

# 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 IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	20.760.341,64	4,20%	340	1,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	35.576.323,75	7,20%	901	0,59%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	82.637.618,72	16,74%	956	1,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	97.602.497,30	19,77%	763	0,80%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVID...	D+0	15/08/2022	15.713.161,03	3,18%	115	2,97%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	14.204.058,82	2,88%	1.364	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	D+0	15/08/2022	3.943.068,86	0,80%	165	0,58%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	77.181.867,24	15,63%	912	0,88%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	2.970.900,35	0,60%	1.262	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	3.206.092,34	0,65%	678	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3 du	Não há	2.002.927,27	0,41%	186	0,26%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1 du	Não há	14.683.141,98	2,97%	56	5,78%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIV...	D+0	3 anos	4.721.946,78	0,96%	71	2,60%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO...	D+30 ou...	Não há	10.997.140,79	2,23%	74	1,83%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	D+4	Não há	26.214.509,51	5,31%	121	4,19%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	D+4	Não há	18.447.808,22	3,74%	96	2,06%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.349.125,34	0,27%	1.411	0,16%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	2.344.297,52	0,47%	16.254	0,21%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	14.185.503,27	2,87%	107	2,68%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	11.088.717,96	2,25%	2.513	1,45%	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
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	D+15	Não há	15.612.172,69	3,16%	56	8,02%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	5.251.330,42	1,06%	18.591	0,12%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MUL...	D+2	01/10/2020	3.528.962,32	0,71%	956	0,70%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	3.189.255,83	0,65%	20.627	0,13%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	2.991.521,99	0,61%	64	2,48%	Artigo 8º, Inciso III
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	Não se ...	Não se aplica	2.193.332,50	0,44%		0,09%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	D+4	Não há	1.186.954,81	0,24%	104	0,10%	Artigo 9º - A, Inciso III
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>493.784.579,25</b>				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	350.589.837,71	71,00%	30,00%	60,00%	90,00%	93.816.283,62
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	148.135.373,78
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	19.892.161,59	4,03%	1,00%	13,00%	40,00%	177.621.670,11
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	24.689.228,96
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	24.689.228,96
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	15.719.087,57	3,18%	1,00%	2,50%	5,00%	8.970.141,39
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>386.201.086,87</b>	<b>78,21%</b>	<b>32,00%</b>	<b>76,50%</b>	<b>175,00%</b>	

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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	30,00%	46.011.443,07	9,32%	5,00%	12,00%	15,00%	28.056.243,82
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	43.230.691,44	8,75%	0,00%	5,00%	10,00%	6.147.766,49
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	14.961.070,56	3,03%	1,00%	5,50%	10,00%	34.417.387,37
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	24.689.228,96
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	2.193.332,50	0,44%	0,00%	0,50%	5,00%	22.495.896,46
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>106.396.537,57</b>	<b>21,55%</b>	<b>6,00%</b>	<b>23,00%</b>	<b>45,00%</b>	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2020			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	24.689.228,96
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	24.689.228,96
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	1.186.954,81	0,24%	0,00%	0,50%	5,00%	23.502.274,15
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>1.186.954,81</b>	<b>0,24%</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,50%</b>	<b>15,00%</b>	

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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	440.429.419,84	89,19	0,09
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	36.976.323,64	7,49	0,00
VINCI PARTNERS	14.185.503,27	2,87	0,02
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	2.193.332,50	0,44	0,60

**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 '	350.589.837,71	71,00	30,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	30,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	19.892.161,59	4,03	1,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	15.719.087,57	3,18	1,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	46.011.443,07	9,32	5,00	10,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	43.230.691,44	8,75	1,00	10,00
Artigo 8º, Inciso III	14.961.070,56	3,03	1,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	2.193.332,50	0,44	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso I	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso III	1.186.954,81	0,24	0,00	5,00

**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 IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>	0,99%	3,35%	3,35%	3,35%	8,68%	23,17%	-	-
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 5+ (Benchmark)</b>	2,84%	-5,26%	5,99%	-5,26%	1,68%	43,55%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	2,83%	-5,44%	5,88%	-5,44%	1,57%	42,12%	0,05%	0,15%
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	0,28%	2,60%	1,15%	2,60%	5,98%	13,67%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,26%	2,45%	1,06%	2,45%	5,71%	13,15%	0,00%	0,00%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,26%	2,48%	1,09%	2,48%	5,78%	13,28%	0,00%	0,00%
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	1,12%	3,17%	3,77%	3,17%	8,73%	24,75%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1,10%	3,04%	3,71%	3,04%	8,51%	24,21%	0,01%	0,04%
<b>IMA-B (Benchmark)</b>	2,05%	-1,66%	4,96%	-1,66%	4,73%	35,13%	-	-
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%
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%

**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>IPCA (Benchmark)</b>	0,26%	0,10%	-0,43%	0,10%	2,12%	5,57%	-	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	0,98%	2,68%	3,62%	2,68%	7,94%	24,05%	0,01%	0,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,15%	3,02%	3,50%	3,02%	8,41%	30,53%	0,01%	0,03%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	1,26%	3,55%	5,02%	3,55%	9,75%	27,65%	0,02%	0,05%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,75%	4,63%	3,27%	4,63%	9,82%	28,20%	0,01%	0,03%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,95%	-	2,88%	-	-	-	0,01%	-
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,66%	-	-	-	-	-	0,01%	-



**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>IBX-50 (Benchmark)</b>	9,33%	-17,76%	31,79%	-17,76%	-7,36%	27,59%	-	-
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	9,45%	-18,44%	31,25%	-18,44%	-6,86%	25,17%	0,13%	0,39%
<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%	-	-
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	8,61%	-17,75%	29,78%	-17,75%	-5,96%	29,82%	0,12%	0,37%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	0,11%	1,79%	0,62%	1,79%	5,40%	-	0,00%	0,01%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	9,88%	-14,67%	33,22%	-14,67%	5,17%	-	0,12%	0,41%
<b>SMLL (Benchmark)</b>	14,43%	-20,73%	32,49%	-20,73%	5,76%	49,01%	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	12,89%	-21,45%	31,67%	-21,45%	3,57%	42,14%	0,16%	0,45%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,21%	1,75%	0,73%	1,75%	4,58%	11,21%	-	-
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	2,60%	-3,10%	8,72%	-3,10%	3,61%	18,53%	0,03%	0,11%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	1,25%	-1,03%	5,40%	-1,03%	6,27%	25,21%	0,01%	0,07%
<b>Não Informado (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	9,33%	-15,92%	28,43%	-15,92%	5,63%	56,90%	0,12%	0,39%

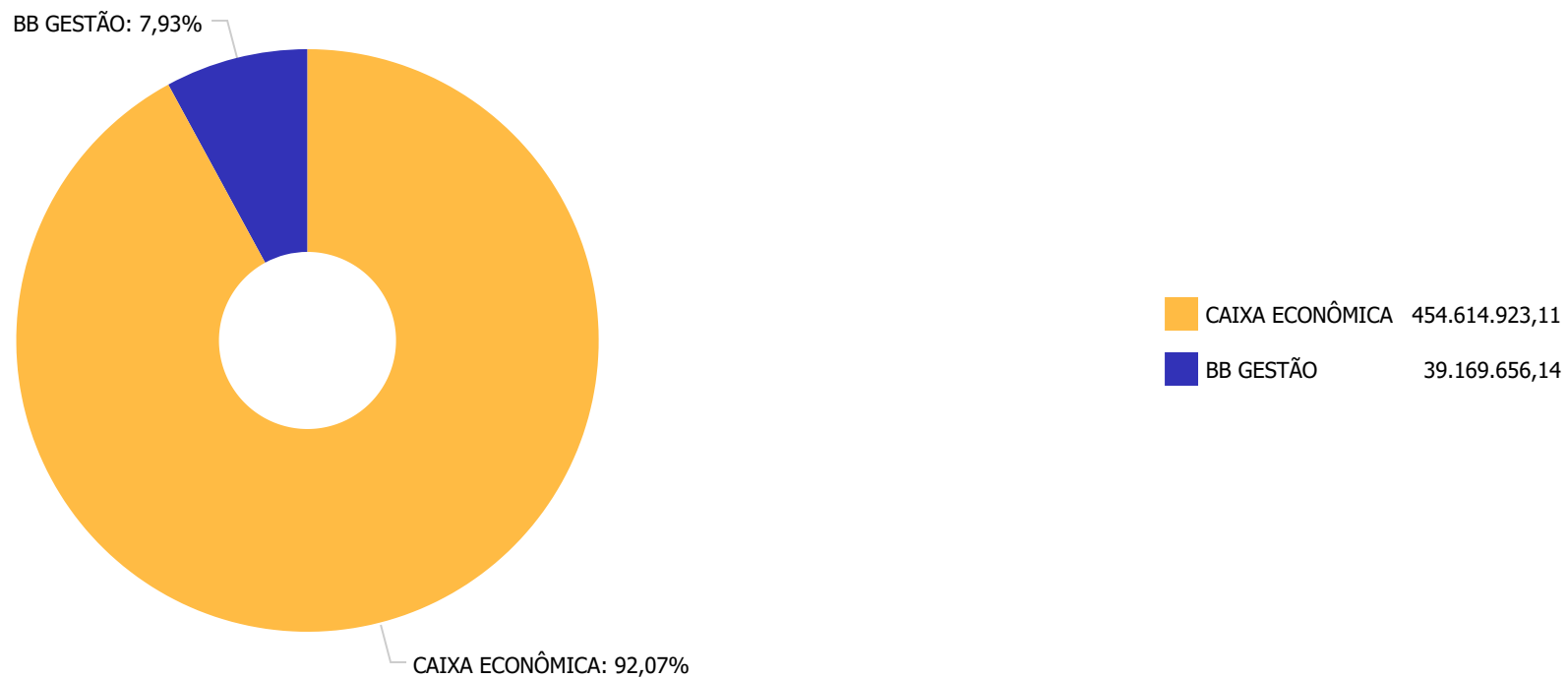
**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2020 - RENDA VARIÁVEL**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	-0,02%	-0,02%	-	-0,02%	-0,02%	-0,02%	-	-
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	8,58%	-13,79%	30,01%	-13,79%	-	-	0,12%	-
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	2,24%	-1,63%	9,03%	-1,63%	-	-	0,03%	-

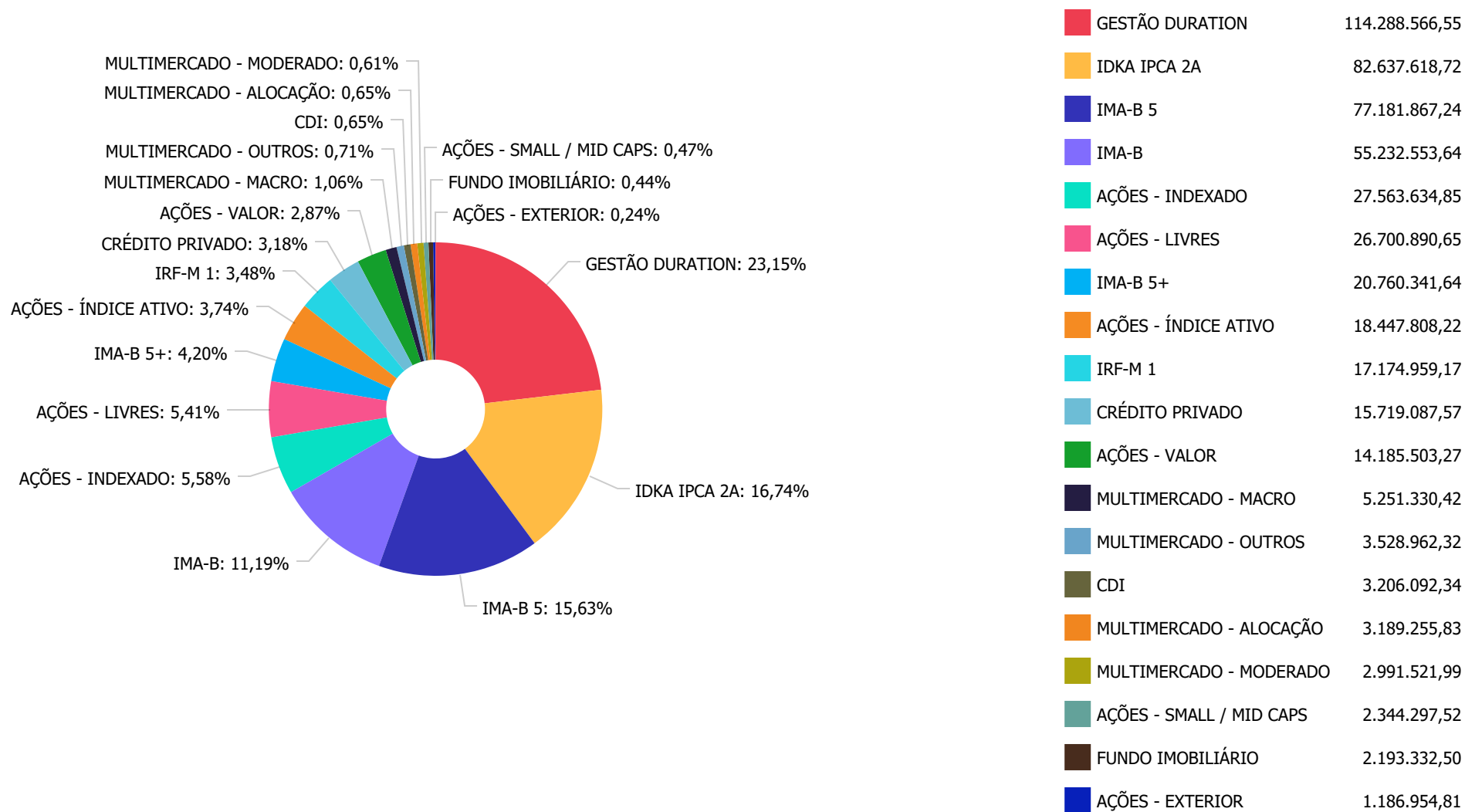
**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Junho/2020 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR**

	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%	-	-
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	4,37%	32,85%	24,40%	32,85%	54,59%	66,72%	0,12%	0,20%

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



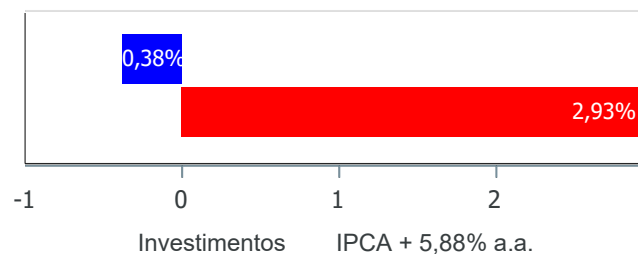
**Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Junho / 2020)**



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

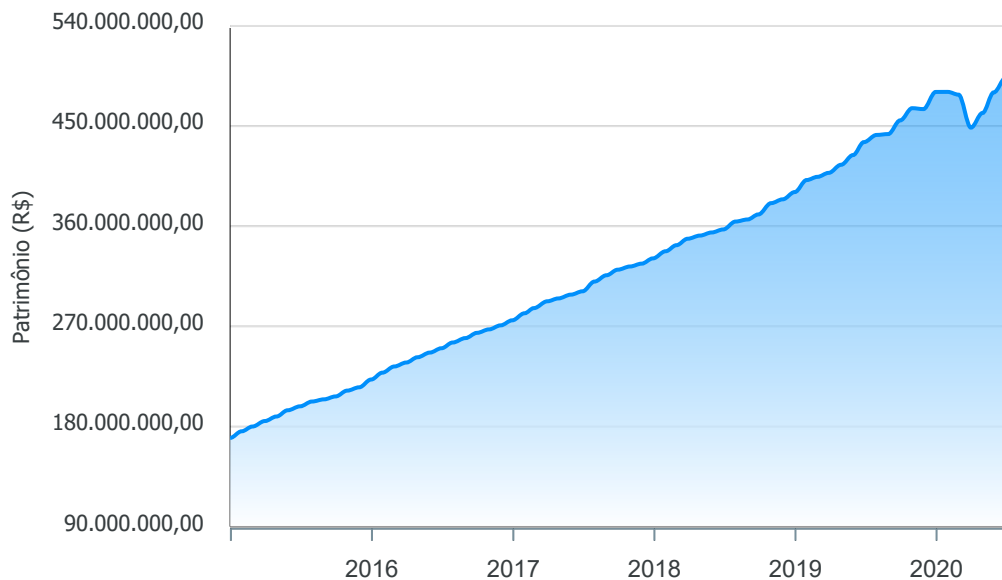
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	480.726.013,95	31.194.230,79	34.435.535,00	479.118.394,83	1.633.685,09	1.633.685,09	0,34%	0,34%	0,71%	0,71%	47,79%	1,80%
Fevereiro	479.118.394,83	47.123.300,03	42.981.918,47	478.272.443,50	-4.987.332,89	-3.353.647,80	-1,03%	-0,70%	0,66%	1,38%	-50,57%	3,34%
Março	478.272.443,50	11.262.131,93	9.530.400,00	447.969.637,61	-32.034.537,82	-35.388.185,62	-6,67%	-7,32%	0,57%	1,95%	-374,77%	14,39%
Abril	447.969.637,61	16.153.351,94	11.828.900,00	461.799.607,99	9.505.518,44	-25.882.667,18	2,10%	-5,38%	0,14%	2,10%	-255,98%	7,58%
Mai	461.799.607,99	26.415.208,16	20.544.134,69	480.300.710,11	12.630.028,65	-13.252.638,53	2,70%	-2,82%	0,07%	2,17%	-129,70%	4,19%
Junho	480.300.710,11	6.958.586,09	5.572.400,00	493.784.579,25	12.097.683,05	-1.154.955,48	2,51%	-0,38%	0,74%	2,93%	-12,95%	3,42%

**Investimentos x Meta Atuarial**



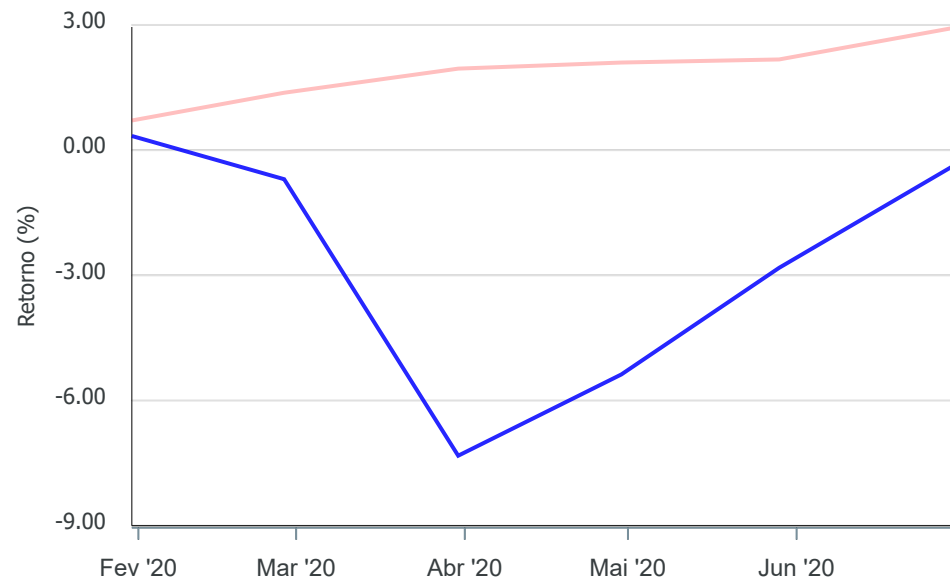
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	20.189.534,63	0,00	0,00	20.760.341,64	570.807,01	2,83%	2,83%	4,98%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	34.870.135,41	0,00	0,00	35.576.323,75	706.188,34	2,03%	2,03%	2,99%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	4.663.047,33	0,00	0,00	4.721.946,78	58.899,45	1,26%	1,26%	1,61%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	81.677.680,36	0,00	0,00	82.637.618,72	959.938,36	1,18%	1,18%	0,86%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDEN...	15.535.303,89	0,00	0,00	15.713.161,03	177.857,14	1,14%	1,14%	0,75%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	76.343.148,26	0,00	0,00	77.181.867,24	838.718,98	1,10%	1,10%	0,91%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	3.904.326,16	0,00	0,00	3.943.068,86	38.742,70	0,99%	0,99%	0,45%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	10.890.741,89	0,00	0,00	10.997.140,79	106.398,90	0,98%	0,98%	0,82%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	96.876.302,03	0,00	0,00	97.602.497,30	726.195,27	0,75%	0,75%	1,17%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	11.135.263,89	3.464.688,83	0,00	14.683.141,98	83.189,26	0,57%	0,66%	1,04%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	4.925.626,24	33.135,56	2.000.000,00	2.970.900,35	12.138,55	0,24%	0,26%	0,05%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	3.198.328,31	0,00	0,00	3.206.092,34	7.764,03	0,24%	0,24%	0,03%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	16.263.625,82	1.460.761,70	3.561.000,00	14.204.058,82	40.671,30	0,23%	0,26%	0,05%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	0,00	2.000.000,00	0,00	2.002.927,27	2.927,27	0,15%	0,95%	1,34%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>380.473.064,22</b>	<b>6.958.586,09</b>	<b>5.561.000,00</b>	<b>386.201.086,87</b>	<b>4.330.436,56</b>	<b>1,13%</b>		<b>1,33%</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
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	2.076.560,55	0,00	0,00	2.344.297,52	267.736,97	12,89%	12,89%	16,18%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	10.091.921,26	0,00	0,00	11.088.717,96	996.796,70	9,88%	9,88%	12,39%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	16.854.342,18	0,00	0,00	18.447.808,22	1.593.466,04	9,45%	9,45%	13,11%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	12.974.845,05	0,00	0,00	14.185.503,27	1.210.658,22	9,33%	9,33%	12,08%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	1.238.930,33	0,00	0,00	1.349.125,34	110.195,01	8,89%	8,89%	12,41%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	24.136.464,75	0,00	0,00	26.214.509,51	2.078.044,76	8,61%	8,61%	12,48%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	14.378.335,69	0,00	0,00	15.612.172,69	1.233.837,00	8,58%	8,58%	12,44%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	3.108.437,10	0,00	0,00	3.189.255,83	80.818,73	2,60%	2,60%	3,49%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	2.925.916,90	0,00	0,00	2.991.521,99	65.605,09	2,24%	2,24%	2,60%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	5.186.343,96	0,00	0,00	5.251.330,42	64.986,46	1,25%	1,25%	1,24%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	2.193.191,72	0,00	11.400,00	2.193.332,50	11.540,78	0,53%	-0,02%	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTI...	3.525.093,62	0,00	0,00	3.528.962,32	3.868,70	0,11%	0,11%	0,03%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>98.690.383,11</b>	<b>0,00</b>	<b>11.400,00</b>	<b>106.396.537,57</b>	<b>7.717.554,46</b>	<b>7,82%</b>		<b>11,05%</b>

# CRÉDITO E MERCADO

*Consultoria em Investimentos*

INSTITUTO DE PREVIDÊNCIA DO MUNICÍPIO DE RIO BRANCO  
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
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	1.137.262,78	0,00	0,00	1.186.954,81	49.692,03	4,37%	4,37%	12,44%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>1.137.262,78</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>1.186.954,81</b>	<b>49.692,03</b>	<b>4,37%</b>		<b>12,44%</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 GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	94.508.545,38	0,00	0,00	97.602.497,30	3.093.951,92	3,27%	3,27%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	79.810.639,99	0,00	0,00	82.637.618,72	2.826.978,73	3,54%	3,54%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	74.422.805,48	0,00	0,00	77.181.867,24	2.759.061,76	3,71%	3,71%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	33.912.676,05	0,00	0,00	35.576.323,75	1.663.647,70	4,91%	4,91%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	19.608.194,38	0,00	0,00	20.760.341,64	1.152.147,26	5,88%	5,88%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDEN...	15.182.382,72	0,00	0,00	15.713.161,03	530.778,31	3,50%	3,50%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	10.613.457,18	0,00	0,00	10.997.140,79	383.683,61	3,62%	3,62%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	4.496.130,22	0,00	0,00	4.721.946,78	225.816,56	5,02%	5,02%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	10.261.049,81	22.696.246,04	18.898.934,69	14.204.058,82	145.697,66	0,44%	1,09%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,00	14.540.875,36	0,00	14.683.141,98	142.266,62	0,98%	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	3.850.691,19	0,00	0,00	3.943.068,86	92.377,67	2,40%	2,40%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	4.370.015,85	551.463,36	2.000.000,00	2.970.900,35	49.421,14	1,00%	1,06%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	20.178.775,13	0,00	17.000.000,00	3.206.092,34	27.317,21	0,14%	0,58%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	0,00	2.000.000,00	0,00	2.002.927,27	2.927,27	0,15%	2,88%
<b>Total Renda Fixa</b>					<b>13.096.073,42</b>	<b>3,51%</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
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	16.727.095,46	3.738.561,43	0,00	26.214.509,51	5.748.852,62	28,09%	29,78%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	12.257.360,93	2.000.000,00	0,00	18.447.808,22	4.190.447,29	29,39%	31,25%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	8.332.916,80	4.000.000,00	0,00	15.612.172,69	3.279.255,89	26,59%	30,01%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	11.045.146,07	0,00	0,00	14.185.503,27	3.140.357,20	28,43%	28,43%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	8.323.649,44	0,00	0,00	11.088.717,96	2.765.068,52	33,22%	33,22%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	1.780.458,94	0,00	0,00	2.344.297,52	563.838,58	31,67%	31,67%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	1.031.583,63	0,00	0,00	1.349.125,34	317.541,71	30,78%	30,78%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	4.982.216,22	0,00	0,00	5.251.330,42	269.114,20	5,40%	5,40%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	2.933.422,63	0,00	0,00	3.189.255,83	255.833,20	8,72%	8,72%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	2.743.720,09	0,00	0,00	2.991.521,99	247.801,90	9,03%	9,03%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	2.135.465,27	0,00	46.500,00	2.193.332,50	104.367,23	4,89%	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTI...	3.507.082,66	0,00	0,00	3.528.962,32	21.879,66	0,62%	0,62%
				<b>Total Renda Variável</b>	<b>20.904.358,00</b>	<b>24,45%</b>	

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	954.156,09	0,00	0,00	1.186.954,81	232.798,72	24,40%	24,40%
				<b>Total Exterior</b>	<b>232.798,72</b>	<b>24,40%</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
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	93.287.509,66	0,00	0,00	97.602.497,30	4.314.987,64	4,63%	4,63%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	87.161.024,89	0,00	7.000.000,00	82.637.618,72	2.476.593,83	2,84%	3,12%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	74.903.091,16	0,00	0,00	77.181.867,24	2.278.776,08	3,04%	3,04%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	53.300.872,55	23.042.853,15	62.628.934,69	14.204.058,82	489.267,81	0,64%	2,48%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDEN...	15.645.539,97	0,00	396.635,83	15.713.161,03	464.256,89	2,97%	3,02%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	49.867.999,00	0,00	47.000.000,00	3.206.092,34	338.093,34	0,68%	1,37%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	10.710.382,14	0,00	0,00	10.997.140,79	286.758,65	2,68%	2,68%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	4.560.072,06	0,00	0,00	4.721.946,78	161.874,72	3,55%	3,55%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	0,00	14.540.875,36	0,00	14.683.141,98	142.266,62	0,98%	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	3.265.941,60	1.603.390,65	2.000.000,00	2.970.900,35	101.568,10	2,09%	2,45%
BB TÍTULOS PÚBLICOS VII FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	3.983.724,49	0,00	104.882,64	3.943.068,86	64.227,01	1,61%	1,64%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	0,00	2.000.000,00	0,00	2.002.927,27	2.927,27	0,15%	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.456.400,66	35.000.000,00	0,00	35.576.323,75	-880.076,91	-2,41%	-1,88%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	2.227.220,22	20.000.000,00	0,00	20.760.341,64	-1.466.878,58	-6,60%	-5,44%
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>8.774.642,47</b>	<b>1,77%</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
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTI...	3.466.867,86	0,00	0,00	3.528.962,32	62.094,46	1,79%	1,79%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BRASIL IBOVESPA II FIC MUL...	5.652.350,00	0,00	5.655.135,00	0,00	2.785,00	0,05%	-
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	3.040.924,20	0,00	0,00	2.991.521,99	-49.402,21	-1,62%	-1,62%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	5.306.074,37	0,00	0,00	5.251.330,42	-54.743,95	-1,03%	-1,03%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3.189.247,66	8.000.000,00	0,00	11.088.717,96	-100.529,70	-0,90%	-14,67%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	3.291.396,20	0,00	0,00	3.189.255,83	-102.140,37	-3,10%	-3,10%
BB RECEBÍVEIS IMOBILIÁRIOS FII - BBIM11	2.229.700,98	214.774,71	107.700,00	2.193.332,50	-143.443,19	-5,87%	-0,02%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	1.634.544,54	0,00	0,00	1.349.125,34	-285.419,20	-17,46%	-17,46%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	3.248.538,64	12.886.373,98	0,00	15.612.172,69	-522.739,93	-3,24%	-13,79%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	0,00	3.000.676,11	0,00	2.344.297,52	-656.378,59	-21,87%	-21,45%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	3.179.931,34	12.079.303,55	0,00	14.185.503,27	-1.073.731,62	-7,04%	-15,92%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	19.724.239,39	2.000.000,00	0,00	18.447.808,22	-3.276.431,17	-15,08%	-18,44%
CAIXA BRASIL IBOVESPA FI AÇÕES	26.392.420,37	3.738.561,43	0,00	26.214.509,51	-3.916.472,29	-13,00%	-17,75%
<b>Total Renda Variável</b>					<b>-10.116.552,76</b>	<b>-8,68%</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
CAIXA INSTITUCIONAL BDR NÍVEL I FI AÇÕES	0,00	1.000.000,00	0,00	1.186.954,81	186.954,81	18,70%	32,85%
				<b>Total Exterior</b>	<b>186.954,81</b>	<b>18,70%</b>	