

CRÉDITO E MERCADO

Engenharia Financeira
Relatório Analítico dos Investimentos

em agosto de 2020

Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2020)

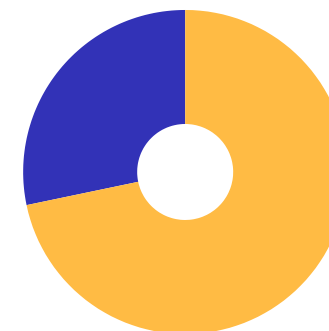
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	21.912.248,69	5,18%	905	0,36%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	30.959.467,79	7,31%	892	0,48%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	45.684.116,54	10,79%	970	0,51%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	135.274,06	0,03%	1.359	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	16.361.772,35	3,86%	627	0,38%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENC...	D+0	16/05/2023	13.521.450,21	3,19%	51	3,85%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	69.578.510,61	16,43%	852	0,52%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	3.369.407,18	0,80%	289	0,07%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	16.836.401,44	3,98%	54	18,47%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	D+1471	Não há	1.926.718,80	0,46%	26	2,84%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
MULTINVEST GRAU DE INVESTIMENTO FI RENDA FIXA	D+4	Não há	2.308.532,41	0,55%	6	13,47%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA L...	D+1	Não há	6.762.842,51	1,60%	49	11,75%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1471	Não há	5.179.899,44	1,22%	31	1,97%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	15.012.575,20	3,55%	271	1,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	25.381.692,74	5,99%	189	1,85%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	9.109.496,57	2,15%	100	1,54%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	Não pos...	1008 dias úteis	7.088.963,62	1,67%	8	25,76%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	2.565.958,48	0,61%		0,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	D+13	Não há	4.618.638,83	1,09%	104	4,16%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	9.051.443,97	2,14%	1.071	3,62%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
MULTINVEST FI AÇÕES	D+11	Não há	6.815.017,16	1,61%	300	7,06%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	2.262.635,32	0,53%	12.586	0,27%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	6.026.712,51	1,42%	3.533	0,36%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+33	Não há	7.737.528,72	1,83%	3.294	1,56%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
META VALOR FI AÇÕES	D+4	Não há	19.366.981,89	4,57%	193	7,00%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	D+4	Não há	9.931.868,61	2,35%	1.800	3,54%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	8.990.285,64	2,12%	8.187	0,91%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	D+3 du	Não há	5.270.132,58	1,24%	152	5,63%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	2.467.206,29	0,58%	158	0,07%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+30 ou...	Não há	1.537.385,02	0,36%		6,49%	Artigo 8º, Inciso III
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCA...	D+1	Não há	3.804.728,71	0,90%	31	5,15%	Artigo 8º, Inciso III
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	3.418.943,78	0,81%	41	8,85%	Artigo 8º, Inciso III
W7 MULTIESTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	10.788.784,46	2,55%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	Não se ...	Não se aplica	5.765.354,12	1,36%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII ...	Não se ...	Não se aplica	2.903.225,40	0,69%		1,91%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
CSHG BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	Não se ...	Não se aplica	1.268.262,70	0,30%		0,11%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	Não se ...	Não se aplica	7.703.781,86	1,82%		4,91%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1901	Não há	4.197.868,46	0,99%	10	6,12%	Desenquadrado - RF
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1461	Não há	5.770.215,60	1,36%	8	20,56%	Desenquadrado - RF
Total para cálculo dos limites da Resolução			423.392.330,27				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	42.339.233,03
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	198.152.840,25	46,80%	20,00%	37,50%	81,00%	144.794.947,27
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	254.035.398,16
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	40,00%	85.887.566,29	20,29%	10,00%	30,00%	40,00%	83.469.365,82
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea 'a'	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	63.508.849,54
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'	5,00%	9.654.922,10	2,28%	0,00%	2,50%	5,00%	11.514.694,41
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	21.169.616,51
Desenquadrado - RF	0,00%	9.968.084,06	2,35%	0,00%	0,00%	0,00%	-9.968.084,06
Total Renda Fixa	100,00%	303.663.412,70	71,72%	30,00%	70,00%	216,00%	

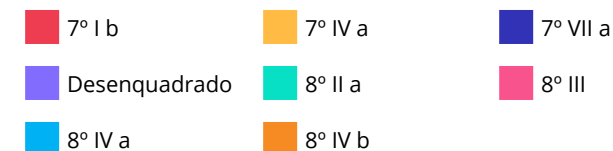
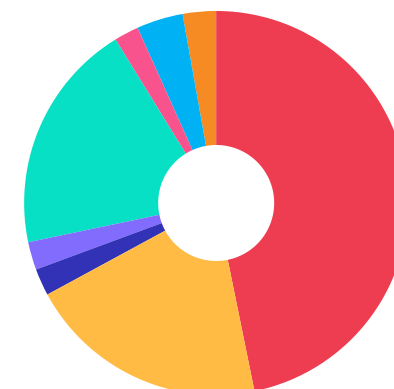


RENTA FIXA 303.663.412,70

RENTA VARIÁVEL 119.728.917,57

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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'a'	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	21.169.616,51
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'b'	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	21.169.616,51
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	82.538.451,52	19,49%	7,00%	15,00%	20,00%	2.140.014,53
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	8.761.057,51	2,07%	0,00%	5,00%	10,00%	33.578.175,52
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	5,00%	16.554.138,58	3,91%	0,00%	5,00%	5,00%	4.615.477,93
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	5,00%	11.875.269,96	2,80%	0,00%	5,00%	5,00%	9.294.346,55
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	21.169.616,51
Total Renda Variável	30,00%	119.728.917,57	28,28%	7,00%	30,00%	55,00%	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	137.310.149,90	32,43	0,03
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	75.855.265,55	17,92	0,00
INFINITY ASSET MANAGEMENT	27.018.187,73	6,38	5,10
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	25.381.692,74	5,99	0,00
META ASSET MANAGEMENT	19.366.981,89	4,57	6,91
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	18.922.154,25	4,47	1,23
ITAÚ UNIBANCO	18.750.838,75	4,43	0,00
GRAPHEN INVESTIMENTOS LTDA	17.358.703,96	4,10	33,09
MULTINVEST CAPITAL	14.893.765,17	3,52	3,01
A5 CAPITAL PARTNERS	10.788.784,46	2,55	-
4UM GESTAO DE RECURSOS LTDA	9.051.443,97	2,14	0,34
PERFIN INVESTIMENTOS	7.737.528,72	1,83	0,10
NAVI CAPITAL	6.026.712,51	1,42	0,37
KINEA PRIVATE EQUITY INVESTIME...	5.765.354,12	1,36	0,00
FINACAP CONSULTORIA FINANCEIRA	5.270.132,58	1,24	1,46
BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUT...	5.179.899,44	1,22	0,07
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	4.618.638,83	1,09	1,05
AURORA CAPITAL	4.197.868,46	0,99	1,76
ZION INVEST	2.903.225,40	0,69	0,59
AZ QUEST INVESTIMENTOS	2.262.635,32	0,53	0,01
RJI CORRETORA DE VALORES	1.926.718,80	0,46	1,16
CAPITÂNIA	1.537.385,02	0,36	0,02
CREDIT SUISSE HEDGING-GRIFFO C...	1.268.262,70	0,30	0,12

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2020		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	198.152.840,25	46,80	20,00	81,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	85.887.566,29	20,29	10,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	9.654.922,10	2,28	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	82.538.451,52	19,49	7,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	8.761.057,51	2,07	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	16.554.138,58	3,91	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	11.875.269,96	2,80	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	0,88%	5,97%	2,88%	4,20%	10,63%	23,47%	-	-
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	-0,99%	-0,44%	-5,43%	-4,37%	2,04%	13,78%	1,08%	0,32%

IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	1,03%	5,39%	2,99%	4,11%	9,71%	23,52%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,69%	4,43%	2,73%	3,38%	8,67%	21,54%	0,01%	0,03%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,79%	4,80%	2,82%	3,70%	8,84%	21,88%	0,01%	0,03%

IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	0,81%	5,32%	2,64%	3,71%	9,61%	21,21%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-0,19%	-3,54%	-0,82%	-2,77%	-5,23%	-0,82%	0,00%	-

IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	0,73%	4,66%	2,39%	3,22%	8,58%	18,96%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,66%	5,89%	2,95%	4,38%	11,02%	31,73%	0,01%	0,04%

IMA-B 5+ (Benchmark)	-3,62%	-2,01%	6,38%	-2,35%	4,71%	44,71%	-	-
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	1,33%	3,84%	6,02%	3,77%	6,80%	19,15%	0,02%	0,09%

IRF-M 1 (Benchmark)	0,12%	2,96%	0,64%	2,12%	5,06%	12,83%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,10%	2,83%	0,60%	2,03%	4,85%	12,44%	0,00%	0,01%

IMA-B 5 (Benchmark)	0,43%	4,63%	2,55%	3,39%	9,24%	25,01%	-	-
----------------------------	-------	-------	-------	-------	-------	--------	---	---

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-4,54%	-34,39%	-7,53%	-31,95%	-32,39%	-29,61%	0,00%	0,27%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,37%	4,46%	2,43%	3,21%	8,96%	24,42%	0,01%	0,04%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	0,59%	-5,39%	-4,44%	-6,63%	-2,13%	4,73%	0,01%	0,06%
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-0,13%	0,14%	3,21%	0,64%	4,50%	23,34%	0,04%	0,06%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	-2,29%	-19,45%	-4,66%	-19,54%	-18,15%	-16,43%	0,02%	0,17%

IMA-B (Benchmark)	-1,80%	0,80%	4,61%	0,09%	6,64%	36,00%	-	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,79%	0,52%	4,60%	-0,14%	6,27%	35,06%	0,02%	0,11%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-1,83%	0,54%	4,54%	-0,14%	6,20%	35,19%	0,02%	0,11%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	-1,92%	2,09%	4,48%	1,17%	8,22%	39,31%	0,02%	0,10%
MULTINVEST GRAU DE INVESTIMENTO FI RENDA FIXA	2,85%	-5,66%	-0,03%	-7,11%	-0,82%	14,58%	0,02%	0,08%

CDI (Benchmark)	0,16%	2,12%	0,57%	1,43%	3,86%	10,38%	-	-
INFINITY LÓTUS FI RENDA FIXA LP	0,99%	4,43%	3,55%	3,71%	6,37%	13,57%	0,01%	0,03%

IPCA (Benchmark)	0,24%	0,70%	0,86%	0,24%	2,44%	5,95%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,13%	2,70%	0,86%	2,09%	4,74%	18,63%	0,00%	0,01%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	-0,56%	5,06%	1,17%	3,57%	9,21%	27,35%	0,01%	0,03%
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,86%	2,63%	1,79%	1,79%	6,03%	22,43%	0,01%	0,04%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	1,08%	7,59%	3,49%	5,41%	13,19%	29,21%	-	-
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	-	-

IDIV (Benchmark)	-4,83%	-17,25%	10,46%	-10,38%	-3,64%	44,78%	-	-
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	-3,87%	-17,93%	10,15%	-11,46%	-3,41%	29,79%	0,08%	0,35%

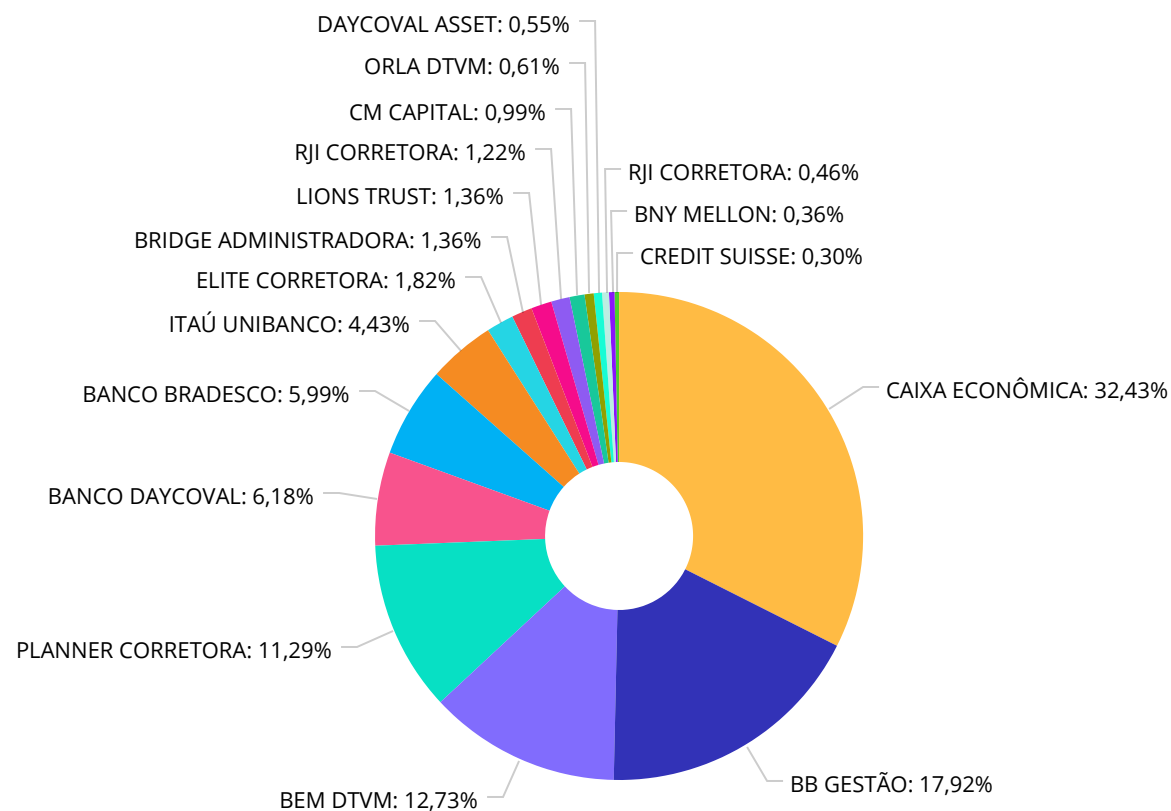
IBX (Benchmark)	-3,38%	-13,46%	14,15%	-4,51%	-1,12%	33,35%	-	-
META VALOR FI AÇÕES	-2,00%	-6,24%	19,10%	-1,03%	13,72%	51,36%	0,12%	0,51%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	-2,60%	-16,00%	14,34%	-4,54%	-4,22%	33,67%	0,10%	0,38%

Ibovespa (Benchmark)	-3,44%	-14,07%	13,69%	-4,61%	-1,75%	29,59%	-	-
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-2,06%	-7,67%	14,64%	-6,21%	10,00%	57,22%	0,08%	0,43%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	-3,21%	-9,23%	17,71%	0,89%	11,04%	38,86%	0,07%	0,39%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	-1,98%	-12,25%	17,24%	-7,84%	-2,23%	32,56%	0,11%	0,44%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	-5,77%	-18,10%	10,83%	-10,38%	-4,54%	26,26%	0,09%	0,40%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	-6,24%	-17,19%	8,81%	-13,91%	-0,49%	50,93%	0,08%	0,40%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-3,93%	-27,34%	13,94%	-21,07%	-17,17%	22,23%	0,12%	0,50%
MULTINVEST FI AÇÕES	-3,86%	-10,44%	16,31%	-7,23%	6,75%	46,43%	0,11%	0,43%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-2,88%	-9,11%	14,42%	-0,74%	4,56%	52,97%	0,11%	0,37%

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

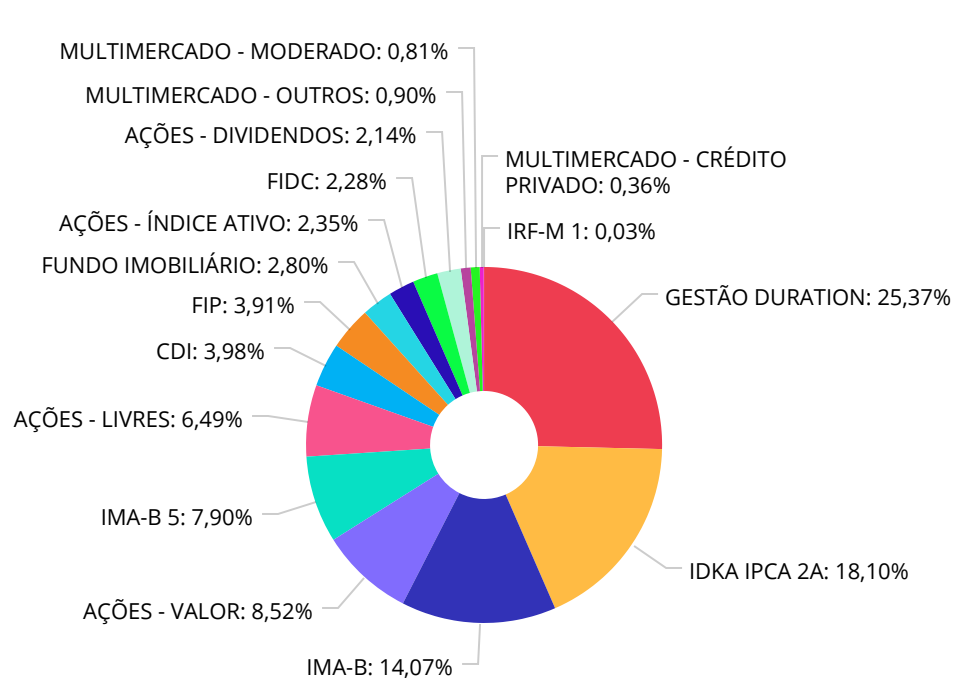
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,16%	2,12%	0,57%	1,43%	3,86%	10,38%	-	-
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	1,23%	4,76%	3,98%	4,67%	7,00%	14,00%	0,01%	0,04%
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	0,13%	2,57%	0,71%	1,50%	4,71%	12,51%	0,00%	0,01%
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-	-	-	-	-	-	0,03%	-
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	-	-	-	-	-	-	-	-
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	-0,13%	-1,05%	-0,37%	-0,72%	-	-	0,00%	0,00%
CSHG BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	4,52%	-29,30%	4,73%	-24,53%	-16,83%	7,00%	0,06%	0,28%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - CARE11	-5,26%	-30,23%	30,44%	-24,37%	-42,31%	-52,38%	0,34%	0,60%

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



CAIXA ECONÔMICA	137.310.149,90
BB GESTÃO	75.855.265,55
BEM DTVM	53.889.246,18
PLANNER CORRETORA	47.799.161,21
BANCO DAYCOVAL	26.181.999,05
BANCO BRADESCO	25.381.692,74
ITAÚ UNIBANCO	18.750.838,75
ELITE CORRETORA	7.703.781,86
BRIDGE ADMINISTRADORA	5.770.215,60
LIONS TRUST	5.765.354,12
RJI CORRETORA	5.179.899,44
CM CAPITAL	4.197.868,46
ORLA DTVM	2.565.958,48
DAYCOVAL ASSET	2.308.532,41
RJI CORRETORA	1.926.718,80
BNY MELLON	1.537.385,02
CREDIT SUISSE	1.268.262,70

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

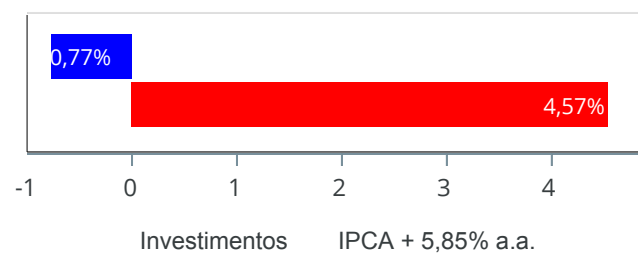


GESTÃO DURATION	107.400.985,45
IDKA IPCA 2A	76.643.584,33
IMA-B	59.555.770,67
AÇÕES - VALOR	36.070.770,46
IMA-B 5	33.436.474,65
AÇÕES - LIVRES	27.484.368,48
CDI	16.836.401,44
FIP	16.554.138,58
FUNDO IMOBILIÁRIO	11.875.269,96
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	9.931.868,61
FIDC	9.654.922,10
AÇÕES - DIVIDENDOS	9.051.443,97
MULTIMERCADO - OUTROS	3.804.728,71
MULTIMERCADO - MODERADO	3.418.943,78
MULTIMERCADO - CRÉDITO PRIVADO	1.537.385,02
IRF-M 1	135.274,06

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	435.083.987,15	5.418.202,43	6.293.697,59	435.654.897,26	1.446.405,27	1.446.405,27	0,33%	0,33%	0,71%	0,71%	46,91%	2,17%
Fevereiro	435.654.897,26	26.147.187,06	26.889.815,73	432.155.043,44	-2.757.225,15	-1.310.819,88	-0,63%	-0,30%	0,66%	1,37%	-22,06%	3,46%
Março	432.155.043,44	10.899.560,63	11.531.032,28	399.293.679,60	-32.229.892,19	-33.540.712,07	-7,46%	-7,74%	0,57%	1,95%	-397,45%	15,87%
Abril	399.293.679,60	3.184.673,95	3.931.952,59	404.881.678,44	6.335.277,48	-27.205.434,59	1,59%	-6,27%	0,14%	2,09%	-300,13%	7,41%
Mai	404.881.678,44	3.484.311,43	4.288.306,99	412.303.314,74	8.225.631,86	-18.979.802,73	2,03%	-4,37%	0,07%	2,16%	-202,08%	4,22%
Junho	412.303.314,74	4.735.468,15	5.522.255,49	419.262.773,89	7.746.246,49	-11.233.556,24	1,88%	-2,57%	0,74%	2,91%	-88,29%	3,54%
Julho	419.262.773,89	8.374.230,07	9.213.525,93	430.035.391,04	11.611.913,01	378.356,77	2,77%	0,13%	0,88%	3,82%	3,27%	4,90%
Agosto	430.035.391,04	6.664.499,10	9.460.014,97	423.392.330,27	-3.847.544,90	-3.469.188,13	-0,89%	-0,77%	0,72%	4,57%	-16,88%	4,99%

Investimentos x Meta Atuarial



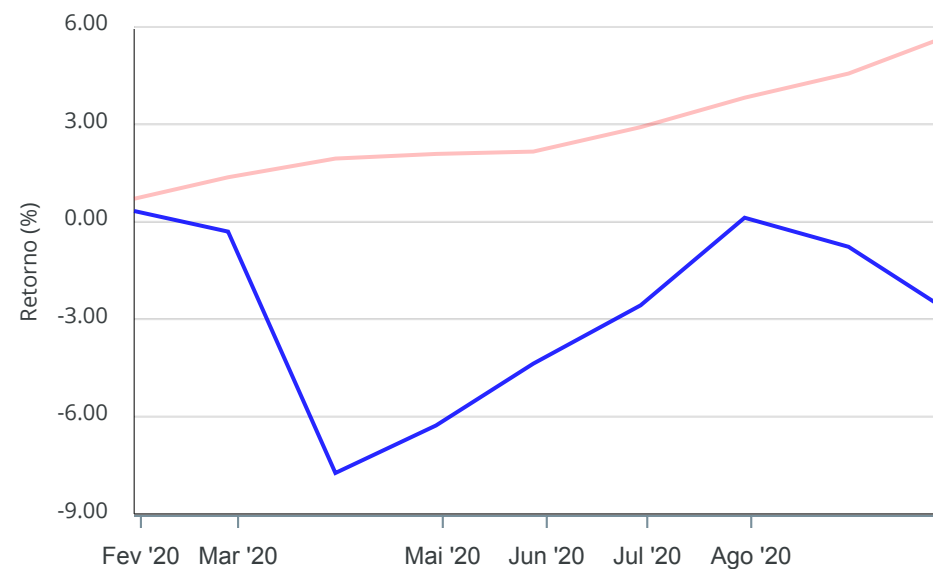
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Agosto/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
MULTINVEST GRAU DE INVESTIMENTO FI RENDA FIXA	2.244.469,28	0,00	0,00	2.308.532,41	64.063,13	2,85%	2,85%	2,19%
INFINITY TIGER ALOCAÇÃO DINÂMICA FI RENDA FIXA LP	6.673.986,77	0,00	0,00	6.762.842,51	88.855,74	1,33%	1,33%	1,84%
INFINITY LÔTUS FI RENDA FIXA LP	16.672.111,73	0,00	0,00	16.836.401,44	164.289,71	0,99%	0,99%	0,88%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	45.460.018,93	0,00	135.417,54	45.684.116,54	359.515,15	0,79%	0,79%	0,77%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	33.729.301,59	0,00	3.000.000,00	30.959.467,79	230.166,20	0,68%	0,69%	0,74%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	13.432.746,46	0,00	0,00	13.521.450,21	88.703,75	0,66%	0,66%	1,05%
MULTINVEST INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	5.736.300,72	0,00	0,00	5.770.215,60	33.914,88	0,59%	0,59%	0,94%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	16.416.465,90	0,00	114.847,19	16.361.772,35	60.153,64	0,37%	0,37%	0,81%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	135.143,68	0,00	0,00	135.274,06	130,38	0,10%	0,10%	0,15%
GGR INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	4.203.495,23	0,00	0,00	4.197.868,46	-5.626,77	-0,13%	-0,13%	4,30%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	5.550.964,73	0,00	2.172.924,98	3.369.407,18	-8.632,57	-0,16%	-0,12%	0,26%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	2.571.042,52	0,00	0,00	2.565.958,48	-5.084,04	-0,20%	-	0,24%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	70.337.325,00	3.664.499,10	4.021.801,96	69.578.510,61	-401.511,53	-0,54%	-0,56%	0,92%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	25.601.873,69	0,00	0,00	25.381.692,74	-220.180,95	-0,86%	-0,86%	1,05%
AR BANK IMOBILIÁRIOS I FIDC SÊNIOR	7.159.797,50	0,00	0,00	7.088.963,62	-70.833,88	-0,99%	-29,51%	108,34%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	15.286.743,84	0,00	0,00	15.012.575,20	-274.168,64	-1,79%	-1,79%	2,27%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	22.320.806,34	0,00	0,00	21.912.248,69	-408.557,65	-1,83%	-1,83%	2,27%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	9.287.440,61	0,00	0,00	9.109.496,57	-177.944,04	-1,92%	-1,92%	2,30%
TOWER BRIDGE II RENDA FIXA FI IMA-B 5	1.971.863,22	0,00	0,00	1.926.718,80	-45.144,42	-2,29%	-2,29%	1,69%
TOWER IMA-B 5 FI RENDA FIXA	5.426.307,09	0,00	0,00	5.179.899,44	-246.407,65	-4,54%	-4,54%	0,16%

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
Total Renda Fixa	310.218.204,83	3.664.499,10	9.444.991,67	303.663.412,70	-774.299,56	-0,25%		3,66%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CSHG BRASIL SHOPPING FII - HGBS11	1.213.514,10	0,00	1.497,50	1.268.262,70	56.246,10	4,63%	4,52%	6,25%
INFINITY INSTITUCIONAL FI MULTIMERCADO	3.377.316,90	0,00	0,00	3.418.943,78	41.626,88	1,23%	1,23%	0,84%
ITAÚ INSTITUCIONAL JUROS E MOEDAS FIC MULTIMERCADO	3.799.777,76	0,00	0,00	3.804.728,71	4.950,95	0,13%	0,13%	0,13%
KINEA PRIVATE EQUITY II FICFIP	5.769.108,46	0,00	0,00	5.765.354,12	-3.754,34	-0,07%	-	-
BR HOTÉIS FII - BRHT11B	7.713.687,62	0,00	0,00	7.703.781,86	-9.905,76	-0,13%	-0,13%	0,00%
W7 MULTISTRATÉGIA FIP	10.813.797,02	0,00	0,00	10.788.784,46	-25.012,56	-0,23%	-	-
CAPITÂNIA MULTI FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1.555.068,07	0,00	0,00	1.537.385,02	-17.683,05	-1,14%	-	2,77%
META VALOR FI AÇÕES	16.708.080,74	3.000.000,00	0,00	19.366.981,89	-341.098,85	-1,73%	-2,00%	11,87%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	2.308.306,12	0,00	0,00	2.262.635,32	-45.670,80	-1,98%	-1,98%	10,65%
PERFIN FORESIGHT INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	7.900.377,82	0,00	0,00	7.737.528,72	-162.849,10	-2,06%	-2,06%	7,62%
QUELUZ VALOR FI AÇÕES	4.742.014,39	0,00	0,00	4.618.638,83	-123.375,56	-2,60%	-2,60%	9,50%
NAVI INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	6.205.302,50	0,00	0,00	6.026.712,51	-178.589,99	-2,88%	-2,88%	11,00%
FINACAP MAURITSSTAD FI AÇÕES	5.445.150,70	0,00	0,00	5.270.132,58	-175.018,12	-3,21%	-3,21%	7,39%
MULTINVEST FI AÇÕES	7.088.406,80	0,00	0,00	6.815.017,16	-273.389,64	-3,86%	-3,86%	11,43%
4UM MARLIM DIVIDENDOS FI AÇÕES	9.416.161,02	0,00	0,00	9.051.443,97	-364.717,05	-3,87%	-3,87%	7,96%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	2.567.999,23	0,00	0,00	2.467.206,29	-100.792,94	-3,92%	-3,92%	11,66%
BRAZILIAN GRAVEYARD AND DEATH CARE SERVICES FII - ...	3.064.515,70	0,00	13.525,80	2.903.225,40	-147.764,50	-4,82%	-8,42%	34,23%
CONSTÂNCIA LEGAN BRASIL FI AÇÕES	10.540.101,97	0,00	0,00	9.931.868,61	-608.233,36	-5,77%	-5,77%	9,03%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	9.588.499,29	0,00	0,00	8.990.285,64	-598.213,65	-6,24%	-6,24%	8,07%
Total Renda Variável	119.817.186,21	3.000.000,00	15.023,30	119.728.917,57	-3.073.245,34	-2,50%		8,90%