

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos
Relatório Analítico dos Investimentos

em agosto de 2020



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

Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	2.885.932,81	2,00%	1.359	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	7.277.060,89	5,05%	130	0,73%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	817.288,28	0,57%	1.244	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	8.893.046,82	6,17%	905	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	5.888.947,11	4,08%	627	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	20.029.610,93	13,89%	852	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	2.486.298,92	1,72%	932	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	15/08/2024	1.527.232,00	1,06%	26	0,87%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	2.190.414,84	1,52%	673	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	9.685.591,72	6,72%	970	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	3.631.283,76	2,52%	892	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	84.312,29	0,06%	65	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.964.160,27	2,75%	64	0,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
SICREDI INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIAD...	D+1	Não há	824.115,06	0,57%	458	0,18%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	525.390,90	0,36%	696	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' '
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA L...	D+1	Não há	4.293.871,84	2,98%	49	7,46%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	10.011.474,27	6,94%	289	0,20%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3 du	Não há	6.584.911,76	4,57%	361	0,34%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	2.595.876,39	1,80%	590	0,10%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' '
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	4.508.725,22	3,13%	122	0,24%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' '

Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2020)

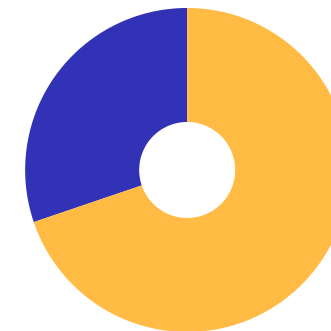
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	D+0	Não há	1.477.212,65	1,02%	118	0,13%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	142.684,44	0,10%	54	0,16%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FIAÇÕES	D+4	Não há	4.332.069,20	3,00%	1.800	1,54%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
SICREDI SCHROEDERS IBOVESPA FIAÇÕES	D+4	Não há	1.204.917,96	0,84%	11.308	0,28%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	4.326.012,11	3,00%	47.653	0,11%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
ATHENA TOTAL RETURN INSTITUCIONAL II FIAÇÕES	D+7 du ...	Não há	448.224,67	0,31%	19	2,36%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
BRADESCO SELECTION FIAÇÕES	D+4	Não há	634.385,27	0,44%	204	0,09%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	1.667.844,66	1,16%	1.650	0,18%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
META VALOR FIAÇÕES	D+4	Não há	6.389.953,83	4,43%	193	2,31%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
MULTINVEST FIAÇÕES	D+11	Não há	1.863.743,60	1,29%	300	1,93%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	5.417.812,39	3,76%	12.586	0,65%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIAÇÕES	D+15	Não há	3.127.858,31	2,17%	8.187	0,32%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
BRADESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	D+1	Não há	1.002.709,99	0,70%	28	0,35%	Artigo 8º, Inciso III
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	1.021.487,47	0,71%	41	2,65%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	499.156,30	0,35%	80	0,06%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	4.067.661,11	2,82%	20.483	0,17%	Artigo 8º, Inciso III
MULTINVEST FORTUNA FI MULTIMERCADO	D+11	Não há	491.043,32	0,34%	183	1,49%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	3.961.320,93	2,75%	19.855	0,08%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	3.100.000,00	2,15%		1,27%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	Término...	Não há	294.070,99	0,20%		0,00%	Desenquadrado - RF

Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
Total para cálculo dos limites da Resolução			144.175.715,28				

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

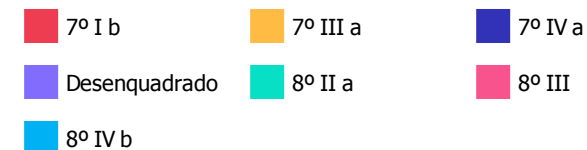
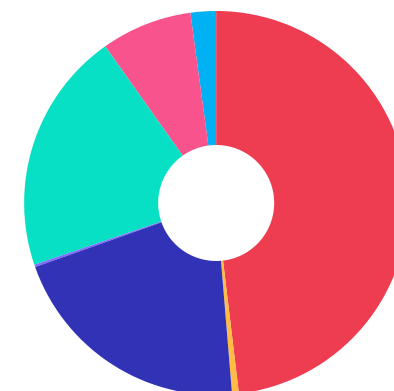
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	69.361.180,64	48,11%	20,00%	30,00%	90,00%	60.396.963,11
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	824.115,06	0,57%	0,00%	10,00%	60,00%	85.681.314,11
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	30.140.147,47	20,91%	10,00%	30,00%	40,00%	27.530.138,64
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	21.626.357,29
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	7.208.785,76
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	7.208.785,76
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	7.208.785,76
Desenquadrado - RF	0,00%	294.070,99	0,20%	0,00%	0,00%	0,00%	-294.070,99
Total Renda Fixa	100,00%	100.619.514,16	69,79%	30,00%	70,00%	220,00%	



RENDA FIXA 100.619.514,16
RENDA VARIÁVEL 43.556.201,12

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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	29.412.822,00	20,40%	7,00%	15,00%	20,00%	-577.678,94
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	11.043.379,12	7,66%	7,00%	10,00%	10,00%	3.374.192,41
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	7.208.785,76
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	3.100.000,00	2,15%	0,00%	5,00%	5,00%	4.108.785,76
Total Renda Variável	30,00%	43.556.201,12	30,21%	14,00%	30,00%	40,00%	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	57.661.242,44	39,99	0,01
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	23.376.566,80	16,21	0,00
ITAÚ UNIBANCO	19.863.171,59	13,78	0,00
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	13.422.881,37	9,31	0,00
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	7.459.927,51	5,17	0,48
META ASSET MANAGEMENT	6.389.953,83	4,43	2,28
INFINITY ASSET MANAGEMENT	5.458.043,75	3,79	1,03
AZ QUEST INVESTIMENTOS	5.417.812,39	3,76	0,02
MULTINVEST CAPITAL	2.354.786,92	1,63	0,48
SCHRODER INVESTMENT MANAGEMENT...	1.204.917,96	0,84	0,03
SICREDI	824.115,06	0,57	0,60
ATHENA CAPITAL	448.224,67	0,31	0,02
MACROINVEST GESTÃO DE RECURSOS	294.070,99	0,20	3,01

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 '	69.361.180,64	48,11	20,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	824.115,06	0,57	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	30.140.147,47	20,91	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 II, Alínea ' a '	29.412.822,00	20,40	7,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	11.043.379,12	7,66	7,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	3.100.000,00	2,15	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00

Artigo 14º - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR)

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 PRÉ 2 ANOS (Benchmark)	-0,36%	7,17%	1,23%	5,08%	10,88%	28,55%	-	-
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	-0,39%	7,04%	1,21%	4,91%	10,58%	27,98%	0,01%	0,02%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	1,03%	5,39%	2,99%	4,11%	9,71%	23,52%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,69%	4,43%	2,73%	3,38%	8,67%	21,54%	0,01%	0,03%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,79%	4,80%	2,82%	3,70%	8,84%	21,88%	0,01%	0,03%
IMA-B 5+ (Benchmark)	-3,62%	-2,01%	6,38%	-2,35%	4,71%	44,71%	-	-
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	1,33%	3,84%	6,02%	3,77%	6,80%	19,15%	0,02%	0,09%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,12%	2,96%	0,64%	2,12%	5,06%	12,83%	-	-
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	0,11%	2,81%	0,62%	2,03%	4,85%	12,37%	0,00%	0,01%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,09%	2,78%	0,58%	1,99%	4,77%	12,31%	0,00%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,10%	2,83%	0,60%	2,03%	4,85%	12,44%	0,00%	0,01%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,43%	4,63%	2,55%	3,39%	9,24%	25,01%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,39%	4,45%	2,48%	3,24%	8,93%	24,43%	0,01%	0,04%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	0,41%	4,53%	2,47%	3,32%	9,06%	24,40%	0,01%	0,04%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,37%	4,46%	2,43%	3,21%	8,96%	24,42%	0,01%	0,04%

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%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,85%	0,64%	4,50%	-0,06%	6,38%	35,28%	0,02%	0,11%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	-1,83%	0,82%	4,70%	0,08%	6,70%	36,30%	0,02%	0,11%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,83%	0,54%	4,54%	-0,14%	6,20%	35,19%	0,02%	0,11%
SICREDI INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-1,88%	0,05%	4,44%	-0,79%	5,68%	34,52%	0,02%	0,11%
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-2,48%	0,67%	0,47%	1,54%	5,84%	21,37%	0,02%	0,07%

CDI (Benchmark)	0,16%	2,12%	0,57%	1,43%	3,86%	10,38%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	0,16%	1,89%	0,66%	1,24%	3,51%	9,88%	0,00%	0,00%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,15%	1,77%	0,64%	1,12%	3,36%	9,69%	0,00%	0,00%
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	0,99%	4,43%	3,55%	3,71%	6,37%	13,57%	0,01%	0,03%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO	0,18%	1,80%	0,68%	1,16%	3,42%	9,79%	0,00%	0,00%

IPCA (Benchmark)	0,24%	0,70%	0,86%	0,24%	2,44%	5,95%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,13%	2,70%	0,86%	2,09%	4,74%	18,63%	0,00%	0,01%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	-0,56%	5,06%	1,17%	3,57%	9,21%	27,35%	0,01%	0,03%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,05%	-	1,81%	-	-	-	0,01%	-

Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	-	-	-	-	-	-	0,00%	-

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

Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
-----	-----	----	----	-----	-----	---------	------------------

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IBX (Benchmark)	-3,38%	-13,46%	14,15%	-4,51%	-1,12%	33,35%	-	-
META VALOR FIAÇÕES	-2,00%	-6,24%	19,10%	-1,03%	13,72%	51,36%	0,12%	0,51%

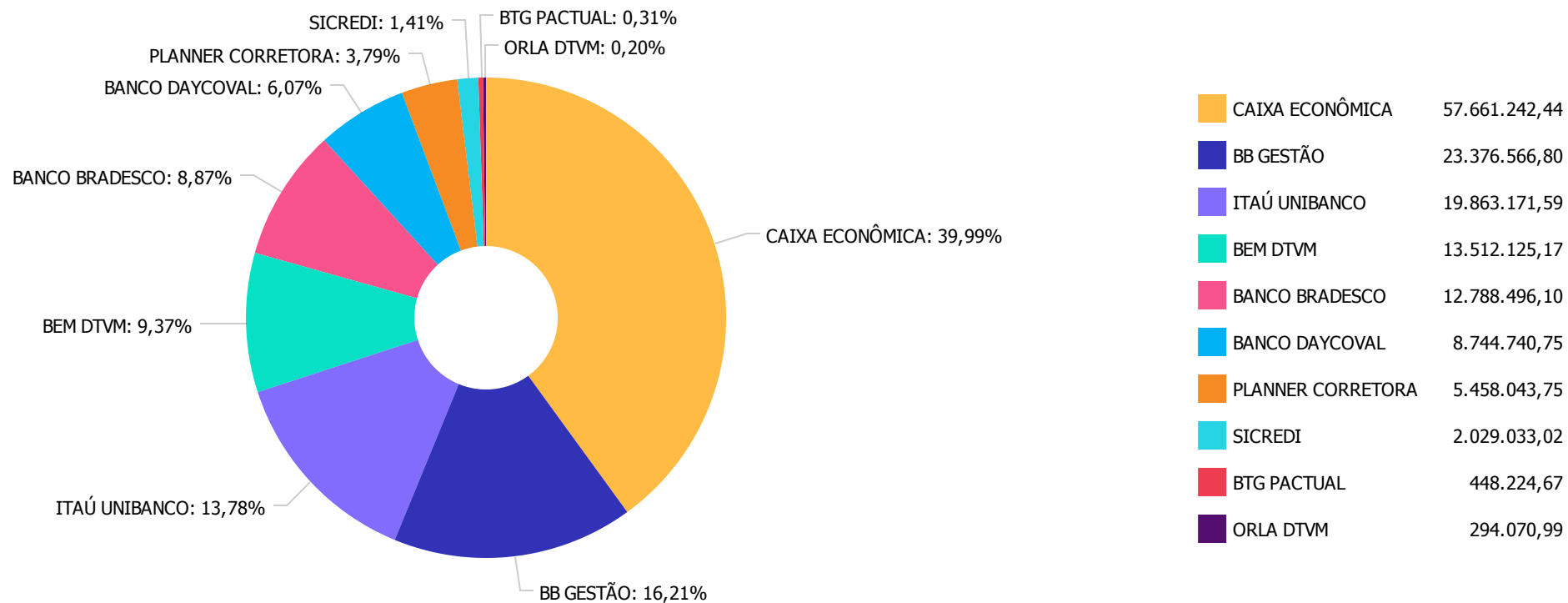
Ibovespa (Benchmark)	-3,44%	-14,07%	13,69%	-4,61%	-1,75%	29,59%	-	-
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	-1,98%	-12,25%	17,24%	-7,84%	-2,23%	32,56%	0,11%	0,44%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FIAÇÕES	-5,77%	-18,10%	10,83%	-10,38%	-4,54%	26,26%	0,09%	0,40%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FIAÇÕES	-6,24%	-17,19%	8,81%	-13,91%	-0,49%	50,93%	0,08%	0,40%
MULTINVEST FIAÇÕES	-3,86%	-10,44%	16,31%	-7,23%	6,75%	46,43%	0,11%	0,43%
SICREDI SCHRODERS IBOVESPA FIAÇÕES	-2,81%	-13,25%	16,13%	-6,10%	0,84%	36,42%	0,10%	0,39%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-3,55%	-15,94%	10,23%	-6,32%	-2,66%	48,05%	0,10%	0,35%
BRADESCO SELECTION FIAÇÕES	-1,15%	-17,90%	18,53%	-6,49%	-9,95%	23,51%	0,10%	0,40%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-0,20%	-16,55%	17,29%	-7,31%	-2,64%	42,50%	0,09%	0,41%

CDI (Benchmark)	0,16%	2,12%	0,57%	1,43%	3,86%	10,38%	-	-
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	1,23%	4,76%	3,98%	4,67%	7,00%	14,00%	0,01%	0,04%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	-0,78%	-1,51%	4,29%	1,17%	4,36%	18,02%	0,03%	0,11%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	-0,14%	0,22%	2,54%	1,07%	5,57%	24,78%	0,01%	0,07%
BRADESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	-0,21%	4,84%	1,12%	3,95%	8,43%	15,94%	0,01%	0,02%
MULTINVEST FORTUNA FI MULTIMERCADO	-1,11%	-1,39%	2,64%	-1,41%	0,80%	29,28%	0,03%	0,08%

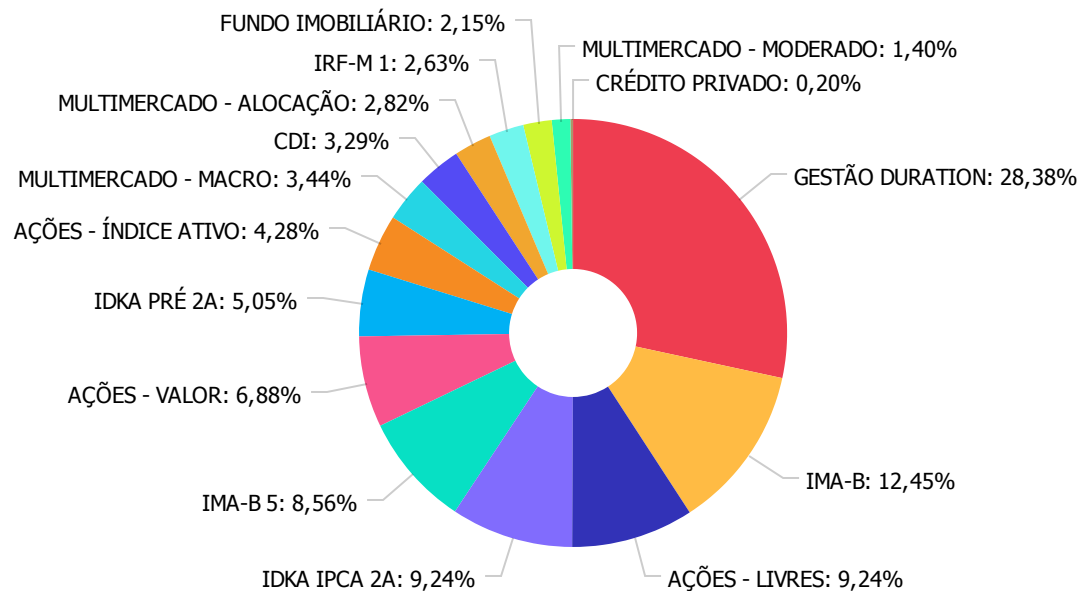
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	-10,41%	4,03%	19,23%	5,16%	41,29%	63,76%	0,11%	0,46%
ATHENA TOTAL RETURN INSTITUCIONAL II FIAÇÕES	-2,85%	-19,02%	11,89%	-15,73%	-5,98%	50,23%	0,08%	0,44%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	-0,23%	0,62%	4,58%	2,70%	-	-	0,03%	-

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



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

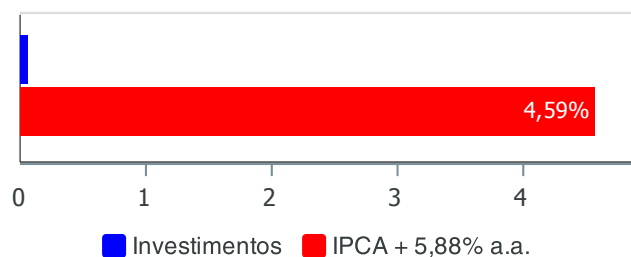


GESTÃO DURATION	40.919.868,80
IMA-B	17.943.533,94
AÇÕES - LIVRES	13.319.907,48
IDKA IPCA 2A	13.316.875,48
IMA-B 5	12.339.406,30
AÇÕES - VALOR	9.921.542,09
IDKA PRÉ 2A	7.277.060,89
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	6.171.372,43
MULTIMERCADO - MACRO	4.964.030,92
CDI	4.741.164,38
MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	4.067.661,11
IRF-M 1	3.787.533,38
FUNDO IMOBILIÁRIO	3.100.000,00
MULTIMERCADO - MODERADO	2.011.687,09
CRÉDITO PRIVADO	294.070,99

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

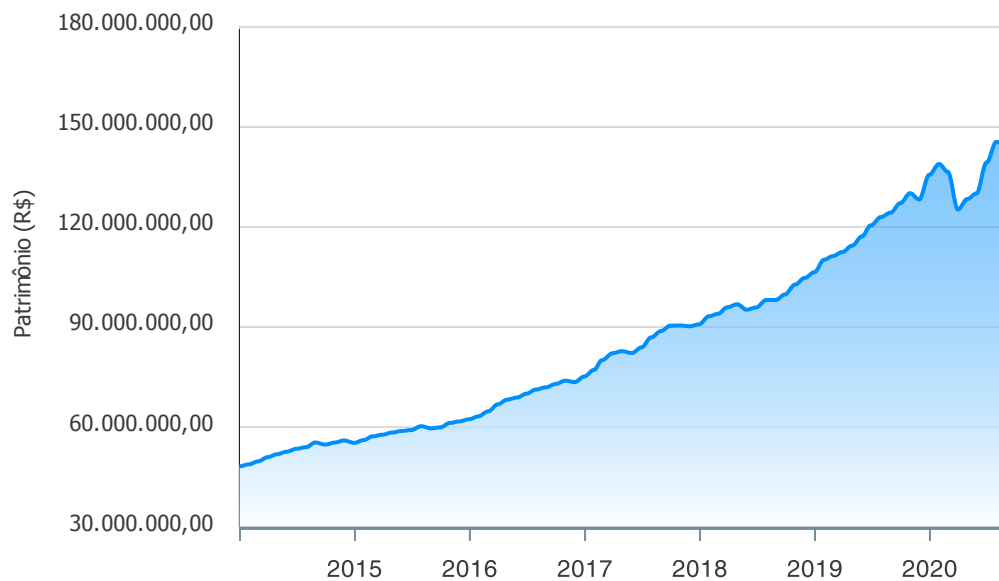
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	132.811.185,40	2.046.060,74	81.831,38	136.141.736,69	1.366.321,93	1.366.321,93	1,01%	1,01%	0,71%	0,71%	142,56%	3,21%
Fevereiro	136.141.736,69	2.514.582,81	2.094.382,31	133.874.815,93	-2.687.121,26	-1.320.799,33	-1,97%	-0,97%	0,66%	1,38%	-70,79%	4,77%
Março	133.874.815,93	5.729.115,99	5.941.084,37	121.293.941,01	-12.368.906,54	-13.689.705,87	-9,24%	-10,12%	0,57%	1,95%	-518,06%	16,44%
Abril	121.293.941,01	8.878.104,74	9.019.382,64	124.555.675,02	3.403.011,91	-10.286.693,96	2,81%	-7,60%	0,14%	2,10%	-361,99%	8,52%
Mai	124.555.675,02	3.913.305,53	5.719.595,02	126.291.021,75	3.541.636,22	-6.745.057,74	2,84%	-4,97%	0,07%	2,17%	-228,78%	4,44%
Junho	126.291.021,75	10.532.923,34	5.054.693,82	135.698.163,70	3.928.912,43	-2.816.145,31	2,98%	-2,14%	0,74%	2,93%	-73,10%	4,24%
Julho	135.698.163,70	12.700.196,22	11.083.716,07	141.995.640,34	4.680.996,49	1.864.851,18	3,41%	1,20%	0,88%	3,84%	31,13%	3,26%
Agosto	141.995.640,34	8.683.188,34	8.284.127,33	140.796.426,00	-1.598.275,35	266.575,83	-1,12%	0,06%	0,72%	4,59%	1,29%	3,18%

Investimentos x Meta Atuarial



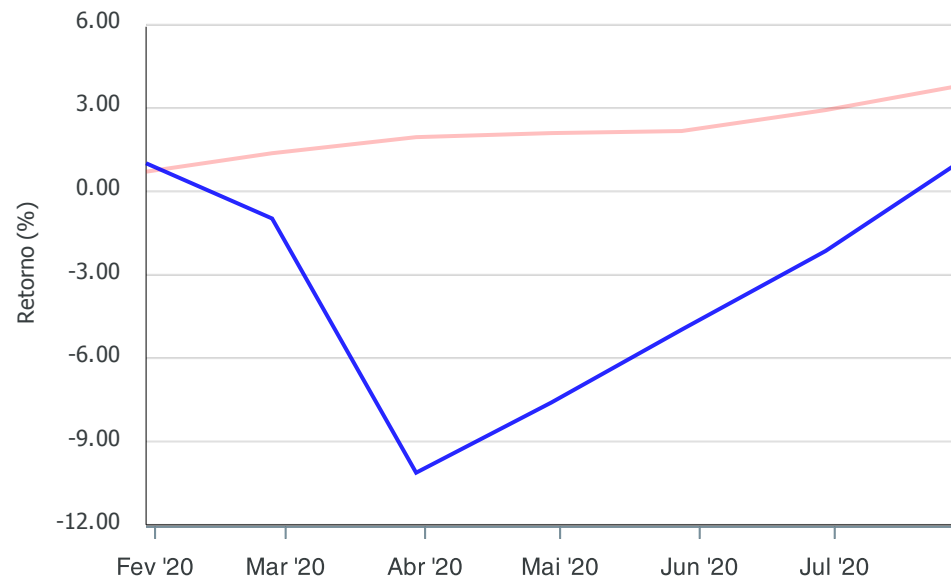
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



- Investimentos Meta Atuarial CDI IMA-B IMA-B 5
- IMA-B 5+ IMA Geral IRF-M IRF-M 1 IRF-M 1+
- Ibovespa IBX SMLL IDIV

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	4.237.455,45	0,00	0,00	4.293.871,84	56.416,39	1,33%	1,33%	1,84%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	3.606.538,43	0,00	0,00	3.631.283,76	24.745,33	0,69%	0,69%	0,74%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	7.612.313,22	2.009.718,91	0,00	9.685.591,72	63.559,59	0,66%	0,79%	0,77%
ITAÚ INSTITUCIONAL INFLAÇÃO 5 FIC RENDA FIXA	3.948.065,48	0,00	0,00	3.964.160,27	16.094,79	0,41%	0,41%	0,82%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.476.595,61	0,00	0,00	2.486.298,92	9.703,31	0,39%	0,39%	0,83%
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	2.135.882,87	0,00	2.000.000,00	142.684,44	6.801,57	0,32%	0,99%	0,88%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.764.290,64	2.107.833,54	0,00	5.888.947,11	16.822,93	0,29%	0,37%	0,81%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	2.591.180,93	0,00	0,00	2.595.876,39	4.695,46	0,18%	0,18%	0,03%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	524.630,33	0,00	0,00	525.390,90	760,57	0,14%	0,14%	0,03%
ITAÚ INSTITUCIONAL FI REFERENCIADO DI	1.139.763,73	446.092,92	110.411,53	1.477.212,65	1.767,53	0,11%	0,16%	0,04%
CAIXA BRASIL 2020 II TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.176.749,00	0,00	2.179.173,00	0,00	2.424,00	0,11%	-	0,18%
ITAÚ SOBERANO IRF-M 1 FI RENDA FIXA	84.222,52	0,00	0,00	84.312,29	89,77	0,11%	0,11%	0,15%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	3.321.859,93	0,00	439.159,65	2.885.932,81	3.232,53	0,10%	0,10%	0,15%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	2.815.626,44	0,00	2.000.000,00	817.288,28	1.661,84	0,06%	0,09%	0,15%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	10.023.975,93	0,00	0,00	10.011.474,27	-12.501,66	-0,12%	-0,12%	0,26%
SANTOS CREDIT YIELD FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	294.476,10	0,00	0,00	294.070,99	-405,11	-0,14%	-	0,03%
CAIXA BRASIL 2024 V TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.566.072,00	0,00	35.127,68	1.527.232,00	-3.712,32	-0,24%	-2,48%	1,64%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	7.305.642,51	0,00	0,00	7.277.060,89	-28.581,62	-0,39%	-0,39%	1,06%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	19.512.422,22	627.343,40	0,00	20.029.610,93	-110.154,69	-0,55%	-0,56%	0,92%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	3.354.277,62	3.273.282,32	0,00	6.584.911,76	-42.648,18	-0,64%	-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
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	8.835.860,20	218.917,25	0,00	8.893.046,82	-161.730,63	-1,79%	-1,83%	2,27%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	4.592.949,55	0,00	0,00	4.508.725,22	-84.224,33	-1,83%	-1,83%	2,33%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.231.784,43	0,00	0,00	2.190.414,84	-41.369,59	-1,85%	-1,85%	2,27%
SICREDI INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO ...	839.900,30	0,00	0,00	824.115,06	-15.785,24	-1,88%	-1,88%	2,26%
Total Renda Fixa	98.992.535,44	8.683.188,34	6.763.871,86	100.619.514,16	-292.337,76	-0,29%		1,05%

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
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	1.009.050,48	0,00	0,00	1.021.487,47	12.436,99	1,23%	1,23%	0,84%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	4.967.736,35	0,00	1.000.000,00	3.961.320,93	-6.415,42	-0,13%	-0,14%	1,46%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	4.334.511,61	0,00	0,00	4.326.012,11	-8.499,50	-0,20%	-0,20%	8,75%
BRADESCO MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO	1.004.847,81	0,00	0,00	1.002.709,99	-2.137,82	-0,21%	-0,21%	0,50%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	500.308,79	0,00	0,00	499.156,30	-1.152,49	-0,23%	-0,23%	2,59%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	4.099.444,86	0,00	0,00	4.067.661,11	-31.783,75	-0,78%	-0,78%	2,84%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	1.264.684,27	0,00	616.667,00	634.385,27	-13.632,00	-1,08%	-1,14%	10,30%
MULTINVEST FORTUNA FI MULTIMERCADO	496.563,27	0,00	0,00	491.043,32	-5.519,95	-1,11%	-1,11%	3,21%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	5.527.169,74	0,00	0,00	5.417.812,39	-109.357,35	-1,98%	-1,98%	10,65%
META VALOR FI AÇÕES	6.520.137,89	0,00	0,00	6.389.953,83	-130.184,06	-2,00%	-2,00%	11,87%
SICREDI SCHROEDERS IBOVESPA FI AÇÕES	1.239.735,28	0,00	0,00	1.204.917,96	-34.817,32	-2,81%	-2,81%	9,82%
ATHENA TOTAL RETURN INSTITUCIONAL II FI AÇÕES	461.381,01	0,00	0,00	448.224,67	-13.156,34	-2,85%	-2,85%	8,26%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	1.729.301,02	0,00	0,00	1.667.844,66	-61.456,36	-3,55%	-3,55%	9,60%
MULTINVEST FI AÇÕES	1.938.509,10	0,00	0,00	1.863.743,60	-74.765,50	-3,86%	-3,86%	11,43%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	4.597.367,61	0,00	0,00	4.332.069,20	-265.298,41	-5,77%	-5,77%	9,03%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	3.335.986,02	0,00	0,00	3.127.858,31	-208.127,71	-6,24%	-6,24%	8,07%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	3.460.000,00	0,00	14.000,00	3.100.000,00	-346.000,00	-10,00%	-10,40%	11,49%
Total Renda Variável	46.486.735,11	0,00	1.630.667,00	43.556.201,12	-1.299.866,99	-2,80%		8,09%