

# CRÉDITO E MERCADO

*Consultoria em Investimentos*

Relatório Analítico dos Investimentos

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

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

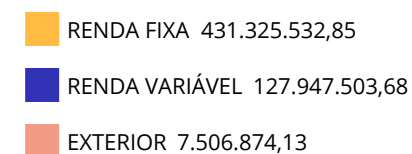
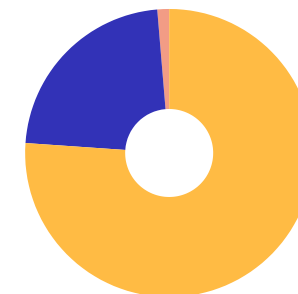
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	42.225.540,64	7,45%	763	0,35%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	88.750.665,66	15,66%	901	1,48%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	18.311.827,08	3,23%	74	1,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	23.654.497,60	4,17%	118	2,44%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	D+2	Não há	43.558.685,40	7,69%	23.846	3,35%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	5.152.747,38	0,91%	956	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	15/08/2022	24.423.794,25	4,31%	165	3,57%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	39.152.464,72	6,91%	670	0,71%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	17.724.955,71	3,13%	884	0,29%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	13.039.700,40	2,30%	6	24,52%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS F...	D+1	Não há	17.742.037,98	3,13%	207	1,46%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	3.461.559,89	0,61%	678	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	92.832.772,74	16,38%	287	1,80%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se ...	Não se aplica	1.294.283,40	0,23%	98	1,53%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	D+4	Não há	7.059.544,56	1,25%	1.411	0,85%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
VINCI MOSAICO FI AÇÕES	D+4 du ...	Não há	5.441.064,76	0,96%	1.703	0,37%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAU FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	10.462.982,86	1,85%	53	1,23%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	D+4	Não há	5.483.500,34	0,97%	2.090	0,28%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	11.466.600,10	2,02%	204	1,71%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	8.718.869,43	1,54%	6.411	0,42%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '

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

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	D+4	Não há	7.946.891,43	1,40%	15.538	0,75%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	7.435.264,04	1,31%	1.743	2,78%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	12.133.448,29	2,14%	6.693	0,86%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
VINCI VALOREM FI MULTIMERCADO	D+2	Não há	9.645.908,38	1,70%	32.480	0,79%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	6.948.859,86	1,23%	20.627	0,29%	Artigo 8º, Inciso III
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	D+2	Não há	17.197.195,25	3,03%	55	3,83%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	6.067.306,44	1,07%	9.851	0,68%	Artigo 8º, Inciso III
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	11.281.970,44	1,99%	1.083	0,94%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTIESTRATÉGIA F...	Não se ...	Não se aplica	658.097,50	0,12%	19	3,21%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	7.506.874,13	1,32%	414	0,66%	Artigo 9º - A, Inciso III
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>566.779.910,66</b>				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	333.736.916,82	58,88%	35,00%	55,50%	65,00%	34.670.025,11
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	65,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	85.016.986,60
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	45,00%	96.294.332,63	16,99%	15,00%	16,00%	30,00%	73.739.640,57
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	1.294.283,40	0,23%	0,00%	0,50%	0,50%	1.539.616,15
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>431.325.532,85</b>	<b>76,10%</b>	<b>50,00%</b>	<b>72,00%</b>	<b>110,50%</b>	



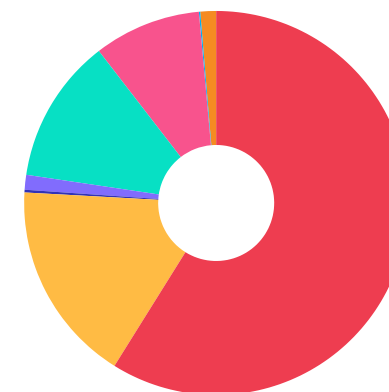
**ATENÇÃO!** Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.695/18 em seus Artigo 7º § 10º e Artigo 8º § 10º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!



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

Artigos - Renda Variável	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	35,00%	7.059.544,56	1,25%	0,00%	1,50%	2,50%	7.109.953,21
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	25,00%	69.088.621,25	12,19%	6,00%	11,50%	15,00%	15.928.365,35
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	51.141.240,37	9,02%	6,00%	9,50%	10,00%	5.536.750,70
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	658.097,50	0,12%	0,00%	0,50%	1,00%	5.009.701,61
<b>Total Renda Variável</b>	<b>35,00%</b>	<b>127.947.503,68</b>	<b>22,57%</b>	<b>12,00%</b>	<b>23,00%</b>	<b>28,50%</b>	

Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2020			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	3,00%	17.003.397,32
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	7.506.874,13	1,32%	0,00%	2,00%	2,00%	3.828.724,08
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>7.506.874,13</b>	<b>1,32%</b>	<b>0,00%</b>	<b>5,00%</b>	<b>5,00%</b>	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	165.509.298,01	29,20	0,03
ITAÚ UNIBANCO	92.832.772,74	16,38	0,01
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	88.360.759,24	15,59	0,01
SUL AMERICA INVESTIMENTOS GEST...	51.505.576,83	9,09	0,15
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	40.604.598,04	7,16	0,00
BANCO J. SAFRA S/A	24.704.069,38	4,36	0,01
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	21.758.569,83	3,84	0,02
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	17.742.037,98	3,13	0,00
AZ QUEST INVESTIMENTOS	12.133.448,29	2,14	0,04
SAFRA ASSET MANAGEMENT	11.281.970,44	1,99	0,00
ITAÚ DTVM	10.462.982,86	1,85	0,00
VINCI GESTÃO DE PATRIMÔNIO LTD...	9.645.908,38	1,70	0,01
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	7.435.264,04	1,31	0,01
WESTERN ASSET	6.067.306,44	1,07	0,01
VINCI PARTNERS	5.441.064,76	0,96	0,01
PETRA CAPITAL	1.294.283,40	0,23	0,02

**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 '	333.736.916,82	58,88	35,00	65,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	96.294.332,63	16,99	15,00	30,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	1.294.283,40	0,23	0,00	0,50
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	7.059.544,56	1,25	0,00	2,50
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	69.088.621,25	12,19	6,00	15,00
Artigo 8º, Inciso III	51.141.240,37	9,02	6,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	658.097,50	0,12	0,00	1,00
Artigo 9º - A, Inciso II	0,00	0,00	0,00	3,00
Artigo 9º - A, Inciso III	7.506.874,13	1,32	0,00	2,00

**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 Junho/2020 - RENDA FIXA**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IDKA PRÉ 2 ANOS (Benchmark)</b>	0,70%	6,60%	3,31%	6,60%	11,71%	28,80%	-	-
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	0,70%	6,50%	3,14%	6,50%	11,48%	28,06%	0,01%	0,02%
<b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>	0,99%	3,35%	3,35%	3,35%	8,68%	23,17%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,21%	2,88%	3,57%	2,88%	8,18%	21,13%	0,01%	0,03%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,18%	3,12%	3,54%	3,12%	8,19%	21,36%	0,01%	0,03%
<b>IMA-B (Benchmark)</b>	2,05%	-1,66%	4,96%	-1,66%	4,73%	35,13%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,02%	-1,75%	4,90%	-1,75%	4,74%	34,48%	0,03%	0,10%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,03%	-1,88%	4,91%	-1,88%	4,52%	34,35%	0,03%	0,10%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	2,14%	-2,93%	4,79%	-2,93%	3,89%	33,29%	0,03%	0,09%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP	2,00%	-2,03%	4,83%	-2,03%	4,40%	34,09%	0,03%	0,10%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,24%	1,43%	5,16%	1,43%	4,77%	20,97%	0,02%	0,07%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,99%	1,64%	2,40%	1,64%	6,28%	19,00%	0,00%	0,02%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,21%	1,75%	0,73%	1,75%	4,58%	11,21%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,24%	1,37%	0,58%	1,37%	4,03%	10,44%	0,00%	0,01%
<b>IPCA (Benchmark)</b>	0,26%	0,10%	-0,43%	0,10%	2,12%	5,57%	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,21%	-1,55%	-0,59%	-1,55%	-8,44%	-12,07%	0,00%	0,06%

**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
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,44%	2,27%	1,12%	2,27%	5,62%	19,25%	0,00%	0,01%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,75%	4,63%	3,27%	4,63%	9,82%	28,20%	0,01%	0,03%
<b>Não Informado (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1,20%	0,18%	3,88%	0,18%	3,05%	13,49%	0,01%	0,06%



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>S&amp;P 500 (Benchmark)</b>	1,84%	-4,04%	19,95%	-4,04%	4,59%	14,05%	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	0,85%	-6,40%	18,78%	-6,40%	4,13%	17,08%	0,13%	0,23%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	0,91%	-5,88%	18,57%	-5,88%	4,57%	17,16%	0,13%	0,22%
<b>IPCA + 10,00% ao ano (Benchmark)</b>	1,06%	4,86%	1,89%	4,86%	12,34%	27,64%	-	-
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTISTRATÉGIA FIP	-0,49%	-	-	-	-78,05%	-78,29%	0,00%	0,74%
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	1,12%	3,17%	3,77%	3,17%	8,73%	24,75%	-	-
VINCI VALOREM FI MULTIMERCADO	1,24%	3,49%	3,00%	3,49%	8,08%	22,06%	0,01%	0,03%
<b>IGC (Benchmark)</b>	9,24%	-15,27%	32,66%	-15,27%	0,83%	43,12%	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	8,89%	-17,46%	30,78%	-17,46%	-3,94%	35,59%	0,12%	0,38%
<b>Ibovespa (Benchmark)</b>	8,76%	-17,80%	30,18%	-17,80%	-6,20%	30,64%	-	-
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	8,62%	-16,61%	30,81%	-16,61%	-1,66%	35,75%	0,12%	0,39%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	10,27%	-8,33%	41,67%	-8,33%	8,82%	58,71%	0,10%	0,42%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	7,94%	-25,33%	30,81%	-25,33%	-8,45%	27,44%	0,14%	0,46%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	7,79%	-15,79%	29,82%	-15,79%	-3,40%	35,64%	0,12%	0,37%
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	8,95%	-24,53%	25,56%	-24,53%	-13,48%	19,34%	0,12%	0,39%
VINCI MOSAICO FI AÇÕES	9,36%	-15,32%	28,90%	-15,32%	6,44%	57,37%	0,12%	0,40%

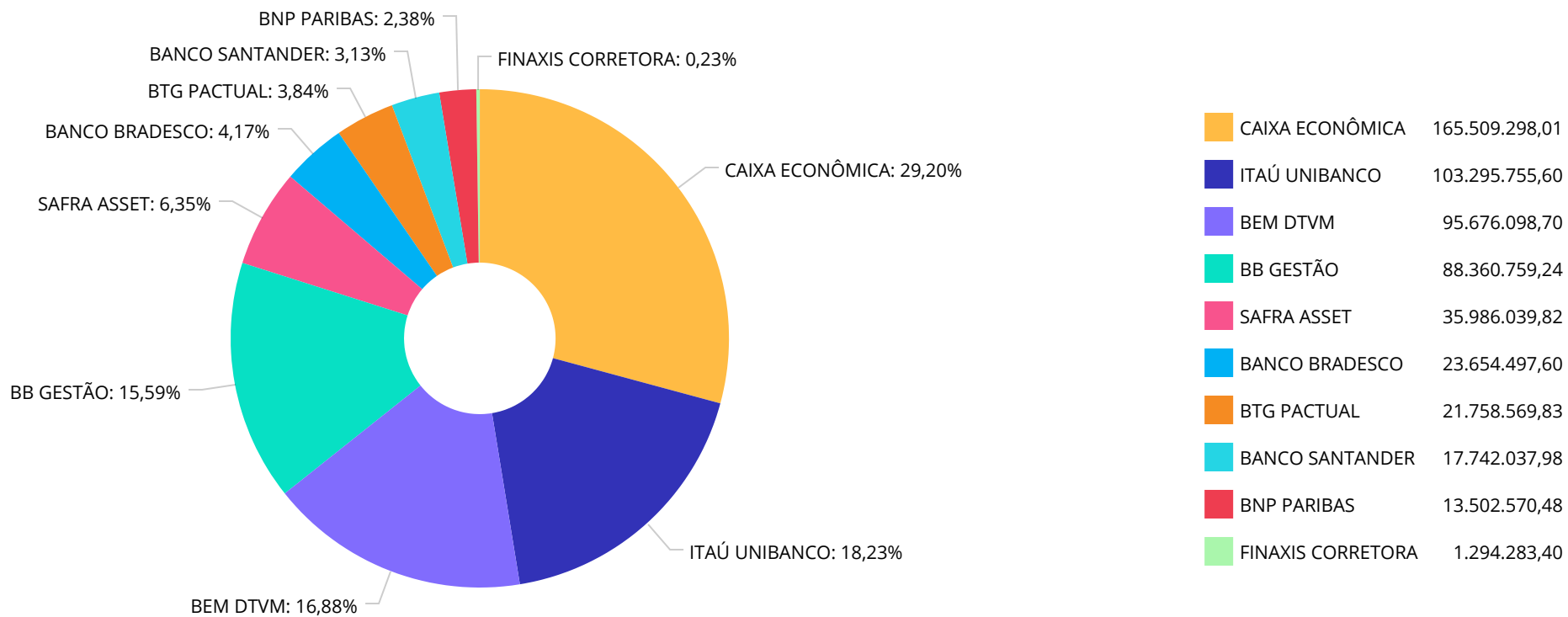
**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2020 - RENDA VARIÁVEL**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>SMLL (Benchmark)</b>	14,43%	-20,73%	32,49%	-20,73%	5,76%	49,01%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	8,63%	-20,26%	28,01%	-20,26%	7,24%	45,66%	0,13%	0,46%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,21%	1,75%	0,73%	1,75%	4,58%	11,21%	-	-
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	0,28%	1,61%	0,99%	1,61%	4,81%	12,46%	0,00%	0,01%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	2,60%	-3,10%	8,72%	-3,10%	3,61%	18,53%	0,03%	0,11%
<b>Não definido (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	8,50%	-15,58%	31,97%	-15,58%	6,25%	52,81%	0,11%	0,41%

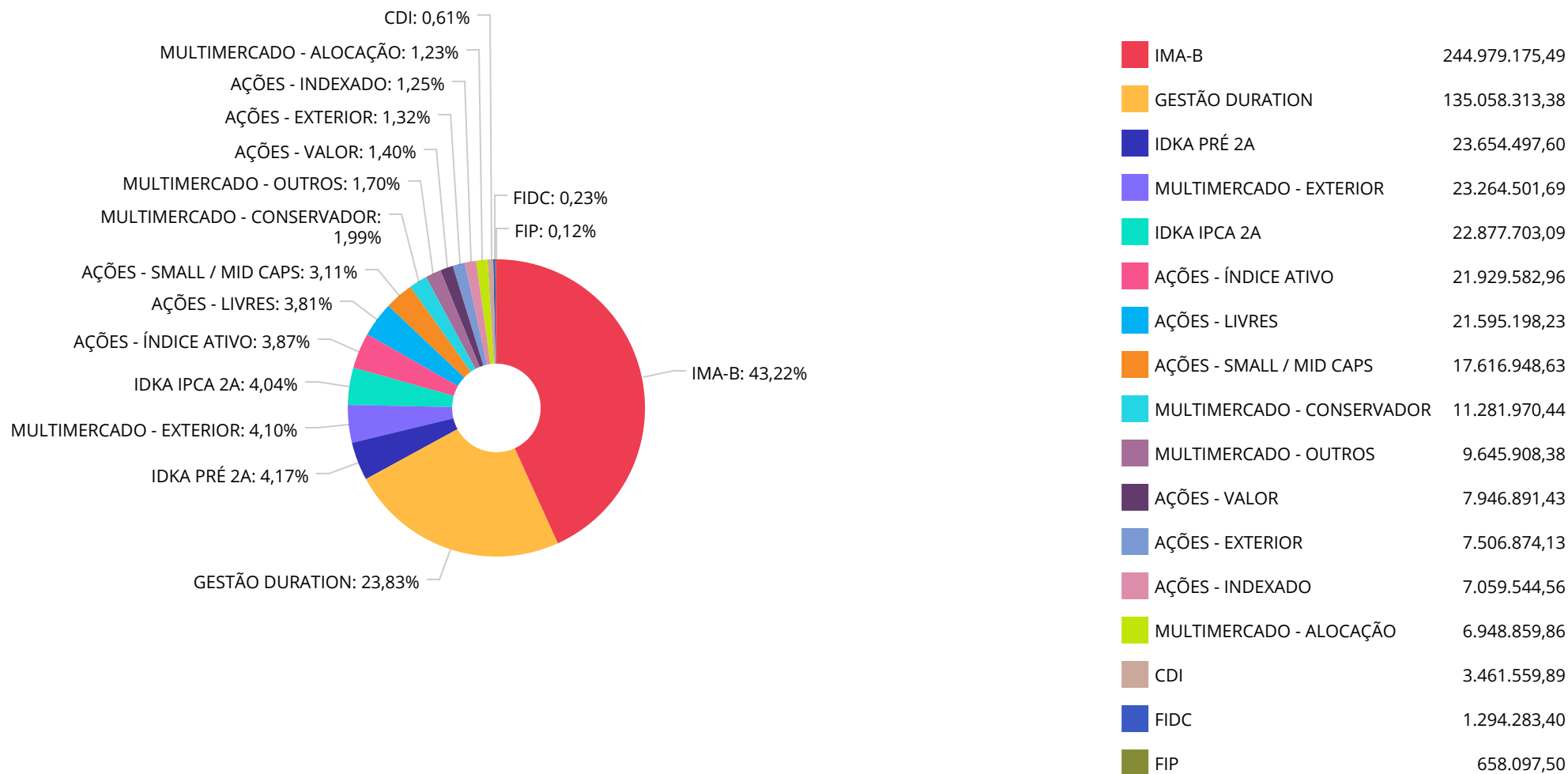
**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2020 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR**

	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%	-	-
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,92%	23,59%	21,91%	23,59%	40,42%	67,23%	0,11%	0,20%

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



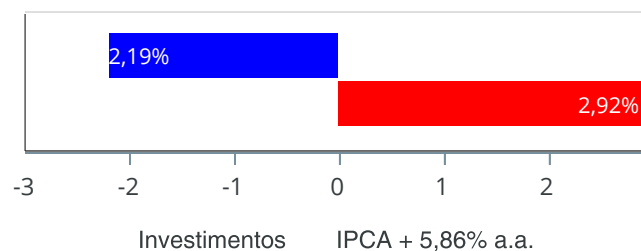
**Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Junho / 2020)**



**Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)**

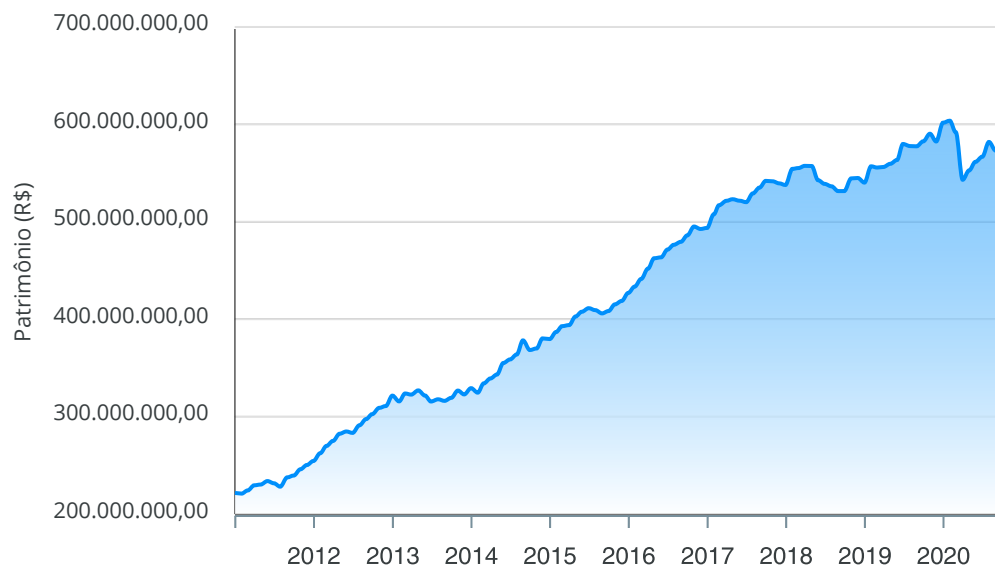
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	601.757.165,89	33.792.081,99	34.429.117,89	603.762.413,32	2.642.283,33	2.642.283,33	0,44%	0,44%	0,71%	0,71%	61,89%	2,07%
Fevereiro	603.762.413,32	118.776.753,06	122.569.044,97	591.890.201,50	-8.079.919,91	-5.437.636,58	-1,34%	-0,91%	0,66%	1,37%	-65,93%	4,18%
Março	591.890.201,50	19.290.056,34	21.502.334,97	543.161.369,33	-46.516.553,54	-51.954.190,12	-7,86%	-8,69%	0,57%	1,95%	-445,95%	15,79%
Abril	543.161.369,33	35.294.520,01	39.137.466,90	552.732.885,77	13.414.463,33	-38.539.726,79	2,47%	-6,44%	0,14%	2,09%	-307,50%	8,16%
Mai	552.732.885,77	33.482.139,00	37.311.288,32	561.503.943,68	12.600.207,23	-25.939.519,56	2,28%	-4,31%	0,07%	2,17%	-198,72%	4,07%
Junho	561.503.943,68	25.232.606,58	32.392.567,75	566.779.910,66	12.435.928,15	-13.503.591,41	2,21%	-2,19%	0,74%	2,92%	-74,87%	3,64%

Investimentos x Meta Atuarial



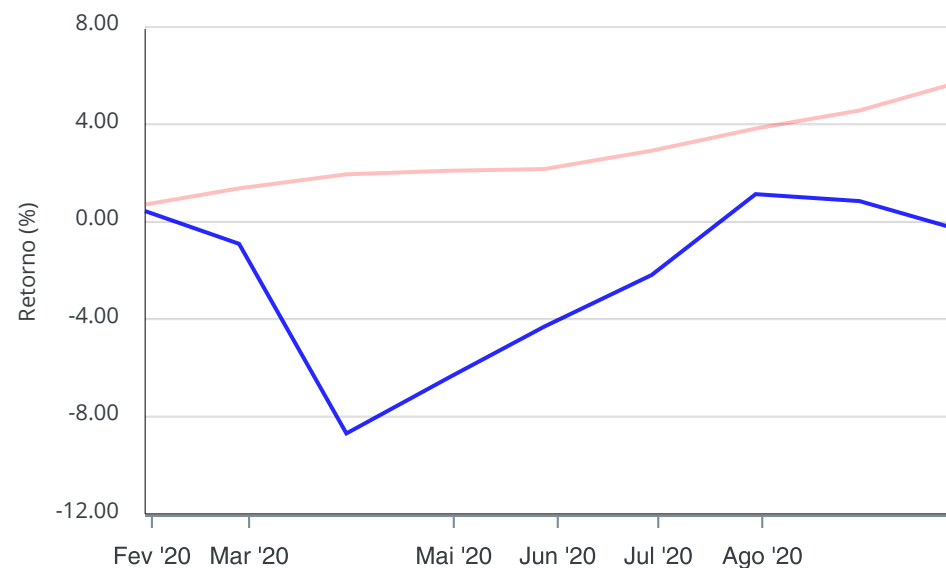
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Junho/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	42.646.646,13	0,00	0,00	43.558.685,40	912.039,27	2,14%	2,14%	2,74%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	86.988.969,15	0,00	0,00	88.750.665,66	1.761.696,51	2,03%	2,03%	2,99%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC...	17.393.844,13	0,00	0,00	17.742.037,98	348.193,85	2,00%	2,00%	2,98%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	36.316.906,56	2.091.384,78	0,00	39.152.464,72	744.173,38	1,94%	2,02%	2,98%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	18.087.986,29	0,00	0,00	18.311.827,08	223.840,79	1,24%	1,24%	1,72%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	17.512.526,55	0,00	0,00	17.724.955,71	212.429,16	1,21%	1,21%	0,81%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.885.000,30	0,00	0,00	13.039.700,40	154.700,10	1,20%	1,20%	0,89%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	24.183.817,78	0,00	0,00	24.423.794,25	239.976,47	0,99%	0,99%	0,45%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	14.986.386,63	8.136.988,82	18.188.357,29	5.152.747,38	217.729,22	0,94%	1,18%	0,86%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	41.911.368,49	0,00	0,00	42.225.540,64	314.172,15	0,75%	0,75%	1,17%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	92.429.930,43	0,00	0,00	92.832.772,74	402.842,31	0,44%	0,44%	0,38%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	22.595.061,32	15.004.232,98	14.104.210,46	23.654.497,60	159.413,76	0,42%	0,70%	0,92%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	3.553.133,28	0,00	100.000,00	3.461.559,89	8.426,61	0,24%	0,24%	0,03%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.297.037,11	0,00	0,00	1.294.283,40	-2.753,71	-0,21%	-0,21%	0,05%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>432.788.614,15</b>	<b>25.232.606,58</b>	<b>32.392.567,75</b>	<b>431.325.532,85</b>	<b>5.696.879,87</b>	<b>1,24%</b>		<b>1,70%</b>



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
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	7.906.723,22	0,00	0,00	8.718.869,43	812.146,21	10,27%	10,27%	10,27%
VINCI MOSAICO FI AÇÕES	4.975.615,43	0,00	0,00	5.441.064,76	465.449,33	9,35%	9,35%	12,28%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	10.524.333,76	0,00	0,00	11.466.600,10	942.266,34	8,95%	8,95%	12,00%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	6.482.929,05	0,00	0,00	7.059.544,56	576.615,51	8,89%	8,89%	12,41%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	11.169.079,81	0,00	0,00	12.133.448,29	964.368,48	8,63%	8,63%	12,99%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	9.632.787,23	0,00	0,00	10.462.982,86	830.195,63	8,62%	8,62%	11,52%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	5.053.899,76	0,00	0,00	5.483.500,34	429.600,58	8,50%	8,50%	10,67%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	7.362.310,91	0,00	0,00	7.946.891,43	584.580,52	7,94%	7,94%	13,71%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	6.898.027,46	0,00	0,00	7.435.264,04	537.236,58	7,79%	7,79%	11,90%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	6.772.769,24	0,00	0,00	6.948.859,86	176.090,62	2,60%	2,60%	3,49%
VINCI VALOREM FI MULTIMERCADO	9.527.395,50	0,00	0,00	9.645.908,38	118.512,88	1,24%	1,24%	0,96%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	17.042.543,03	0,00	0,00	17.197.195,25	154.652,22	0,91%	0,91%	12,57%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	6.016.351,73	0,00	0,00	6.067.306,44	50.954,71	0,85%	0,85%	12,81%
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	11.250.669,04	0,00	0,00	11.281.970,44	31.301,40	0,28%	0,28%	0,32%
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTIELABORADA FIP	661.342,23	0,00	0,00	658.097,50	-3.244,73	-0,49%	-0,49%	0,32%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>121.276.777,40</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>127.947.503,68</b>	<b>6.670.726,28</b>	<b>5,50%</b>		<b>9,75%</b>

# CRÉDITO E MERCADO

*Consultoria em Investimentos*

FUNDAÇÃO DE PREVIDÊNCIA DOS SERVIDORES PÚBLICOS MUNICIPAIS EFETIVOS DE BAURU - FUNPREV  
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/06/2020

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
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	7.438.552,13	0,00	0,00	7.506.874,13	68.322,00	0,92%	0,92%	10,81%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>7.438.552,13</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>7.506.874,13</b>	<b>68.322,00</b>	<b>0,92%</b>		<b>10,81%</b>

**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 IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	79.599.649,59	5.103.470,99	0,00	88.750.665,66	4.047.545,08	4,78%	4,91%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	41.567.426,31	0,00	0,00	43.558.685,40	1.991.259,09	4,79%	4,79%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	34.667.600,91	2.755.945,59	0,00	39.152.464,72	1.728.918,22	4,62%	4,90%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	40.887.011,44	0,00	0,00	42.225.540,64	1.338.529,20	3,27%	3,27%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	91.801.526,31	0,00	0,00	92.832.772,74	1.031.246,43	1,12%	1,12%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	17.413.375,64	0,00	0,00	18.311.827,08	898.451,44	5,16%	5,16%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC...	16.924.964,98	0,00	0,00	17.742.037,98	817.073,00	4,83%	4,83%
BRDESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	29.993.654,27	57.314.074,88	64.359.919,79	23.654.497,60	706.688,24	0,81%	3,14%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	17.113.644,85	0,00	0,00	17.724.955,71	611.310,86	3,57%	3,57%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	23.851.596,98	0,00	0,00	24.423.794,25	572.197,27	2,40%	2,40%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	19.883.374,51	28.835.774,13	44.071.403,18	5.152.747,38	505.001,92	1,04%	3,54%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	12.552.116,40	0,00	0,00	13.039.700,40	487.584,00	3,88%	3,88%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	3.851.509,95	0,00	410.000,00	3.461.559,89	20.049,94	0,52%	0,58%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.301.924,19	0,00	0,00	1.294.283,40	-7.640,79	-0,59%	-0,59%
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>14.748.213,90</b>	<b>2,81%</b>	

**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
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	14.503.804,72	0,00	0,00	17.197.195,25	2.693.390,53	18,57%	18,57%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	9.478.650,90	0,00	0,00	12.133.448,29	2.654.797,39	28,01%	28,01%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	6.154.472,10	0,00	0,00	8.718.869,43	2.564.397,33	41,67%	41,67%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	7.998.672,16	0,00	0,00	10.462.982,86	2.464.310,70	30,81%	30,81%
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	9.132.535,81	0,00	0,00	11.466.600,10	2.334.064,29	25,56%	25,56%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	6.075.030,42	0,00	0,00	7.946.891,43	1.871.861,01	30,81%	30,81%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	5.727.499,35	0,00	0,00	7.435.264,04	1.707.764,69	29,82%	29,82%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	5.397.949,60	0,00	0,00	7.059.544,56	1.661.594,96	30,78%	30,78%
BRDESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	4.155.147,17	0,00	0,00	5.483.500,34	1.328.353,17	31,97%	31,97%
VINCI MOSAICO FI AÇÕES	4.221.080,32	0,00	0,00	5.441.064,76	1.219.984,44	28,90%	28,90%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	5.108.223,95	0,00	0,00	6.067.306,44	959.082,49	18,78%	18,78%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	6.391.441,71	0,00	0,00	6.948.859,86	557.418,15	8,72%	8,72%
VINCI VALOREM FI MULTIMERCADO	9.365.228,37	0,00	0,00	9.645.908,38	280.680,01	3,00%	3,00%
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	11.171.931,27	0,00	0,00	11.281.970,44	110.039,17	0,98%	0,98%
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTIELSTRATÉGIA FIP	712.816,61	0,00	0,00	658.097,50	-54.719,11	-7,68%	-
				<b>Total Renda Variável</b>	<b>22.353.019,22</b>	<b>21,17%</b>	

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

<b>Ativos Exterior</b>	<b>Saldo Anterior</b>	<b>Aplicações</b>	<b>Resgates</b>	<b>Saldo Atual</b>	<b>Retorno (R\$)</b>	<b>Retorno (%)</b>	<b>(%) Instit</b>
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	6.157.508,54	0,00	0,00	7.506.874,13	1.349.365,59	21,91%	21,91%
				<b>Total Exterior</b>	<b>1.349.365,59</b>	<b>21,91%</b>	

**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
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	90.774.729,40	0,00	0,00	92.832.772,74	2.058.043,34	2,27%	2,27%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	40.358.757,61	0,00	0,00	42.225.540,64	1.866.783,03	4,63%	4,63%
BRDESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	0,00	97.558.208,79	75.286.737,69	23.654.497,60	1.383.026,50	1,42%	6,50%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	18.054.416,06	0,00	431.266,98	18.311.827,08	688.678,00	3,81%	1,43%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	50.646.691,03	28.387,71	33.612.923,58	17.724.955,71	662.800,55	1,31%	2,88%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	24.675.619,60	0,00	649.654,40	24.423.794,25	397.829,05	1,61%	1,64%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	13.015.690,20	0,00	329.016,67	13.039.700,40	353.026,87	2,71%	0,18%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	9.721.124,12	83.783.293,84	88.592.171,54	5.152.747,38	240.500,96	0,26%	3,12%
BRDESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	37.912.957,19	16.000.000,00	54.098.722,30	0,00	185.765,11	0,34%	1,15%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	4.095.136,69	0,00	685.000,00	3.461.559,89	51.423,20	1,26%	1,37%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	0,00	6.745.465,36	6.748.408,61	0,00	2.943,25	0,04%	1,37%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.314.712,69	0,00	0,00	1.294.283,40	-20.429,29	-1,55%	-1,55%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC...	18.110.044,05	0,00	0,00	17.742.037,98	-368.006,07	-2,03%	-2,03%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	35.413.921,86	4.363.518,73	0,00	39.152.464,72	-624.975,87	-1,57%	-1,75%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	100.026.864,49	13.089.282,55	23.407.919,03	88.750.665,66	-957.562,35	-0,85%	-1,88%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	48.367.093,72	0,00	3.500.000,00	43.558.685,40	-1.308.408,32	-2,71%	-2,93%
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>4.611.437,96</b>	<b>0,65%</b>	

**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
VINCI VALOREM FI MULTIMERCADO	9.320.948,17	0,00	0,00	9.645.908,38	324.960,21	3,49%	3,49%
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	11.103.594,04	0,00	0,00	11.281.970,44	178.376,40	1,61%	1,61%
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTISTRATÉGIA FIP	722.229,59	0,00	0,00	658.097,50	-64.132,09	-8,88%	-
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	0,00	7.200.000,00	0,00	6.948.859,86	-251.140,14	-3,49%	-3,10%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	0,00	6.720.000,00	0,00	6.067.306,44	-652.693,56	-9,71%	-6,40%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	9.511.250,72	0,00	0,00	8.718.869,43	-792.381,29	-8,33%	-8,33%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	18.271.871,93	0,00	0,00	17.197.195,25	-1.074.676,68	-5,88%	-5,88%
BRDESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	0,00	6.720.000,00	0,00	5.483.500,34	-1.236.499,66	-18,40%	-15,58%
VINCI MOSAICO FI AÇÕES	0,00	6.720.000,00	0,00	5.441.064,76	-1.278.935,24	-19,03%	-15,32%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	8.829.781,08	0,00	0,00	7.435.264,04	-1.394.517,04	-15,79%	-15,79%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	8.553.052,64	0,00	0,00	7.059.544,56	-1.493.508,08	-17,46%	-17,46%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	12.547.420,56	0,00	0,00	10.462.982,86	-2.084.437,70	-16,61%	-16,61%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	0,00	10.220.000,00	0,00	7.946.891,43	-2.273.108,57	-22,24%	-25,33%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	15.215.455,71	0,00	0,00	12.133.448,29	-3.082.007,42	-20,26%	-20,26%
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	15.193.802,74	0,00	0,00	11.466.600,10	-3.727.202,64	-24,53%	-24,53%
<b>Total Renda Variável</b>					<b>-18.901.903,50</b>	<b>-12,87%</b>	

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
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	0,00	6.720.000,00	0,00	7.506.874,13	786.874,13	11,71%	23,59%
				<b>Total Exterior</b>	<b>786.874,13</b>	<b>11,71%</b>	