

# 2020

## Relatório Mensal

# Julho

## Análise dos Investimentos

De acordo com a Portaria MTP nº 1.467 de 2 de junho de 2022, Capítulo VI, Seção V, Artigo 136º e com o Manual do Pró-Gestão RPPS versão 3.3, item 3.2.6 Nível I, aprovado pela Portaria SPREV nº 918, de 2 de Março de 2022.

| Ativo   | Saldo Atual   | % Carteira | PL R\$            | % PL  | Lei      |
|---|---------------|------------|-------------------|-------|----------|
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO             | 29.889.380,14 | 12,38%     | 10.799.663.748,52 | 0,28% | 7º Ib    |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO     | 266.633,92    | 0,11%      | 6.099.396.938,17  | 0,00% | 7º Ib    |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO      | 685.733,85    | 0,28%      | 5.823.784.558,48  | 0,01% | 7º Ib    |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO   | 11.803.657,53 | 4,89%      | 7.835.713.656,67  | 0,15% | 7º Ib    |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO      | 2.746.914,98  | 1,14%      | 5.350.645.859,80  | 0,05% | 7º Ib    |
| BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA             | 8.949.076,17  | 3,71%      | 946.282.128,30    | 0,95% | 7º Ib    |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA              | 39.457.466,34 | 16,35%     | 12.451.209.797,34 | 0,32% | 7º Ib    |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 19.236.314,71 | 7,97%      | 7.954.778.997,85  | 0,24% | 7º Ib    |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP      | 15.389.979,28 | 6,38%      | 12.027.903.790,65 | 0,13% | 7º Ib    |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP     | 177.371,30    | 0,07%      | 2.059.270.796,72  | 0,01% | 7º Ib    |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP        | 415.723,59    | 0,17%      | 6.313.416.954,01  | 0,01% | 7º Ib    |
| CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP    | 7.427.813,27  | 3,08%      | 1.311.603.752,58  | 0,57% | 7º Ib    |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA         | 28.445.452,69 | 11,78%     | 10.907.406.871,77 | 0,26% | 7º Ib    |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP     | 26.932,17     | 0,01%      | 3.049.933.927,01  | 0,00% | 7º Ib    |
| ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA                    | 368.659,43    | 0,15%      | 210.873.996,60    | 0,17% | 7º Ib    |
| CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP      | 314.681,80    | 0,13%      | 2.998.036.270,63  | 0,01% | 7º III a |
| BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO                       | 623.146,39    | 0,26%      | 1.510.787.186,06  | 0,04% | 7º IV a  |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP  | 11.851.578,68 | 4,91%      | 2.412.408.451,26  | 0,49% | 7º IV a  |
| BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA                   | 19.001.363,13 | 7,87%      | 1.237.407.026,84  | 1,54% | 7º IV a  |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA               | 373.952,29    | 0,15%      | 831.066.921,71    | 0,04% | 7º IV a  |
| BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI              | 2.126.410,41  | 0,88%      | 3.786.771.901,20  | 0,06% | 7º IV a  |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA         | 16.447.279,44 | 6,81%      | 5.186.154.771,17  | 0,32% | 7º IV a  |
| XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP              | 1.251.486,80  | 0,52%      | 481.380.309,42    | 0,26% | 7º IV a  |
| CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO         | 5.881.686,40  | 2,44%      | 184.385.326,60    | 3,19% | 7º VII b |
| BB INDEXADO IBRX FIC AÇÕES                                  | 483.544,22    | 0,20%      | 204.093.174,13    | 0,24% | 8º I a   |
| BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES                                | 187.504,47    | 0,08%      | 1.935.501.908,96  | 0,01% | 8º II a  |
| BRADESCO SELECTION FI AÇÕES                                 | 196.796,73    | 0,08%      | 711.621.761,40    | 0,03% | 8º II a  |

Investimentos

\$ 241.370.286,52

Disponibilidades Financeiras

\$ 187.314,58

Total Carteira

\$ 241.557.601,10

Governança (Pró Gestão)

📄 Não possui

| Ativo   | Saldo Atual  | % Carteira | PL R\$           | % PL  | Lei      |
|---|--------------|------------|------------------|-------|----------|
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES                                    | 3.580.934,38 | 1,48%      | 4.123.590.154,26 | 0,09% | 8º II a  |
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES                      | 2.553.612,87 | 1,06%      | 3.901.201.469,95 | 0,07% | 8º II a  |
| XP INVESTOR 30 FIC AÇÕES                                  | 515.514,62   | 0,21%      | 686.700.662,67   | 0,08% | 8º II a  |
| XP INVESTOR DIVIDENDOS 30 FIC AÇÕES                       | 488.513,76   | 0,20%      | 128.849.407,24   | 0,38% | 8º II a  |
| CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO | 4.706.131,37 | 1,95%      | 507.871.987,12   | 0,93% | 8º III   |
| ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO        | 326.983,48   | 0,14%      | 73.825.160,83    | 0,44% | 8º III   |
| ITAÚ PRIVATE S&P500@ BRL FIC MULTIMERCADO                 | 3.059.307,01 | 1,27%      | 1.013.747.629,74 | 0,30% | 8º III   |
| XP MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO                   | 229.542,47   | 0,10%      | 411.390.622,76   | 0,06% | 8º III   |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I                  | 1.883.206,43 | 0,78%      | 1.279.266.331,34 | 0,15% | 9º A III |

Investimentos

\$ 241.370.286,52

Disponibilidades Financeiras

\$ 187.314,58

Total Carteira

\$ 241.557.601,10

Governança (Pró Gestão)

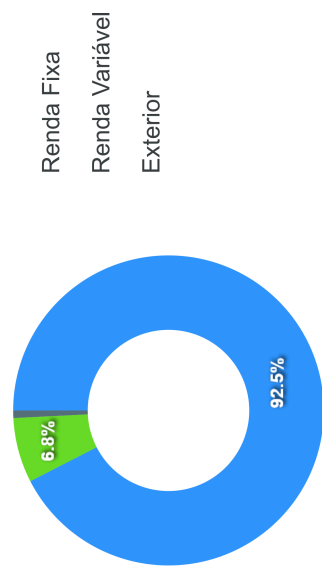
☑ Não possui

| Artigos                                     | Limite (%) | Utilizado             | Livre                 |
|---|------------|-----------------------|-----------------------|
| 7º I b - FI 100% Títulos TN                 | 100,00%    | 165.287.109,37 68,48% | 76.083.177,15 31,52%  |
| 7º III a - FI Referenciados RF              | 60,00%     | 314.681,80 0,13%      | 144.507.490,11 59,87% |
| 7º IV a - FI de Renda Fixa                  | 40,00%     | 51.675.217,14 21,41%  | 44.872.897,47 18,59%  |
| 7º VII b - FI Renda Fixa - Crédito Privado  | 5,00%      | 5.881.686,40 2,44%    | 6.186.827,93 2,56%    |
| 8º I a - FI Referenciados em Renda Variável | 30,00%     | 483.544,22 0,20%      | 71.927.541,74 29,80%  |
| 8º II a - FI em Ações                       | 20,00%     | 7.522.876,83 3,12%    | 40.751.180,47 16,88%  |
| 8º III - FI Multimercado                    | 10,00%     | 8.321.964,33 3,45%    | 15.815.064,32 6,55%   |
| 9º A III - Ações - BDR Nível I              | 10,00%     | 1.883.206,43 0,78%    | 22.253.822,22 9,22%   |

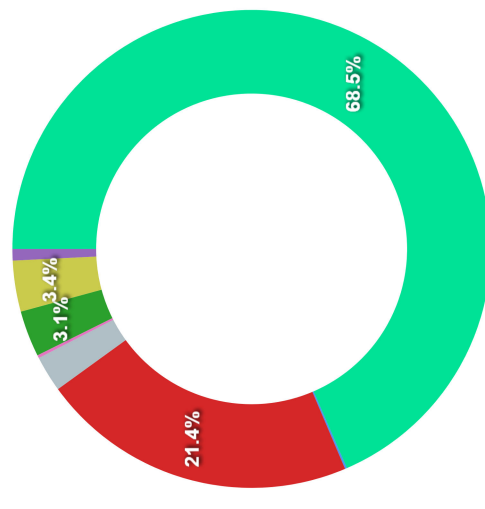
Governança (Pró Gestão)

🔗 Não possui

Segmentos



Artigos



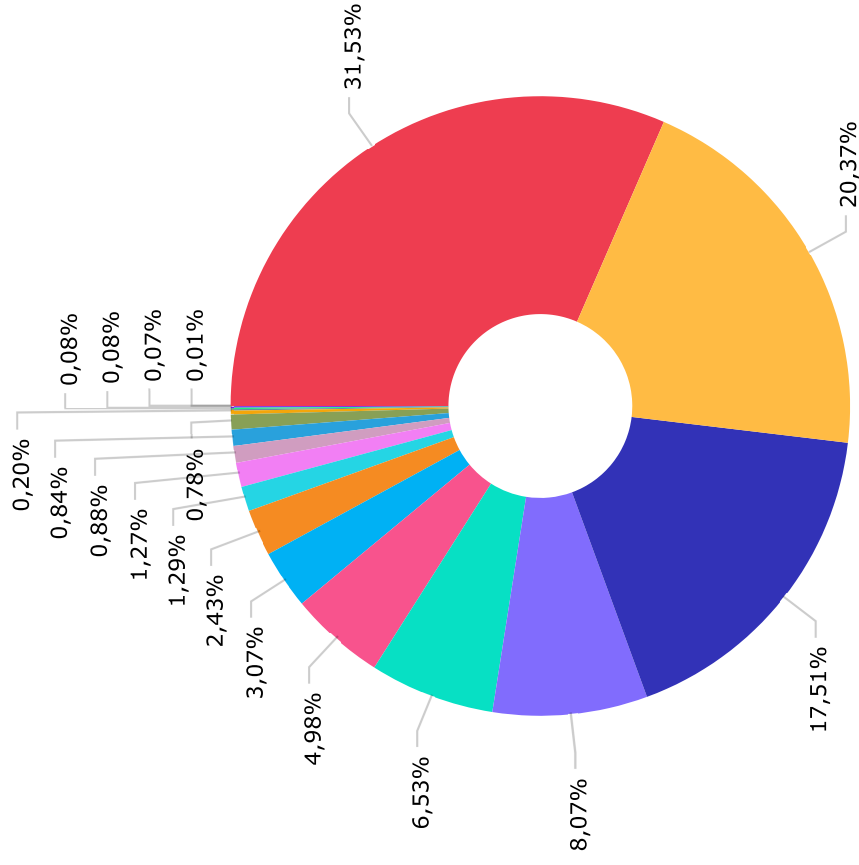
| Artigos                           | Atual  | Inferior | Alvo  | Superior | GAP Superior   | Artigos                           | Atual | Inferior | Alvo  | Superior | GAP Superior  |
|-----------------------------------|--------|----------|-------|----------|----------------|-----------------------------------|-------|----------|-------|----------|---------------|
| 7º I a - Títulos TN SELIC         | 0,00%  | 0,00%    | 0,00% | 100,00%  | 241.370.286,52 | 8º I a - FI Referenciados em R... | 0,20% | 0,00%    | 0,00% | 30,00%   | 71.927.541,74 |
| 7º I b - FI 100% Títulos TN       | 68,48% | 0,00%    | 0,00% | 100,00%  | 76.083.177,15  | 8º I b - FI de Índices Referen... | 0,00% | 0,00%    | 0,00% | 30,00%   | 72.411.085,96 |
| 7º I c - ETF 100% Títulos TN      | 0,00%  | 0,00%    | 0,00% | 100,00%  | 241.370.286,52 | 8º II a - FI em Ações             | 3,12% | 0,00%    | 0,00% | 20,00%   | 40.751.180,47 |
| 7º III a - FI Referenciados RF    | 0,13%  | 0,00%    | 0,00% | 60,00%   | 144.507.490,11 | 8º II b - FI em Índices de Açõ... | 0,00% | 0,00%    | 0,00% | 20,00%   | 48.274.057,30 |
| 7º III b - FI de Índices Refer... | 0,00%  | 0,00%    | 0,00% | 60,00%   | 144.822.171,91 | 8º III - FI Multimercado          | 3,45% | 0,00%    | 0,00% | 10,00%   | 15.815.064,32 |
| 7º IV a - FI de Renda Fixa        | 21,41% | 0,00%    | 0,00% | 40,00%   | 44.872.897,47  | 8º IV b - FI Imobiliário          | 0,00% | 0,00%    | 0,00% | 5,00%    | 12.068.514,33 |
| 7º IV b - FI de Índices Renda ... | 0,00%  | 0,00%    | 0,00% | 40,00%   | 96.548.114,61  | 9º A I - Renda Fixa - Dívida E... | 0,00% | 0,00%    | 0,00% | 10,00%   | 24.137.028,65 |
| 7º V b - Letras Imobiliárias G... | 0,00%  | 0,00%    | 0,00% | 5,00%    | 12.068.514,33  | 9º A II - Constituídos no Bras... | 0,00% | 0,00%    | 0,00% | 10,00%   | 24.137.028,65 |
| 7º VII b - FI Renda Fixa - Cré... | 2,44%  | 0,00%    | 0,00% | 5,00%    | 6.186.827,93   | 9º A III - Ações - BDR Nível I    | 0,78% | 0,00%    | 0,00% | 10,00%   | 22.253.822,22 |
| 7º VII c - FI de Debêntures In... | 0,00%  | 0,00%    | 0,00% | 5,00%    | 12.068.514,33  |                                   |       |          |       |          |               |

|   | Mês         | Ano           | 3M           | 6M            | 12M          | 24M          | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|---|-------------|---------------|--------------|---------------|--------------|--------------|-----------|--------------------|
| <b>CDI - BENCHMARK</b>                                      | <b>0,19</b> | <b>1,95</b>   | <b>0,64</b>  | <b>1,57</b>   | <b>4,22</b>  | <b>10,83</b> |           |                    |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO             | 1,77        | 3,55          | 3,83         | 3,05          | 7,10         | 23,78        | 1,05      | 2,22               |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP  | 0,24        | 1,61          | 0,75         | 1,26          | 3,74         | 10,19        | 0,03      | 0,05               |
| XP MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO                     | 1,44        | 2,37          | 6,21         | 2,39          | 6,23         | 15,42        |           |                    |
| ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO          | 0,30        | 2,44          | 0,89         | 1,94          | 4,99         | 12,91        | 0,13      | 0,27               |
| <b>GLOBAL BDRX - BENCHMARK</b>                              | <b>1,77</b> | <b>34,78</b>  | <b>9,44</b>  | <b>26,60</b>  | <b>55,42</b> | <b>70,67</b> |           |                    |
| CAIXA INSTITUCIONAL FI AÇÕES BDR NÍVEL I                    | 1,88        | 35,34         | 9,28         | 27,06         | 55,47        | 69,34        | 8,52      | 17,94              |
| <b>IBOVESPA - BENCHMARK</b>                                 | <b>8,27</b> | <b>-11,01</b> | <b>27,83</b> | <b>-9,54</b>  | <b>1,08</b>  | <b>29,91</b> |           |                    |
| XP INVESTOR 30 FIC AÇÕES                                    | 8,53        | -10,69        | 29,59        | -13,50        | 8,07         | 43,99        | 11,02     | 23,20              |
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES                                      | 7,54        | -16,38        | 23,81        | -16,23        | -0,92        | 38,66        | 8,75      | 18,43              |
| XP INVESTOR DIVIDENDOS 30 FIC AÇÕES                         | 6,16        | -19,48        | 15,87        | -20,62        | -1,35        | 44,92        | 10,57     | 22,26              |
| BRADESCO SELECTION FI AÇÕES                                 | 10,05       | -16,95        | 29,32        | -15,87        | -6,40        | 22,01        | 10,30     | 21,69              |
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES                        | 5,80        | -24,37        | 29,49        | -25,46        | -12,43       | 22,51        | 11,66     | 24,55              |
| CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO   | 0,05        | 1,85          | 0,43         | 1,53          | 4,66         |              |           |                    |
| <b>IBX - BENCHMARK</b>                                      | <b>8,42</b> | <b>-10,43</b> | <b>28,20</b> | <b>-9,30</b>  | <b>2,17</b>  | <b>33,69</b> |           |                    |
| BB INDEXADO IBRX FIC AÇÕES                                  | 8,11        | -11,83        | 27,04        | -10,53        | -0,36        | 27,00        | 9,91      | 20,88              |
| <b>IDIV - BENCHMARK</b>                                     | <b>6,53</b> | <b>-13,05</b> | <b>21,87</b> | <b>-11,65</b> | <b>3,50</b>  | <b>46,49</b> |           |                    |
| BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES                                | 7,15        | -16,70        | 20,14        | -14,37        | -8,25        | 17,96        | 9,89      | 20,83              |
| <b>IDKA IPCA 2 ANOS - BENCHMARK</b>                         | <b>0,94</b> | <b>4,31</b>   | <b>3,72</b>  | <b>3,76</b>   | <b>8,68</b>  | <b>22,37</b> |           |                    |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0,83        | 3,97          | 3,96         | 3,50          | 8,10         | 20,93        | 0,77      | 1,63               |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO     | 0,81        | 3,71          | 4,07         | 3,32          | 7,99         | 20,62        | 0,74      | 1,56               |

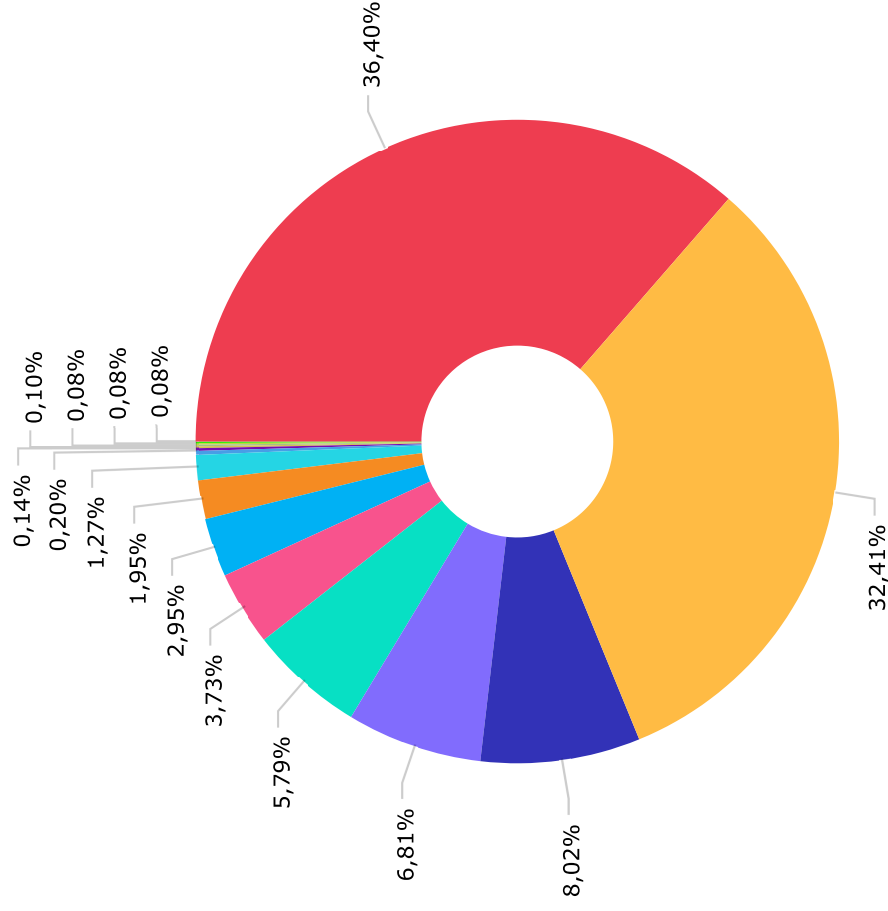
|  | Mês  | Ano  | 3M    | 6M   | 12M  | 24M   | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|--|------|------|-------|------|------|-------|-----------|--------------------|
| <b>IMA GERAL - BENCHMARK</b>                             |      |      |       |      |      |       |           |                    |
| CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 1,74 | 3,64 | 3,79  | 3,07 | 7,33 | 23,84 |           | 1,96               |
|  | 1,65 | 3,29 | 3,54  | 2,79 | 6,86 | 22,77 | 0,93      |                    |
| <b>IMA-B - BENCHMARK</b>                                 |      |      |       |      |      |       |           |                    |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO   | 4,39 | 2,65 | 8,14  | 2,38 | 8,16 | 37,87 |           | 4,78               |
|  | 4,36 | 2,54 | 8,07  | 2,27 | 7,94 | 37,20 | 2,27      |                    |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP     | 4,38 | 2,42 | 8,09  | 2,17 | 7,72 | 37,07 | 2,27      | 4,78               |
| CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP   | 4,40 | 2,46 | 8,09  | 2,22 | 7,80 | 36,97 | 2,27      | 4,78               |
| BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO                    | 4,39 | 2,36 | 8,15  | 2,09 | 7,74 | 36,90 | 2,27      | 4,79               |
| <b>IMA-B 5 - BENCHMARK</b>                               |      |      |       |      |      |       |           |                    |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP   | 0,99 | 4,19 | 4,28  | 3,61 | 8,83 | 24,16 |           | 1,74               |
|  | 0,97 | 4,05 | 4,23  | 3,48 | 8,54 | 23,61 | 0,83      |                    |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA            | 0,97 | 4,24 | 4,28  | 3,66 | 8,77 | 23,92 | 0,87      | 1,83               |
| <b>IMA-B 5+ - BENCHMARK</b>                              |      |      |       |      |      |       |           |                    |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP  | 7,33 | 1,68 | 11,51 | 1,64 | 7,81 | 49,37 |           | 7,99               |
|  | 7,29 | 1,46 | 11,43 | 1,50 | 7,35 | 47,92 | 3,79      |                    |
| <b>IPCA - BENCHMARK</b>                                  |      |      |       |      |      |       |           |                    |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA           | 0,36 | 0,46 | 0,24  | 0,25 | 2,31 | 5,60  |           | 1,93               |
|  | 0,98 | 5,65 | 3,14  | 4,79 | 9,68 | 28,24 | 0,92      |                    |
| XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP           | 1,98 | 4,14 | 5,73  | 3,42 | 8,66 | 24,65 | 1,15      | 2,42               |
| BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA                | 1,71 | 3,52 | 3,83  | 3,08 | 7,06 | 23,05 | 1,05      | 2,21               |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA      | 0,55 | 2,83 | 1,54  | 2,48 | 5,21 | 19,22 | 0,26      | 0,54               |
| <b>IRF-M - BENCHMARK</b>                                 |      |      |       |      |      |       |           |                    |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO   | 1,08 | 6,00 | 3,32  | 5,08 | 9,81 | 26,59 |           | 2,17               |
|  | 1,13 | 5,86 | 3,31  | 4,96 | 9,57 | 26,04 | 1,03      |                    |
| ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA                 | 0,23 | 2,70 | 0,91  | 2,26 | 5,23 | 12,70 | 0,15      | 0,31               |
| <b>IRF-M 1 - BENCHMARK</b>                               |      |      |       |      |      |       |           |                    |
|  | 0,24 | 2,84 | 0,94  | 2,39 | 5,51 | 13,20 |           |                    |

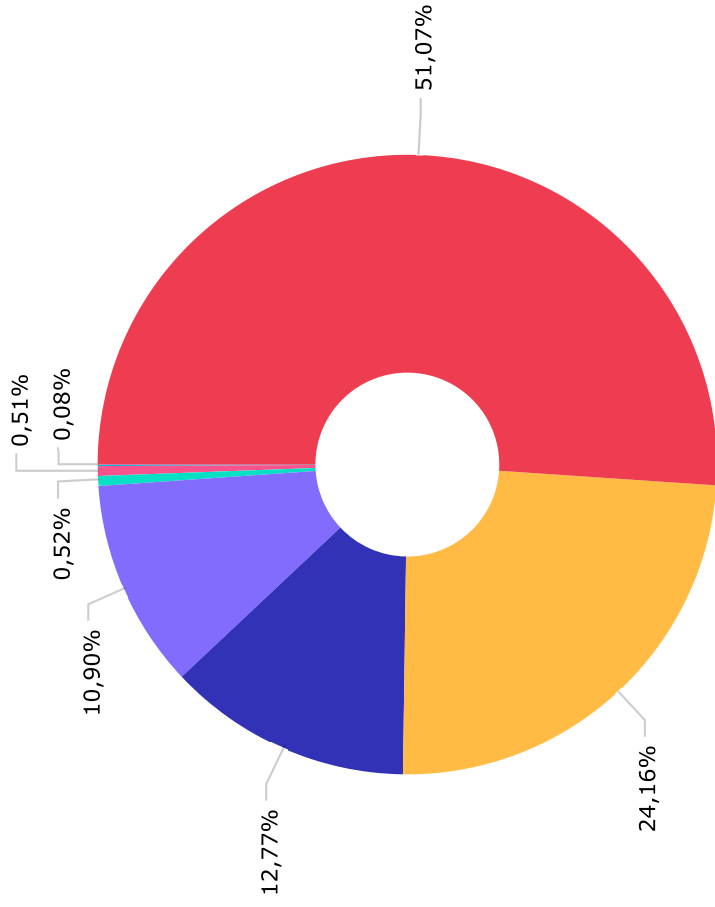
|   | Mês         | Ano         | 3M           | 6M          | 12M          | 24M          | VaR - Mês | Volatilidade - Mês |
|---|-------------|-------------|--------------|-------------|--------------|--------------|-----------|--------------------|
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA       | 0,24        | 2,73        | 0,90         | 2,30        | 5,30         | 12,79        | 0,15      | 0,31               |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | 0,23        | 2,69        | 0,88         | 2,26        | 5,22         | 12,65        | 0,15      | 0,31               |
| BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA           | 0,22        | 2,66        | 0,87         | 2,24        | 5,21         | 12,59        | 0,15      | 0,32               |
| <b>IRF-M 1+ - BENCHMARK</b>                               | <b>1,47</b> | <b>7,59</b> | <b>4,50</b>  | <b>6,41</b> | <b>12,02</b> | <b>32,81</b> |           |                    |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP   | 1,50        | 7,47        | 4,47         | 6,32        | 11,77        | 32,19        | 1,45      | 3,06               |
| <b>S&amp;P 500 (MOEDA ORIGINAL) - BENCHMARK</b>           | <b>5,51</b> | <b>1,25</b> | <b>12,32</b> | <b>1,41</b> | <b>9,76</b>  | <b>16,15</b> |           |                    |
| ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO                 | 5,68        | -0,60       | 12,54        | -0,96       | 9,02         | 19,43        | 6,47      | 13,63              |
| <b>SELIC - BENCHMARK</b>                                  | <b>0,19</b> | <b>1,95</b> | <b>0,64</b>  | <b>1,57</b> | <b>4,22</b>  | <b>10,83</b> |           |                    |
| BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI            | 0,27        | 1,42        | 0,85         | 1,05        | 3,58         | 10,08        | 0,03      | 0,06               |
| <b>IPCA + 6,00% AO ANO - BENCHMARK</b>                    | <b>0,90</b> | <b>3,91</b> | <b>1,73</b>  | <b>3,16</b> | <b>8,47</b>  | <b>18,63</b> |           |                    |
| CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO       | 1,86        | 5,47        | 6,05         | 4,62        | 10,69        | 28,48        | 1,42      | 2,99               |



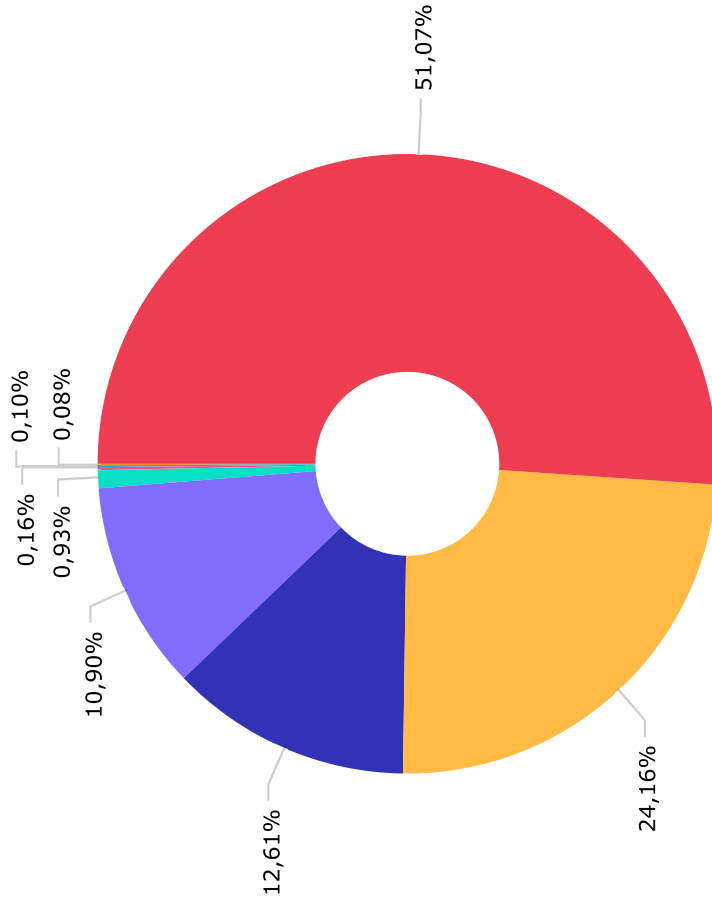


|                              |               |
|------------------------------|---------------|
| IPCA                         | 76.157.595,71 |
| IRF-M 1                      | 49.198.186,39 |
| CDI                          | 42.297.484,77 |
| IDKA IPCA 2 Anos             | 19.502.948,63 |
| IMA-B 5                      | 15.763.931,57 |
| Ibovespa                     | 12.041.503,73 |
| IMA Geral                    | 7.427.813,27  |
| IPCA + 6,00% ao ano          | 5.881.686,40  |
| IRF-M                        | 3.115.574,41  |
| S&P 500 (Moeda Original)     | 3.059.307,01  |
| Selic                        | 2.126.410,41  |
| IMA-B                        | 2.039.285,63  |
| Global BDRX                  | 1.883.206,43  |
| IBX                          | 483.544,22    |
| IDIV                         | 187.504,47    |
| Disponibilidades Financeiras | 187.314,58    |
| IMA-B 5+                     | 177.371,30    |
| IRF-M 1+                     | 26.932,17     |





| Management                         | Value          |
|------------------------------------|----------------|
| CAIXA ECONÔMICA FEDERAL            | 123.362.759,35 |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A...  | 58.350.589,71  |
| BRAM - BRADESCO ASSET MANAGEMEM... | 30.835.103,20  |
| ITAU UNIBANCO S.A.                 | 26.336.776,61  |
| XP VISTA ASSET MANAGEMENT LTDA...  | 1.251.486,80   |
| XP GESTAO DE RECURSOS LTDA         | 1.233.570,85   |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA         | 187.314,58     |



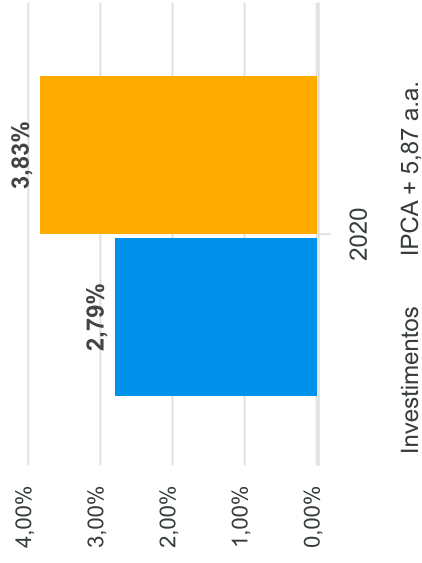
| Administrador                     | Valor          |
|-----------------------------------|----------------|
| CAIXA ECONÔMICA FEDERAL           | 123.362.759,35 |
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM S.A... | 58.350.589,71  |
| BANCO BRADESCO S.A.               | 30.450.802,00  |
| ITAU UNIBANCO S.A.                | 26.336.776,61  |
| INTRAG DTVM LTDA                  | 2.255.515,18   |
| BEM DISTRIBUIDORA DE TÍTULOS E... | 384.301,20     |
| BNY MELLON SERVICOS FINANCEIRO... | 229.542,47     |
| DISPONIBILIDADE FINANCEIRA        | 187.314,58     |

| Mês       | Saldo Anterior | Aplicações    | Resgates      | Saldo Atual    | Retorno \$    | Retorno Acumulado \$ | Retorno % | Retorno Acumulado % | Meta % | Meta Acumulado % | Meta x Retorno Acumulado % | Risco - VaR |
|-----------|----------------|---------------|---------------|----------------|---------------|----------------------|-----------|---------------------|--------|------------------|----------------------------|-------------|
| Janeiro   | 224.454.039,47 | 1.806.166,41  | 464.263,84    | 227.072.452,80 | 1.276.510,76  | 1.276.510,76         | 0,57% ▲   | 0,57%               | 0,71%  | 0,71%            | 80,28%                     | 0,99%       |
| Fevereiro | 227.072.452,80 | 18.218.124,97 | 16.770.078,99 | 228.313.992,89 | -206.505,89   | 1.070.004,87         | -0,09% ▼  | 0,47%               | 0,66%  | 1,37%            | 34,31%                     | 1,47%       |
| Março     | 228.313.992,89 | 1.911.652,93  | 437.454,03    | 224.520.746,59 | -5.267.445,20 | -4.197.440,33        | -2,29% ▼  | -1,83%              | 0,57%  | 1,95%            | -93,85%                    | 6,99%       |
| Abril     | 224.520.746,59 | 2.226.174,73  | 418.311,87    | 228.867.596,24 | 2.538.986,79  | -1.658.453,54        | 1,12% ▲   | -0,73%              | 0,14%  | 2,10%            | -34,76%                    | 4,07%       |
| Mai       | 228.867.596,24 | 1.958.683,12  | 448.311,87    | 233.339.058,83 | 2.961.091,34  | 1.302.637,80         | 1,29% ▲   | 0,55%               | 0,07%  | 2,17%            | 25,35%                     | 1,82%       |
| Junho     | 233.339.058,83 | 1.950.539,59  | 557.069,88    | 237.093.296,18 | 2.360.767,64  | 3.663.405,44         | 1,01% ▲   | 1,56%               | 0,74%  | 2,92%            | 53,42%                     | 1,42%       |
| Julho     | 237.093.296,18 | 1.884.405,10  | 488.694,23    | 241.370.286,52 | 2.881.279,47  | 6.544.684,91         | 1,21% ▲   | 2,79%               | 0,88%  | 3,83%            | 72,85%                     | 1,12%       |

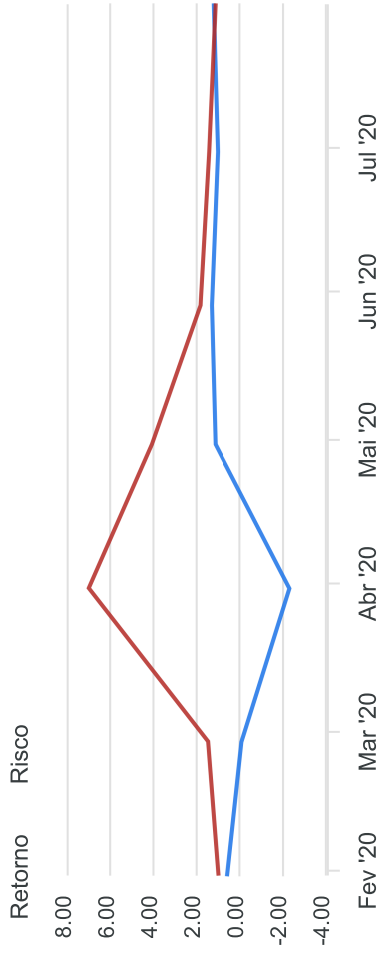
Retorno Acumulado (Períodos)

| Período | Retorno \$    | Retorno % | Meta % |
|---------|---------------|-----------|--------|
| 1º Trim | -4.197.440,33 | -1,83%    | 1,95%  |
| 2º Trim | 7.860.845,77  | 3,45%     | 0,95%  |
| 1º Sem  | 3.663.405,44  | 1,56%     | 2,92%  |

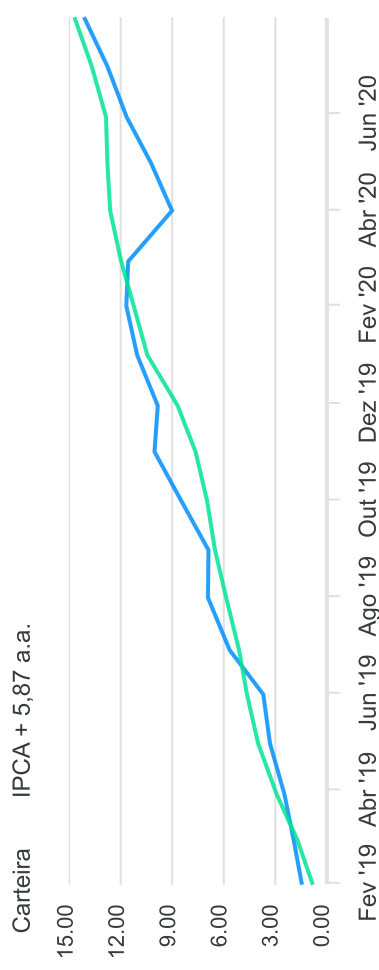
Gráfico Retorno e Meta Acumulado



### Gráfico Risco x Retorno

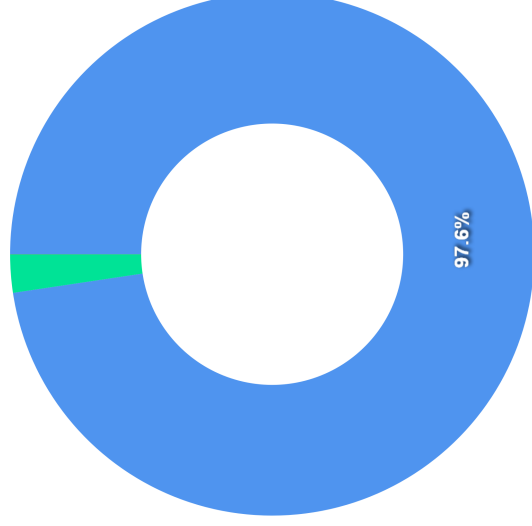


### Gráfico comparativo Retorno x Meta Rentabilidade



### Liquidez - 31/07/2020

| Disponibilidade | Valor          | %     |
|-----------------|----------------|-------|
| Até D+30        | 235.847.441,35 | 97,71 |
| Até D+180       | 5.710.159,75   | 2,37  |
| Até D+360       | 0,00           | 0,00  |
| Até D+720       | 0,00           | 0,00  |
| Até D+1800      | 0,00           | 0,00  |
| Até D+3600      | 0,00           | 0,00  |
| Acima D+3600    | 0,00           | 0,00  |
| Indeterminado   | 0,00           | 0,00  |



| RENDA FIXA  | Saldo Anterior | Aplicações   | Resgates   | Saldo Atual    | Retorno \$   | Retorno % | Risco - VaR |
|---|----------------|--------------|------------|----------------|--------------|-----------|-------------|
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO             | 29.370.183,18  | 0,00         | 0,00       | 29.889.380,14  | 519.196,96   | 1,77% ▲   | 1,05%       |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO     | 264.500,33     | 0,00         | 0,00       | 266.633,92     | 2.133,59     | 0,81% ▲   | 0,74%       |
| BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO                       | 596.964,42     | 0,00         | 0,00       | 623.146,39     | 26.181,97    | 4,39% ▲   | 2,27%       |
| BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO      | 657.069,49     | 0,00         | 0,00       | 685.733,85     | 28.664,36    | 4,36% ▲   | 2,27%       |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO   | 11.776.228,24  | 0,00         | 0,00       | 11.803.657,53  | 27.429,29    | 0,23% ▲   | 0,15%       |
| BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO      | 2.716.323,76   | 0,00         | 0,00       | 2.746.914,98   | 30.591,22    | 1,13% ▲   | 1,03%       |
| BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP  | 11.823.669,14  | 0,00         | 0,00       | 11.851.578,68  | 27.909,54    | 0,24% ▲   | 0,03%       |
| BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA                   | 18.682.090,37  | 0,00         | 0,00       | 19.001.363,13  | 319.272,76   | 1,71% ▲   | 1,05%       |
| BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FIC RENDA FIXA               | 370.347,49     | 0,00         | 0,00       | 373.952,29     | 3.604,80     | 0,97% ▲   | 0,87%       |
| BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA             | 8.929.657,29   | 0,00         | 0,00       | 8.949.076,17   | 19.418,88    | 0,22% ▲   | 0,15%       |
| BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI              | 2.120.787,44   | 0,00         | 0,00       | 2.126.410,41   | 5.622,97     | 0,27% ▲   | 0,03%       |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA              | 39.075.580,20  | 0,00         | 0,00       | 39.457.466,34  | 381.886,14   | 0,98% ▲   | 0,92%       |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 19.078.123,53  | 0,00         | 0,00       | 19.236.314,71  | 158.191,18   | 0,83% ▲   | 0,77%       |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP      | 13.434.804,17  | 1.811.569,06 | 0,00       | 15.389.979,28  | 143.606,05   | 0,94% ▲   | 0,83%       |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP     | 165.316,73     | 0,00         | 0,00       | 177.371,30     | 12.054,57    | 7,29% ▲   | 3,79%       |
| CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP        | 398.298,00     | 0,00         | 0,00       | 415.723,59     | 17.425,59    | 4,38% ▲   | 2,27%       |
| CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP    | 7.307.093,49   | 0,00         | 0,00       | 7.427.813,27   | 120.719,78   | 1,65% ▲   | 0,93%       |
| CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO         | 5.774.521,60   | 0,00         | 0,00       | 5.881.686,40   | 107.164,80   | 1,86% ▲   | 1,42%       |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA         | 28.792.460,01  | 72.836,04    | 488.694,23 | 28.445.452,69  | 68.850,87    | 0,24% ▲   | 0,15%       |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP     | 26.534,35      | 0,00         | 0,00       | 26.932,17      | 397,82       | 1,50% ▲   | 1,45%       |
| CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP      | 301.430,05     | 0,00         | 0,00       | 314.681,80     | 13.251,75    | 4,40% ▲   | 2,27%       |
| ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA         | 16.357.071,33  | 0,00         | 0,00       | 16.447.279,44  | 90.208,11    | 0,55% ▲   | 0,26%       |
| ITAÚ INSTITUCIONAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA                    | 367.806,28     | 0,00         | 0,00       | 368.659,43     | 853,15       | 0,23% ▲   | 0,15%       |
| XP INFLAÇÃO FI RENDA FIXA REFERENCIADO IPCA LP              | 1.227.190,16   | 0,00         | 0,00       | 1.251.486,80   | 24.296,64    | 1,98% ▲   | 1,15%       |
|   | 219.614.051,05 | 1.884.405,10 | 488.694,23 | 223.158.694,71 | 2.148.932,79 | 0,97%     | 0,68%       |

| RENDA VARIÁVEL  | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual   | Retorno \$ | Retorno % | Risco - VaR |
|---|----------------|------------|----------|---------------|------------|-----------|-------------|
| BB INDEXADO IBRX FIC AÇÕES                                | 447.279,75     | 0,00       | 0,00     | 483.544,22    | 36.264,47  | 8,11% ▲   | 9,91%       |
| BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES                              | 174.988,36     | 0,00       | 0,00     | 187.504,47    | 12.516,11  | 7,15% ▲   | 9,89%       |
| BRADESCO SELECTION FI AÇÕES                               | 178.832,80     | 0,00       | 0,00     | 196.796,73    | 17.963,93  | 10,05% ▲  | 10,30%      |
| CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO | 4.703.556,45   | 0,00       | 0,00     | 4.706.131,37  | 2.574,92   | 0,05% ▲   | -           |
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES                                    | 3.329.940,73   | 0,00       | 0,00     | 3.580.934,38  | 250.993,65 | 7,54% ▲   | 8,75%       |
| ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO        | 326.002,38     | 0,00       | 0,00     | 326.983,48    | 981,10     | 0,30% ▲   | 0,13%       |
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES                      | 2.413.677,11   | 0,00       | 0,00     | 2.553.612,87  | 139.935,76 | 5,80% ▲   | 11,66%      |
| ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO                 | 2.894.991,79   | 0,00       | 0,00     | 3.059.307,01  | 164.315,22 | 5,68% ▲   | 6,47%       |
| XP INVESTOR 30 FIC AÇÕES                                  | 474.982,54     | 0,00       | 0,00     | 515.514,62    | 40.532,08  | 8,53% ▲   | 11,02%      |
| XP INVESTOR DIVIDENDOS 30 FIC AÇÕES                       | 460.172,93     | 0,00       | 0,00     | 488.513,76    | 28.340,83  | 6,16% ▲   | 10,57%      |
| XP MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO                   | 226.274,24     | 0,00       | 0,00     | 229.542,47    | 3.268,23   | 1,44% ▲   | -           |
| -   | 15.630.699,08  | 0,00       | 0,00     | 16.328.385,38 | 697.686,30 | 4,46%     | 6,24%       |



| ESTRUTURADOS  | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual   | Retorno \$ | Retorno % | Risco - VaR |
|---|----------------|------------|----------|---------------|------------|-----------|-------------|
| BB INDEXADO IBRX FIC AÇÕES                                | 447.279,75     | 0,00       | 0,00     | 483.544,22    | 36.264,47  | 8,11% ▲   | 9,91%       |
| BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES                              | 174.988,36     | 0,00       | 0,00     | 187.504,47    | 12.516,11  | 7,15% ▲   | 9,89%       |
| BRADESCO SELECTION FI AÇÕES                               | 178.832,80     | 0,00       | 0,00     | 196.796,73    | 17.963,93  | 10,05% ▲  | 10,30%      |
| CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO | 4.703.556,45   | 0,00       | 0,00     | 4.706.131,37  | 2.574,92   | 0,05% ▲   | -           |
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES                                    | 3.329.940,73   | 0,00       | 0,00     | 3.580.934,38  | 250.993,65 | 7,54% ▲   | 8,75%       |
| ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO        | 326.002,38     | 0,00       | 0,00     | 326.983,48    | 981,10     | 0,30% ▲   | 0,13%       |
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES                      | 2.413.677,11   | 0,00       | 0,00     | 2.553.612,87  | 139.935,76 | 5,80% ▲   | 11,66%      |
| ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO                 | 2.894.991,79   | 0,00       | 0,00     | 3.059.307,01  | 164.315,22 | 5,68% ▲   | 6,47%       |
| XP INVESTOR 30 FIC AÇÕES                                  | 474.982,54     | 0,00       | 0,00     | 515.514,62    | 40.532,08  | 8,53% ▲   | 11,02%      |
| XP INVESTOR DIVIDENDOS 30 FIC AÇÕES                       | 460.172,93     | 0,00       | 0,00     | 488.513,76    | 28.340,83  | 6,16% ▲   | 10,57%      |
| XP MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO                   | 226.274,24     | 0,00       | 0,00     | 229.542,47    | 3.268,23   | 1,44% ▲   | -           |
| -   | 15.630.699,08  | 0,00       | 0,00     | 16.328.385,38 | 697.686,30 | 4,46%     | 6,24%       |

| FUNDOS IMOBILIÁRIOS                                       | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual   | Retorno \$ | Retorno % | Risco - VaR |
|---|----------------|------------|----------|---------------|------------|-----------|-------------|
| BB INDEXADO IBRX FIC AÇÕES                                | 447.279,75     | 0,00       | 0,00     | 483.544,22    | 36.264,47  | 8,11% ▲   | 9,91%       |
| BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES                              | 174.988,36     | 0,00       | 0,00     | 187.504,47    | 12.516,11  | 7,15% ▲   | 9,89%       |
| BRADESCO SELECTION FI AÇÕES                               | 178.832,80     | 0,00       | 0,00     | 196.796,73    | 17.963,93  | 10,05% ▲  | 10,30%      |
| CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO | 4.703.556,45   | 0,00       | 0,00     | 4.706.131,37  | 2.574,92   | 0,05% ▲   | -           |
| ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES                                    | 3.329.940,73   | 0,00       | 0,00     | 3.580.934,38  | 250.993,65 | 7,54% ▲   | 8,75%       |
| ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO        | 326.002,38     | 0,00       | 0,00     | 326.983,48    | 981,10     | 0,30% ▲   | 0,13%       |
| ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES                      | 2.413.677,11   | 0,00       | 0,00     | 2.553.612,87  | 139.935,76 | 5,80% ▲   | 11,66%      |
| ITAÚ PRIVATE S&P500® BRL FIC MULTIMERCADO                 | 2.894.991,79   | 0,00       | 0,00     | 3.059.307,01  | 164.315,22 | 5,68% ▲   | 6,47%       |
| XP INVESTOR 30 FIC AÇÕES                                  | 474.982,54     | 0,00       | 0,00     | 515.514,62    | 40.532,08  | 8,53% ▲   | 11,02%      |
| XP INVESTOR DIVIDENDOS 30 FIC AÇÕES                       | 460.172,93     | 0,00       | 0,00     | 488.513,76    | 28.340,83  | 6,16% ▲   | 10,57%      |
| XP MACRO INSTITUCIONAL FIC MULTIMERCADO                   | 226.274,24     | 0,00       | 0,00     | 229.542,47    | 3.268,23   | 1,44% ▲   | -           |
| -   | 15.630.699,08  | 0,00       | 0,00     | 16.328.385,38 | 697.686,30 | 4,46%     | 6,24%       |

|   | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates | Saldo Atual  | Retorno \$ | Retorno % | Risco - VaR |
|---|----------------|------------|----------|--------------|------------|-----------|-------------|
| INVESTIMENTOS NO EXTERIOR               |                |            |          |              |            |           |             |
| CAIXA INSTITUCIONAL FIAÇÕES BDR NÍVEL I | 1.848.546,05   | 0,00       | 0,00     | 1.883.206,43 | 34.660,38  | 1,88% ▲   | 8,52%       |
|   | 1.848.546,05   | 0,00       | 0,00     | 1.883.206,43 | 34.660,38  | 1,88%     | 0,00%       |

