

# CRÉDITO E MERCADO

*Consultoria em Investimentos*

Relatório Analítico dos Investimentos

em setembro e 3º trimestre de 2020

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

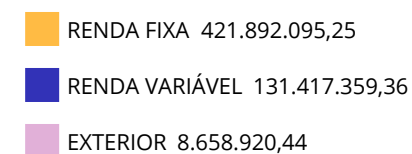
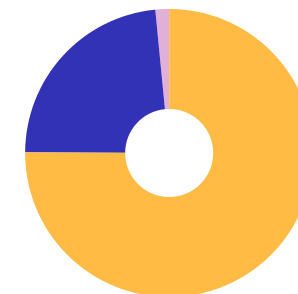
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	42.609.607,06	7,58%	868	0,31%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	75.684.995,07	13,47%	903	1,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	15/08/2024	9.024.326,10	1,61%	6	24,52%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS F...	D+1	Não há	17.898.559,12	3,18%	197	1,61%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	18.027.694,26	3,21%	74	1,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	17.468.108,31	3,11%	130	1,78%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	D+2	Não há	21.834.407,03	3,89%	21.251	1,63%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	117.421.295,50	20,89%	982	1,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	15/08/2022	8.535.583,70	1,52%	165	3,57%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	89.025.921,77	15,84%	290	1,86%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	3.104.645,89	0,55%	677	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se ...	Não se aplica	1.256.951,44	0,22%	98	1,53%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	D+4	Não há	7.031.994,56	1,25%	1.637	0,78%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
VINCI MOSAICO FI AÇÕES	D+4 du ...	Não há	5.486.630,64	0,98%	1.544	0,38%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAU FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	D+5	Não há	10.537.134,99	1,88%	55	1,19%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	D+4	Não há	5.546.862,87	0,99%	1.976	0,28%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	12.132.538,18	2,16%	205	1,76%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	D+4	Não há	7.935.030,09	1,41%	13.986	0,75%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	7.387.677,25	1,31%	1.589	2,76%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	9.129.332,40	1,62%	6.456	0,37%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '

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

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	12.599.777,04	2,24%	6.258	0,76%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
VINCI VALOREM FI MULTIMERCADO	D+2	Não há	9.798.055,91	1,74%	43.594	0,57%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	6.917.902,15	1,23%	20.023	0,30%	Artigo 8º, Inciso III
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	D+2	Não há	18.472.254,20	3,29%	76	3,39%	Artigo 8º, Inciso III
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	6.518.407,05	1,16%	15.513	0,66%	Artigo 8º, Inciso III
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	11.275.827,82	2,01%	998	1,08%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTISTRATÉGIA F...	Não se ...	Não se aplica	647.934,21	0,12%	19	3,21%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	8.658.920,44	1,54%	576	0,53%	Artigo 9º - A, Inciso III
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>561.968.375,05</b>				

**Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Setembro / 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%	328.504.576,15	58,46%	35,00%	55,50%	65,00%	36.774.867,63
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	65,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	84.295.256,26
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	45,00%	92.130.567,66	16,39%	15,00%	16,00%	30,00%	76.459.944,86
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	1.256.951,44	0,22%	0,00%	0,50%	0,50%	1.552.890,44
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>421.892.095,25</b>	<b>75,07%</b>	<b>50,00%</b>	<b>72,00%</b>	<b>110,50%</b>	



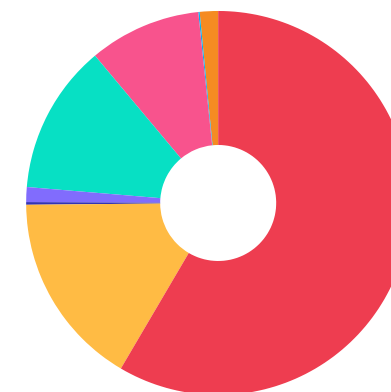
**ATENÇÃO!** Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.695/18 em seus Artigo 7º § 10º e Artigo 8º § 10º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!



**Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Setembro / 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%	7.031.994,56	1,25%	0,00%	1,50%	2,50%	7.017.214,82
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	25,00%	70.754.983,46	12,59%	6,00%	11,50%	15,00%	13.540.272,80
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	52.982.447,13	9,43%	6,00%	9,50%	10,00%	3.214.390,38
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	647.934,21	0,12%	0,00%	0,50%	1,00%	4.971.749,54
<b>Total Renda Variável</b>	<b>35,00%</b>	<b>131.417.359,36</b>	<b>23,39%</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%	16.859.051,25
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	8.658.920,44	1,54%	0,00%	2,00%	2,00%	2.580.447,06
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>8.658.920,44</b>	<b>1,54%</b>	<b>0,00%</b>	<b>5,00%</b>	<b>5,00%</b>	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	188.729.079,07	33,58	0,03
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	91.252.573,33	16,24	0,01
ITAÚ UNIBANCO	89.025.921,77	15,84	0,01
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	35.147.509,36	6,25	0,00
SUL AMERICA INVESTIMENTOS GEST...	29.769.437,12	5,30	0,09
BANCO J. SAFRA S/A	27.131.174,64	4,83	0,01
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	18.153.658,50	3,23	0,01
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	17.898.559,12	3,18	0,00
AZ QUEST INVESTIMENTOS	12.599.777,04	2,24	0,04
SAFRA ASSET MANAGEMENT	11.275.827,82	2,01	0,00
ITAÚ DTVM	10.537.134,99	1,88	0,00
VINCI GESTÃO DE PATRIMÔNIO LTD...	9.798.055,91	1,74	0,01
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	7.387.677,25	1,31	0,01
WESTERN ASSET	6.518.407,05	1,16	0,01
VINCI PARTNERS	5.486.630,64	0,98	0,01
PETRA CAPITAL	1.256.951,44	0,22	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 '	328.504.576,15	58,46	35,00	65,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	92.130.567,66	16,39	15,00	30,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	1.256.951,44	0,22	0,00	0,50
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	7.031.994,56	1,25	0,00	2,50
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	70.754.983,46	12,59	6,00	15,00
Artigo 8º, Inciso III	52.982.447,13	9,43	6,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	647.934,21	0,12	0,00	1,00
Artigo 9º - A, Inciso II	0,00	0,00	0,00	3,00
Artigo 9º - A, Inciso III	8.658.920,44	1,54	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 Setembro/2020 - RENDA FIXA**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IDKA PRÉ 2 ANOS (Benchmark)</b>	-0,47%	6,67%	0,06%	3,38%	8,65%	26,43%	-	-
BRDESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	-0,55%	6,45%	-0,05%	3,09%	8,31%	25,84%	0,02%	0,03%

<b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>	0,02%	5,41%	1,99%	5,41%	8,00%	21,88%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,11%	4,55%	1,61%	5,24%	7,28%	20,27%	0,01%	0,03%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,04%	4,84%	1,67%	5,27%	7,35%	20,53%	0,01%	0,03%

<b>IMA-B (Benchmark)</b>	-1,51%	-0,72%	0,96%	5,97%	2,11%	34,14%	-	-
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	-1,26%	-1,90%	1,07%	5,91%	1,30%	31,89%	0,04%	0,10%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA LP	-1,54%	-1,17%	0,88%	5,75%	1,58%	33,11%	0,04%	0,11%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,77%	-0,15%	-1,55%	3,53%	2,74%	20,75%	0,03%	0,07%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,19%	2,64%	0,98%	3,41%	5,12%	17,74%	0,01%	0,02%

<b>CDI (Benchmark)</b>	0,16%	2,28%	0,51%	1,25%	3,54%	10,04%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,00%	1,77%	0,39%	0,97%	2,90%	9,20%	0,00%	0,00%

<b>IPCA (Benchmark)</b>	0,64%	1,34%	1,24%	0,81%	3,14%	6,12%	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	-0,17%	-4,39%	-2,88%	-3,45%	-4,90%	-13,75%	0,00%	0,11%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,23%	2,47%	0,20%	1,32%	3,69%	17,87%	0,00%	0,01%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	-0,50%	4,53%	-0,09%	3,18%	6,41%	25,88%	0,02%	0,03%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,48%	-30,67%	-30,79%	-28,11%	-28,86%	-21,20%	0,02%	0,32%



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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>S&amp;P 500 (Benchmark)</b>	-3,92%	4,09%	8,47%	30,12%	12,98%	15,41%	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	-4,88%	0,56%	7,44%	27,61%	9,43%	16,25%	0,11%	0,25%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	-4,80%	1,10%	7,41%	27,36%	9,96%	16,39%	0,11%	0,24%
<b>IPCA + 10,00% ao ano (Benchmark)</b>	1,44%	8,81%	3,76%	5,73%	13,45%	28,36%	-	-
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTISTRATÉGIA FIP	-0,51%	-	-1,54%	-	-11,51%	-78,59%	0,00%	0,06%
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	-0,12%	4,51%	1,30%	5,11%	7,24%	23,75%	-	-
VINCI VALOREM FI MULTIMERCADO	-0,09%	5,12%	1,58%	4,62%	7,32%	22,63%	0,02%	0,03%
<b>IGC (Benchmark)</b>	-4,81%	-14,61%	0,77%	33,69%	-3,97%	32,91%	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	-5,04%	-17,78%	-0,39%	30,27%	-8,20%	24,95%	0,10%	0,40%
<b>Ibovespa (Benchmark)</b>	-4,80%	-18,20%	-0,48%	29,56%	-9,68%	19,23%	-	-
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	-4,26%	-16,02%	0,71%	31,74%	-5,26%	30,94%	0,10%	0,40%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-2,97%	-4,02%	4,71%	48,34%	5,55%	60,69%	0,11%	0,43%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	-7,94%	-25,44%	-0,15%	30,62%	-15,48%	24,09%	0,11%	0,48%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	-4,54%	-16,33%	-0,64%	28,99%	-7,90%	38,38%	0,11%	0,38%
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	-2,74%	-20,15%	5,81%	32,85%	-12,72%	15,23%	0,10%	0,40%
VINCI MOSAICO FI AÇÕES	-2,82%	-14,61%	0,84%	29,98%	1,22%	57,42%	0,11%	0,41%

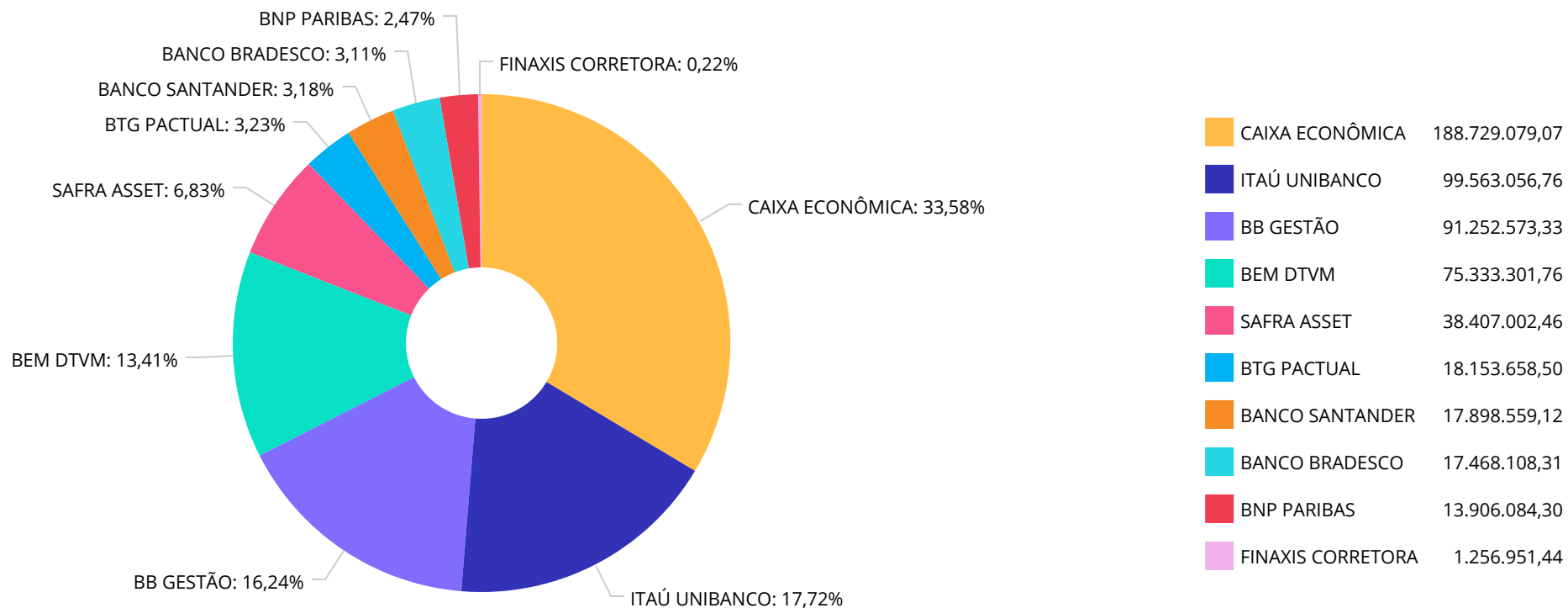
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>SMLL (Benchmark)</b>	-5,44%	-18,93%	2,27%	35,50%	-1,78%	54,49%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	-5,97%	-17,19%	3,84%	32,93%	-0,96%	56,53%	0,11%	0,48%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,16%	2,28%	0,51%	1,25%	3,54%	10,04%	-	-
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	-0,62%	1,55%	-0,05%	0,93%	3,01%	10,22%	0,01%	0,01%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	-2,05%	-3,54%	-0,45%	8,24%	0,88%	14,18%	0,03%	0,11%
<b>Não definido (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	-5,04%	-14,61%	1,16%	33,49%	-1,67%	48,47%	0,11%	0,42%

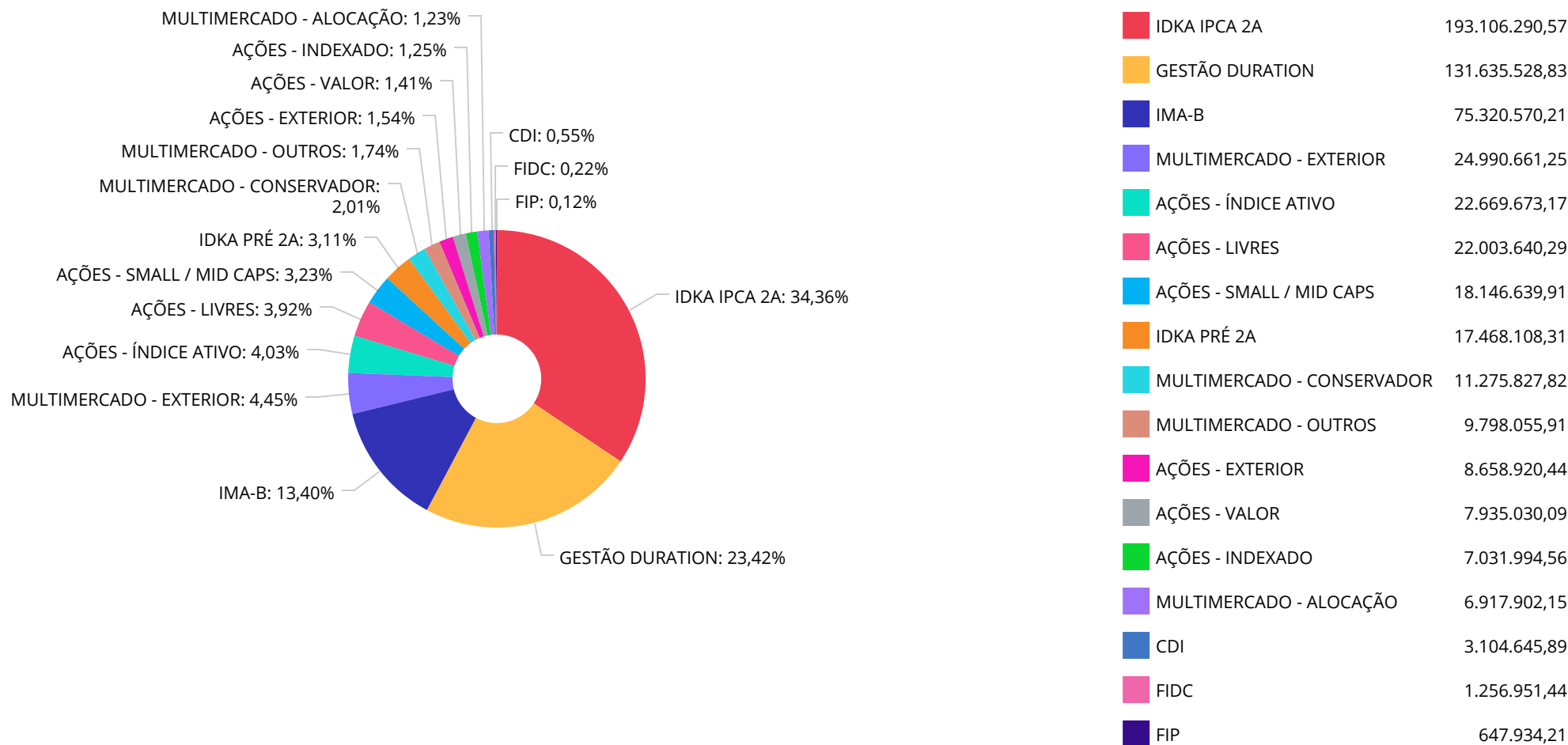
**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2020 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	-1,97%	51,44%	14,34%	43,02%	60,30%	70,28%	-	-
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-2,53%	42,55%	15,35%	40,62%	48,85%	70,31%	0,14%	0,24%

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



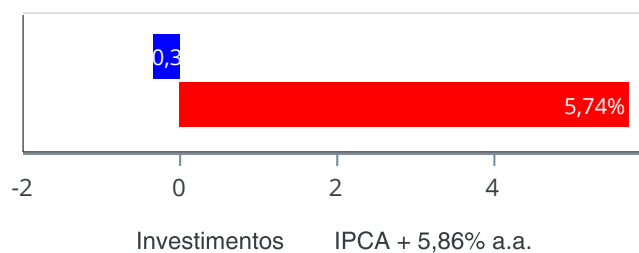
**Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Setembro / 2020)**



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

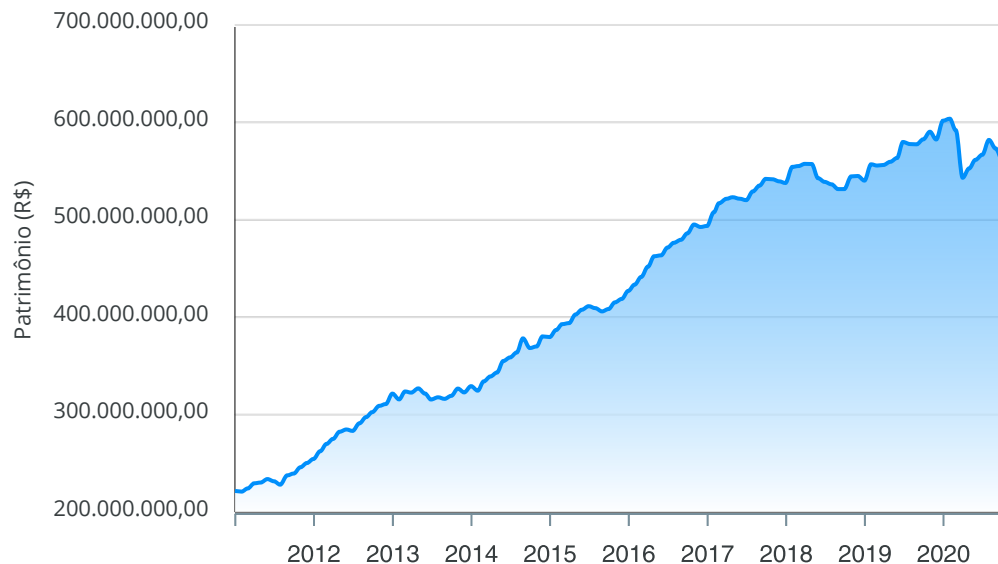
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	601.757.165,89	33.792.081,99	34.429.117,89	603.762.413,32	2.642.283,33	2.642.283,33	0,44%	0,44%	0,71%	0,71%	61,89%	2,07%
Fevereiro	603.762.413,32	118.776.753,06	122.569.044,97	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%
Julho	566.779.910,66	13.534.143,80	17.603.452,90	581.950.094,04	19.239.492,48	5.735.901,07	3,39%	1,13%	0,88%	3,83%	29,64%	2,91%
Agosto	581.950.094,04	205.867.975,03	212.983.934,58	573.188.442,12	-1.645.692,37	4.090.208,70	-0,28%	0,85%	0,72%	4,57%	18,56%	2,56%
Setembro	573.188.442,12	13.339.177,27	17.826.554,35	561.968.375,05	-6.732.689,99	-2.642.481,29	-1,17%	-0,34%	1,12%	5,74%	-5,85%	3,37%

Investimentos x Meta Atuarial



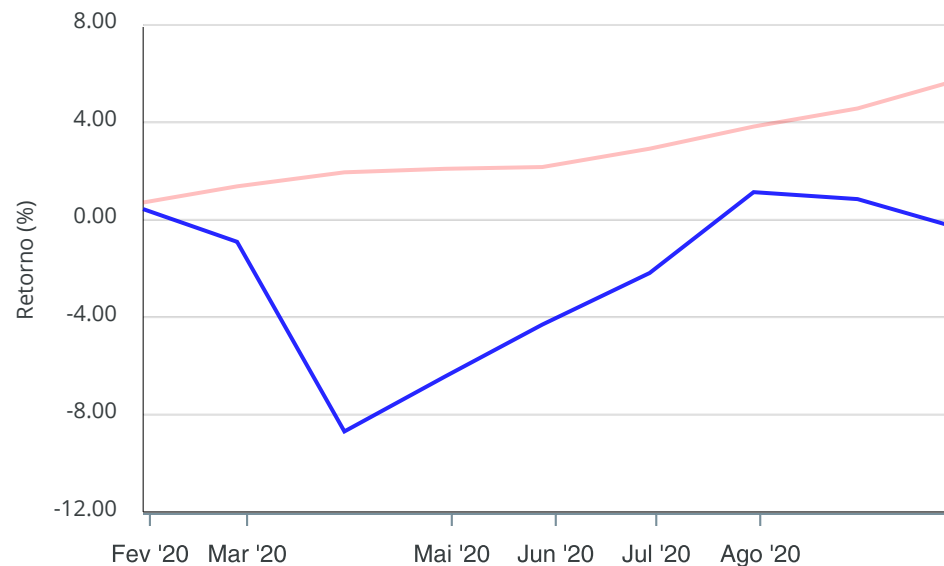
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO



- 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 Setembro/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	8.519.315,70	0,00	0,00	8.535.583,70	16.268,00	0,19%	0,19%	1,15%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	75.244.796,82	355.117,70	0,00	75.684.995,07	85.080,55	0,11%	0,11%	1,35%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	107.757.629,26	12.979.658,92	3.337.088,51	117.421.295,50	21.095,83	0,02%	0,04%	1,38%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	3.254.685,73	0,00	150.000,00	3.104.645,89	-39,84	0,00%	0,00%	0,10%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.259.079,77	0,00	0,00	1.256.951,44	-2.128,33	-0,17%	-0,17%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	89.230.482,59	0,00	0,00	89.025.921,77	-204.560,82	-0,23%	-0,23%	0,49%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	9.067.802,40	0,00	0,00	9.024.326,10	-43.476,30	-0,48%	-0,48%	1,80%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	42.825.085,23	0,00	0,00	42.609.607,06	-215.478,17	-0,50%	-0,50%	1,68%
BRDESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	32.024.155,21	4.400,65	14.339.465,84	17.468.108,31	-220.981,71	-0,69%	-0,55%	1,76%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	18.167.562,34	0,00	0,00	18.027.694,26	-139.868,08	-0,77%	-0,77%	2,55%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	22.113.821,73	0,00	0,00	21.834.407,03	-279.414,70	-1,26%	-1,26%	3,87%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC...	18.178.188,87	0,00	0,00	17.898.559,12	-279.629,75	-1,54%	-1,54%	4,13%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>427.642.605,65</b>	<b>13.339.177,27</b>	<b>17.826.554,35</b>	<b>421.892.095,25</b>	<b>-1.263.133,32</b>	<b>-0,29%</b>		<b>1,52%</b>



**Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Setembro/2020****FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL**

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
VINCI VALOREM FI MULTIMERCADO	9.806.903,73	0,00	0,00	9.798.055,91	-8.847,82	-0,09%	-0,09%	1,53%
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTISTRATÉGIA FIP	651.223,15	0,00	0,00	647.934,21	-3.288,94	-0,51%	-0,51%	0,32%
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	11.345.976,02	0,00	0,00	11.275.827,82	-70.148,20	-0,62%	-0,62%	0,69%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	7.062.988,54	0,00	0,00	6.917.902,15	-145.086,39	-2,05%	-2,05%	3,06%
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	12.473.960,41	0,00	0,00	12.132.538,18	-341.422,23	-2,74%	-2,74%	10,29%
VINCI MOSAICO FI AÇÕES	5.645.532,04	0,00	0,00	5.486.630,64	-158.901,40	-2,81%	-2,81%	10,54%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	9.408.330,43	0,00	0,00	9.129.332,40	-278.998,03	-2,97%	-2,97%	11,45%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	11.006.490,52	0,00	0,00	10.537.134,99	-469.355,53	-4,26%	-4,26%	10,31%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	7.739.321,96	0,00	0,00	7.387.677,25	-351.644,71	-4,54%	-4,54%	10,52%
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	19.402.810,61	0,00	0,00	18.472.254,20	-930.556,41	-4,80%	-4,80%	10,72%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	6.852.511,52	0,00	0,00	6.518.407,05	-334.104,47	-4,88%	-4,88%	10,83%
BRDESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	5.841.123,92	0,00	0,00	5.546.862,87	-294.261,05	-5,04%	-5,04%	10,54%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	7.405.567,94	0,00	0,00	7.031.994,56	-373.573,38	-5,04%	-5,04%	10,36%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	13.399.652,53	0,00	0,00	12.599.777,04	-799.875,49	-5,97%	-5,97%	10,55%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	8.619.413,64	0,00	0,00	7.935.030,09	-684.383,55	-7,94%	-7,94%	10,55%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>136.661.806,96</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>131.417.359,36</b>	<b>-5.244.447,60</b>	<b>-3,84%</b>		<b>8,63%</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: 30/09/2020

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	8.884.029,51	0,00	0,00	8.658.920,44	-225.109,07	-2,53%	-2,53%	13,89%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>8.884.029,51</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>8.658.920,44</b>	<b>-225.109,07</b>	<b>-2,53%</b>		<b>13,89%</b>

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

**FUNDOS DE RENDA FIXA**

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	88.750.665,66	5.132.421,66	96.733.847,64	0,00	2.850.760,32	3,04%	0,89%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	39.152.464,72	691.975,44	41.112.510,48	0,00	1.268.070,32	3,18%	0,83%
SULAMÉRICA INFLATIE FI RENDA FIXA LP	43.558.685,40	0,00	22.650.000,00	21.834.407,03	925.721,63	2,13%	1,07%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	17.724.955,71	57.546.708,89	0,00	75.684.995,07	413.330,47	0,55%	1,61%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	5.152.747,38	132.176.910,61	20.153.338,70	117.421.295,50	244.976,21	0,18%	1,66%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	92.832.772,74	0,00	4.000.000,00	89.025.921,77	193.149,03	0,21%	0,20%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	24.423.794,25	0,00	16.070.799,03	8.535.583,70	182.588,48	0,75%	0,98%
SANTANDER IMA-B INSTITUCIONAL TÍTULOS PÚBLICOS FIC...	17.742.037,98	0,00	0,00	17.898.559,12	156.521,14	0,88%	0,88%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	18.311.827,08	0,00	424.153,10	18.027.694,26	140.020,28	0,76%	-1,55%
BTG PACTUAL 2024 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	13.039.700,40	0,00	4.120.353,49	9.024.326,10	104.979,19	0,81%	-30,79%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	3.461.559,89	0,00	370.000,00	3.104.645,89	13.086,00	0,38%	0,39%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.294.283,40	0,00	0,00	1.256.951,44	-37.331,96	-2,88%	-2,88%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	42.225.540,64	424.153,10	0,00	42.609.607,06	-40.086,68	-0,09%	-0,09%
BRDESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	23.654.497,60	36.769.126,40	42.778.939,39	17.468.108,31	-176.576,30	-0,29%	-0,05%
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>6.239.208,13</b>	<b>0,94%</b>	

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

**FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL**

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
SAFRA S&P REAIS PB FI MULTIMERCADO	17.197.195,25	0,00	0,00	18.472.254,20	1.275.058,95	7,41%	7,41%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	11.466.600,10	0,00	0,00	12.132.538,18	665.938,08	5,81%	5,81%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	12.133.448,29	0,00	0,00	12.599.777,04	466.328,75	3,84%	3,84%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	6.067.306,44	0,00	0,00	6.518.407,05	451.100,61	7,43%	7,43%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	8.718.869,43	0,00	0,00	9.129.332,40	410.462,97	4,71%	4,71%
VINCI VALOREM FI MULTIMERCADO	9.645.908,38	0,00	0,00	9.798.055,91	152.147,53	1,58%	1,58%
ITAÚ FOF RPI IBOVESPA ATIVO FIC AÇÕES	10.462.982,86	0,00	0,00	10.537.134,99	74.152,13	0,71%	0,71%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	5.483.500,34	0,00	0,00	5.546.862,87	63.362,53	1,16%	1,16%
VINCI MOSAICO FI AÇÕES	5.441.064,76	0,00	0,00	5.486.630,64	45.565,88	0,84%	0,84%
SAFRA CARTEIRA PREMIUM FI MULTIMERCADO	11.281.970,44	0,00	0,00	11.275.827,82	-6.142,62	-0,05%	-0,05%
CAIXA INCORPORAÇÃO IMOBILIÁRIA MULTISTRATÉGIA FIP	658.097,50	0,00	0,00	647.934,21	-10.163,29	-1,54%	-1,54%
SULAMÉRICA EQUITIES FI AÇÕES	7.946.891,43	0,00	0,00	7.935.030,09	-11.861,34	-0,15%	-0,15%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	7.059.544,56	0,00	0,00	7.031.994,56	-27.550,00	-0,39%	-0,39%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	6.948.859,86	0,00	0,00	6.917.902,15	-30.957,71	-0,45%	-0,45%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	7.435.264,04	0,00	0,00	7.387.677,25	-47.586,79	-0,64%	-0,64%
				<b>Total Renda Variável</b>	<b>3.469.855,68</b>	<b>2,71%</b>	

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

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
SAFRA CONSUMO AMERICANO PB FI AÇÕES BDR NÍVEL I	7.506.874,13	0,00	0,00	8.658.920,44	1.152.046,31	15,35%	15,35%
				<b>Total Exterior</b>	<b>1.152.046,31</b>	<b>15,35%</b>	