	2.447	0,05%	8º II a
17.502.937/0001-68	CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR ...	D+4	Não há	870.261,74	2,27%	176	0,05%	8º II a
15.154.220/0001-47	CAIXA SMALL CAPS ATIVO RESP LIMITADA FIF AÇÕES	D+4	Não há	479.703,72	1,25%	16.007	0,04%	8º II a
13.155.995/0001-01	DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	D+15	Não há	483.586,56	1,26%	1.143	0,34%	8º II a
08.817.414/0001-10	ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	1.143.905,74	2,98%	56	0,13%	8º II a
23.731.629/0001-07	ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX RESP LIMITADA FIF CIC...	D+24	Não há	632.448,15	1,65%	153	0,02%	8º II a
32.246.546/0001-13	ITAÚ OLIMPO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+3	Não há	4.399,50	0,01%	20.966	0,00%	8º II a
07.899.238/0001-40	META VALOR RESP LIMITADA FIF AÇÕES	D+4	Não há	541.421,70	1,41%	190	0,20%	8º II a
18.366.002/0001-64	AUSTRO MULTIPAR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+1	96 meses	496.482,16	1,29%	33	0,61%	8º III
20.886.575/0001-60	FP2 FIP MULTISTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	826.682,03	2,16%		0,00%	8º IV a
11.490.580/0001-69	GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTISTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	122.763,47	0,32%		0,00%	8º IV a
16.720.629/0001-46	IMOBILIÁRIO PARANÁ REC FIP MULTISTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	30.019,70	0,08%	11	0,41%	8º IV a
13.584.584/0001-31	BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES RESP...	Não se ...	Não se aplica	45.142,18	0,12%		0,03%	8º IV b
17.098.794/0001-70	CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	38.757,24	0,10%		0,02%	8º IV b

Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 2020)

CNPJ	Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Lei
14.631.148/0001-39	HAZ FII - ATCR11	Não se ...	Não se aplica	968.849,93	2,53%		1,35%	8º IV b
15.538.445/0001-05	SP DOWNTOWN FII - SPTW11	Não se ...	Não se aplica	89.070,00	0,23%		0,05%	8º IV b
14.410.722/0001-29	TIVIO RENDA IMOBILIÁRIA RESP LIMITADA FII - TVRI...	Não se ...	Não se aplica	13.882,00	0,04%		0,00%	8º IV b
28.319.463/0001-30	AUSTRO INSTITUCIONAL PIPE BANCOS FIC AÇÕES	D+31	30/04/2021	120.289,73	0,31%	22	0,45%	NE
Total para cálculo dos limites da Resolução			38.350.379,04					
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			5.066.609,47	Artigo 6º				
PL Total			43.416.988,51					

Enquadramento e Política de Investimento (RENTA FIXA) - base (Outubro / 2020)

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	100,00%	8.036.439,91	20,96%	20,00%	30,00%	90,00%	26.478.901,23
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	23.010.227,42
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea a	40,00%	18.190.866,75	47,43%	10,00%	30,00%	40,00%	-2.850.715,13
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea a	15,00%	1.276.134,38	3,33%	0,00%	0,00%	15,00%	4.476.422,48
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea a	5,00%	145.333,48	0,38%	0,00%	0,00%	5,00%	1.772.185,47
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea b	5,00%	910.069,50	2,37%	0,00%	0,00%	5,00%	1.007.449,45
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea c	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.917.518,95
Total Renda Fixa	100,00%	28.558.844,02	74,47%	30,00%	70,00%	220,00%	

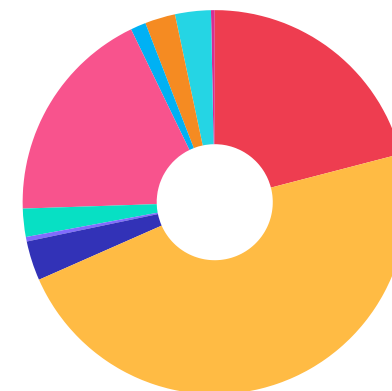


RENTA FIXA 28.558.844,02

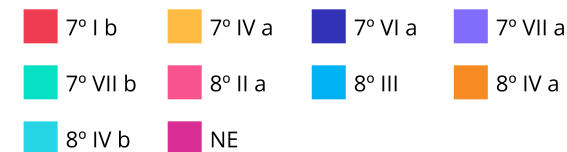
RENTA VARIÁVEL 9.791.535,02

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Outubro / 2020)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	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%	5,00%	1.917.518,95
Artigo 8º, Inciso I, Alínea b	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.917.518,95
Artigo 8º, Inciso II, Alínea a	20,00%	7.039.596,58	18,36%	7,00%	15,00%	20,00%	630.479,23
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	496.482,16	1,29%	3,00%	10,00%	10,00%	3.338.555,74
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea a	5,00%	979.465,20	2,55%	0,00%	0,00%	5,00%	938.053,75
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea b	5,00%	1.155.701,35	3,01%	0,00%	5,00%	5,00%	761.817,60
Desenquadrado - RV	0,00%	120.289,73	0,31%	0,00%	0,00%	0,00%	-120.289,73
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	9.791.535,02	25,53%	10,00%	30,00%	50,00%	



Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2020			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.917.518,95
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2020		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	0,00	0,00	20,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea a	0,00	0,00	10,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea a	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	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	5,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea b	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea a	0,00	0,00	7,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00	3,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea a	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea b	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	5,00

Enquadramento por Gestores - base (Outubro / 2020)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	12.215.366,95	31,85	-
VERITAS CAPITAL MANAGEMENT	10.169.315,49	26,52	-
CAIXA DTVM S.A	8.875.756,90	23,14	-
SICREDI	1.276.134,38	3,33	-
GRAPHEN INVESTIMENTOS	1.144.203,11	2,98	-
ITAÚ DTVM	1.143.905,74	2,98	-
ARENA CAPITAL	826.682,03	2,16	-
ITAÚ UNIBANCO	636.847,65	1,66	-
META ASSET MANAGEMENT	541.421,70	1,41	-
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	483.586,56	1,26	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	335.788,01	0,88	-
BANCO BRADESCO	310.223,14	0,81	-
GENIAL GESTÃO LTDA	211.833,47	0,55	-
AUSTRO CAPITAL	120.289,73	0,31	-
ZION INVEST	45.142,18	0,12	-
TIVIO CAPITAL DISTRIBUIDORA DE...	13.882,00	0,04	-

Artigo 20º - 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) - (Resolução 4963)

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 IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,04%	5,45%	1,09%	4,85%	6,73%	19,60%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REND...	0,15%	5,00%	0,98%	4,98%	6,16%	18,25%	1,15%	2,84%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENC...	0,33%	4,89%	1,13%	5,25%	6,32%	18,19%	1,02%	3,01%
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	1,35%	7,28%	3,24%	5,03%	10,10%	19,67%	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	-0,13%	4,45%	-0,97%	5,02%	4,80%	23,24%	1,41%	5,25%
IRF-M 1+ (Benchmark)	-0,61%	4,76%	-2,63%	1,75%	4,63%	23,41%	-	-
BB IRF-M 1+ RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,55%	4,12%	-2,93%	1,39%	3,94%	-	2,20%	3,81%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,16%	3,29%	0,43%	1,38%	4,06%	11,49%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIX...	0,14%	3,12%	0,37%	1,27%	3,86%	11,05%	0,24%	0,51%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,20%	4,72%	0,50%	4,81%	5,71%	20,28%	-	-
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	0,13%	4,61%	0,36%	4,66%	5,49%	19,92%	1,11%	3,38%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1,10%	-5,58%	-4,35%	-7,82%	-6,22%	-25,56%	8,07%	5,79%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	0,18%	4,56%	0,43%	4,64%	5,52%	19,72%	1,10%	3,24%
IMA-B (Benchmark)	0,21%	-0,51%	-3,08%	4,81%	-1,00%	25,47%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCI...	0,20%	-0,73%	-3,19%	4,62%	-1,29%	24,83%	2,26%	10,02%

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
CDB - BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.	-	-	-	-	-	-	-	-
IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	-9,63%	-74,30%	-64,14%	-69,78%	-75,08%	-72,82%	15,48%	51,78%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	-3,42%	-45,27%	-13,98%	-38,81%	-45,13%	-42,39%	6,69%	25,58%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA ...	0,19%	-0,81%	-3,15%	4,68%	-1,41%	24,69%	2,25%	10,13%

IRF-M (Benchmark)	-0,33%	4,27%	-1,63%	1,64%	4,44%	19,78%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCI...	-0,31%	3,99%	-1,77%	1,49%	4,12%	19,16%	1,45%	2,65%

CDI (Benchmark)	0,16%	2,44%	0,47%	1,12%	3,21%	9,62%	-	-
CAIXA BRASIL RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,12%	1,89%	0,26%	1,09%	2,56%	8,75%	0,34%	0,44%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA ...	-0,07%	-	-1,99%	2,03%	-	-	1,48%	-
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SI...	0,09%	1,73%	0,27%	0,70%	2,36%	7,80%	0,00%	0,31%
BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVID...	0,16%	1,98%	0,37%	1,12%	2,69%	8,87%	0,26%	0,42%
BB FLUXO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,06%	1,48%	0,13%	0,52%	2,07%	7,24%	0,24%	0,34%
CAIXA PRÁTICO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,01%	0,12%	0,02%	0,06%	0,24%	1,29%	0,00%	0,07%

IPCA (Benchmark)	0,86%	2,22%	1,75%	1,99%	3,92%	6,55%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	-0,11%	4,42%	-1,16%	1,94%	4,51%	23,65%	1,18%	2,40%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA ...	0,08%	2,55%	-0,28%	1,26%	3,26%	17,36%	0,34%	0,89%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	0,49%	3,15%	1,16%	3,77%	4,55%	15,45%	0,95%	2,22%

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
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	-0,16%	-4,54%	6,25%	-3,44%	-4,89%	-13,61%	0,01%	11,38%

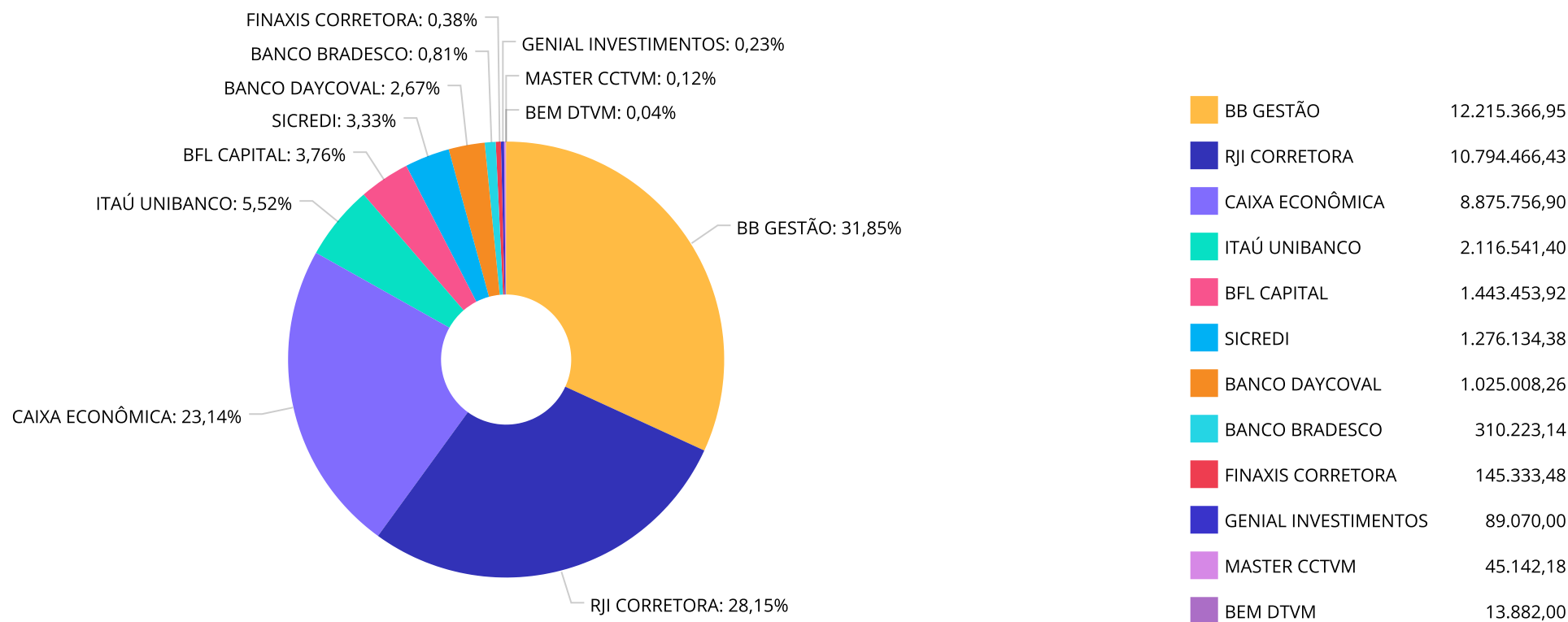
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Outubro/2020 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	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%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR NÍVEL I	-1,77%	50,05%	10,87%	21,16%	60,56%	94,90%	13,32%	23,48%
Ibovespa (Benchmark)	-0,69%	-18,76%	-8,71%	16,70%	-12,37%	7,47%	-	-
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	-1,91%	-16,48%	-10,39%	15,76%	-6,94%	-	10,01%	42,33%
AUSTRO INSTITUCIONAL PIPE BANCOS FIC AÇÕES	-10,14%	-63,00%	-4,57%	-41,13%	-62,90%	-56,04%	20,22%	35,26%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	-4,17%	-35,96%	-15,33%	9,64%	-27,31%	-4,47%	11,82%	50,94%
BB SELEÇÃO FATORIAL RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	-0,66%	-11,60%	-6,81%	22,19%	-2,28%	32,35%	11,64%	42,95%
BB CONSUMO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	-2,96%	-11,50%	-8,54%	16,34%	-1,99%	40,24%	11,53%	42,83%
DAYCOVAL IBOVESPAATIVO FI AÇÕES	-0,51%	-17,97%	-7,27%	20,44%	-12,21%	11,75%	12,63%	40,34%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPAATIVO FIC AÇÕES	-1,33%	-17,14%	-8,38%	16,50%	-9,12%	15,39%	10,90%	40,25%
ITAÚ OLIMPO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	-1,44%	-14,52%	-7,44%	19,56%	-7,04%	-	11,13%	39,67%
IBX (Benchmark)	-0,55%	-17,87%	-8,31%	17,55%	-11,05%	11,01%	-	-
META VALOR RESP LIMITADA FIF AÇÕES	-2,18%	-13,26%	-9,34%	23,54%	1,21%	19,36%	13,12%	51,40%
IFIX (Benchmark)	-1,01%	-13,47%	1,23%	6,27%	-0,90%	23,38%	-	-
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES RESP LIMITADA FII - C...	1,28%	-38,76%	-16,84%	-4,82%	-41,05%	-58,20%	12,46%	60,43%
SP DOWNTOWN FII - SPTW11	-3,25%	-27,32%	20,76%	17,11%	-3,78%	-	6,04%	52,90%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	-19,46%	0,01%	-13,87%	19,06%	24,79%	-84,80%	26,40%	54,80%

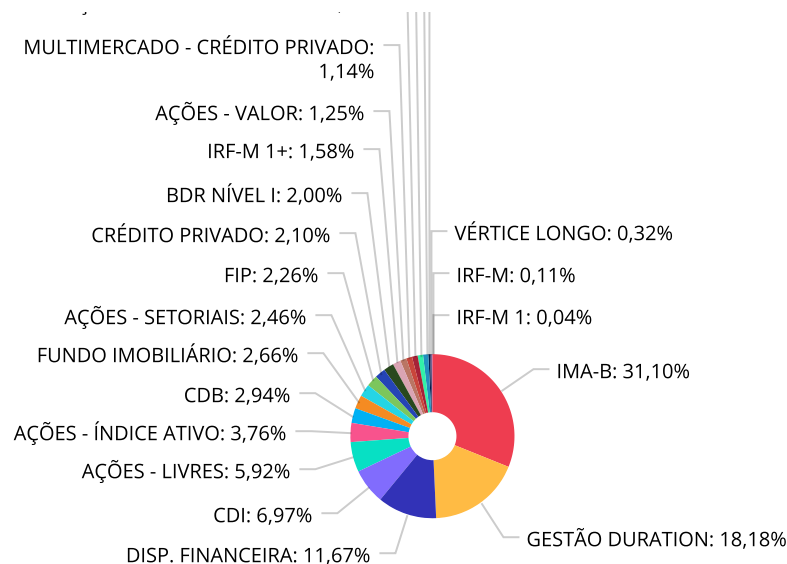
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Outubro/2020 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
TIVIO RENDA IMOBILIÁRIA RESP LIMITADA FII - TVRI11	0,12%	-19,19%	-0,03%	-8,84%	-10,36%	0,49%	2,79%	26,72%
HAZ FII - ATCR11	-0,29%	2,24%	-0,14%	2,19%	384,73%	384,73%	-	-
IPCA (Benchmark)	0,86%	2,22%	1,75%	1,99%	3,92%	6,55%	-	-
AUSTRO MULTIPAR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-0,30%	-16,27%	-0,90%	-1,85%	-16,49%	-8,53%	0,00%	13,39%
IMOBILIÁRIO PARANÁ REC FIP MULTISTRATÉGIA	-0,49%	-	-1,71%	-3,09%	-5,66%	-	0,05%	0,48%
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	1,70%	11,04%	4,32%	7,26%	14,74%	30,00%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTISTRATÉGIA	-0,44%	-	-	-	-96,92%	-96,89%	-	-
IPCA + 9,00% ao ano (Benchmark)	1,59%	9,79%	3,97%	6,52%	13,19%	26,51%	-	-
FP2 FIP MULTISTRATÉGIA	-	-	-	-	-	-	-	-
SMLL (Benchmark)	-2,28%	-20,78%	-8,74%	20,16%	-6,17%	34,08%	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO RESP LIMITADA FIF AÇÕES	-2,40%	-22,29%	-9,46%	17,02%	-8,36%	26,57%	12,07%	45,87%

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



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



IMA-B	13.500.655,28	GESTÃO DURATION	7.895.073,98	DISP. FINANCEIRA	5.066.609,47
CDI	3.028.111,96	AÇÕES - LIVRES	2.568.302,12	AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	1.631.891,80
CDB	1.276.134,38	FUNDO IMOBILIÁRIO	1.155.701,35	AÇÕES - SETORIAIS	1.068.305,23
FIP	979.465,20	CRÉDITO PRIVADO	910.069,50	BDR NÍVEL I	870.261,74
IRF-M 1+	685.665,03	AÇÕES - VALOR	541.421,70	MULTIMERCADO - CRÉDITO PRIVADO	496.482,16
AÇÕES - SMALL / MID CAPS	479.703,72	IMA-B 5	465.408,16	IDKA IPCA 2A	446.983,81
FIDC	145.333,48	VÉRTICE LONGO	138.229,11	IRF-M	47.837,15
IRF-M 1	19.342,18				

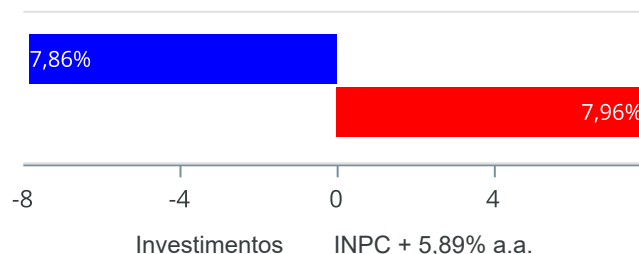
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Outubro / 2020)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
------------------	------------	--------	------	-------------	------------	---------	----------	----------

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2020

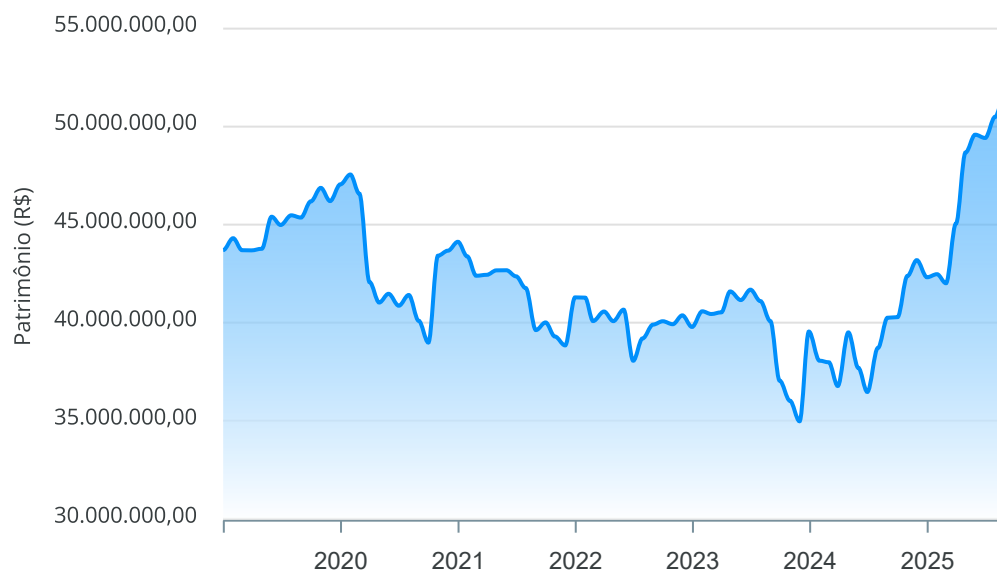
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	47.055.425,39	2.422.019,00	2.034.188,91	47.505.509,53	62.254,05	62.254,05	0,13%	0,13%	0,69%	0,69%	18,97%	3,57%
Fevereiro	47.505.509,53	741.998,43	1.235.261,87	46.536.380,29	-475.865,80	-413.611,75	-1,00%	-0,87%	0,58%	1,28%	-68,31%	4,27%
Março	46.536.380,29	900.214,98	1.398.061,94	42.028.862,47	-4.009.670,86	-4.423.282,61	-8,62%	-9,41%	0,68%	1,97%	-478,62%	19,75%
Abril	42.028.862,47	846.865,72	1.263.774,36	40.979.848,09	-632.105,74	-5.055.388,35	-1,50%	-10,78%	0,22%	2,20%	-490,84%	10,27%
Maio	40.979.848,09	1.979.674,69	4.323.488,01	39.042.759,00	406.724,23	-4.648.664,12	0,99%	-9,89%	0,20%	2,40%	-411,41%	7,24%
Junho	39.042.759,00	3.019.229,14	2.240.179,17	40.819.448,84	997.639,87	-3.651.024,25	2,51%	-7,63%	0,78%	3,20%	-238,35%	6,10%
Julho	40.819.448,84	1.955.081,28	2.373.941,74	41.364.960,73	964.372,35	-2.686.651,90	2,36%	-5,45%	0,97%	4,20%	-129,79%	12,38%
Agosto	41.364.960,73	14.318.226,11	15.879.181,36	39.309.419,58	-494.585,90	-3.181.237,80	-1,20%	-6,58%	0,84%	5,07%	-129,69%	6,38%
Setembro	39.309.419,58	2.423.096,08	2.714.917,60	38.479.771,76	-537.826,30	-3.719.064,10	-1,37%	-7,86%	1,35%	6,49%	-121,00%	6,50%
Outubro	38.479.771,76	1.164.637,63	1.352.848,14	38.292.695,24	1.133,99	-3.717.930,11	0,00%	-7,86%	1,37%	7,96%	-98,74%	5,35%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



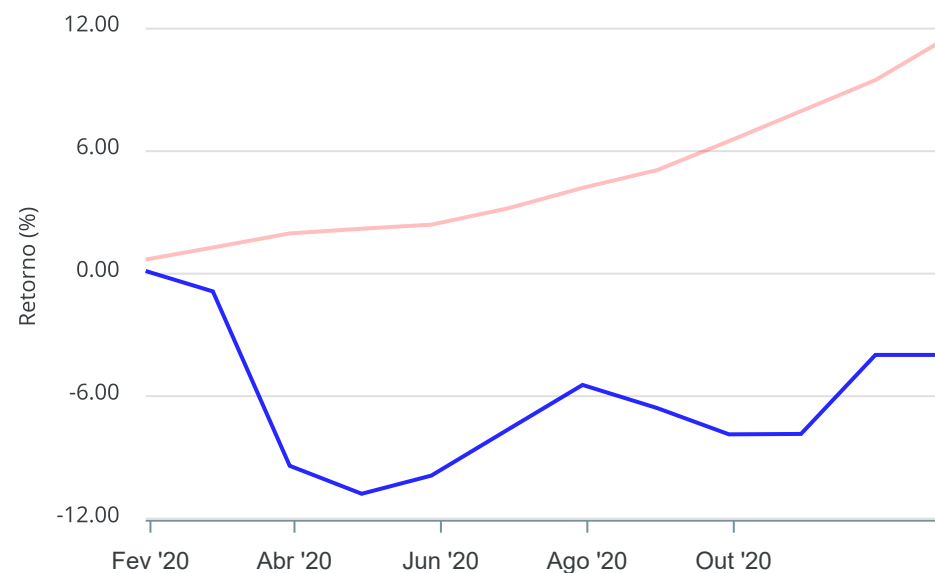
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



Investimentos Meta de Rentabilidade ☐ CDI ☐ IMA-B

☐ IMA-B 5 ☐ IMA-B 5+ ☐ IMA Geral ☐ IRF-M ☐ IRF-M 1

☐ IRF-M 1+ ☐ Ibovespa ☐ IBX ☐ SMLL ☐ IDIV

Investimentos Meta de Rentabilidade ☐ 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
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	4.928.064,08	0,00	164.669,32	4.982.157,34	218.762,58	4,44%	1,10%	8,07%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	4.289.065,50	0,00	171.806,65	4.142.491,07	25.232,22	0,59%	-3,42%	6,69%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII RESP LIMITADA FIF RENDA FI...	137.551,67	0,00	0,00	138.229,11	677,44	0,49%	0,49%	0,95%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA...	118.930,00	0,00	0,00	119.320,79	390,79	0,33%	0,33%	1,02%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA ...	1.337.026,24	0,00	0,00	1.339.644,22	2.617,98	0,20%	0,20%	2,26%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA ...	2.483.371,77	0,00	0,00	2.488.177,73	4.805,96	0,19%	0,19%	2,25%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC R...	154.912,87	0,00	0,00	155.185,02	272,15	0,18%	0,18%	1,10%
BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFEREN...	7.112,12	0,00	0,00	7.123,46	11,34	0,16%	0,16%	0,26%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RESP LI...	327.163,18	0,00	0,00	327.663,02	499,84	0,15%	0,15%	1,15%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITAD...	19.314,58	0,00	0,00	19.342,18	27,60	0,14%	0,14%	0,24%
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF C...	309.834,89	0,00	0,00	310.223,14	388,25	0,13%	0,13%	1,11%
CAIXA BRASIL RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERENC...	26.454,40	0,00	0,00	26.486,22	31,82	0,12%	0,12%	0,34%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA...	180.462,95	0,00	0,00	180.602,99	140,04	0,08%	0,08%	0,34%
BB FLUXO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SIMPLES ...	2.369.702,99	72.017,42	0,00	2.443.159,24	1.438,83	0,06%	0,06%	0,24%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RESP LIMITADA FIF CI...	420.525,64	456.066,17	452.880,00	423.871,15	159,34	0,02%	0,09%	0,00%
CAIXA PRÁTICO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA CUR...	0,00	127.460,82	0,00	127.471,89	11,07	0,01%	0,01%	0,00%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL RESP LIMITADA FIF ...	5.002.701,71	0,00	0,00	4.999.095,33	-3.606,38	-0,07%	-0,07%	1,48%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FIF ...	2.718.306,31	0,00	0,00	2.715.375,66	-2.930,65	-0,11%	-0,11%	1,18%
CAIXA BRASIL IPCA XVI RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA...	911.250,00	0,00	0,00	910.069,50	-1.180,50	-0,13%	-0,13%	1,41%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	145.560,15	0,00	0,00	145.333,48	-226,67	-0,16%	-0,16%	0,01%

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
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA ...	47.987,78	0,00	0,00	47.837,15	-150,63	-0,31%	-0,31%	1,45%
IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	606.574,08	0,00	56.482,12	548.184,92	-1.907,04	-0,31%	-9,63%	15,48%
CDB - BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.	1.281.482,57	0,00	0,00	1.276.134,38	-5.348,19	-0,42%	-	-
BB IRF-M 1+ RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENC...	689.430,93	0,00	0,00	685.665,03	-3.765,90	-0,55%	-0,55%	2,20%
Total Renda Fixa	28.512.786,41	655.544,41	845.838,09	28.558.844,02	236.351,29	0,83%		3,68%

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
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES RESP L...	44.570,76	0,00	111,82	45.142,18	683,24	1,53%	1,28%	12,46%
TIVIO RENDA IMOBILIÁRIA RESP LIMITADA FII - TVRI11	13.870,00	0,00	108,23	13.882,00	120,23	0,87%	0,12%	2,79%
FP2 FIP MULTIESTRATÉGIA	826.739,88	0,00	0,00	826.682,03	-57,85	-0,01%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	122.980,88	0,00	0,00	122.763,47	-217,41	-0,18%	-	-
HAZ FII - ATCR11	971.681,95	0,00	0,00	968.849,93	-2.832,02	-0,29%	-0,29%	-
AUSTRO MULTIPAR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	497.954,58	0,00	0,00	496.482,16	-1.472,42	-0,30%	-0,30%	0,00%
SP DOWNTOWN FII - SPTW11	90.690,00	0,00	1.290,00	89.070,00	-330,00	-0,36%	-3,25%	6,04%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTI...	586.093,49	0,00	583.712,62	0,00	-2.380,87	-0,41%	-	-
IMOBILIÁRIO PARANÁ REC FIP MULTIESTRATÉGIA	30.166,89	0,00	0,00	30.019,70	-147,19	-0,49%	-0,49%	0,05%
DAYCOVAL IBOVESPAATIVO FI AÇÕES	486.049,25	0,00	0,00	483.586,56	-2.462,69	-0,51%	-0,51%	12,63%
BB SELEÇÃO FATORIAL RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	1.497.172,44	0,00	0,00	1.487.277,12	-9.895,32	-0,66%	-0,66%	11,64%
ITAÚ OLIMPO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	4.463,84	0,00	0,00	4.399,50	-64,34	-1,44%	-1,44%	11,13%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	39.647,60	0,00	280,00	38.757,24	-610,36	-1,54%	-19,46%	26,40%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR RESP LIMITADA FIF CIC AÇÃOE...	457.289,77	0,00	0,00	448.576,85	-8.712,92	-1,91%	-1,91%	10,01%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO RESP LIMITADA FIF AÇÕES	491.518,34	0,00	0,00	479.703,72	-11.814,62	-2,40%	-2,40%	12,07%
BB CONSUMO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	976.923,10	0,00	0,00	948.015,50	-28.907,60	-2,96%	-2,96%	11,53%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX RESP LIMITADA FIF CIC A...	659.965,50	0,00	0,00	632.448,15	-27.517,35	-4,17%	-4,17%	11,82%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPAATIVO FIC AÇÕES	1.210.945,09	0,00	0,00	1.143.905,74	-67.039,35	-5,54%	-1,33%	10,90%
META VALOR RESP LIMITADA FIF AÇÕES	0,00	583.712,62	0,00	541.421,70	-42.290,92	-7,25%	-2,18%	13,12%
AUSTRO INSTITUCIONAL PIPE BANCOS FIC AÇÕES	133.863,73	0,00	0,00	120.289,73	-13.574,00	-10,14%	-10,14%	20,22%

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
Total Renda Variável	9.142.587,09	583.712,62	585.502,67	8.921.273,28	-219.523,76	-2,26%		10,90%

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
CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR NÍ...	885.959,38	0,00	0,00	870.261,74	-15.697,64	-1,77%	-1,77%	13,32%
Total Exterior	885.959,38	0,00	0,00	870.261,74	-15.697,64	-1,77%		13,32%

Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da CRÉDITO E MERCADO CONSULTORIA DE INVESTIMENTOS.. As informações aqui contidas, tem por somente, o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre o(s) produto(s) mencionado(s), entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros exigidos legalmente. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas aos objetivos, aos riscos e à política de investimento do(s) produto(s). Todas as informações podem ser obtidas com os responsáveis pela distribuição, administração, gestão ou no próprio site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários) através do link: <https://www.gov.br/cvm/pt-br>.

Sua elaboração buscou atender os objetivos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil de investidor.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas aos investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de Consultoria de Valores Mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe a Consultoria de Valores Mobiliários a prestação dos serviços de ORIENTAÇÃO, RECOMENDAÇÃO E ACONSELHAMENTO, DE FORMA PROFISSIONAL, INDEPENDENTE E INDIVIDUALIZADA, SOBRE INVESTIMENTOS NO MERCADO DE VALORES MOBILIÁRIOS, CUJA ADOÇÃO E IMPLEMENTAÇÃO SEJAM EXCLUSIVAS DO CLIENTE (Resolução CVM nº 19/2021).

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no Art. 3º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria MTP nº 1.467/2022, art. 84, inciso III, alínea "a".

Os RPPS DEVEM, independente da contratação de Consultoria de Valores Mobiliários, se adequar às normativas pertinentes e principalmente a Portaria MTP nº 1.467/2022 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963/2021, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.

Relatório Analítico dos Investimentos

em novembro de 2020

Este relatório atende a Portaria MTP Nº 1.467, de 2 de junho de 2022.

Carteira consolidada de investimentos - base (Novembro / 2020)

CNPJ	Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Lei
13.322.205/0001-35	BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REN...	D+1	Não há	875.506,02	2,00%	916	0,01%	7º I b
07.442.078/0001-05	BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REND...	D+1	Não há	1.366.345,24	3,13%	675	0,02%	7º I b
32.161.826/0001-29	BB IRF-M 1+ RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	688.673,58	1,58%	112	0,16%	7º I b
07.111.384/0001-69	BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REND...	D+1	Não há	43.777,87	0,10%	697	0,00%	7º I b
19.523.305/0001-06	BB TÍTULOS PÚBLICOS VII RESP LIMITADA FIF RENDA ...	D+0	15/08/2022	139.844,68	0,32%	165	0,06%	7º I b
23.215.097/0001-55	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FI...	D+0	Não há	2.737.641,24	6,27%	879	0,02%	7º I b
14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RESP ...	D+0	Não há	331.653,64	0,76%	998	0,00%	7º I b
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITAD...	D+0	Não há	2.117.400,10	4,85%	897	0,04%	7º I b
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMIT...	D+0	Não há	182.873,07	0,42%	1.359	0,00%	7º I b
09.093.819/0001-15	ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC...	D+1	Não há	911.195,49	2,09%	70	0,07%	7º I b
35.292.588/0001-89	BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL RESP LIMITADA FI...	D+3	Não há	5.049.475,02	11,56%	412	0,23%	7º IV a
13.077.415/0001-05	BB FLUXO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SIMPLE...	D+0	Não há	2.512.977,75	5,75%	757	0,13%	7º IV a
13.077.418/0001-49	BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFER...	D+0	Não há	7.134,71	0,02%	584	0,00%	7º IV a
20.216.216/0001-04	BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF...	D+1	Não há	670.446,77	1,54%	133	0,07%	7º IV a
14.508.643/0001-55	CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RESP LIMITADA FIF ...	D+0	Não há	98.103,44	0,22%	298	0,02%	7º IV a
03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERE...	D+0	Não há	15.646,94	0,04%	651	0,00%	7º IV a
00.834.074/0001-23	CAIXA PRÁTICO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA C...	D+0	Não há	1.089,11	0,00%	15.934	0,00%	7º IV a
12.402.646/0001-84	IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	D+1002	Não há	546.317,88	1,25%	12	5,95%	7º IV a
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITA...	D+1	Não há	180.791,86	0,41%	272	0,00%	7º IV a
15.153.656/0001-11	MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1800	Não há	4.866.671,29	11,14%	18	2,74%	7º IV a

Carteira consolidada de investimentos - base (Novembro / 2020)

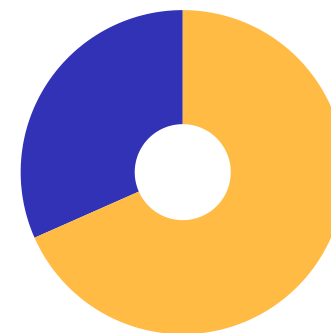
CNPJ	Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Lei
13.594.673/0001-69	TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	D+31 ou...	Não há	4.167.483,35	9,54%	15	3,64%	7º IV a
01.181.521/0001-55	CDB - BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.	S/Info	Não Informado	1.281.366,57	2,93%		0,00%	7º VI a
06.018.364/0001-85	PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	145.108,99	0,33%	98	0,18%	7º VII a
21.918.896/0001-62	CAIXA BRASIL IPCA XVI RESP LIMITADA FIF RENDA FI...	D+0	18/04/2018	921.057,00	2,11%	75	0,48%	7º VII b
08.973.942/0001-68	BB CONSUMO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+4	Não há	1.030.091,79	2,36%	13.293	0,25%	8º II a
07.882.792/0001-14	BB SELEÇÃO FATORIAL RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+3	Não há	2.252.757,39	5,16%	11.669	0,57%	8º II a
07.882.792/0001-14	BB SELEÇÃO FATORIAL RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+3	Não há	641.440,84	1,47%	11.669	0,16%	8º II a
30.068.224/0001-04	CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR RESP LIMITADA FIF CIC AÇ...	D+25	Não há	1.015.326,09	2,32%	2.429	0,11%	8º II a
17.502.937/0001-68	CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR ...	D+4	Não há	891.410,13	2,04%	188	0,05%	8º II a
15.154.220/0001-47	CAIXA SMALL CAPS ATIVO RESP LIMITADA FIF AÇÕES	D+4	Não há	555.152,52	1,27%	15.441	0,04%	8º II a
13.155.995/0001-01	DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	D+15	Não há	548.285,45	1,26%	1.096	0,31%	8º II a
08.817.414/0001-10	ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	1.301.207,74	2,98%	56	0,13%	8º II a
16.718.302/0001-30	ITAÚ MOMENTO 30 RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+23	Não há	302.774,48	0,69%	38.140	0,01%	8º II a
32.246.546/0001-13	ITAÚ OLIMPO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+3	Não há	4.978,30	0,01%	20.404	0,00%	8º II a
07.899.238/0001-40	META VALOR RESP LIMITADA FIF AÇÕES	D+4	Não há	1.014.168,91	2,32%	184	0,32%	8º II a
18.366.002/0001-64	AUSTRO MULTIPAR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+1	96 meses	495.076,40	1,13%	33	0,61%	8º III
09.274.058/0001-06	DAYCOVAL FIF MULTIESTRATÉGIA	D+1	Não há	1.498.253,97	3,43%	1.707	0,66%	8º III
20.886.575/0001-60	FP2 FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	826.625,36	1,89%		0,00%	8º IV a
11.490.580/0001-69	GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	122.549,32	0,28%		0,00%	8º IV a
16.720.629/0001-46	IMOBILIÁRIO PARANÁ REC FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	29.877,36	0,07%	11	0,41%	8º IV a

Carteira consolidada de investimentos - base (Novembro / 2020)

CNPJ	Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Lei
13.584.584/0001-31	BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES RESP...	Não se ...	Não se aplica	45.142,18	0,10%		0,03%	8º IV b
17.098.794/0001-70	CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	38.797,61	0,09%		0,02%	8º IV b
14.631.148/0001-39	HAZ FII - ATR11	Não se ...	Não se aplica	968.739,92	2,22%		1,35%	8º IV b
15.538.445/0001-05	SP DOWNTOWN FII - SPTW11	Não se ...	Não se aplica	87.919,10	0,20%		0,05%	8º IV b
14.410.722/0001-29	TIVIO RENDA IMOBILIÁRIA RESP LIMITADA FII - TVRI...	Não se ...	Não se aplica	13.690,00	0,03%		0,00%	8º IV b
28.319.463/0001-30	AUSTRO INSTITUCIONAL PIPE BANCOS FIC AÇÕES	D+31	30/04/2021	128.973,67	0,30%	22	0,45%	NE
Total para cálculo dos limites da Resolução			43.671.820,14					

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Novembro / 2020)

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	100,00%	9.394.910,93	21,51%	20,00%	30,00%	90,00%	29.909.727,20
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	26.203.092,08
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea a	40,00%	18.116.138,12	41,48%	10,00%	30,00%	40,00%	-647.410,06
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea a	15,00%	1.281.366,57	2,93%	0,00%	0,00%	15,00%	5.269.406,45
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea a	5,00%	145.108,99	0,33%	0,00%	0,00%	5,00%	2.038.482,02
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea b	5,00%	921.057,00	2,11%	0,00%	0,00%	5,00%	1.262.534,01
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea c	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.183.591,01
Total Renda Fixa	100,00%	29.858.581,61	68,37%	30,00%	70,00%	220,00%	

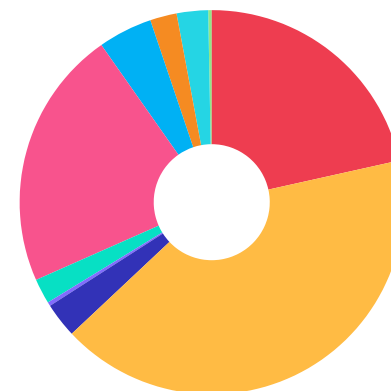


RENDA FIXA 29.858.581,61

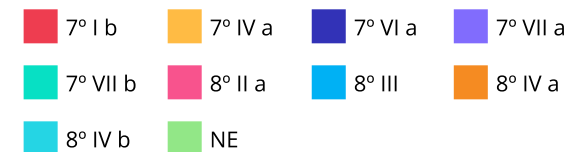
RENDA VARIÁVEL 13.813.238,53

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Novembro / 2020)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	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%	5,00%	2.183.591,01
Artigo 8º, Inciso I, Alínea b	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.183.591,01
Artigo 8º, Inciso II, Alínea a	20,00%	9.557.593,64	21,89%	7,00%	15,00%	20,00%	-823.229,61
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	1.993.330,37	4,56%	3,00%	10,00%	10,00%	2.373.851,64
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea a	5,00%	979.052,04	2,24%	0,00%	0,00%	5,00%	1.204.538,97
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea b	5,00%	1.154.288,81	2,64%	0,00%	5,00%	5,00%	1.029.302,20
Desenquadrado - RV	0,00%	128.973,67	0,30%	0,00%	0,00%	0,00%	-128.973,67
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	13.813.238,53	31,63%	10,00%	30,00%	50,00%	



Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2020			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.183.591,01
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2020		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	0,00	0,00	20,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea a	0,00	0,00	10,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea a	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	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	5,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea b	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea a	0,00	0,00	7,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00	3,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea a	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea b	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	5,00

Enquadramento por Gestores - base (Novembro / 2020)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	14.608.024,89	33,45	0,00
VERITAS CAPITAL MANAGEMENT	10.075.548,92	23,07	0,56
CAIXA DTVM S.A	8.906.150,89	20,39	0,00
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	2.046.539,42	4,69	0,04
ITAÚ DTVM	1.301.207,74	2,98	0,00
SICREDI	1.281.366,57	2,93	0,68
GRAPHEN INVESTIMENTOS	1.143.726,27	2,62	0,81
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	1.091.987,35	2,50	0,00
META ASSET MANAGEMENT	1.014.168,91	2,32	0,32
ARENA CAPITAL	826.625,36	1,89	-
BANCO BRADESCO	670.446,77	1,54	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	307.752,78	0,70	0,00
PLURAL	210.468,42	0,48	0,00
AUSTRO CAPITAL	128.973,67	0,30	0,01
ZION INVEST	45.142,18	0,10	0,01
TIVIO CAPITAL DISTRIBUIDORA DE...	13.690,00	0,03	0,00

Artigo 20º - 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) - (Resolução 4963)

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	1,25%	6,77%	1,31%	4,33%	8,05%	20,89%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENC...	1,34%	6,29%	1,79%	4,57%	7,52%	19,65%	0,73%	3,10%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REND...	1,22%	6,28%	1,41%	4,27%	7,44%	19,53%	0,68%	2,87%
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	1,36%	8,73%	3,89%	6,37%	10,52%	20,99%	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	1,21%	5,71%	0,44%	3,37%	7,26%	24,58%	0,89%	5,03%
IRF-M 1+ (Benchmark)	0,46%	5,24%	-1,06%	0,29%	6,00%	22,54%	-	-
BB IRF-M 1+ RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,44%	4,58%	-1,27%	0,05%	5,30%	-	2,00%	3,59%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,23%	3,52%	0,54%	1,19%	3,95%	11,13%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIX...	0,22%	3,34%	0,49%	1,09%	3,75%	10,71%	0,11%	0,52%
IMA-B 5 (Benchmark)	1,32%	6,10%	1,40%	3,99%	7,41%	21,69%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	1,29%	5,91%	1,32%	3,82%	7,20%	21,13%	0,88%	3,23%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-2,32%	-7,77%	-5,30%	-9,68%	-8,11%	-27,54%	3,88%	6,05%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	1,30%	5,97%	1,24%	3,77%	7,27%	21,30%	0,87%	3,35%
IMA-B (Benchmark)	2,00%	1,48%	0,67%	5,31%	3,52%	26,83%	-	-
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	0,60%	-44,94%	-12,17%	-34,87%	-44,04%	-42,34%	5,22%	25,93%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	-0,34%	-74,39%	-28,08%	-69,88%	-74,27%	-73,14%	0,22%	52,31%
CDB - BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.	-	-	-	-	-	-	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCI...	1,99%	1,24%	0,60%	5,13%	3,24%	26,17%	2,32%	9,84%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA ...	1,99%	1,17%	0,62%	5,19%	3,18%	26,04%	2,33%	9,93%

IRF-M (Benchmark)	0,36%	4,65%	-0,53%	0,58%	5,30%	19,04%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCI...	0,34%	4,35%	-0,63%	0,45%	4,98%	18,41%	1,26%	2,50%

CDI (Benchmark)	0,15%	2,59%	0,46%	1,03%	2,97%	9,24%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA ...	1,01%	-	0,05%	1,86%	-	-	1,46%	-
CAIXA BRASIL RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,16%	2,05%	0,27%	0,91%	2,40%	8,40%	0,04%	0,43%
CAIXA PRÁTICO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,01%	0,13%	0,03%	0,06%	0,18%	1,21%	0,00%	0,05%
BB FLUXO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,06%	1,54%	0,11%	0,42%	1,83%	6,86%	0,02%	0,33%
BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVID...	0,16%	2,14%	0,34%	1,02%	2,50%	8,51%	0,03%	0,41%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SI...	0,08%	1,81%	0,26%	0,61%	2,12%	7,43%	0,00%	0,30%

IPCA (Benchmark)	0,89%	3,13%	2,41%	3,29%	4,31%	7,73%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	1,17%	4,35%	1,86%	3,69%	5,31%	16,61%	0,56%	2,36%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA ...	0,11%	2,65%	-0,05%	0,82%	3,01%	16,62%	0,02%	0,90%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	0,82%	5,27%	0,21%	1,37%	5,90%	24,20%	0,87%	2,23%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	-0,15%	-4,69%	-0,48%	-3,39%	-4,85%	-13,53%	0,01%	11,39%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Novembro/2020 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,15%	2,59%	0,46%	1,03%	2,97%	9,24%	-	-
DAYCOVAL FIF MULTIESTRATÉGIA	0,43%	3,37%	-0,19%	0,80%	3,80%	12,27%	0,59%	1,12%

Global BDRX (Benchmark)	2,55%	52,59%	-1,23%	20,39%	50,26%	91,01%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR NÍVEL I	2,43%	53,70%	-1,39%	20,75%	50,99%	90,52%	9,00%	22,96%

Ibovespa (Benchmark)	15,90%	-5,84%	9,58%	24,59%	0,61%	21,66%	-	-
AUSTRO INSTITUCIONAL PIPE BANCOS FIC AÇÕES	7,22%	-60,33%	3,45%	-21,64%	-60,03%	-59,52%	17,14%	37,66%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	12,53%	-6,01%	4,45%	21,02%	2,73%	-	9,22%	44,09%
ITAÚ MOMENTO 30 RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	11,85%	-2,92%	5,46%	26,79%	6,26%	34,60%	11,23%	42,06%
ITAÚ OLIMPO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	13,16%	-3,28%	6,84%	26,61%	4,10%	-	10,43%	41,78%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPAATIVO FIC AÇÕES	13,75%	-5,74%	7,45%	22,78%	2,06%	27,36%	9,55%	42,57%
DAYCOVAL IBOVESPAATIVO FI AÇÕES	13,38%	-7,00%	6,80%	25,62%	-0,81%	23,31%	10,30%	42,63%
BB CONSUMO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	8,66%	-3,84%	1,14%	17,32%	3,55%	46,98%	11,00%	43,55%
BB SELEÇÃO FATORIAL RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	16,82%	3,27%	10,31%	30,58%	13,22%	49,89%	11,39%	45,91%

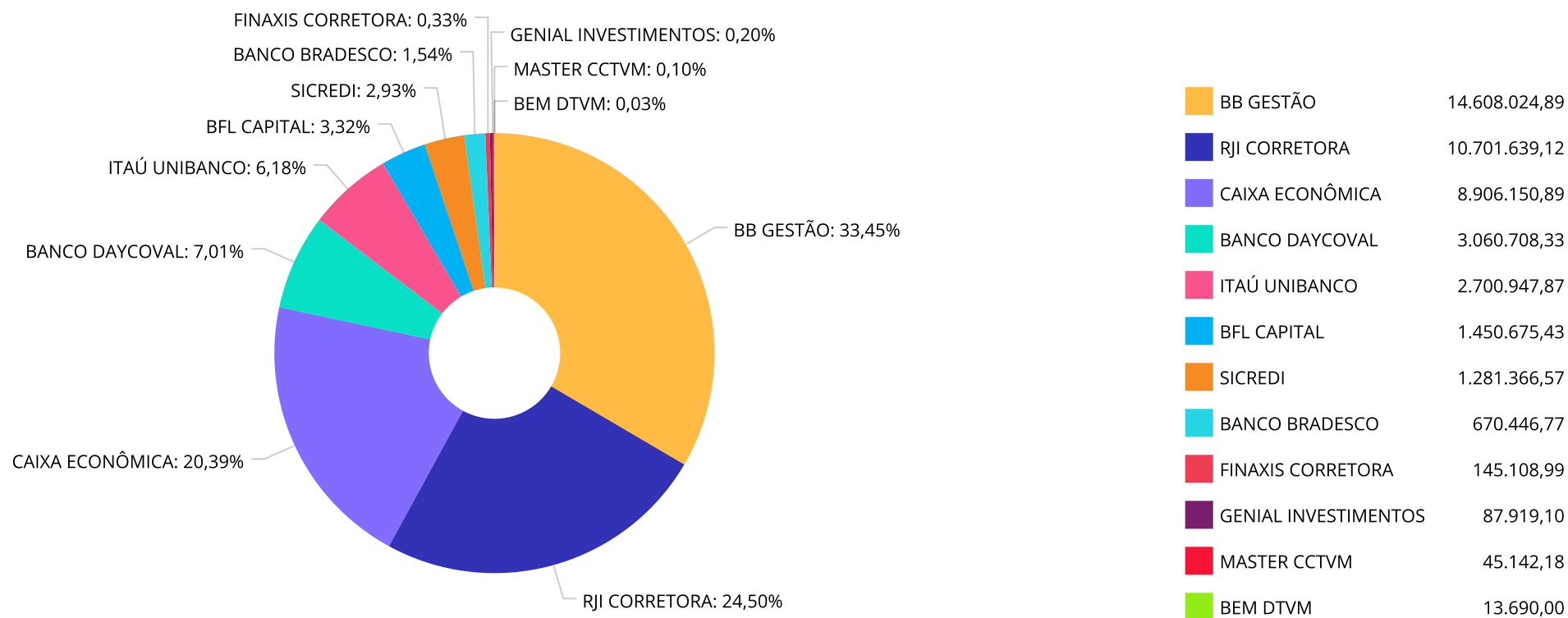
IBX (Benchmark)	15,46%	-5,18%	9,57%	25,07%	1,72%	24,85%	-	-
META VALOR RESP LIMITADA FIF AÇÕES	12,35%	-2,55%	3,94%	23,79%	9,33%	30,01%	12,13%	52,54%

IFIX (Benchmark)	1,51%	-12,17%	0,95%	5,68%	-2,83%	22,09%	-	-
------------------	-------	---------	-------	-------	--------	--------	---	---

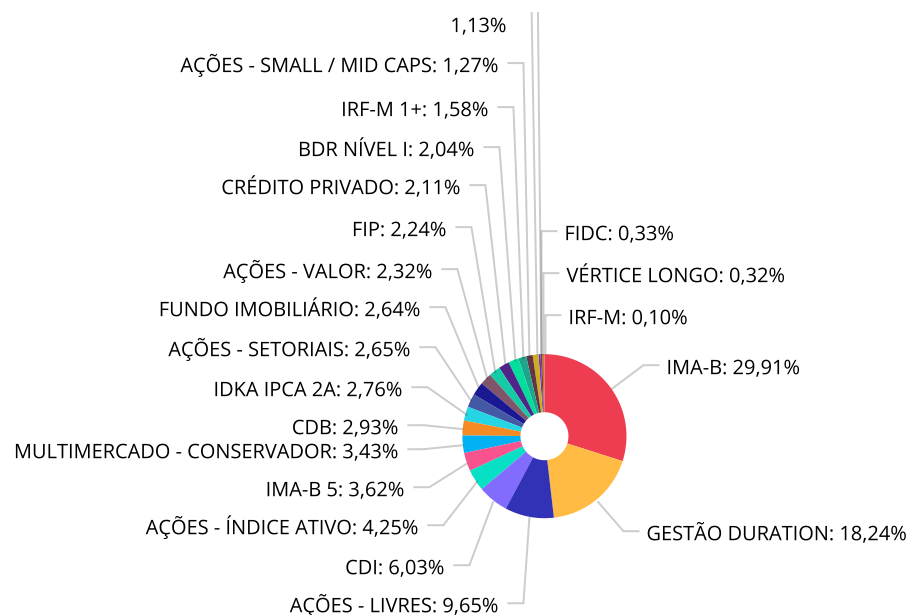
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Novembro/2020 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
HAZ FII - ATCR11	-0,01%	2,23%	-0,18%	2,13%	384,67%	384,67%	-	-
TIVIO RENDA IMOBILIÁRIA RESP LIMITADA FII - TVRI11	-1,57%	-20,46%	-1,52%	-12,33%	-14,63%	-2,02%	2,54%	26,37%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	-3,36%	-3,35%	-7,10%	10,77%	6,27%	-85,83%	24,33%	53,96%
SP DOWNTOWN FII - SPTW11	-1,29%	-28,26%	6,49%	25,77%	-11,26%	-	4,06%	52,64%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES RESP LIMITADA FII - C...	0,00%	-38,76%	-12,22%	14,49%	-24,76%	-57,07%	12,35%	56,86%
IPCA (Benchmark)	0,89%	3,13%	2,41%	3,29%	4,31%	7,73%	-	-
IMOBILIÁRIO PARANÁ REC FIP MULTISTRATÉGIA	-0,47%	-	-1,86%	-3,09%	-	-17,66%	0,02%	0,48%
AUSTRO MULTIPAR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-0,28%	-16,51%	-0,87%	-1,83%	-16,62%	-8,54%	0,00%	13,37%
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	1,69%	12,92%	4,96%	8,62%	15,17%	31,43%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTISTRATÉGIA	-0,44%	-	-1,31%	-	-	-96,90%	-	-
IPCA + 9,00% ao ano (Benchmark)	1,58%	11,53%	4,60%	7,88%	13,62%	27,90%	-	-
FP2 FIP MULTISTRATÉGIA	-	-	-	-	-	-	-	-
SMLL (Benchmark)	16,64%	-7,60%	7,78%	33,38%	4,09%	49,24%	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO RESP LIMITADA FIF AÇÕES	15,73%	-10,07%	6,25%	29,26%	1,22%	41,06%	10,99%	48,30%

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



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



IMA-B	13.064.217,86	GESTÃO DURATION	7.967.908,12	AÇÕES - LIVRES	4.212.298,80
CDI	2.634.951,95	AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	1.854.471,49	IMA-B 5	1.581.642,26
MULTIMERCADO - CONSERVADOR	1.498.253,97	CDB	1.281.366,57	IDKA IPCA 2A	1.207.159,66
AÇÕES - SETORIAIS	1.159.065,46	FUNDO IMOBILIÁRIO	1.154.288,81	AÇÕES - VALOR	1.014.168,91
FIP	979.052,04	CRÉDITO PRIVADO	921.057,00	BDR NÍVEL I	891.410,13
IRF-M 1+	688.673,58	AÇÕES - SMALL / MID CAPS	555.152,52	MULTIMERCADO - CRÉDITO PRIVADO	495.076,40
IRF-M 1	182.873,07	FIDC	145.108,99	VÉRTICE LONGO	139.844,68
IRF-M	43.777,87				

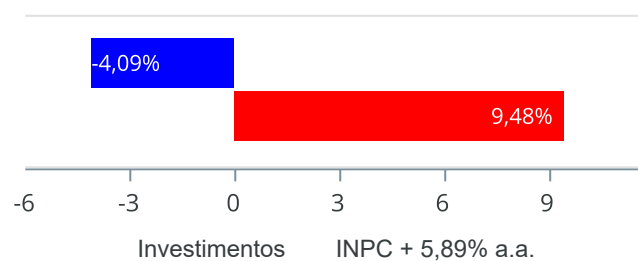
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Novembro / 2020)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
------------------	------------	--------	------	-------------	------------	---------	----------	----------

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2020

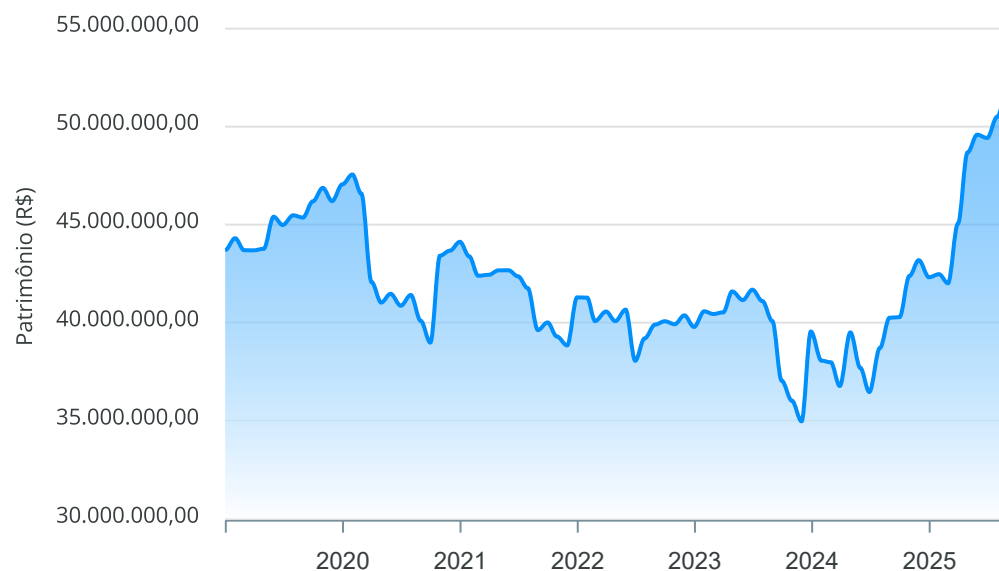
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	47.055.425,39	2.422.019,00	2.034.188,91	47.505.509,53	62.254,05	62.254,05	0,13%	0,13%	0,69%	0,69%	18,97%	3,57%
Fevereiro	47.505.509,53	741.998,43	1.235.261,87	46.536.380,29	-475.865,80	-413.611,75	-1,00%	-0,87%	0,58%	1,28%	-68,31%	4,27%
Março	46.536.380,29	900.214,98	1.398.061,94	42.028.862,47	-4.009.670,86	-4.423.282,61	-8,62%	-9,41%	0,68%	1,97%	-478,62%	19,75%
Abril	42.028.862,47	846.865,72	1.263.774,36	40.979.848,09	-632.105,74	-5.055.388,35	-1,50%	-10,78%	0,22%	2,20%	-490,84%	10,27%
Maio	40.979.848,09	1.979.674,69	4.323.488,01	39.042.759,00	406.724,23	-4.648.664,12	0,99%	-9,89%	0,20%	2,40%	-411,41%	7,24%
Junho	39.042.759,00	3.019.229,14	2.240.179,17	40.819.448,84	997.639,87	-3.651.024,25	2,51%	-7,63%	0,78%	3,20%	-238,35%	6,10%
Julho	40.819.448,84	1.955.081,28	2.373.941,74	41.364.960,73	964.372,35	-2.686.651,90	2,36%	-5,45%	0,97%	4,20%	-129,79%	12,38%
Agosto	41.364.960,73	14.318.226,11	15.879.181,36	39.309.419,58	-494.585,90	-3.181.237,80	-1,20%	-6,58%	0,84%	5,07%	-129,69%	6,38%
Setembro	39.309.419,58	2.423.096,08	2.714.917,60	38.479.771,76	-537.826,30	-3.719.064,10	-1,37%	-7,86%	1,35%	6,49%	-121,00%	6,50%
Outubro	38.479.771,76	1.164.637,63	1.352.848,14	38.292.695,24	1.133,99	-3.717.930,11	0,00%	-7,86%	1,37%	7,96%	-98,74%	5,35%
Novembro	38.292.695,24	7.105.120,12	3.617.261,71	43.485.930,68	1.705.377,03	-2.012.553,08	4,08%	-4,09%	1,41%	9,48%	-43,20%	4,20%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



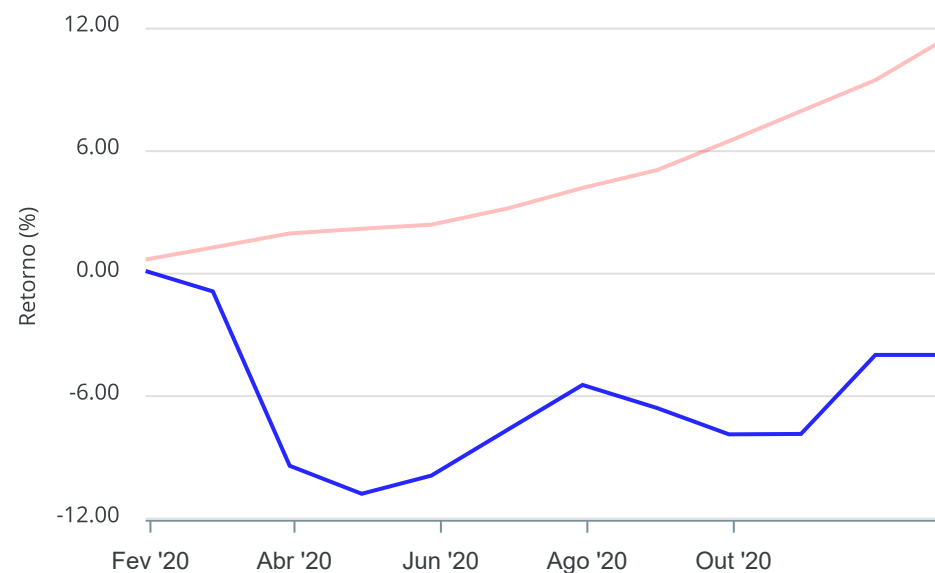
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



Investimentos Meta de Rentabilidade ☐ CDI ☐ IMA-B

☐ IMA-B 5 ☐ IMA-B 5+ ☐ IMA Geral ☐ IRF-M ☐ IRF-M 1

☐ IRF-M 1+ ☐ Ibovespa ☐ IBX ☐ SMLL ☐ IDIV

Investimentos Meta de Rentabilidade ☐ 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 Novembro/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA ...	1.339.644,22	0,00	0,00	1.366.345,24	26.701,02	1,99%	1,99%	2,32%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA ...	2.488.177,73	0,00	419.946,51	2.117.400,10	49.168,88	1,98%	1,99%	2,33%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RESP LI...	327.663,02	0,00	0,00	331.653,64	3.990,62	1,22%	1,22%	0,68%
CAIXA BRASIL IPCA XVI RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA...	910.069,50	0,00	0,00	921.057,00	10.987,50	1,21%	1,21%	0,89%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII RESP LIMITADA FIF RENDA FI...	138.229,11	0,00	0,00	139.844,68	1.615,57	1,17%	1,17%	0,56%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL RESP LIMITADA FIF ...	4.999.095,33	0,00	0,00	5.049.475,02	50.379,69	1,01%	1,01%	1,46%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FIF ...	2.715.375,66	0,00	0,00	2.737.641,24	22.265,58	0,82%	0,82%	0,87%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF C...	310.223,14	355.000,00	0,00	670.446,77	5.223,63	0,79%	1,30%	0,87%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA...	119.320,79	750.000,00	0,00	875.506,02	6.185,23	0,71%	1,34%	0,73%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC R...	155.185,02	750.000,00	0,00	911.195,49	6.010,47	0,66%	1,29%	0,88%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	4.142.491,07	0,00	0,00	4.167.483,35	24.992,28	0,60%	0,60%	5,22%
BB IRF-M 1+ RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENC...	685.665,03	0,00	0,00	688.673,58	3.008,55	0,44%	0,44%	2,00%
CDB - BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.	1.276.134,38	0,00	0,00	1.281.366,57	5.232,19	0,41%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA ...	47.837,15	0,00	4.217,56	43.777,87	158,28	0,33%	0,34%	1,26%
BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFEREN...	7.123,46	0,00	0,00	7.134,71	11,25	0,16%	0,16%	0,03%
CAIXA BRASIL RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERENC...	26.486,22	0,00	10.874,94	15.646,94	35,66	0,13%	0,15%	0,04%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA...	180.602,99	0,00	0,00	180.791,86	188,87	0,10%	0,10%	0,02%
BB FLUXO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SIMPLES ...	2.443.159,24	1.948.055,04	1.879.716,53	2.512.977,75	1.480,00	0,03%	0,06%	0,02%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RESP LIMITADA FIF CI...	423.871,15	151.658,44	477.609,44	98.103,44	183,29	0,03%	0,08%	0,00%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITAD...	19.342,18	163.489,19	0,00	182.873,07	41,70	0,02%	0,22%	0,11%

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA PRÁTICO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA CUR...	127.471,89	26.121,84	152.516,99	1.089,11	12,37	0,01%	0,01%	0,00%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	145.333,48	0,00	0,00	145.108,99	-224,49	-0,15%	-0,15%	0,01%
IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	548.184,92	0,00	0,00	546.317,88	-1.867,04	-0,34%	-0,34%	0,22%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	4.982.157,34	0,00	82.334,66	4.866.671,29	-33.151,39	-0,67%	-2,32%	3,88%
Total Renda Fixa	28.558.844,02	4.144.324,51	3.027.216,63	29.858.581,61	182.629,71	0,62%		2,21%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA SMALL CAPS ATIVO RESP LIMITADA FIF AÇÕES	479.703,72	0,00	0,00	555.152,52	75.448,80	15,73%	15,73%	10,99%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPAATIVO FIC AÇÕES	1.143.905,74	0,00	0,00	1.301.207,74	157.302,00	13,75%	13,75%	9,55%
DAYCOVAL IBOVESPAATIVO FI AÇÕES	483.586,56	0,00	0,00	548.285,45	64.698,89	13,38%	13,38%	10,30%
ITAÚ OLIMPO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	4.399,50	0,00	0,00	4.978,30	578,80	13,16%	13,16%	10,43%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX RESP LIMITADA FIF CIC A...	632.448,15	0,00	698.821,13	0,00	66.372,98	10,49%	13,92%	11,36%
BB CONSUMO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	948.015,50	0,00	0,00	1.030.091,79	82.076,29	8,66%	8,66%	11,00%
META VALOR RESP LIMITADA FIF AÇÕES	541.421,70	400.000,00	0,00	1.014.168,91	72.747,21	7,73%	12,35%	12,13%
AUSTRO INSTITUCIONAL PIPE BANCOS FIC AÇÕES	120.289,73	0,00	0,00	128.973,67	8.683,94	7,22%	7,22%	17,14%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR RESP LIMITADA FIF CIC AÇÃO...	448.576,85	500.000,00	0,00	1.015.326,09	66.749,24	7,04%	12,53%	9,22%
ITAÚ MOMENTO 30 RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	0,00	298.821,13	0,00	302.774,48	3.953,35	1,32%	11,84%	11,23%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	38.757,24	0,00	280,00	38.797,61	320,37	0,83%	-3,36%	24,33%
SP DOWNTOWN FII - SPTW11	89.070,00	0,00	1.290,00	87.919,10	139,10	0,16%	-1,29%	4,06%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES RESP L...	45.142,18	0,00	0,00	45.142,18	0,00	0,00%	0,00%	12,35%
FP2 FIP MULTISTRATÉGIA	826.682,03	0,00	0,00	826.625,36	-56,67	-0,01%	-	-
HAZ FII - ATCR11	968.849,93	0,00	0,00	968.739,92	-110,01	-0,01%	-0,01%	-
DAYCOVAL FIF MULTISTRATÉGIA	0,00	1.500.000,00	0,00	1.498.253,97	-1.746,03	-0,12%	0,43%	0,59%
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTISTRATÉGIA	122.763,47	0,00	0,00	122.549,32	-214,15	-0,17%	-	-
AUSTRO MULTIPAR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	496.482,16	0,00	0,00	495.076,40	-1.405,76	-0,28%	-0,28%	0,00%
IMOBILIÁRIO PARANÁ REC FIP MULTISTRATÉGIA	30.019,70	0,00	0,00	29.877,36	-142,34	-0,47%	-0,47%	0,02%
TIVIO RENDA IMOBILIÁRIA RESP LIMITADA FII - TVRI11	13.882,00	0,00	108,23	13.690,00	-83,77	-0,60%	-1,56%	2,54%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB SELEÇÃO FATORIAL RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	1.487.277,12	0,00	0,00	641.440,84	-845.836,28	-56,87%	16,82%	11,39%
Total Renda Variável	8.921.273,28	2.698.821,13	700.499,36	10.669.071,01	-250.524,04	-2,16%		8,33%

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR NÍ...	870.261,74	0,00	0,00	891.410,13	21.148,39	2,43%	2,43%	9,00%
Total Exterior	870.261,74	0,00	0,00	891.410,13	21.148,39	2,43%		9,00%

Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da CRÉDITO E MERCADO CONSULTORIA DE INVESTIMENTOS.. As informações aqui contidas, tem por somente, o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre o(s) produto(s) mencionado(s), entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros exigidos legalmente. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas aos objetivos, aos riscos e à política de investimento do(s) produto(s). Todas as informações podem ser obtidas com os responsáveis pela distribuição, administração, gestão ou no próprio site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários) através do link: <https://www.gov.br/cvm/pt-br>.

Sua elaboração buscou atender os objetivos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil de investidor.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas aos investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de Consultoria de Valores Mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe a Consultoria de Valores Mobiliários a prestação dos serviços de ORIENTAÇÃO, RECOMENDAÇÃO E ACONSELHAMENTO, DE FORMA PROFISSIONAL, INDEPENDENTE E INDIVIDUALIZADA, SOBRE INVESTIMENTOS NO MERCADO DE VALORES MOBILIÁRIOS, CUJA ADOÇÃO E IMPLEMENTAÇÃO SEJAM EXCLUSIVAS DO CLIENTE (Resolução CVM nº 19/2021).

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no Art. 3º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria MTP nº 1.467/2022, art. 84, inciso III, alínea "a".

Os RPPS DEVEM, independente da contratação de Consultoria de Valores Mobiliários, se adequar às normativas pertinentes e principalmente a Portaria MTP nº 1.467/2022 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963/2021, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.

Relatório Analítico dos Investimentos

em dezembro, 4º trimestre e ano de 2020

Este relatório atende a Portaria MTP Nº 1.467, de 2 de junho de 2022.

Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2020)

CNPJ	Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Lei
13.322.205/0001-35	BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REN...	D+1	Não há	2.480.541,45	5,62%	922	0,03%	7º I b
07.442.078/0001-05	BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REND...	D+1	Não há	1.432.419,40	3,25%	679	0,02%	7º I b
32.161.826/0001-29	BB IRF-M 1+ RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	709.968,43	1,61%	115	0,17%	7º I b
07.111.384/0001-69	BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REND...	D+1	Não há	44.637,85	0,10%	701	0,00%	7º I b
19.523.305/0001-06	BB TÍTULOS PÚBLICOS VII RESP LIMITADA FIF RENDA ...	D+0	15/08/2022	141.531,87	0,32%	165	0,06%	7º I b
23.215.097/0001-55	CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FI...	D+0	Não há	2.773.796,26	6,29%	885	0,02%	7º I b
14.386.926/0001-71	CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RESP ...	D+0	Não há	826.621,65	1,87%	1.005	0,01%	7º I b
10.740.658/0001-93	CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITAD...	D+0	Não há	2.219.891,78	5,03%	899	0,04%	7º I b
10.740.670/0001-06	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMIT...	D+0	Não há	334.493,19	0,76%	1.361	0,00%	7º I b
09.093.819/0001-15	ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC...	D+1	Não há	927.698,01	2,10%	74	0,06%	7º I b
35.292.588/0001-89	BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL RESP LIMITADA FI...	D+3	Não há	5.185.634,03	11,75%	431	0,19%	7º IV a
13.077.415/0001-05	BB FLUXO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SIMPLE...	D+0	Não há	426.905,64	0,97%	743	0,02%	7º IV a
13.077.418/0001-49	BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFER...	D+0	Não há	7.152,66	0,02%	576	0,00%	7º IV a
20.216.216/0001-04	BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF...	D+1	Não há	682.364,75	1,55%	136	0,07%	7º IV a
14.508.643/0001-55	CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RESP LIMITADA FIF ...	D+0	Não há	112.067,03	0,25%	297	0,01%	7º IV a
03.737.206/0001-97	CAIXA BRASIL RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERE...	D+0	Não há	15.703,69	0,04%	641	0,00%	7º IV a
00.834.074/0001-23	CAIXA PRÁTICO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA C...	D+0	Não há	0,02	0,00%	15.442	0,00%	7º IV a
12.402.646/0001-84	IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	D+1002	Não há	544.310,01	1,23%	12	5,95%	7º IV a
21.838.150/0001-49	ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITA...	D+1	Não há	181.157,35	0,41%	269	0,00%	7º IV a
15.153.656/0001-11	MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1800	Não há	4.674.797,79	10,59%	18	2,74%	7º IV a

Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2020)

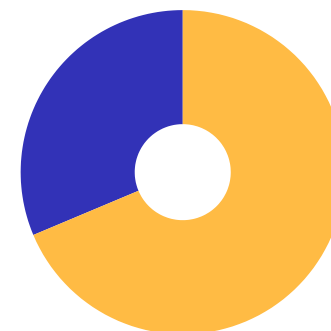
CNPJ	Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Lei
13.594.673/0001-69	TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	D+31 ou...	Não há	4.180.596,11	9,47%	15	3,64%	7º IV a
01.181.521/0001-55	CDB - BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.	S/Info	Não Informado	1.313.407,13	2,98%		0,00%	7º VI a
06.018.364/0001-85	PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	Não se ...	Não se aplica	144.896,13	0,33%	98	0,18%	7º VII a
21.918.896/0001-62	CAIXA BRASIL IPCA XVI RESP LIMITADA FIF RENDA FI...	D+0	18/04/2018	937.441,00	2,12%	76	0,47%	7º VII b
08.973.942/0001-68	BB CONSUMO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+4	Não há	1.080.611,33	2,45%	12.798	0,25%	8º II a
07.882.792/0001-14	BB SELEÇÃO FATORIAL RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+3	Não há	2.487.559,46	5,64%	15.778	0,42%	8º II a
30.068.224/0001-04	CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR RESP LIMITADA FIF CIC AÇ...	D+25	Não há	1.092.949,80	2,48%	2.413	0,11%	8º II a
17.502.937/0001-68	CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR ...	D+4	Não há	897.592,61	2,03%	191	0,05%	8º II a
15.154.220/0001-47	CAIXA SMALL CAPS ATIVO RESP LIMITADA FIF AÇÕES	D+4	Não há	597.341,57	1,35%	15.069	0,04%	8º II a
13.155.995/0001-01	DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	D+15	Não há	596.784,03	1,35%	1.055	0,30%	8º II a
08.817.414/0001-10	ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	1.410.061,46	3,20%	55	0,13%	8º II a
16.718.302/0001-30	ITAÚ MOMENTO 30 RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+23	Não há	328.200,89	0,74%	38.437	0,01%	8º II a
32.246.546/0001-13	ITAÚ OLIMPO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	D+3	Não há	5.405,25	0,01%	20.287	0,00%	8º II a
07.899.238/0001-40	META VALOR RESP LIMITADA FIF AÇÕES	D+4	Não há	1.090.230,03	2,47%	183	0,31%	8º II a
18.366.002/0001-64	AUSTRO MULTIPAR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+1	96 meses	493.623,37	1,12%	33	0,61%	8º III
09.274.058/0001-06	DAYCOVAL FIF MULTIESTRATÉGIA	D+1	Não há	1.498.969,10	3,40%	1.620	0,63%	8º III
20.886.575/0001-60	FP2 FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	826.568,68	1,87%		0,00%	8º IV a
11.490.580/0001-69	GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	122.285,31	0,28%	33	1,53%	8º IV a
16.720.629/0001-46	IMOBILIÁRIO PARANÁ REC FIP MULTIESTRATÉGIA	Não se ...	Não se aplica	29.728,78	0,07%	11	0,41%	8º IV a
13.584.584/0001-31	BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES RESP...	Não se ...	Não se aplica	39.999,40	0,09%		0,03%	8º IV b

Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2020)

CNPJ	Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	Lei
17.098.794/0001-70	CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	38.848,80	0,09%		0,02%	8º IV b
14.631.148/0001-39	HAZ FII - ATCR11	Não se ...	Não se aplica	970.139,92	2,20%		1,35%	8º IV b
15.538.445/0001-05	SP DOWNTOWN FII - SPTW11	Não se ...	Não se aplica	84.660,00	0,19%		0,05%	8º IV b
14.410.722/0001-29	TIVIO RENDA IMOBILIÁRIA RESP LIMITADA FII - TVRI...	Não se ...	Não se aplica	12.401,00	0,03%		0,00%	8º IV b
28.319.463/0001-30	AUSTRO INSTITUCIONAL PIPE BANCOS FIC AÇÕES	D+31	30/04/2021	122.415,02	0,28%	22	0,45%	NE
Total para cálculo dos limites da Resolução			44.124.409,04					
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			0,01	Artigo 6º				
PL Total			44.124.409,05					

Enquadramento e Política de Investimento (RENTA FIXA) - base (Dezembro / 2020)

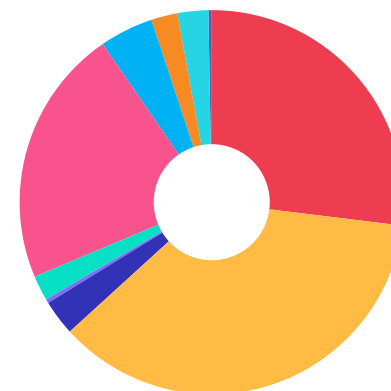
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	100,00%	11.891.599,89	26,95%	20,00%	30,00%	90,00%	27.820.368,25
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	26.474.645,42
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea a	40,00%	16.010.689,08	36,29%	10,00%	30,00%	40,00%	1.639.074,54
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea a	15,00%	1.313.407,13	2,98%	0,00%	0,00%	15,00%	5.305.254,23
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea a	5,00%	144.896,13	0,33%	0,00%	0,00%	5,00%	2.061.324,32
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea b	5,00%	937.441,00	2,12%	0,00%	0,00%	5,00%	1.268.779,45
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea c	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.206.220,45
Total Renda Fixa	100,00%	30.298.033,23	68,67%	30,00%	70,00%	220,00%	



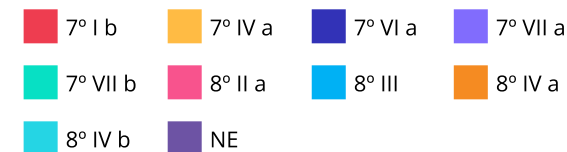
RENDA FIXA 30.298.033,23
RENDA VARIÁVEL 13.826.375,81

Enquadramento e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Dezembro / 2020)

Artigos - Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	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%	5,00%	2.206.220,45
Artigo 8º, Inciso I, Alínea b	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.206.220,45
Artigo 8º, Inciso II, Alínea a	20,00%	9.586.736,43	21,73%	7,00%	15,00%	20,00%	-761.854,62
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	1.992.592,47	4,52%	3,00%	10,00%	10,00%	2.419.848,43
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea a	5,00%	978.582,77	2,22%	0,00%	0,00%	5,00%	1.227.637,68
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea b	5,00%	1.146.049,12	2,60%	0,00%	5,00%	5,00%	1.060.171,33
Desenquadrado - RV	0,00%	122.415,02	0,28%	0,00%	0,00%	0,00%	-122.415,02
Total Renda Variável / Estruturado / Imobiliário	30,00%	13.826.375,81	31,33%	10,00%	30,00%	50,00%	



Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2020			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.206.220,45
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	



Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2020		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea b	0,00	0,00	20,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea a	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea a	0,00	0,00	10,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea a	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	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	5,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea b	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea a	0,00	0,00	7,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00	3,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea a	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea b	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	5,00

Enquadramento por Gestores - base (Dezembro / 2020)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	13.996.962,12	31,72	0,00
VERITAS CAPITAL MANAGEMENT	9.893.327,28	22,42	0,43
CAIXA DTVM S.A	9.846.747,40	22,32	0,00
DAYCOVAL ASSET MANAGEMENT	2.095.753,13	4,75	0,04
ITAÚ DTVM	1.410.061,46	3,20	0,00
SICREDI	1.313.407,13	2,98	0,80
GRAPHEN INVESTIMENTOS	1.144.764,83	2,59	0,55
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	1.108.855,36	2,51	0,00
META ASSET MANAGEMENT	1.090.230,03	2,47	0,31
ARENA CAPITAL	826.568,68	1,87	-
BANCO BRADESCO	682.364,75	1,55	-
ITAÚ ASSET MANAGEMENT	333.606,14	0,76	0,00
GENIAL GESTÃO LTDA	206.945,31	0,47	0,00
AUSTRO CAPITAL	122.415,02	0,28	0,01
ZION INVEST	39.999,40	0,09	0,01
TIVIO CAPITAL DISTRIBUIDORA DE...	12.401,00	0,03	0,00

Artigo 20º - 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) - (Resolução 4963)

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	1,73%	8,62%	3,05%	5,10%	8,62%	21,46%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REND...	1,65%	8,03%	3,05%	4,76%	8,03%	20,12%	0,71%	3,02%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENC...	1,53%	7,92%	3,22%	4,89%	7,92%	20,01%	0,66%	3,19%
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	1,87%	10,76%	4,64%	7,55%	10,76%	22,49%	-	-
CAIXA BRASIL IPCA XVI RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	1,78%	7,59%	2,87%	3,90%	7,59%	25,32%	0,71%	5,10%
IRF-M 1+ (Benchmark)	3,05%	8,45%	2,90%	2,29%	8,45%	23,90%	-	-
BB IRF-M 1+ RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3,09%	7,81%	2,98%	2,09%	7,81%	-	1,68%	4,47%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,31%	3,84%	0,70%	1,21%	3,84%	10,86%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIX...	0,29%	3,63%	0,65%	1,12%	3,63%	10,42%	0,10%	0,51%
IMA-B 5 (Benchmark)	1,83%	8,04%	3,38%	4,72%	8,04%	22,25%	-	-
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	1,78%	7,86%	3,23%	4,48%	7,86%	21,79%	0,77%	3,50%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-3,94%	-11,41%	-5,14%	-12,89%	-11,41%	-32,98%	6,03%	6,85%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	1,81%	7,83%	3,31%	4,58%	7,83%	21,71%	0,74%	3,41%
IMA-B (Benchmark)	4,85%	6,41%	7,18%	8,21%	6,41%	30,83%	-	-
CDB - BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.	-	-	-	-	-	-	-	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	-0,37%	-74,48%	-10,27%	-64,70%	-74,48%	-73,34%	0,05%	52,08%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	0,32%	-44,76%	-2,53%	-33,63%	-44,76%	-39,02%	0,37%	25,63%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA ...	4,84%	6,06%	7,13%	8,09%	6,06%	30,02%	2,04%	10,83%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCI...	4,84%	6,14%	7,14%	8,03%	6,14%	30,17%	2,03%	10,74%

IRF-M (Benchmark)	1,95%	6,69%	1,99%	1,75%	6,69%	19,53%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCI...	1,96%	6,40%	1,99%	1,64%	6,40%	18,94%	1,04%	2,94%

CDI (Benchmark)	0,16%	2,76%	0,47%	0,99%	2,76%	8,88%	-	-
CAIXA BRASIL RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,36%	2,42%	0,64%	1,03%	2,42%	8,27%	0,15%	0,44%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA ...	2,70%	-	3,66%	3,62%	-	-	1,09%	-
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SI...	0,09%	1,90%	0,26%	0,55%	1,90%	7,07%	0,00%	0,27%
BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVID...	0,25%	2,40%	0,57%	1,01%	2,40%	8,28%	0,02%	0,38%
BB FLUXO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SIMPLES PREVIDENCIÁRIO	0,10%	1,64%	0,22%	0,40%	1,64%	6,54%	0,01%	0,30%
CAIXA PRÁTICO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,01%	0,15%	0,04%	0,06%	0,15%	1,13%	0,00%	0,03%

IPCA (Benchmark)	1,35%	4,52%	3,13%	4,42%	4,52%	9,02%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	1,32%	6,67%	2,04%	1,95%	6,67%	24,19%	0,55%	2,38%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA FIF CIC RENDA ...	0,20%	2,86%	0,39%	0,58%	2,86%	15,12%	0,02%	0,89%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	1,21%	5,61%	2,89%	3,91%	5,61%	16,66%	0,64%	2,44%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	-0,15%	-4,83%	-0,46%	-3,33%	-4,83%	-13,52%	0,01%	11,39%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2020 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,16%	2,76%	0,47%	0,99%	2,76%	8,88%	-	-
DAYCOVAL FIF MULTIESTRATÉGIA	0,05%	3,42%	0,07%	0,48%	3,42%	11,59%	0,38%	1,14%

Global BDRX (Benchmark)	0,93%	54,01%	1,70%	16,29%	54,01%	108,94%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR NÍVEL I	0,69%	54,76%	1,31%	16,49%	54,76%	108,09%	7,07%	22,45%

Ibovespa (Benchmark)	9,30%	2,92%	25,81%	25,21%	2,92%	35,42%	-	-
AUSTRO INSTITUCIONAL PIPE BANCOS FIC AÇÕES	-5,09%	-62,35%	-8,55%	-22,68%	-62,35%	-60,35%	12,94%	36,84%
BB SELEÇÃO FATORIAL RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	10,42%	14,03%	28,14%	32,00%	14,03%	67,13%	7,54%	46,06%
BB CONSUMO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	4,90%	0,88%	10,61%	11,96%	0,88%	54,61%	6,35%	43,18%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	8,85%	1,23%	22,78%	24,35%	1,23%	35,86%	6,02%	43,02%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	8,37%	2,14%	21,63%	22,49%	2,14%	37,94%	6,16%	42,59%
ITAÚ MOMENTO 30 RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	8,40%	5,24%	19,08%	23,30%	5,24%	42,55%	6,93%	41,84%
ITAÚ OLIMPO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	8,58%	5,02%	21,09%	24,09%	5,02%	-	6,68%	41,95%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	7,65%	1,18%	18,83%	18,56%	1,18%	-	5,83%	43,78%

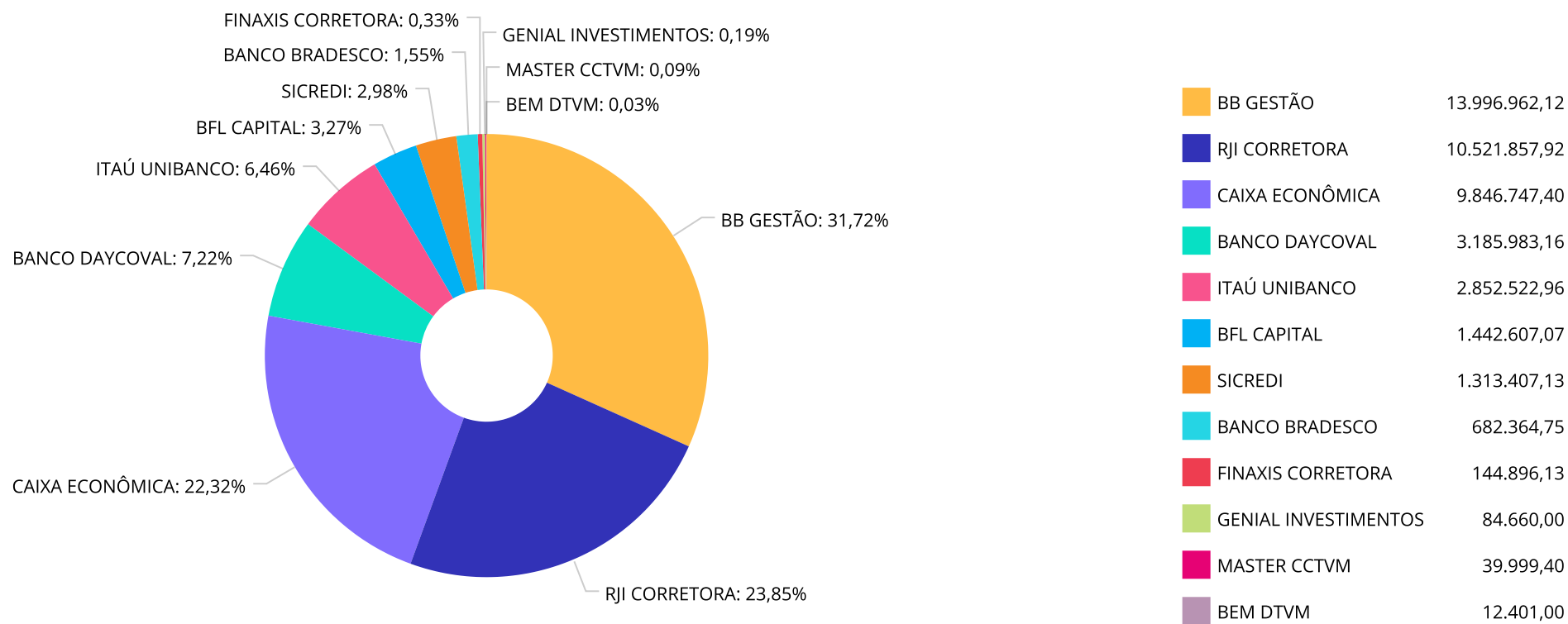
IBX (Benchmark)	9,15%	3,50%	25,34%	25,28%	3,50%	38,06%	-	-
META VALOR RESP LIMITADA FIF AÇÕES	7,50%	4,76%	18,15%	20,09%	4,76%	40,67%	6,83%	51,76%

IFIX (Benchmark)	2,19%	-10,24%	2,69%	2,28%	-10,24%	22,05%	-	-
-------------------------	-------	---------	-------	-------	---------	--------	---	---

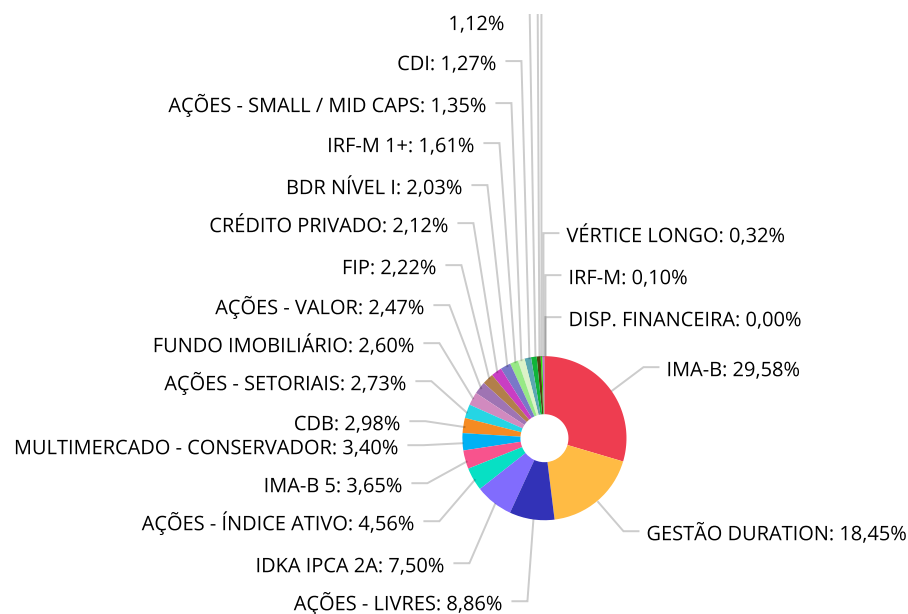
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2020 - RENDA VARIÁVEL, ESTRUTURADOS E FUNDO IMOBILIÁRIO

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES RESP LIMITADA FII - C...	-11,39%	-45,74%	-10,26%	-1,41%	-45,74%	-59,30%	7,42%	51,18%
SP DOWNTOWN FII - SPTW11	-3,42%	-30,71%	-7,76%	19,17%	-30,71%	-	11,58%	42,56%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	-4,97%	-8,15%	-26,02%	-12,28%	-8,15%	35,59%	15,57%	53,39%
TIVIO RENDA IMOBILIÁRIA RESP LIMITADA FII - TVRI11	-9,21%	-27,78%	-10,52%	-24,43%	-27,78%	-11,40%	14,09%	25,82%
HAZ FII - ATCR11	0,15%	2,38%	-0,16%	0,02%	2,38%	385,37%	-	-
IPCA (Benchmark)	1,35%	4,52%	3,13%	4,42%	4,52%	9,02%	-	-
AUSTRO MULTIPAR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-0,29%	-16,76%	-0,87%	-1,82%	-16,76%	-18,36%	0,28%	13,36%
IMOBILIÁRIO PARANÁ REC FIP MULTIESTRATÉGIA	-0,50%	-	-1,45%	-3,12%	-	-11,69%	-	0,48%
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	2,24%	15,45%	5,74%	9,85%	15,45%	33,11%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	-2,41%	-	-3,27%	-4,58%	-	-96,97%	-	82,97%
IPCA + 9,00% ao ano (Benchmark)	2,12%	13,88%	5,38%	9,09%	13,88%	29,52%	-	-
FP2 FIP MULTIESTRATÉGIA	-	-	-	-	-	-	-	-
SMLL (Benchmark)	7,52%	-0,65%	22,54%	25,33%	-0,65%	57,16%	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO RESP LIMITADA FIF AÇÕES	7,60%	-3,23%	21,53%	23,20%	-3,23%	49,75%	6,40%	47,27%

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



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



IMA-B	13.052.015,09	GESTÃO DURATION	8.140.587,64	AÇÕES - LIVRES	3.908.710,15
IDKA IPCA 2A	3.307.163,10	AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	2.012.250,74	IMA-B 5	1.610.062,76
MULTIMERCADO - CONSERVADOR	1.498.969,10	CDB	1.313.407,13	AÇÕES - SETORIAIS	1.203.026,35
FUNDO IMOBILIÁRIO	1.146.049,12	AÇÕES - VALOR	1.090.230,03	FIP	978.582,77
CRÉDITO PRIVADO	937.441,00	BDR NÍVEL I	897.592,61	IRF-M 1+	709.968,43
AÇÕES - SMALL / MID CAPS	597.341,57	CDI	561.829,04	MULTIMERCADO - CRÉDITO PRIVADO	493.623,37
IRF-M 1	334.493,19	FIDC	144.896,13	VÉRTICE LONGO	141.531,87
IRF-M	44.637,85	DISP. FINANCEIRA	0,01		

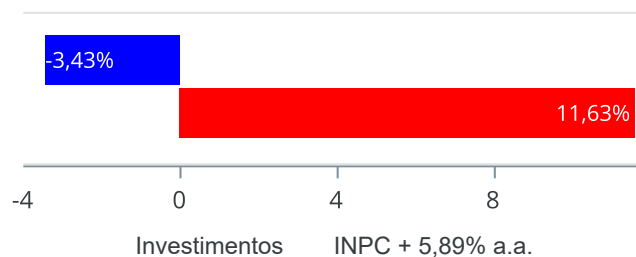
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Dezembro / 2020)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
------------------	------------	--------	------	-------------	------------	---------	----------	----------

Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2020

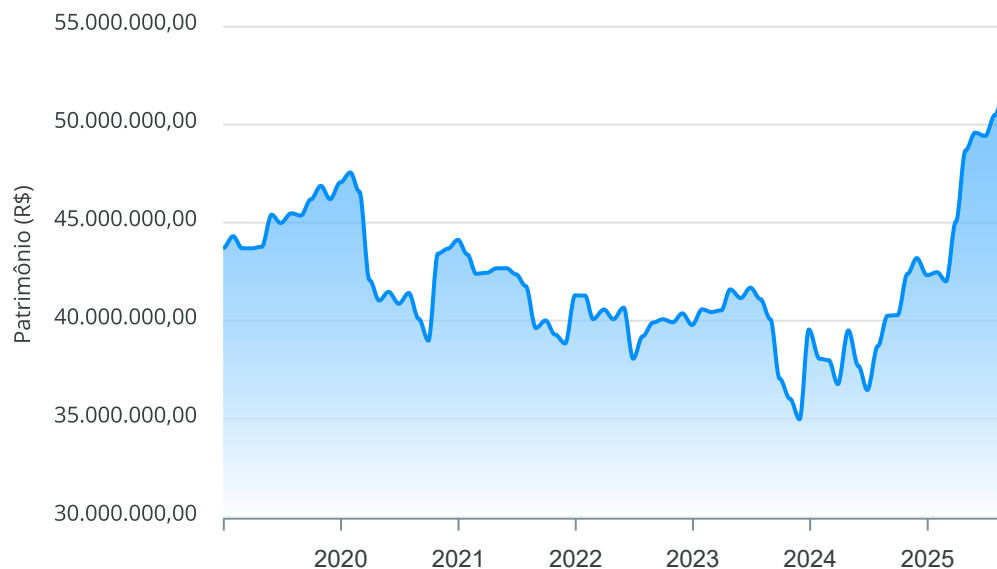
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	47.055.425,39	2.422.019,00	2.034.188,91	47.505.509,53	62.254,05	62.254,05	0,13%	0,13%	0,69%	0,69%	18,97%	3,57%
Fevereiro	47.505.509,53	741.998,43	1.235.261,87	46.536.380,29	-475.865,80	-413.611,75	-1,00%	-0,87%	0,58%	1,28%	-68,31%	4,27%
Março	46.536.380,29	900.214,98	1.398.061,94	42.028.862,47	-4.009.670,86	-4.423.282,61	-8,62%	-9,41%	0,68%	1,97%	-478,62%	19,75%
Abril	42.028.862,47	846.865,72	1.263.774,36	40.979.848,09	-632.105,74	-5.055.388,35	-1,50%	-10,78%	0,22%	2,20%	-490,84%	10,27%
Maio	40.979.848,09	1.979.674,69	4.323.488,01	39.042.759,00	406.724,23	-4.648.664,12	0,99%	-9,89%	0,20%	2,40%	-411,41%	7,24%
Junho	39.042.759,00	3.019.229,14	2.240.179,17	40.819.448,84	997.639,87	-3.651.024,25	2,51%	-7,63%	0,78%	3,20%	-238,35%	6,10%
Julho	40.819.448,84	1.955.081,28	2.373.941,74	41.364.960,73	964.372,35	-2.686.651,90	2,36%	-5,45%	0,97%	4,20%	-129,79%	12,38%
Agosto	41.364.960,73	14.318.226,11	15.879.181,36	39.309.419,58	-494.585,90	-3.181.237,80	-1,20%	-6,58%	0,84%	5,07%	-129,69%	6,38%
Setembro	39.309.419,58	2.423.096,08	2.714.917,60	38.479.771,76	-537.826,30	-3.719.064,10	-1,37%	-7,86%	1,35%	6,49%	-121,00%	6,50%
Outubro	38.479.771,76	1.164.637,63	1.352.848,14	38.292.695,24	1.133,99	-3.717.930,11	0,00%	-7,86%	1,37%	7,96%	-98,74%	5,35%
Novembro	38.292.695,24	7.105.120,12	3.617.261,71	43.485.930,68	1.705.377,03	-2.012.553,08	4,08%	-4,09%	1,41%	9,48%	-43,20%	4,20%
Dezembro	43.485.930,68	3.234.352,11	3.251.039,20	43.772.636,65	303.393,06	-1.709.160,02	0,70%	-3,43%	1,97%	11,63%	-29,45%	2,90%

Investimentos x Meta de Rentabilidade



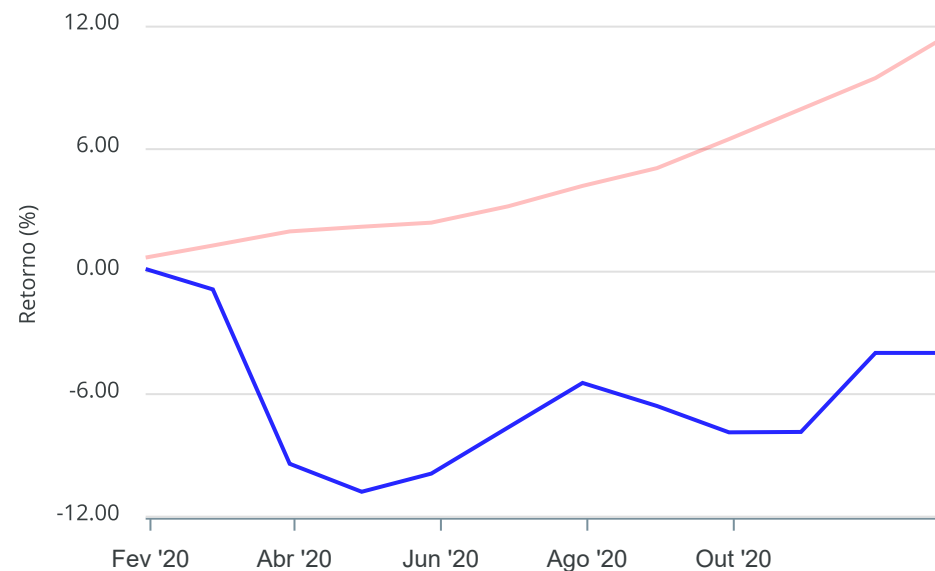
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



Investimentos Meta de Rentabilidade ☐ CDI ☐ IMA-B

☐ IMA-B 5 ☐ IMA-B 5+ ☐ IMA Geral ☐ IRF-M ☐ IRF-M 1

☐ IRF-M 1+ ☐ Ibovespa ☐ IBX ☐ SMLL ☐ IDIV

Investimentos Meta de Rentabilidade ☐ 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 Dezembro/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA ...	2.117.400,10	0,00	0,00	2.219.891,78	102.491,68	4,84%	4,84%	2,04%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA ...	1.366.345,24	0,00	0,00	1.432.419,40	66.074,16	4,84%	4,84%	2,03%
BB IRF-M 1+ RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENC...	688.673,58	0,00	0,00	709.968,43	21.294,85	3,09%	3,09%	1,68%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL RESP LIMITADA FIF ...	5.049.475,02	0,00	0,00	5.185.634,03	136.159,01	2,70%	2,70%	1,09%
CDB - BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.	1.281.366,57	0,00	0,00	1.313.407,13	32.040,56	2,50%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA ...	43.777,87	0,00	0,00	44.637,85	859,98	1,96%	1,96%	1,04%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC R...	911.195,49	0,00	0,00	927.698,01	16.502,52	1,81%	1,81%	0,74%
CAIXA BRASIL IPCA XVI RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA...	921.057,00	0,00	0,00	937.441,00	16.384,00	1,78%	1,78%	0,71%
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF C...	670.446,77	0,00	0,00	682.364,75	11.917,98	1,78%	1,78%	0,77%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FIF ...	2.737.641,24	0,00	0,00	2.773.796,26	36.155,02	1,32%	1,32%	0,55%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII RESP LIMITADA FIF RENDA FI...	139.844,68	0,00	0,00	141.531,87	1.687,19	1,21%	1,21%	0,64%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA...	875.506,02	1.584.041,99	0,00	2.480.541,45	20.993,44	0,85%	1,53%	0,66%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RESP LI...	331.653,64	488.208,92	0,00	826.621,65	6.759,09	0,82%	1,65%	0,71%
CAIXA BRASIL RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERENC...	15.646,94	0,00	0,00	15.703,69	56,75	0,36%	0,36%	0,15%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	4.167.483,35	0,00	0,00	4.180.596,11	13.112,76	0,31%	0,31%	0,37%
BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFEREN...	7.134,71	0,00	0,00	7.152,66	17,95	0,25%	0,25%	0,02%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA...	180.791,86	0,00	0,00	181.157,35	365,49	0,20%	0,20%	0,02%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITAD...	182.873,07	151.089,24	0,00	334.493,19	530,88	0,16%	0,28%	0,10%
BB FLUXO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SIMPLES ...	2.512.977,75	1.162.101,20	3.249.949,96	426.905,64	1.776,65	0,05%	0,10%	0,01%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RESP LIMITADA FIF CI...	98.103,44	115.831,40	101.968,80	112.067,03	100,99	0,05%	0,09%	0,00%

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA PRÁTICO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA CUR...	1.089,11	0,00	1.089,24	0,02	0,15	0,01%	0,01%	0,00%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	145.108,99	0,00	0,00	144.896,13	-212,86	-0,15%	-0,15%	0,01%
IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	546.317,88	0,00	0,00	544.310,01	-2.007,87	-0,37%	-0,37%	0,05%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	4.866.671,29	0,00	0,00	4.674.797,79	-191.873,50	-3,94%	-3,94%	6,03%
Total Renda Fixa	29.858.581,61	3.501.272,75	3.353.008,00	30.298.033,23	291.186,87	0,97%		1,72%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB SELEÇÃO FATORIAL RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	641.440,84	0,00	0,00	2.487.559,46	1.846.118,62	287,81%	10,42%	7,54%
BB SELEÇÃO FATORIAL RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	2.252.757,39	0,00	0,00	2.487.559,46	234.802,07	10,42%	10,42%	7,54%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	548.285,45	0,00	0,00	596.784,03	48.498,58	8,85%	8,85%	6,02%
ITAÚ OLIMPO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	4.978,30	0,00	0,00	5.405,25	426,95	8,58%	8,58%	6,68%
ITAÚ MOMENTO 30 RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	302.774,48	0,00	0,00	328.200,89	25.426,41	8,40%	8,40%	6,93%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	1.301.207,74	0,00	0,00	1.410.061,46	108.853,72	8,37%	8,37%	6,16%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR RESP LIMITADA FIF CIC AÇÃOE...	1.015.326,09	0,00	0,00	1.092.949,80	77.623,71	7,65%	7,65%	5,83%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO RESP LIMITADA FIF AÇÕES	555.152,52	0,00	0,00	597.341,57	42.189,05	7,60%	7,60%	6,40%
META VALOR RESP LIMITADA FIF AÇÕES	1.014.168,91	0,00	0,00	1.090.230,03	76.061,12	7,50%	7,50%	6,83%
BB CONSUMO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	1.030.091,79	0,00	0,00	1.080.611,33	50.519,54	4,90%	4,90%	6,35%
HAZ FII - ATCR11	968.739,92	0,00	0,00	970.139,92	1.400,00	0,14%	0,14%	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	38.797,61	0,00	0,00	38.848,80	51,19	0,13%	-4,97%	15,57%
DAYCOVAL FIF MULTIESTRATÉGIA	1.498.253,97	0,00	0,00	1.498.969,10	715,13	0,05%	0,05%	0,38%
FP2 FIP MULTIESTRATÉGIA	826.625,36	0,00	0,00	826.568,68	-56,68	-0,01%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	122.549,32	0,00	0,00	122.285,31	-264,01	-0,22%	-	-
AUSTRO MULTIPAR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	495.076,40	0,00	0,00	493.623,37	-1.453,03	-0,29%	-0,29%	0,28%
IMOBILIÁRIO PARANÁ REC FIP MULTIESTRATÉGIA	29.877,36	0,00	0,00	29.728,78	-148,58	-0,50%	-	-
SP DOWNTOWN FII - SPTW11	87.919,10	0,00	0,00	84.660,00	-3.259,10	-3,71%	-3,41%	11,58%
AUSTRO INSTITUCIONAL PIPE BANCOS FIC AÇÕES	128.973,67	0,00	0,00	122.415,02	-6.558,65	-5,09%	-5,09%	12,94%
TIVIO RENDA IMOBILIÁRIA RESP LIMITADA FII - TVRI11	13.690,00	0,00	0,00	12.401,00	-1.289,00	-9,42%	-9,21%	14,09%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES RESP L...	45.142,18	0,00	0,00	39.999,40	-5.142,78	-11,39%	-11,39%	7,42%
Total Renda Variável	12.921.828,40	0,00	0,00	15.416.342,66	2.494.514,26	19,30%		6,01%

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR NÍ...	891.410,13	0,00	0,00	897.592,61	6.182,48	0,69%	0,69%	7,07%
Total Exterior	891.410,13	0,00	0,00	897.592,61	6.182,48	0,69%		7,07%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL RESP LIMITADA FIF ...	5.002.701,71	0,00	0,00	5.185.634,03	182.932,32	3,66%	3,66%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA ...	2.483.371,77	0,00	419.946,51	2.219.891,78	156.466,52	6,30%	7,13%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA ...	1.337.026,24	0,00	0,00	1.432.419,40	95.393,16	7,13%	7,13%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	4.289.065,50	0,00	171.806,65	4.180.596,11	63.337,26	1,48%	-2,53%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FIF ...	2.718.306,31	0,00	0,00	2.773.796,26	55.489,95	2,04%	2,04%
CDB - BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.	1.281.482,57	0,00	0,00	1.313.407,13	31.924,56	2,49%	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA...	118.930,00	2.334.041,99	0,00	2.480.541,45	27.569,46	1,12%	3,22%
CAIXA BRASIL IPCA XVI RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA...	911.250,00	0,00	0,00	937.441,00	26.191,00	2,87%	2,87%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC R...	154.912,87	750.000,00	0,00	927.698,01	22.785,14	2,52%	3,31%
BB IRF-M 1+ RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENC...	689.430,93	0,00	0,00	709.968,43	20.537,50	2,98%	2,98%
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF C...	309.834,89	355.000,00	0,00	682.364,75	17.529,86	2,64%	3,23%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RESP LI...	327.163,18	488.208,92	0,00	826.621,65	11.249,55	1,38%	3,05%
BB FLUXO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SIMPLES ...	2.369.702,99	3.182.173,66	5.129.666,49	426.905,64	4.695,48	0,08%	0,22%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII RESP LIMITADA FIF RENDA FI...	137.551,67	0,00	0,00	141.531,87	3.980,20	2,89%	2,89%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA ...	47.987,78	0,00	4.217,56	44.637,85	867,63	1,81%	1,99%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA...	180.462,95	0,00	0,00	181.157,35	694,40	0,38%	0,38%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITAD...	19.314,58	314.578,43	0,00	334.493,19	600,18	0,18%	0,64%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RESP LIMITADA FIF CI...	420.525,64	723.556,01	1.032.458,24	112.067,03	443,62	0,04%	0,26%
CAIXA BRASIL RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERENC...	26.454,40	0,00	10.874,94	15.703,69	124,23	0,47%	0,64%
BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFEREN...	7.112,12	0,00	0,00	7.152,66	40,54	0,57%	0,57%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA PRÁTICO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA CUR...	0,00	153.582,66	153.606,23	0,02	23,59	0,02%	0,04%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	145.560,15	0,00	0,00	144.896,13	-664,02	-0,46%	-0,46%
IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	606.574,08	0,00	56.482,12	544.310,01	-5.781,95	-0,95%	-10,26%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	4.928.064,08	0,00	247.003,98	4.674.797,79	-6.262,31	-0,13%	-5,14%
Total Renda Fixa	28.512.786,41	8.301.141,67	7.226.062,72	30.298.033,23	710.167,87	2,40%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre/2020

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB SELEÇÃO FATORIAL RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	1.497.172,44	500.000,00	0,00	2.487.559,46	490.387,02	24,55%	28,14%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	1.210.945,09	0,00	0,00	1.410.061,46	199.116,37	16,44%	21,63%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR RESP LIMITADA FIF CIC AÇÃO...	457.289,77	500.000,00	0,00	1.092.949,80	135.660,03	14,17%	18,83%
DAYCOVAL IBOVESPA ATIVO FI AÇÕES	486.049,25	0,00	0,00	596.784,03	110.734,78	22,78%	22,78%
META VALOR RESP LIMITADA FIF AÇÕES	0,00	983.712,62	0,00	1.090.230,03	106.517,41	10,83%	18,14%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO RESP LIMITADA FIF AÇÕES	491.518,34	0,00	0,00	597.341,57	105.823,23	21,53%	21,53%
BB CONSUMO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	976.923,10	0,00	0,00	1.080.611,33	103.688,23	10,61%	10,61%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX RESP LIMITADA FIF CIC A...	659.965,50	0,00	698.821,13	0,00	38.855,63	5,89%	17,87%
ITAÚ MOMENTO 30 RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	0,00	298.821,13	0,00	328.200,89	29.379,76	9,83%	19,08%
CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR NÍ...	885.959,38	0,00	0,00	897.592,61	11.633,23	1,31%	1,31%
ITAÚ OLIMPO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	4.463,84	0,00	0,00	5.405,25	941,41	21,09%	21,09%
FP2 FIP MULTIESTRATÉGIA	826.739,88	0,00	0,00	826.568,68	-171,20	-0,02%	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	39.647,60	0,00	560,00	38.848,80	-238,80	-0,60%	-26,02%
IMOBILIÁRIO PARANÁ REC FIP MULTIESTRATÉGIA	30.166,89	0,00	0,00	29.728,78	-438,11	-1,45%	-1,45%
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTIESTRATÉGIA	122.980,88	0,00	0,00	122.285,31	-695,57	-0,57%	-3,27%
DAYCOVAL FIF MULTIESTRATÉGIA	0,00	1.500.000,00	0,00	1.498.969,10	-1.030,90	-0,07%	0,07%
TIVIO RENDA IMOBILIÁRIA RESP LIMITADA FII - TVRI11	13.870,00	0,00	216,46	12.401,00	-1.252,54	-9,03%	-10,52%
HAZ FII - ATR11	971.681,95	0,00	0,00	970.139,92	-1.542,03	-0,16%	-0,16%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTI...	586.093,49	0,00	583.712,62	0,00	-2.380,87	-0,41%	-
SP DOWNTOWN FII - SPTW11	90.690,00	0,00	2.580,00	84.660,00	-3.450,00	-3,80%	-7,76%
Total Renda Variável	9.352.157,40	3.782.533,75	1.285.890,21	13.170.338,02	1.321.537,08	11,15%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no ano de 2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA ...	2.508.430,74	0,00	419.946,51	2.219.891,78	131.407,55	6,07%	6,06%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL RESP LIMITADA FIF ...	0,00	5.086.327,23	0,00	5.185.634,03	99.306,80	1,96%	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA ...	1.349.552,00	0,00	0,00	1.432.419,40	82.867,40	6,15%	6,14%
CDB - BANCO COOPERATIVO SICREDI S.A.	730.689,44	500.000,00	0,00	1.313.407,13	82.717,69	6,73%	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.483.081,74	0,00	2.563.696,80	0,00	80.615,06	3,26%	5,09%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA RESP LIMITADA FIF ...	1.064.735,23	2.139.714,37	500.000,00	2.773.796,26	69.346,66	6,80%	6,66%
CAIXA BRASIL IPCA XVI RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA...	871.338,00	0,00	0,00	937.441,00	66.103,00	7,59%	7,59%
BB IRF-M 1+ RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA PREVIDENC...	658.538,15	0,00	0,00	709.968,43	51.430,28	7,81%	7,81%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA...	113.759,54	2.334.041,99	0,00	2.480.541,45	32.739,92	6,53%	7,92%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	1.593.195,68	0,00	1.624.205,94	0,00	31.010,26	1,95%	-
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF C...	296.541,04	355.000,00	0,00	682.364,75	30.823,71	7,31%	7,86%
ITAÚ INSTITUCIONAL IMA-B 5 RESP LIMITADA FIF CIC R...	148.418,84	750.000,00	0,00	927.698,01	29.279,17	7,16%	7,83%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF REN...	2.543.291,44	0,00	2.569.070,87	0,00	25.779,43	1,02%	5,06%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS RESP LI...	857.106,99	488.208,92	543.056,00	826.621,65	24.361,74	6,67%	8,03%
SINGAPORE FIC RENDA FIXA	2.362.137,71	0,00	2.384.619,98	0,00	22.482,27	0,96%	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA ...	375.309,15	0,00	391.973,98	0,00	16.664,83	4,45%	6,43%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII RESP LIMITADA FIF RENDA FI...	397.649,73	0,00	269.451,54	141.531,87	13.333,68	5,50%	5,61%
BB FLUXO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA SIMPLES ...	147.813,37	8.204.057,41	7.935.143,80	426.905,64	10.178,66	1,30%	1,64%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES RESP LIMITADA FIF CI...	180.209,07	11.421.909,06	11.498.901,03	112.067,03	8.849,93	0,70%	1,90%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITA...	1.477.469,21	0,00	1.485.531,78	0,00	8.062,57	0,55%	5,23%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no ano de 2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
ITAÚ IMA-B ATIVO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA	145.731,72	0,00	151.950,83	0,00	6.219,11	4,26%	7,53%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITAD...	218.835,71	314.578,43	205.000,00	334.493,19	6.079,05	3,27%	3,63%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IX FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRI...	290.992,55	0,00	296.598,35	0,00	5.605,80	1,92%	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA RESP LIMITADA...	176.117,25	0,00	0,00	181.157,35	5.040,10	2,86%	2,86%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS RESP LIMITADA FIF RENDA ...	46.000,93	0,00	4.217,56	44.637,85	2.854,48	6,38%	6,40%
CAIXA BRASIL RESP LIMITADA FIF RENDA FIXA REFERENC...	25.995,51	0,00	10.874,94	15.703,69	583,12	2,37%	2,42%
BB PERFIL RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA REFEREN...	6.985,06	0,00	0,00	7.152,66	167,60	2,41%	2,40%
CAIXA PRÁTICO RESP LIMITADA FIF CIC RENDA FIXA CUR...	0,00	153.582,66	153.606,23	0,02	23,59	0,03%	0,15%
PREMIUM FIDC SÊNIOR 1	152.249,16	0,00	0,00	144.896,13	-7.353,03	-4,84%	-4,83%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	2.894.228,36	2.369.407,85	521.452,82	4.674.797,79	-67.385,60	-1,55%	-11,41%
IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	2.133.232,21	0,00	1.295.522,03	544.310,01	-293.400,17	-14,74%	-74,48%
TMJ IMA-B FI RENDA FIXA	7.568.482,34	0,00	2.763.230,96	4.180.596,11	-624.655,27	-8,19%	-44,76%
Total Renda Fixa	33.818.117,87	34.116.827,92	37.588.051,95	30.298.033,23	-48.860,61	-0,07%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no ano de 2020

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB SELEÇÃO FATORIAL RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	0,00	2.105.026,89	0,00	2.487.559,46	382.532,57	94,01%	14,03%
CAIXA INSTITUCIONAL RESP LIMITADA FIF AÇÕES BDR NÍ...	579.979,21	0,00	0,00	897.592,61	317.613,40	54,75%	54,76%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR RESP LIMITADA FIF CIC AÇÃOE...	0,00	978.435,38	0,00	1.092.949,80	114.514,42	8,03%	1,18%
META VALOR RESP LIMITADA FIF AÇÕES	0,00	983.712,62	0,00	1.090.230,03	106.517,41	7,41%	4,76%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPAATIVO FIC AÇÕES	1.212.594,53	151.950,83	0,00	1.410.061,46	45.516,10	2,14%	2,14%
BB CONSUMO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	414.299,67	628.407,59	0,00	1.080.611,33	37.904,07	1,59%	0,88%
ITAÚ MOMENTO 30 RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	0,00	298.821,13	0,00	328.200,89	29.379,76	9,83%	5,24%
HAZ FII - ATCR11	947.587,88	0,00	1.116,18	970.139,92	23.668,22	2,50%	2,38%
DAYCOVAL IBOVESPAATIVO FI AÇÕES	589.538,02	0,00	0,00	596.784,03	7.246,01	1,24%	1,23%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTI...	577.917,00	0,00	583.712,62	0,00	5.795,62	0,99%	-
ITAÚ OLIMPO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	0,00	3.784,43	0,00	5.405,25	1.620,82	47,14%	5,02%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MUL...	565.235,00	0,00	565.862,50	0,00	627,50	0,11%	-
FP2 FIP MULTIESTRATÉGIA	826.874,91	0,00	0,00	826.568,68	-306,23	-0,07%	-
DAYCOVAL FIF MULTIESTRATÉGIA	0,00	1.500.000,00	0,00	1.498.969,10	-1.030,90	-0,07%	3,42%
IMOBILIÁRIO PARANÁ REC FIP MULTIESTRATÉGIA	31.539,66	0,00	0,00	29.728,78	-1.810,88	-5,74%	-
TIVIO RENDA IMOBILIÁRIA RESP LIMITADA FII - TVRI11	17.111,00	0,00	1.170,93	12.401,00	-3.539,07	-21,55%	-27,78%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	50.007,12	0,00	5.045,60	38.848,80	-6.112,72	-12,45%	-8,15%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO RESP LIMITADA FIF AÇÕES	617.279,24	0,00	0,00	597.341,57	-19.937,67	-3,24%	-3,23%
SP DOWNTOWN FII - SPTW11	121.300,00	0,00	12.430,00	84.660,00	-24.210,00	-18,84%	-30,71%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES RESP L...	73.713,18	0,00	704,38	39.999,40	-33.009,40	-44,99%	-45,74%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no ano de 2020

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA BRASIL ETF IBOVESPA RESP LIMITADA FIF AÇÕES	531.884,04	0,00	478.435,38	0,00	-53.448,66	-10,05%	2,57%
AUSTRO MULTIPAR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	592.977,13	0,00	0,00	493.623,37	-99.353,76	-16,75%	-16,76%
BB DIVIDENDOS RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	767.131,64	0,00	628.407,59	0,00	-138.724,05	-18,09%	-7,93%
AUSTRO INSTITUCIONAL PIPE BANCOS FIC AÇÕES	325.131,80	0,00	0,00	122.415,02	-202.716,78	-62,35%	-62,35%
BB IBOVESPA INDEXADO RESP LIMITADA FIF CIC AÇÕES	1.825.396,17	0,00	1.605.026,89	0,00	-220.369,28	-12,08%	1,14%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX RESP LIMITADA FIF CIC A...	987.566,40	0,00	698.821,13	0,00	-288.745,27	-29,23%	-21,23%
GERAÇÃO DE ENERGIA FIP MULTISTRATÉGIA	1.582.243,92	0,00	0,00	122.285,31	-1.459.958,61	-92,27%	-
Total Renda Variável	13.237.307,52	6.650.138,87	4.580.733,20	13.826.375,81	-1.480.337,38	-9,67%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no ano de 2020

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
Total Exterior	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00	0,00%	

Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da CRÉDITO E MERCADO CONSULTORIA DE INVESTIMENTOS.. As informações aqui contidas, tem por somente, o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre o(s) produto(s) mencionado(s), entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros exigidos legalmente. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas aos objetivos, aos riscos e à política de investimento do(s) produto(s). Todas as informações podem ser obtidas com os responsáveis pela distribuição, administração, gestão ou no próprio site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários) através do link: <https://www.gov.br/cvm/pt-br>.

Sua elaboração buscou atender os objetivos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil de investidor.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas aos investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de Consultoria de Valores Mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe a Consultoria de Valores Mobiliários a prestação dos serviços de ORIENTAÇÃO, RECOMENDAÇÃO E ACONSELHAMENTO, DE FORMA PROFISSIONAL, INDEPENDENTE E INDIVIDUALIZADA, SOBRE INVESTIMENTOS NO MERCADO DE VALORES MOBILIÁRIOS, CUJA ADOÇÃO E IMPLEMENTAÇÃO SEJAM EXCLUSIVAS DO CLIENTE (Resolução CVM nº 19/2021).

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no Art. 3º da Resolução CMN nº 4.963/2021, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria MTP nº 1.467/2022, art. 84, inciso III, alínea "a".

Os RPPS DEVEM, independente da contratação de Consultoria de Valores Mobiliários, se adequar às normativas pertinentes e principalmente a Portaria MTP nº 1.467/2022 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 4.963/2021, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.

