

# CRÉDITO E MERCADO

*Consultoria em Investimentos*

Relatório Analítico dos Investimentos

em julho de 2020

**Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2020)**

| Produto / Fundo                                     | Resgate | Carência   | Saldo         | Particip. S/ Total | Cotistas | % S/ PL do Fundo | RESOLUÇÃO - 3.922                     |
|---|---------|------------|---------------|--------------------|----------|------------------|---------------------------------------|
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO     | D+3     | Não há     | 6.482.505,43  | 3,75%              | 593      | 0,06%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '   |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE... | D+1     | Não há     | 9.433.385,60  | 5,46%              | 885      | 0,15%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '   |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | D+0     | Não há     | 5.907.921,12  | 3,42%              | 905      | 0,09%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '   |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVI... | D+2     | Não há     | 1.514.011,15  | 0,88%              | 312      | 0,07%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '   |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE... | D+0     | Não há     | 5.168.239,27  | 2,99%              | 959      | 0,06%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '   |
| SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS F... | D+1     | Não há     | 2.014.765,10  | 1,17%              | 217      | 0,15%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '   |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F... | D+0     | Não há     | 5.698.765,06  | 3,30%              | 1.366    | 0,05%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '   |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ... | D+0     | Não há     | 1.684.130,72  | 0,97%              | 342      | 0,08%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '   |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN... | D+1     | Não há     | 4.675.946,92  | 2,71%              | 675      | 0,08%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '   |
| CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA... | D+0     | Não há     | 231.003,18    | 0,13%              | 230      | 0,02%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '   |
| BRANCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA                     | D+0     | Não há     | 3.865.874,92  | 2,24%              | 122      | 0,45%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '   |
| BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA... | D+1     | Não há     | 488.117,51    | 0,28%              | 136      | 0,09%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '   |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F... | D+0     | Não há     | 9.389.448,36  | 5,43%              | 918      | 0,08%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '   |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP         | D+1     | Não há     | 8.891.299,48  | 5,15%              | 626      | 0,21%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '   |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA       | D+0     | Não possui | 21.628.071,67 | 12,52%             | 791      | 0,17%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '   |
| CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IM... | D+0     | Não há     | 4.965.366,73  | 2,87%              | 305      | 0,17%            | Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' ' |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP       | D+0     | Não há     | 1.234.719,96  | 0,71%              | 707      | 0,03%            | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' '  |
| BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA             | D+4     | Não há     | 6.144.046,52  | 3,56%              | 178      | 0,50%            | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' '  |
| CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP                | D+1 du  | Não há     | 7.121.122,88  | 4,12%              | 63       | 2,24%            | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' '  |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P... | D+3 du  | Não há     | 2.556.886,21  | 1,48%              | 263      | 0,21%            | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' '  |

**Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2020)**

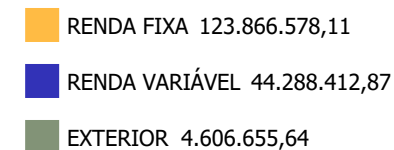
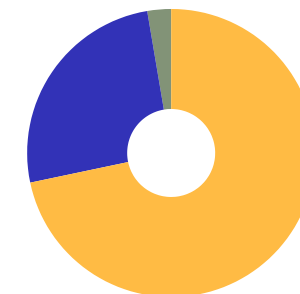
| Produto / Fundo                                     | Resgate    | Carência      | Saldo         | Particip. S/ Total | Cotistas | % S/ PL do Fundo | RESOLUÇÃO - 3.922                   |
|---|------------|---------------|---------------|--------------------|----------|------------------|-------------------------------------|
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA         | D+0        | Não há        | 619.018,91    | 0,36%              | 319      | 0,12%            | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '  |
| SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA                      | D+1        | Não há        | 11.181.484,50 | 6,47%              | 114      | 1,14%            | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '  |
| CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIV... | D+0        | 3 anos        | 2.970.446,91  | 1,72%              | 71       | 1,61%            | Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b ' |
| BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES                     | D+7 du     | Não há        | 2.694.696,45  | 1,56%              | 25.474   | 0,40%            | Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '   |
| SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES     | D+4        | Não há        | 1.448.309,52  | 0,84%              | 46       | 0,18%            | Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '   |
| AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES                   | D+30       | Não há        | 3.031.810,65  | 1,75%              | 6.564    | 0,18%            | Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '  |
| SANTANDER SELEÇÃO 30 FIC AÇÕES                      | Não inf... | Não há        | 2.929.551,62  | 1,70%              | 37.313   | 0,18%            | Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '  |
| BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES                            | D+33       | Não há        | 1.975.085,98  | 1,14%              | 1.656    | 0,21%            | Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '  |
| META VALOR FI AÇÕES                                 | D+4        | Não há        | 7.811.855,44  | 4,52%              | 193      | 2,86%            | Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '  |
| CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES                      | D+15       | Não há        | 2.967.731,02  | 1,72%              | 8.139    | 0,29%            | Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '  |
| BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES                        | D+30       | Não há        | 6.777.209,92  | 3,92%              | 1.708    | 2,34%            | Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '  |
| CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES                  | D+15       | Não há        | 2.123.775,76  | 1,23%              | 60       | 0,86%            | Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '  |
| SANTANDER STAR LONG & SHORT DIRECIONAL FIC MULTI... | D+31       | Não há        | 2.003.787,33  | 1,16%              | 2.039    | 0,80%            | Artigo 8º, Inciso III               |
| CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP            | D+1        | Não há        | 1.642.706,08  | 0,95%              | 5.415    | 0,32%            | Artigo 8º, Inciso III               |
| AZ QUEST EQUITY HEDGE FIC MULTIMERCADO              | D+6        | Não há        | 2.147.073,45  | 1,24%              | 4.807    | 0,96%            | Artigo 8º, Inciso III               |
| CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP            | D+4        | Não há        | 1.556.185,56  | 0,90%              | 19.189   | 0,03%            | Artigo 8º, Inciso III               |
| BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO          | D+5 du     | Não há        | 1.506.403,49  | 0,87%              | 44       | 3,55%            | Artigo 8º, Inciso III               |
| CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L... | D+15       | Não há        | 2.563.860,85  | 1,48%              | 74       | 0,31%            | Artigo 8º, Inciso III               |
| BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII ... | Não se ... | Não se aplica | 1.108.369,75  | 0,64%              |          | 0,67%            | Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '  |
| CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES            | D+4        | Não há        | 1.312.568,80  | 0,76%              | 115      | 0,10%            | Artigo 9º - A, Inciso III           |

Carteira consolidada de investimentos - base (Julho / 2020)

| Produto / Fundo                                    | Resgate | Carência | Saldo                 | Particip. S/ Total | Cotistas | % S/ PL do Fundo | RESOLUÇÃO - 3.922         |
|--|---------|----------|-----------------------|--------------------|----------|------------------|---------------------------|
| BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I             | D+5     | Não há   | 3.294.086,84          | 1,91%              | 14.194   | 1,19%            | Artigo 9º - A, Inciso III |
| <b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b> |         |          | <b>172.761.646,62</b> |                    |          |                  |                           |

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

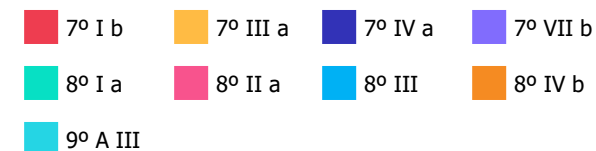
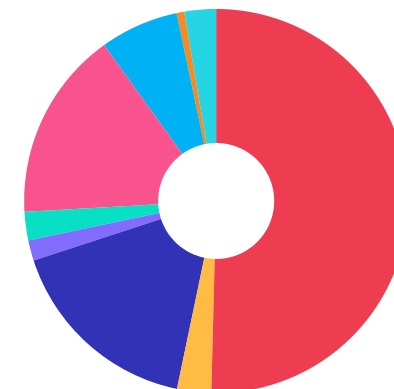
| Artigos - Renda Fixa                | Resolução %    | Carteira \$           | Carteira      | Estratégia de Alocação - 2020 |               |                | GAP Superior  |
|-------------------------------------|----------------|-----------------------|---------------|-------------------------------|---------------|----------------|---------------|
|                                     |                |                       |               | Inf                           | Alvo          | Sup            |               |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   | 100,00%        | 87.073.485,49         | 50,40%        | 15,00%                        | 50,00%        | 90,00%         | 68.411.996,47 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' | 60,00%         | 4.965.366,73          | 2,87%         | 0,00%                         | 3,00%         | 60,00%         | 98.691.621,24 |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '  | 40,00%         | 28.857.278,98         | 16,70%        | 5,00%                         | 15,00%        | 40,00%         | 40.247.379,67 |
| Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '  | 15,00%         | 0,00                  | 0,00%         | 0,00%                         | 0,00%         | 15,00%         | 25.914.246,99 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a ' | 5,00%          | 0,00                  | 0,00%         | 0,00%                         | 0,00%         | 5,00%          | 8.638.082,33  |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b ' | 5,00%          | 2.970.446,91          | 1,72%         | 0,00%                         | 2,00%         | 5,00%          | 5.667.635,42  |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c ' | 5,00%          | 0,00                  | 0,00%         | 0,00%                         | 0,00%         | 5,00%          | 8.638.082,33  |
| <b>Total Renda Fixa</b>             | <b>100,00%</b> | <b>123.866.578,11</b> | <b>71,70%</b> | <b>20,00%</b>                 | <b>70,00%</b> | <b>220,00%</b> |               |



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

| Artigos - Renda Variável           | Resolução     | Carteira \$          | Carteira      | Estratégia de Alocação - 2020 |               |               | GAP Superior  |
|------------------------------------|---------------|----------------------|---------------|-------------------------------|---------------|---------------|---------------|
|                                    |               |                      |               | Inf                           | Alvo          | Sup           |               |
| Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '  | 30,00%        | 4.143.005,97         | 2,40%         | 0,00%                         | 0,00%         | 10,00%        | 13.133.158,69 |
| Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' | 20,00%        | 27.617.020,39        | 15,99%        | 0,00%                         | 18,00%        | 20,00%        | 6.935.308,93  |
| Artigo 8º, Inciso III              | 10,00%        | 11.420.016,76        | 6,61%         | 0,00%                         | 10,00%        | 10,00%        | 5.856.147,90  |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a ' | 5,00%         | 0,00                 | 0,00%         | 0,00%                         | 0,00%         | 5,00%         | 8.638.082,33  |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b ' | 5,00%         | 1.108.369,75         | 0,64%         | 0,00%                         | 2,00%         | 5,00%         | 7.529.712,58  |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' c ' | 5,00%         | 0,00                 | 0,00%         | 0,00%                         | 0,00%         | 5,00%         | 8.638.082,33  |
| <b>Total Renda Variável</b>        | <b>30,00%</b> | <b>44.288.412,87</b> | <b>25,64%</b> | <b>0,00%</b>                  | <b>30,00%</b> | <b>55,00%</b> |               |

| Artigos - Exterior        | Resolução     | Carteira \$         | Carteira     | Estratégia de Alocação - Limite - 2020 |              |              | GAP Superior |
|---------------------------|---------------|---------------------|--------------|--|--------------|--------------|--------------|
|                           |               |                     |              | Inferior                               | Alvo         | Superior     |              |
| Artigo 9º - A, Inciso III | 10,00%        | 4.606.655,64        | 2,67%        | 0,00%                                  | 0,00%        | 5,00%        | 4.031.426,69 |
| <b>Total Exterior</b>     | <b>10,00%</b> | <b>4.606.655,64</b> | <b>2,67%</b> | <b>0,00%</b>                           | <b>0,00%</b> | <b>5,00%</b> |              |



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

| Gestão                            | Valor         | % S/ Carteira | % S/ PL Gestão |
|-----------------------------------|---------------|---------------|----------------|
| CAIXA ECONÔMICA FEDERAL           | 75.817.351,82 | 43,89         | 0,01           |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM        | 40.817.728,61 | 23,63         | 0,00           |
| SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM... | 19.577.898,07 | 11,33         | 0,00           |
| BRADESCO ASSET MANAGEMENT         | 10.009.921,44 | 5,79          | 0,00           |
| BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT      | 9.471.906,37  | 5,48          | 0,02           |
| META ASSET MANAGEMENT             | 7.811.855,44  | 4,52          | 2,82           |
| AZ QUEST INVESTIMENTOS            | 5.178.884,10  | 3,00          | 0,02           |
| CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS          | 2.967.731,02  | 1,72          | 0,19           |
| ZION INVEST                       | 1.108.369,75  | 0,64          | 0,23           |

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

**Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos**

| Artigos                             | Estratégia de Alocação - 2020 |            | Limite Inferior (%) | Limite Superior (%) |
|-------------------------------------|-------------------------------|------------|---------------------|---------------------|
|                                     | Carteira \$                   | Carteira % |                     |                     |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   | 87.073.485,49                 | 50,40      | 15,00               | 90,00               |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' | 4.965.366,73                  | 2,87       | 0,00                | 60,00               |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '  | 28.857.278,98                 | 16,70      | 5,00                | 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 ' | 2.970.446,91                  | 1,72       | 0,00                | 5,00                |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c ' | 0,00                          | 0,00       | 0,00                | 5,00                |
| Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '   | 4.143.005,97                  | 2,40       | 0,00                | 10,00               |
| Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '  | 27.617.020,39                 | 15,99      | 0,00                | 20,00               |
| Artigo 8º, Inciso III               | 11.420.016,76                 | 6,61       | 0,00                | 10,00               |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '  | 0,00                          | 0,00       | 0,00                | 5,00                |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '  | 1.108.369,75                  | 0,64       | 0,00                | 5,00                |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' c '  | 0,00                          | 0,00       | 0,00                | 5,00                |
| Artigo 9º - A, Inciso III           | 4.606.655,64                  | 2,67       | 0,00                | 5,00                |

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

|                                    | Mês   | Ano   | 3M    | 6M    | 12M    | 24M    | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|------------------------------------|-------|-------|-------|-------|--------|--------|---------|------------------|
| <b>IDKA PRÉ 2 ANOS (Benchmark)</b> | 0,89% | 7,55% | 2,91% | 6,54% | 11,53% | 28,08% | -       | -                |
| BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA  | 0,90% | 7,46% | 2,83% | 6,45% | 11,23% | 27,43% | 0,01%   | 0,02%            |

|   |       |       |       |       |       |        |       |       |
|---|-------|-------|-------|-------|-------|--------|-------|-------|
| <b>IMA Geral ex-C (Benchmark)</b>                               | 1,66% | 3,39% | 3,57% | 2,88% | 7,07% | 23,27% | -     | -     |
| BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,67% | 3,19% | 3,53% | 2,70% | 6,77% | 22,63% | 0,01% | 0,04% |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO                 | 1,77% | 3,55% | 3,84% | 3,05% | 7,10% | 23,78% | 0,01% | 0,04% |

|   |       |       |       |       |       |        |       |       |
|---|-------|-------|-------|-------|-------|--------|-------|-------|
| <b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>                         | 0,94% | 4,31% | 3,72% | 3,76% | 8,68% | 22,37% | -     | -     |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO     | 0,81% | 3,71% | 4,07% | 3,32% | 7,99% | 20,62% | 0,01% | 0,03% |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0,83% | 3,98% | 3,96% | 3,50% | 8,10% | 20,93% | 0,01% | 0,03% |

|  |       |       |       |       |       |        |       |       |
|--|-------|-------|-------|-------|-------|--------|-------|-------|
| <b>IMA Geral (Benchmark)</b>                             | 1,74% | 3,64% | 3,79% | 3,07% | 7,33% | 23,84% | -     | -     |
| CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1,65% | 3,29% | 3,54% | 2,79% | 6,86% | 22,77% | 0,01% | 0,04% |

|   |       |       |        |       |       |        |       |       |
|---|-------|-------|--------|-------|-------|--------|-------|-------|
| <b>IMA-B 5+ (Benchmark)</b>                               | 7,32% | 1,68% | 11,51% | 1,64% | 7,81% | 49,37% | -     | -     |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 7,28% | 1,51% | 11,38% | 1,46% | 7,68% | 48,58% | 0,04% | 0,16% |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP   | 7,29% | 1,46% | 11,43% | 1,50% | 7,35% | 47,92% | 0,04% | 0,16% |

|   |       |       |       |       |       |        |       |       |
|---|-------|-------|-------|-------|-------|--------|-------|-------|
| <b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>                          | 0,24% | 2,84% | 0,94% | 2,39% | 5,51% | 13,20% | -     | -     |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA | 0,24% | 2,73% | 0,90% | 2,30% | 5,30% | 12,79% | 0,00% | 0,00% |



**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 |
|--|-------|-------|-------|-------|--------|--------|---------|------------------|
| <b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>                                       | 0,99% | 4,19% | 4,28% | 3,61% | 8,83%  | 24,16% | -       | -                |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP           | 0,97% | 4,05% | 4,23% | 3,48% | 8,54%  | 23,61% | 0,01%   | 0,04%            |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP                      | 0,97% | 4,08% | 4,21% | 3,51% | 8,59%  | 23,64% | 0,01%   | 0,04%            |
| <b>IMA-B (Benchmark)</b>   | 4,39% | 2,65% | 8,14% | 2,38% | 8,16%  | 37,86% | -       | -                |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO           | 4,36% | 2,54% | 8,07% | 2,27% | 7,94%  | 37,20% | 0,02%   | 0,10%            |
| CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP           | 4,40% | 2,46% | 8,09% | 2,22% | 7,80%  | 36,97% | 0,02%   | 0,10%            |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP             | 4,38% | 2,42% | 8,09% | 2,17% | 7,73%  | 37,07% | 0,02%   | 0,11%            |
| SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP | 4,36% | 2,24% | 8,04% | 2,00% | 7,60%  | 36,81% | 0,02%   | 0,11%            |
| <b>CDI (Benchmark)</b>   | 0,19% | 1,95% | 0,64% | 1,57% | 4,21%  | 10,83% | -       | -                |
| CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP                    | 0,25% | 1,62% | 0,82% | 1,25% | 3,72%  | 10,14% | 0,00%   | 0,00%            |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA                      | 0,12% | 1,46% | 0,43% | 1,15% | 3,35%  | 8,99%  | 0,00%   | 0,00%            |
| <b>IPCA (Benchmark)</b>  | 0,36% | 0,46% | 0,24% | 0,25% | 2,31%  | 5,60%  | -       | -                |
| CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO              | 1,86% | 5,47% | 6,05% | 4,62% | 10,69% | 28,48% | 0,01%   | 0,06%            |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA                    | 0,98% | 5,65% | 3,14% | 4,79% | 9,68%  | 28,24% | 0,01%   | 0,03%            |
| SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA                                   | 0,54% | 2,53% | 1,36% | 2,18% | 6,41%  | 20,46% | 0,00%   | 0,02%            |
| BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA                          | 1,71% | 3,52% | 3,83% | 3,08% | 7,06%  | 23,05% | 0,01%   | 0,04%            |

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

|   | <b>Mês</b> | <b>Ano</b> | <b>3M</b> | <b>6M</b> | <b>12M</b> | <b>24M</b> | <b>VaR Mês</b> | <b>Volatilidade 12M</b> |
|---|------------|------------|-----------|-----------|------------|------------|----------------|-------------------------|
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 1,92%      | -          | 4,10%     | -         | -          | -          | 0,01%          | -                       |
| CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP                          | 0,93%      | -          | 3,06%     | -         | -          | -          | 0,01%          | -                       |

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

|  | Mês   | Ano    | 3M     | 6M     | 12M   | 24M    | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|--|-------|--------|--------|--------|-------|--------|---------|------------------|
| <b>S&amp;P 500 (Benchmark)</b>           | 5,51% | 1,25%  | 12,32% | 1,41%  | 9,76% | 16,15% | -       | -                |
| CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP | 5,63% | -1,57% | 12,09% | -1,90% | 7,79% | -      | 0,06%   | 0,24%            |

|                        |       |         |        |        |        |        |       |       |
|------------------------|-------|---------|--------|--------|--------|--------|-------|-------|
| <b>IBX (Benchmark)</b> | 8,41% | -10,43% | 28,20% | -9,30% | 2,17%  | 33,69% | -     | -     |
| META VALOR FI AÇÕES    | 9,67% | -4,33%  | 36,26% | -7,09% | 12,99% | 46,70% | 0,12% | 0,51% |

|   |       |         |        |         |        |        |       |       |
|---|-------|---------|--------|---------|--------|--------|-------|-------|
| <b>Ibovespa (Benchmark)</b>                     | 8,27% | -11,01% | 27,83% | -9,54%  | 1,08%  | 29,91% | -     | -     |
| SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES | 8,65% | -15,29% | 26,32% | -14,45% | -2,38% | 24,16% | 0,10% | 0,41% |
| CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES                  | 8,46% | -11,68% | 23,19% | -13,17% | 7,17%  | 56,52% | 0,08% | 0,39% |
| BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES                    | 7,74% | -9,28%  | 26,10% | -8,58%  | 3,46%  | 33,73% | 0,10% | 0,38% |
| BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES                        | 6,38% | -12,84% | 22,84% | -11,57% | 0,02%  | 50,60% | 0,10% | 0,35% |
| SANTANDER SELEÇÃO 30 FIC AÇÕES                  | 8,91% | -15,98% | 26,21% | -15,39% | -3,36% | 24,36% | 0,09% | 0,42% |

|                                   |        |         |        |         |        |        |       |       |
|-----------------------------------|--------|---------|--------|---------|--------|--------|-------|-------|
| <b>SMLL (Benchmark)</b>           | 9,50%  | -13,20% | 31,66% | -13,59% | 7,86%  | 55,28% | -     | -     |
| AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES | 14,10% | -9,01%  | 31,13% | -14,70% | 11,76% | 63,00% | 0,11% | 0,47% |

|   |       |        |       |        |       |        |       |       |
|---|-------|--------|-------|--------|-------|--------|-------|-------|
| <b>CDI (Benchmark)</b>                                  | 0,19% | 1,95%  | 0,64% | 1,57%  | 4,21% | 10,83% | -     | -     |
| CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP                | 1,41% | 0,36%  | 4,15% | -0,32% | 6,35% | 24,98% | 0,01% | 0,07% |
| AZ QUEST EQUITY HEDGE FIC MULTIMERCADO                  | 0,20% | -0,77% | 0,12% | -1,69% | 2,48% | 9,49%  | 0,01% | 0,03% |
| SANTANDER STAR LONG & SHORT DIRECIONAL FIC MULTIMERCADO | 1,27% | -0,93% | 1,87% | -0,52% | 0,76% | 7,48%  | 0,01% | 0,03% |

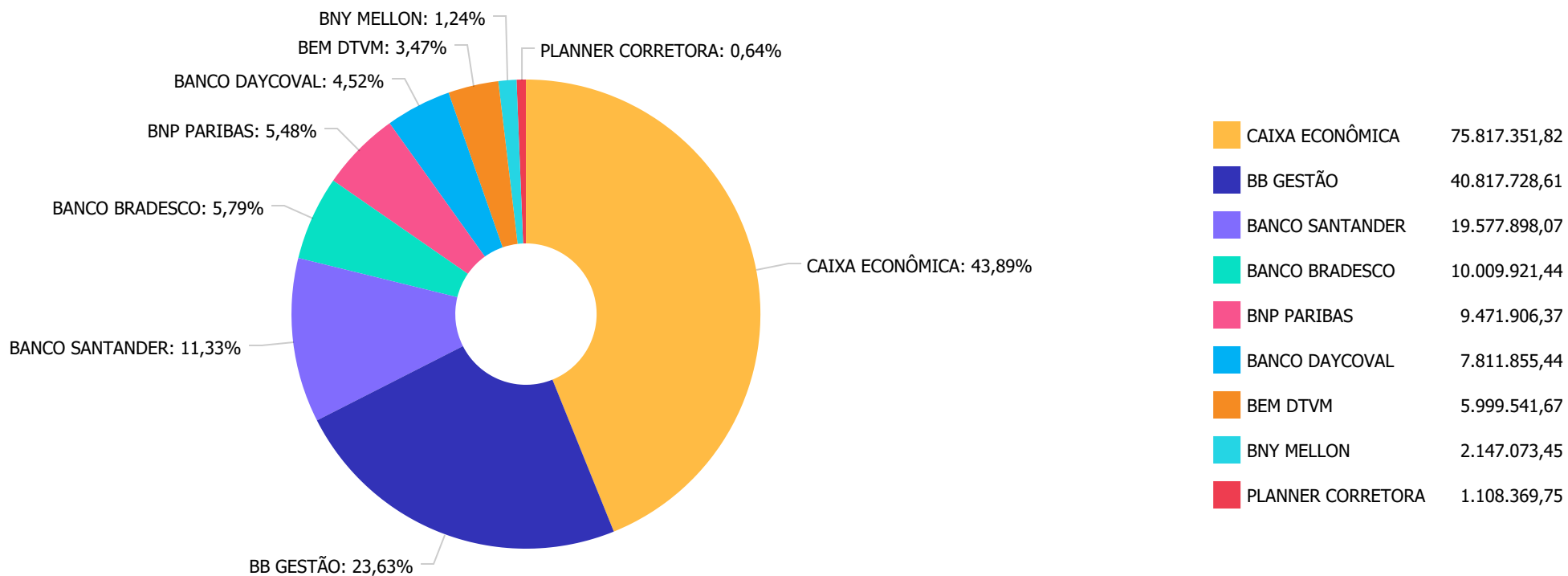
**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2020 - RENDA VARIÁVEL**

|  | Mês    | Ano     | 3M     | 6M      | 12M     | 24M     | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|--|--------|---------|--------|---------|---------|---------|---------|------------------|
| BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO               | 0,69%  | -       | 1,59%  | -       | -       | -       | 0,01%   | -                |
| <b>Não Informado (Benchmark)</b>                         | -      | -       | -      | -       | -       | -       | -       | -                |
| BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11 | 33,80% | -26,36% | 14,46% | -17,39% | -40,25% | -52,50% | 0,34%   | 0,60%            |
| CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES                       | 6,18%  | -8,45%  | 26,47% | -9,58%  | 6,75%   | -       | 0,09%   | 0,38%            |
| CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP        | 2,52%  | 0,86%   | 7,32%  | 0,59%   | -       | -       | 0,03%   | -                |
| <b>Não definido (Benchmark)</b>                          | -      | -       | -      | -       | -       | -       | -       | -                |
| BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES                          | 9,06%  | -14,94% | 31,97% | -16,62% | 6,04%   | 43,49%  | 0,10%   | 0,50%            |

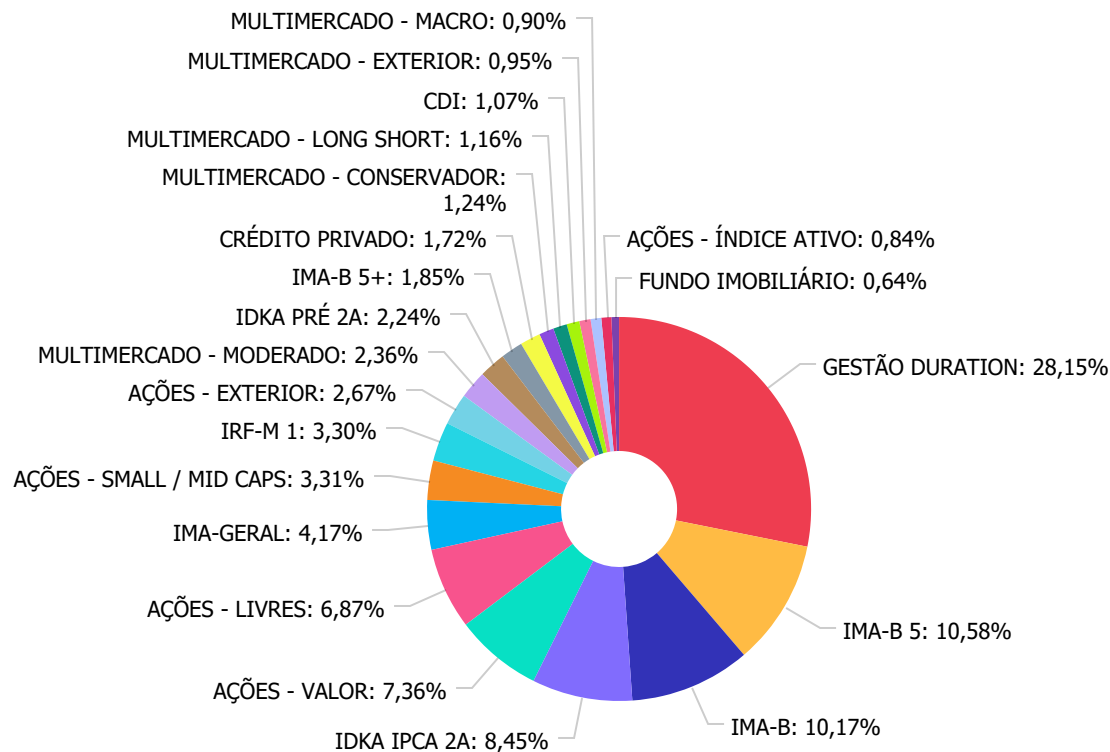
**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Julho/2020 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR**

|  | Mês   | Ano     | 3M     | 6M     | 12M    | 24M    | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|--|-------|---------|--------|--------|--------|--------|---------|------------------|
| <b>Global BDRX (Benchmark)</b>           | 1,77% | 34,78%  | 9,44%  | 26,60% | 55,42% | 70,67% | -       | -                |
| CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES | 1,88% | 35,34%  | 9,28%  | 27,06% | 55,47% | 69,34% | 0,09%   | 0,19%            |
| <b>IBX (Benchmark)</b>                   | 8,41% | -10,43% | 28,20% | -9,30% | 2,17%  | 33,69% | -       | -                |
| BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I   | 0,98% | 30,58%  | 5,63%  | 26,86% | 48,11% | 56,54% | 0,08%   | 0,19%            |

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



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

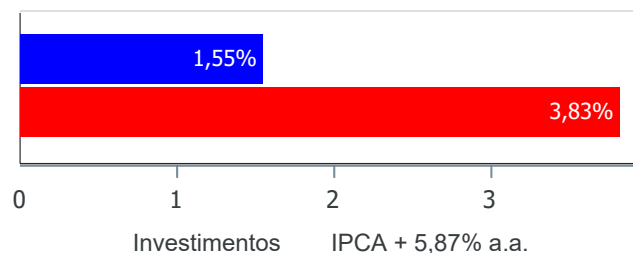


|                            |               |
|----------------------------|---------------|
| GESTÃO DURATION            | 48.631.611,78 |
| IMA-B 5                    | 18.280.747,84 |
| IMA-B                      | 17.563.999,87 |
| IDKA IPCA 2A               | 14.601.624,87 |
| AÇÕES - VALOR              | 12.716.493,04 |
| AÇÕES - LIVRES             | 11.868.716,70 |
| IMA-GERAL                  | 7.201.626,12  |
| AÇÕES - SMALL / MID CAPS   | 5.726.507,10  |
| IRF-M 1                    | 5.698.765,06  |
| AÇÕES - EXTERIOR           | 4.606.655,64  |
| MULTIMERCADO - MODERADO    | 4.070.264,34  |
| IDKA PRÉ 2A                | 3.865.874,92  |
| IMA-B 5+                   | 3.198.141,87  |
| CRÉDITO PRIVADO            | 2.970.446,91  |
| MULTIMERCADO - CONSERVADOR | 2.147.073,45  |
| MULTIMERCADO - LONG SHORT  | 2.003.787,33  |
| CDI                        | 1.853.738,87  |
| MULTIMERCADO - EXTERIOR    | 1.642.706,08  |
| MULTIMERCADO - MACRO       | 1.556.185,56  |

**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   | 152.862.799,62 | 14.258.274,50 | 8.990.003,51 | 158.993.148,59 | 862.077,98     | 862.077,98     | 0,55%       | 0,55%        | 0,71%    | 0,71%     | 76,75%   | 2,66%  |
| Fevereiro | 158.993.148,59 | 5.711.121,50  | 4.136.928,37 | 158.735.225,00 | -1.832.116,72  | -970.038,74    | -1,14%      | -0,60%       | 0,66%    | 1,37%     | -43,81%  | 3,98%  |
| Março     | 158.735.225,00 | 6.259.826,47  | 5.523.476,47 | 147.036.603,84 | -12.434.971,16 | -13.405.009,90 | -7,80%      | -8,35%       | 0,57%    | 1,95%     | -427,98% | 15,41% |
| Abril     | 147.036.603,84 | 6.798.304,96  | 3.094.155,88 | 154.560.459,74 | 3.819.706,82   | -9.585.303,08  | 2,53%       | -6,03%       | 0,14%    | 2,10%     | -287,61% | 7,58%  |
| Mai       | 154.560.459,74 | 10.170.354,35 | 7.608.659,45 | 160.870.142,78 | 3.747.988,14   | -5.837.314,94  | 2,39%       | -3,79%       | 0,07%    | 2,17%     | -174,58% | 4,42%  |
| Junho     | 160.870.142,78 | 7.317.665,62  | 6.599.160,04 | 165.508.449,11 | 3.919.800,75   | -1.917.514,19  | 2,43%       | -1,46%       | 0,74%    | 2,92%     | -49,76%  | 3,84%  |
| Julho     | 165.508.449,11 | 9.640.934,63  | 7.497.129,04 | 172.761.646,62 | 5.109.391,92   | 3.191.877,73   | 3,05%       | 1,55%        | 0,88%    | 3,83%     | 40,39%   | 3,22%  |

**Investimentos x Meta Atuarial**

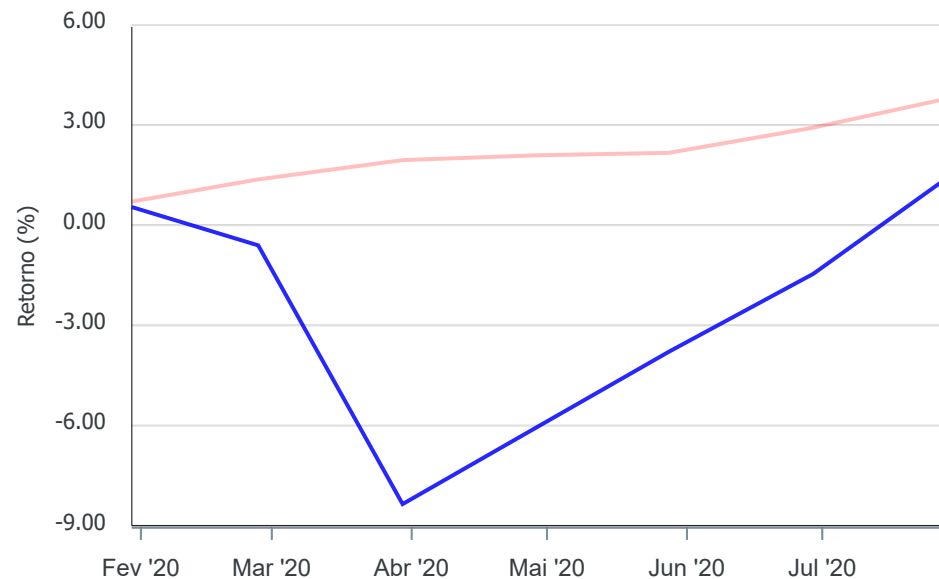




Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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

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

**FUNDOS DE RENDA FIXA**

| Ativos Renda Fixa                                     | Saldo Anterior | Aplicações   | Resgates | Saldo Atual   | Retorno (R\$) | Retorno (%) | (%) Instit | Var - Mês |
|---|----------------|--------------|----------|---------------|---------------|-------------|------------|-----------|
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI... | 1.569.673,35   | 0,00         | 0,00     | 1.684.130,72  | 114.457,37    | 7,29%       | 7,29%      | 3,79%     |
| BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE... | 1.411.296,46   | 0,00         | 0,00     | 1.514.011,15  | 102.714,69    | 7,28%       | 7,28%      | 3,80%     |
| CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-... | 4.756.267,08   | 0,00         | 0,00     | 4.965.366,73  | 209.099,65    | 4,40%       | 4,40%      | 2,27%     |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI... | 4.480.487,69   | 0,00         | 0,00     | 4.675.946,92  | 195.459,23    | 4,36%       | 4,36%      | 2,27%     |
| SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC... | 1.930.548,01   | 0,00         | 0,00     | 2.014.765,10  | 84.217,09     | 4,36%       | 4,36%      | 2,27%     |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ... | 4.689.896,97   | 1.000.000,00 | 0,00     | 5.907.921,12  | 218.024,15    | 3,83%       | 4,38%      | 2,27%     |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE... | 2.508.662,00   | 0,00         | 0,00     | 2.556.886,21  | 48.224,21     | 1,92%       | 1,92%      | 1,19%     |
| CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD... | 2.916.325,13   | 0,00         | 0,00     | 2.970.446,91  | 54.121,78     | 1,86%       | 1,86%      | 1,42%     |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO       | 6.369.900,31   | 0,00         | 0,00     | 6.482.505,43  | 112.605,12    | 1,77%       | 1,77%      | 1,05%     |
| BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA             | 6.040.810,41   | 0,00         | 0,00     | 6.144.046,52  | 103.236,11    | 1,71%       | 1,71%      | 1,05%     |
| BB IMA GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P... | 480.101,84     | 0,00         | 0,00     | 488.117,51    | 8.015,67      | 1,67%       | 1,67%      | 0,92%     |
| CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F... | 227.248,83     | 0,00         | 0,00     | 231.003,18    | 3.754,35      | 1,65%       | 1,65%      | 0,93%     |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA         | 21.418.745,98  | 0,00         | 0,00     | 21.628.071,67 | 209.325,69    | 0,98%       | 0,98%      | 0,92%     |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 9.298.915,03   | 0,00         | 0,00     | 9.389.448,36  | 90.533,33     | 0,97%       | 0,97%      | 0,83%     |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP           | 8.806.124,49   | 0,00         | 0,00     | 8.891.299,48  | 85.174,99     | 0,97%       | 0,97%      | 0,81%     |
| CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP                  | 6.057.448,49   | 1.000.000,00 | 0,00     | 7.121.122,88  | 63.674,39     | 0,90%       | 0,93%      | 0,88%     |
| BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA                     | 3.831.523,98   | 0,00         | 0,00     | 3.865.874,92  | 34.350,94     | 0,90%       | 0,90%      | 1,06%     |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC... | 9.357.900,21   | 0,00         | 0,00     | 9.433.385,60  | 75.485,39     | 0,81%       | 0,81%      | 0,74%     |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND... | 4.133.894,83   | 1.000.000,00 | 0,00     | 5.168.239,27  | 34.344,44     | 0,67%       | 0,83%      | 0,77%     |
| SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA                        | 11.122.025,26  | 0,00         | 0,00     | 11.181.484,50 | 59.459,24     | 0,53%       | 0,53%      | 0,33%     |

**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 FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP         | 1.231.659,78          | 0,00                | 0,00                | 1.234.719,96          | 3.060,18            | 0,25%        | 0,25%      | 0,03%        |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 5.685.061,14          | 0,00                | 0,00                | 5.698.765,06          | 13.703,92           | 0,24%        | 0,24%      | 0,15%        |
| CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA           | 626.360,48            | 5.140.934,63        | 5.150.392,43        | 619.018,91            | 2.116,23            | 0,04%        | 0,12%      | 0,00%        |
| <b>Total Renda Fixa</b>                               | <b>118.950.877,75</b> | <b>8.140.934,63</b> | <b>5.150.392,43</b> | <b>123.866.578,11</b> | <b>1.925.158,16</b> | <b>1,58%</b> |            | <b>1,08%</b> |

**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 FII - ... | 828.360,55           | 0,00                | 7.206,99            | 1.108.369,75         | 287.216,19          | 34,67%       | 33,80%     | 34,23%       |
| AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES                     | 2.657.121,18         | 0,00                | 0,00                | 3.031.810,65         | 374.689,47          | 14,10%       | 14,10%     | 10,88%       |
| META VALOR FI AÇÕES                                   | 7.123.246,21         | 0,00                | 0,00                | 7.811.855,44         | 688.609,23          | 9,67%        | 9,67%      | 11,87%       |
| BNP PARIBAS SMALL CAPS FI AÇÕES                       | 2.470.789,91         | 0,00                | 0,00                | 2.694.696,45         | 223.906,54          | 9,06%        | 9,06%      | 9,68%        |
| SANTANDER SELEÇÃO 30 FIC AÇÕES                        | 2.689.868,49         | 0,00                | 0,00                | 2.929.551,62         | 239.683,13          | 8,91%        | 8,91%      | 9,31%        |
| SANTANDER IBOVESA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES        | 1.332.951,56         | 0,00                | 0,00                | 1.448.309,52         | 115.357,96          | 8,65%        | 8,65%      | 9,85%        |
| CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES                        | 2.736.323,22         | 0,00                | 0,00                | 2.967.731,02         | 231.407,80          | 8,46%        | 8,46%      | 8,07%        |
| BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES                          | 6.290.444,68         | 0,00                | 0,00                | 6.777.209,92         | 486.765,24          | 7,74%        | 7,74%      | 9,77%        |
| BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES                              | 1.856.685,26         | 0,00                | 0,00                | 1.975.085,98         | 118.400,72          | 6,38%        | 6,38%      | 9,60%        |
| CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES                    | 2.000.094,31         | 0,00                | 0,00                | 2.123.775,76         | 123.681,45          | 6,18%        | 6,18%      | 8,68%        |
| CAIXA BOLSA AMERICANA FI MULTIMERCADO LP              | 1.555.102,07         | 0,00                | 0,00                | 1.642.706,08         | 87.604,01           | 5,63%        | 5,63%      | 6,48%        |
| CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP     | 2.500.812,13         | 0,00                | 0,00                | 2.563.860,85         | 63.048,72           | 2,52%        | 2,52%      | 2,59%        |
| CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP              | 1.534.609,55         | 0,00                | 0,00                | 1.556.185,56         | 21.576,01           | 1,41%        | 1,41%      | 1,46%        |
| INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO                | 2.309.189,28         | 0,00                | 2.339.529,62        | 0,00                 | 30.340,34           | 1,31%        | 1,81%      | 0,84%        |
| SANTANDER STAR LONG & SHORT DIRECIONAL FIC MULTIME... | 1.978.716,67         | 0,00                | 0,00                | 2.003.787,33         | 25.070,66           | 1,27%        | 1,27%      | 1,27%        |
| BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO            | 0,00                 | 1.500.000,00        | 0,00                | 1.506.403,49         | 6.403,49            | 0,43%        | 0,69%      | 0,62%        |
| AZ QUEST EQUITY HEDGE FIC MULTIMERCADO                | 2.142.713,73         | 0,00                | 0,00                | 2.147.073,45         | 4.359,72            | 0,20%        | 0,20%      | 0,74%        |
| <b>Total Renda Variável</b>                           | <b>42.007.028,80</b> | <b>1.500.000,00</b> | <b>2.346.736,61</b> | <b>44.288.412,87</b> | <b>3.128.120,68</b> | <b>7,19%</b> |            | <b>8,66%</b> |

# CRÉDITO E MERCADO

*Consultoria em Investimentos*

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE ITAPECERICA DA SERRA  
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 31/07/2020

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

FUNDOS EXTERIOR

| Ativos Exterior                          | Saldo Anterior      | Aplicações  | Resgates    | Saldo Atual         | Retorno (R\$)    | Retorno (%)  | (%) Instit | Var - Mês    |
|--|---------------------|-------------|-------------|---------------------|------------------|--------------|------------|--------------|
| CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES | 1.288.411,00        | 0,00        | 0,00        | 1.312.568,80        | 24.157,80        | 1,88%        | 1,88%      | 8,52%        |
| BB AÇÕES GLOBAIS FIC AÇÕES BDR NÍVEL I   | 3.262.131,56        | 0,00        | 0,00        | 3.294.086,84        | 31.955,28        | 0,98%        | 0,98%      | 8,38%        |
| <b>Total Renda Variável</b>              | <b>4.550.542,56</b> | <b>0,00</b> | <b>0,00</b> | <b>4.606.655,64</b> | <b>56.113,08</b> | <b>1,23%</b> |            | <b>8,42%</b> |