

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

Relatório Analítico dos Investimentos

em maio de 2020

Carteira consolidada de investimentos - base (Maio / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	1.318.684,45	1,39%	74	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	105.968,67	0,11%	1.269	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+0	15/08/2022	826.171,39	0,87%	95	0,16%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVID...	D+0	15/08/2022	1.553.530,41	1,64%	115	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2030	1.417.399,00	1,50%	34	0,65%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	9.574.833,36	10,11%	955	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	2.279.604,24	2,41%	904	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	16/08/2020	1.142.330,88	1,21%	107	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.038.797,72	1,10%	1.372	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	6.138.404,29	6,48%	912	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	17.832.295,60	18,83%	752	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	790.745,65	0,84%	669	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	86.202,92	0,09%	882	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	4.863.776,37	5,14%	441	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO...	D+1	Não há	1.718.842,70	1,82%	300	0,58%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	D+0	Não há	5.501.520,13	5,81%	305	0,19%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' '
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.291.512,19	2,42%	56	0,20%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	117.216,94	0,12%	626	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	8.834.709,31	9,33%	285	0,17%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	170.374,45	0,18%	669	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' '

Carteira consolidada de investimentos - base (Maio / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO...	D+30 ou...	Não há	1.230.548,66	1,30%	74	0,21%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	2.291.150,32	2,42%	121	0,40%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
ITAU GOVERNANÇA CORPORATIVA FI AÇÕES	D+4	Não há	948.739,07	1,00%	6	1,93%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	2.769.135,85	2,92%	1.397	0,39%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	1.122.185,94	1,19%	106	0,24%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAU INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	1.133.115,44	1,20%	163	0,07%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAU DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	470.432,38	0,50%	50.170	0,02%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.310.218,58	1,38%	9.307	0,32%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	D+4	Não há	1.227.164,96	1,30%	2.120	0,07%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	2.283.483,49	2,41%	2.295	0,12%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	2.121.196,98	2,24%	2.523	0,31%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	D+4	Não há	454.000,54	0,48%	14.431	0,08%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	4.828.577,98	5,10%	18.593	0,11%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MUL...	D+2	01/10/2020	1.174.815,24	1,24%	956	0,23%	Artigo 8º, Inciso III
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	Não se ...	Não se aplica	219.319,20	0,23%		0,01%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	D+4	Não há	3.507.788,26	3,70%	98	0,31%	Artigo 9º - A, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			94.694.793,56				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	48.968.744,95	51,71%	20,00%	56,00%	100,00%	45.726.048,61
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	7.220.362,83	7,62%	0,00%	2,00%	30,00%	21.188.075,24
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	11.413.812,89	12,05%	3,00%	8,00%	40,00%	26.464.104,53
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	9.469.479,36
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.734.739,68
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	1.230.548,66	1,30%	0,00%	2,00%	5,00%	3.504.191,02
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	4.734.739,68
Total Renda Fixa	100,00%	68.833.469,33	72,69%	23,00%	68,00%	195,00%	

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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	30,00%	3.239.889,39	3,42%	0,00%	5,00%	30,00%	25.168.548,68
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	12.890.934,16	13,61%	0,00%	17,00%	20,00%	6.048.024,55
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	6.003.393,22	6,34%	0,00%	7,00%	10,00%	3.466.086,14
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,50%	2.367.369,84
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	219.319,20	0,23%	0,00%	1,00%	2,50%	2.148.050,64
Total Renda Variável	30,00%	22.353.535,97	23,61%	0,00%	30,00%	65,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2020			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	3.507.788,26	3,70%	0,00%	2,00%	5,00%	1.226.951,42
Total Exterior	10,00%	3.507.788,26	3,70%	0,00%	2,00%	5,00%	

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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	69.257.280,58	73,14	0,01
ITAÚ UNIBANCO	11.386.996,20	12,02	0,00
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	7.479.520,49	7,90	0,00
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	3.510.648,45	3,71	0,00
SICREDI	1.718.842,70	1,82	0,00
VINCI PARTNERS	1.122.185,94	1,19	0,00
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	219.319,20	0,23	0,12

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 '	48.968.744,95	51,71	20,00	100,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	7.220.362,83	7,62	0,00	30,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	11.413.812,89	12,05	3,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	1.230.548,66	1,30	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	3.239.889,39	3,42	0,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	12.890.934,16	13,61	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	6.003.393,22	6,34	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	2,50
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	219.319,20	0,23	0,00	2,50
Artigo 9º - A, Inciso III	3.507.788,26	3,70	0,00	5,00

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	1,75%	2,33%	1,10%	3,57%	9,03%	22,17%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,00%	1,65%	0,63%	2,82%	8,06%	20,02%	0,01%	0,03%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,91%	1,92%	0,85%	3,04%	8,24%	20,20%	0,01%	0,03%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,42%	2,31%	1,47%	2,74%	6,33%	13,97%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,39%	2,19%	1,41%	2,60%	6,04%	13,42%	0,00%	0,00%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,39%	2,22%	1,42%	2,63%	6,11%	13,55%	0,00%	0,00%
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M 1	0,51%	2,55%	1,60%	2,99%	6,52%	14,11%	0,00%	0,01%
IMA-B 5 (Benchmark)	2,12%	2,03%	0,82%	3,29%	9,46%	23,93%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,11%	1,92%	0,74%	3,15%	9,15%	23,37%	0,01%	0,04%
IMA-B (Benchmark)	1,52%	-3,64%	-4,32%	-1,70%	6,68%	31,99%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,50%	-3,69%	-4,36%	-1,79%	6,48%	31,36%	0,04%	0,10%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	1,49%	-3,80%	-4,44%	-1,89%	6,26%	31,07%	0,04%	0,10%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,50%	-3,82%	-4,48%	-1,91%	6,23%	31,21%	0,04%	0,10%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	3,16%	0,19%	1,08%	1,68%	6,57%	19,48%	0,03%	0,07%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,80%	-2,83%	-0,36%	-2,07%	-0,89%	2,58%	0,01%	0,04%
IRF-M (Benchmark)	1,42%	4,05%	2,47%	4,69%	11,31%	26,14%	-	-

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,40%	3,94%	2,42%	4,57%	11,04%	25,67%	0,02%	0,03%
CDI (Benchmark)	0,24%	1,54%	0,86%	1,92%	4,87%	11,55%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,33%	1,12%	0,48%	1,48%	4,25%	10,73%	0,00%	0,01%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,26%	1,11%	0,48%	1,47%	4,27%	10,77%	0,00%	0,01%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	0,44%	1,23%	0,51%	1,61%	4,45%	11,03%	0,00%	0,01%
IPCA (Benchmark)	-0,38%	-0,16%	-0,62%	0,99%	1,88%	6,62%	-	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	2,17%	1,68%	0,53%	2,80%	8,29%	23,00%	0,01%	0,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2,10%	2,18%	0,80%	3,39%	9,70%	26,84%	0,01%	0,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,92%	1,85%	0,63%	3,00%	8,95%	30,82%	0,01%	0,03%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,05%	0,18%	1,21%	1,54%	2,38%	7,51%	0,00%	0,04%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,54%	1,82%	1,22%	2,17%	7,84%	19,42%	0,01%	0,02%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1,38%	3,85%	2,37%	4,46%	11,99%	27,82%	0,02%	0,03%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IGCT (Benchmark)	8,33%	-24,06%	-16,88%	-18,23%	-7,34%	21,02%	-	-
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA FI AÇÕES	8,28%	-24,24%	-16,97%	-18,43%	-7,93%	19,72%	0,15%	0,38%
ICON (Benchmark)	7,65%	-19,06%	-13,24%	-12,56%	7,69%	32,60%	-	-
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	7,55%	-19,23%	-13,14%	-12,59%	8,38%	29,19%	0,14%	0,42%
Ibovespa (Benchmark)	8,57%	-24,42%	-16,10%	-19,25%	-9,92%	13,87%	-	-
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	8,49%	-24,27%	-16,01%	-19,09%	-9,96%	13,28%	0,15%	0,36%
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	11,04%	-21,99%	-15,08%	-14,69%	2,40%	42,57%	0,20%	0,39%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	9,18%	-36,23%	-30,73%	-29,72%	-18,72%	6,36%	0,21%	0,49%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	7,48%	-23,74%	-15,01%	-17,02%	-8,97%	29,31%	0,14%	0,34%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	0,26%	1,68%	1,09%	2,01%	6,33%	-	0,00%	0,01%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	5,36%	-28,85%	-20,98%	-23,06%	-6,21%	20,72%	0,17%	0,40%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	7,64%	-22,34%	-17,48%	-15,12%	-	-	0,14%	-
CDI (Benchmark)	0,24%	1,54%	0,86%	1,92%	4,87%	11,55%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,43%	-2,26%	-1,43%	-0,21%	7,39%	23,68%	0,02%	0,07%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	7,03%	-23,10%	-19,07%	-13,70%	2,77%	36,75%	0,17%	0,39%

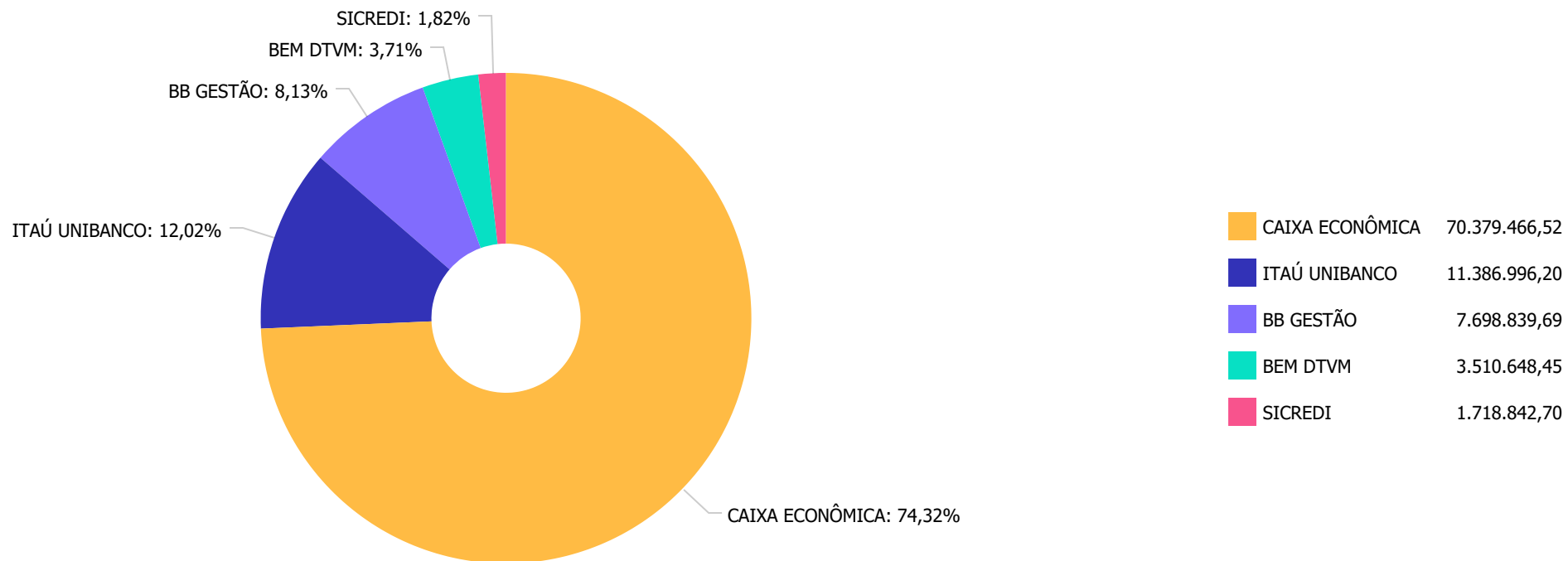
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Maio/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	-	-
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	6,42%	-26,22%	-17,20%	-20,88%	-15,67%	7,33%	0,14%	0,33%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	6,18%	-22,20%	-16,86%	-14,08%	2,67%	36,66%	0,14%	0,40%

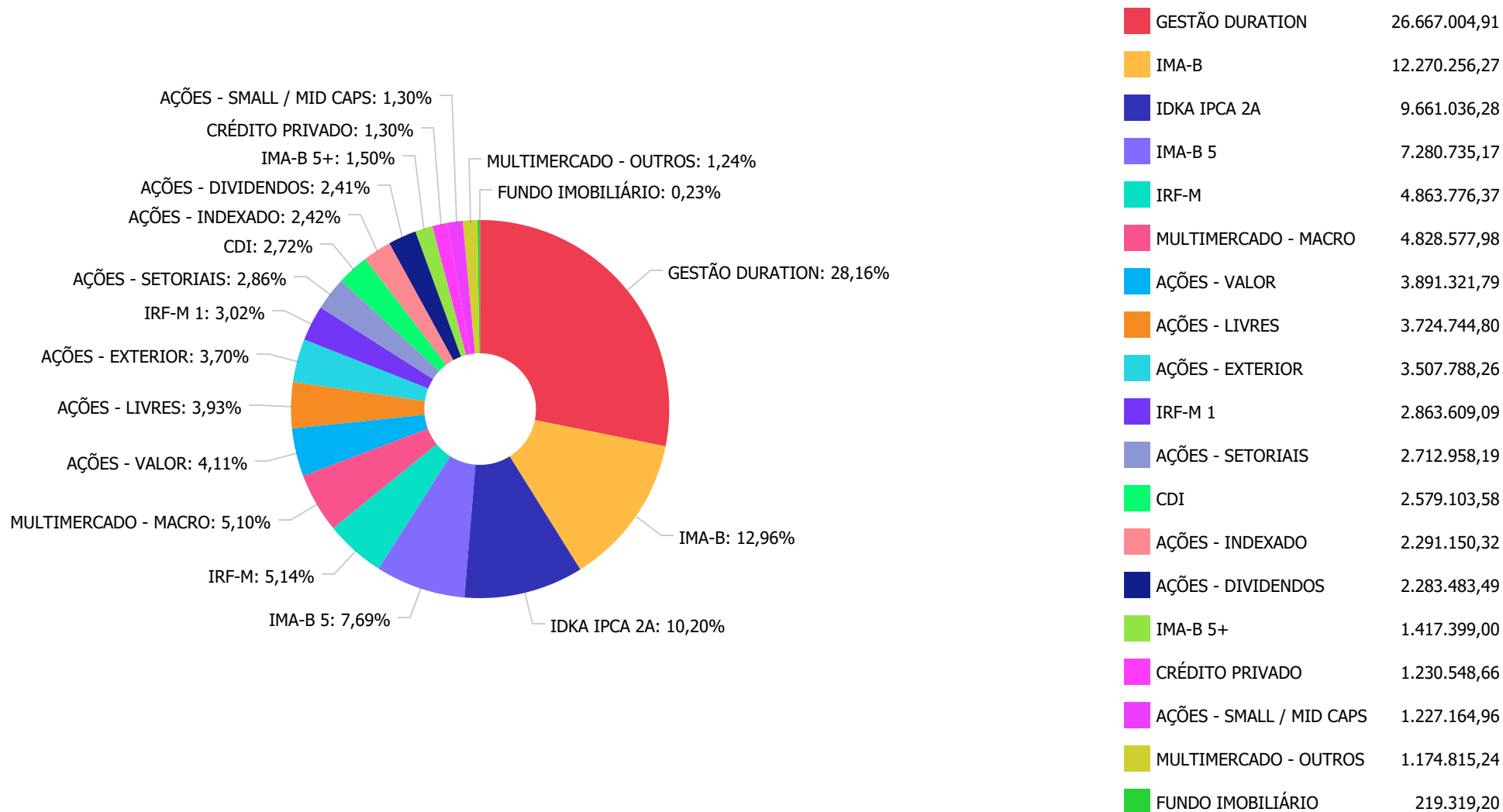
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Maio/2020 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	2,90%	26,74%	26,24%	24,81%	53,67%	68,19%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	2,78%	27,29%	26,70%	25,05%	53,85%	66,23%	0,11%	0,20%

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



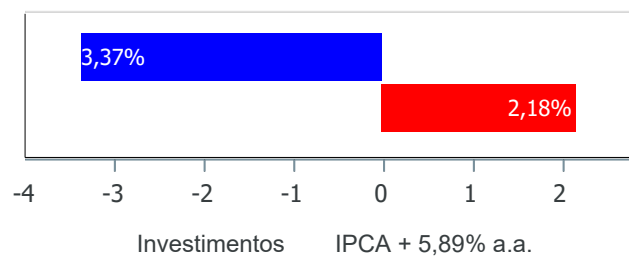
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Maio / 2020)



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

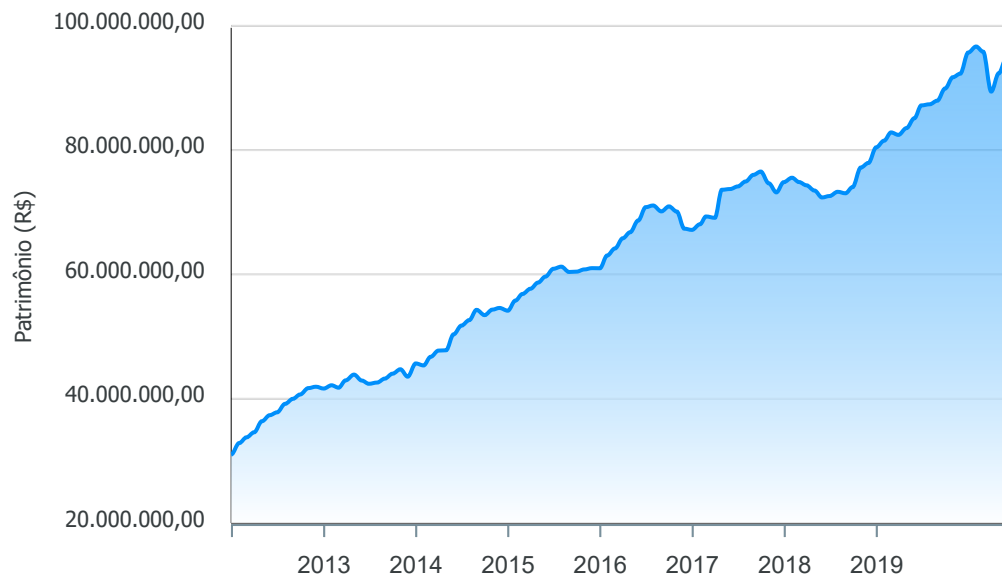
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	95.702.762,81	14.713.112,04	14.063.193,93	96.665.283,55	312.602,63	312.602,63	0,32%	0,32%	0,71%	0,71%	45,57%	2,24%
Fevereiro	96.665.283,55	4.028.541,57	3.604.436,78	95.831.099,33	-1.258.289,01	-945.686,38	-1,30%	-0,98%	0,66%	1,38%	-70,85%	3,65%
Março	95.831.099,33	10.120.017,23	9.552.191,30	89.421.497,33	-6.977.427,93	-7.923.114,31	-7,24%	-8,14%	0,57%	1,96%	-416,24%	14,72%
Abril	89.421.497,33	3.028.542,17	2.495.145,50	92.360.915,91	2.406.021,91	-5.517.092,40	2,67%	-5,69%	0,14%	2,10%	-270,39%	7,60%
Maio	92.360.915,91	3.294.734,71	3.232.428,11	94.694.793,56	2.271.571,05	-3.245.521,35	2,46%	-3,37%	0,07%	2,18%	-154,64%	4,29%

Investimentos x Meta Atuarial



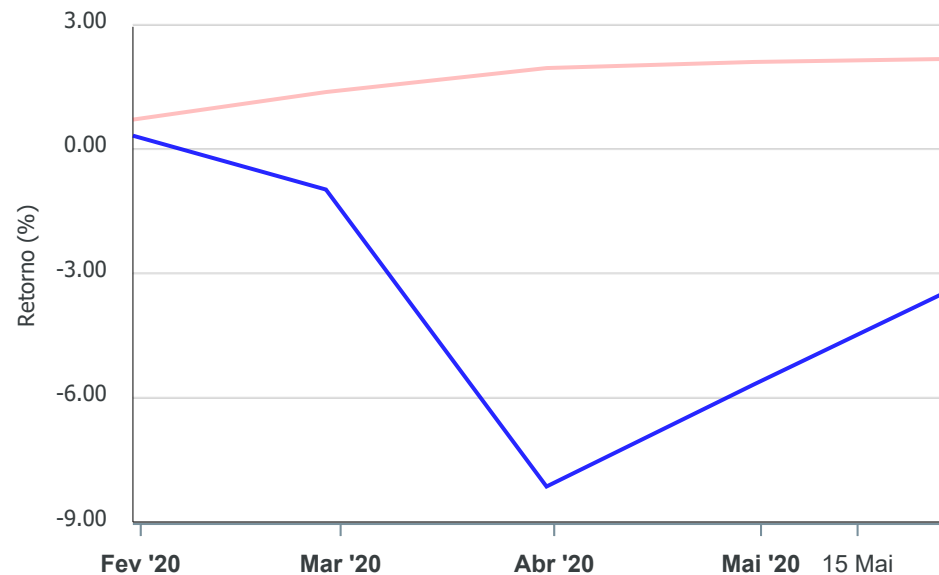
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Maio/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.278.344,46	0,00	0,00	1.318.684,45	40.339,99	3,16%	3,16%	2,56%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	1.204.377,77	0,00	0,00	1.230.548,66	26.170,89	2,17%	2,17%	1,12%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	6.011.839,52	0,00	0,00	6.138.404,29	126.564,77	2,11%	2,11%	1,25%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA I FI RENDA FIXA PREVIDENC...	809.195,81	0,00	0,00	826.171,39	16.975,58	2,10%	2,10%	1,07%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	84.512,17	0,00	0,00	86.202,92	1.690,75	2,00%	2,00%	1,00%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDEN...	1.524.233,31	0,00	0,00	1.553.530,41	29.297,10	1,92%	1,92%	0,92%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	9.375.888,76	501.647,33	483.869,89	9.574.833,36	181.167,16	1,83%	1,91%	1,06%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	779.049,31	0,00	0,00	790.745,65	11.696,34	1,50%	1,50%	3,64%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	2.245.901,69	0,00	0,00	2.279.604,24	33.702,55	1,50%	1,50%	3,66%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	5.420.964,52	0,00	0,00	5.501.520,13	80.555,61	1,49%	1,49%	3,63%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	4.796.837,79	0,00	0,00	4.863.776,37	66.938,58	1,40%	1,40%	1,72%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	17.589.780,80	0,00	0,00	17.832.295,60	242.514,80	1,38%	1,38%	1,72%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.133.253,45	0,00	0,00	1.142.330,88	9.077,43	0,80%	0,80%	0,54%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	8.787.216,90	0,00	0,00	8.834.709,31	47.492,41	0,54%	0,54%	0,70%
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO I...	1.697.037,28	13.230,50	0,00	1.718.842,70	8.574,92	0,50%	0,50%	0,36%
CAIXA BRASIL MATRIZ FI RENDA FIXA	2.281.486,64	0,00	0,00	2.291.512,19	10.025,55	0,44%	0,44%	0,21%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	105.558,34	0,00	0,00	105.968,67	410,33	0,39%	0,39%	0,20%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	169.816,90	0,00	0,00	170.374,45	557,55	0,33%	0,33%	0,08%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	103.742,80	13.203,01	0,00	117.216,94	271,13	0,23%	0,26%	0,05%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.013.507,03	2.766.653,87	2.746.938,22	1.038.797,72	5.575,04	0,15%	0,39%	0,20%

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.416.735,00	0,00	0,00	1.417.399,00	664,00	0,05%	0,05%	0,13%
Total Renda Fixa	67.829.280,25	3.294.734,71	3.230.808,11	68.833.469,33	940.262,48	1,38%		1,50%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INFRAESTRUTURA FI AÇÕES	1.180.005,20	0,00	0,00	1.310.218,58	130.213,38	11,03%	11,03%	19,68%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	1.037.825,11	0,00	0,00	1.133.115,44	95.290,33	9,18%	9,18%	21,29%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	2.111.840,52	0,00	0,00	2.291.150,32	179.309,80	8,49%	8,49%	14,99%
ITAÚ GOVERNANÇA CORPORATIVA FI AÇÕES	876.205,24	0,00	0,00	948.739,07	72.533,83	8,28%	8,28%	15,24%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	1.970.645,91	0,00	0,00	2.121.196,98	150.551,07	7,64%	7,64%	14,38%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	422.123,31	0,00	0,00	454.000,54	31.877,23	7,55%	7,55%	13,65%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	2.576.375,50	0,00	0,00	2.769.135,85	192.760,35	7,48%	7,48%	14,19%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	1.048.495,52	0,00	0,00	1.122.185,94	73.690,42	7,03%	7,03%	16,75%
BRADESCO DIVIDENDOS FI AÇÕES	2.145.675,17	0,00	0,00	2.283.483,49	137.808,32	6,42%	6,42%	14,35%
BRADESCO MID SMALL CAPS FI AÇÕES	1.155.746,05	0,00	0,00	1.227.164,96	71.418,91	6,18%	6,18%	13,96%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	446.503,44	0,00	0,00	470.432,38	23.928,94	5,36%	5,36%	16,91%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	215.121,60	0,00	1.620,00	219.319,20	5.817,60	2,70%	0,00%	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	4.760.494,33	0,00	0,00	4.828.577,98	68.083,65	1,43%	1,43%	2,26%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTI...	1.171.721,21	0,00	0,00	1.174.815,24	3.094,03	0,26%	0,26%	0,17%
Total Renda Variável	21.118.778,11	0,00	1.620,00	22.353.535,97	1.236.377,86	5,85%		11,86%

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

FUNDO MUNICIPAL DE APOSENTADORIA E PENSÕES DE ITAPIRA
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 29/05/2020

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	3.412.857,55	0,00	0,00	3.507.788,26	94.930,71	2,78%	2,78%	11,11%
Total Renda Variável	3.412.857,55	0,00	0,00	3.507.788,26	94.930,71	2,78%		11,11%