

# CRÉDITO E MERCADO

*Engenharia Financeira*  
Relatório Analítico dos Investimentos

em setembro e 3º trimestre de 2020



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

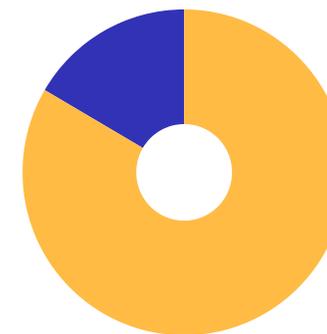
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
TÍTULOS PÚBLICOS			91.358.145,96	15,83%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	50.168.076,61	8,69%	868	0,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	57.124.913,83	9,90%	1.239	0,77%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	46.983.920,46	8,14%	597	0,45%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	50.644.942,81	8,77%	463	0,45%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	67.593.581,54	11,71%	676	1,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	61.636.292,69	10,68%	982	0,67%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRA1 FI RENDA FIXA	D+1445	Não há	632.982,05	0,11%	16	4,17%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	D+1009	Não há	3.697.377,98	0,64%		0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	D+1800	Não há	1.177.741,56	0,20%	18	0,66%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	46.977.278,77	8,14%	290	0,98%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 4	Não se ...	Não se aplica	0,01	0,00%		0,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	1.816.232,48	0,31%		0,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
PREMIUM FIDC SÊNIOR	Não se ...	Não se aplica	1.779.007,93	0,31%	98	2,17%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	Não se ...	Não se aplica	0,01	0,00%		0,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 3	Não se ...	Não se aplica	0,01	0,00%		0,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
ITAU DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	23.580.217,07	4,09%	46.574	0,62%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	D+30	Não há	20.368.580,21	3,53%	1.589	7,62%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	21.906.353,97	3,80%	12.180	2,90%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	D+30	Não há	20.003.070,67	3,47%	6.258	1,20%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+1	Não há	233.042,14	0,04%	12	14,12%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	225.380,55	0,04%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRASIL ÓLEO & GÁS MULTISTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	383,61	0,00%	15	0,40%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
ÁTICO FLORESTAL BRASIL FICFIP	Não se ...	Não se aplica	1.538.230,46	0,27%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRCR11	S/Info	Não se aplica	295.386,00	0,05%		0,02%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
RIO BRAVO RENDA VAREJO FII - RBVA11	Não se ...	Não se aplica	2.398.000,00	0,42%		0,49%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se ...	Não se aplica	2.016.189,25	0,35%		5,13%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	S/Info	Não se aplica	3.080.470,34	0,53%		6,25%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>577.235.798,97</b>				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			<b>490.838,89</b>				Artigo 6º
<b>PL Total</b>			<b>577.726.637,86</b>				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	91.358.145,96	15,83%	5,00%	15,00%	100,00%	485.877.653,01
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	334.151.727,94	57,89%	10,00%	52,50%	100,00%	243.084.071,03
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	28.861.789,95
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	28.861.789,95
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	115.447.159,79
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	115.447.159,79
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	52.485.380,36	9,09%	0,00%	10,00%	40,00%	178.408.939,23
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	28.861.789,95
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	3.595.240,44	0,62%	0,00%	0,50%	3,00%	13.721.833,53
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>481.590.494,70</b>	<b>83,43%</b>	<b>15,00%</b>	<b>78,00%</b>	<b>298,00%</b>	

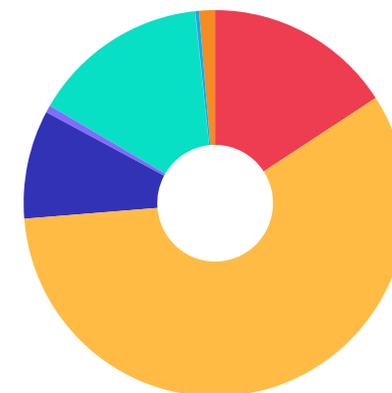


RENDA FIXA 481.590.494,70

RENDA VARIÁVEL 95.645.304,27

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Setembro / 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%	0,50%	10,00%	57.723.579,90
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	25,00%	144.308.949,74
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	85.858.221,92	14,87%	0,00%	14,00%	20,00%	29.588.937,87
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	28.861.789,95
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	233.042,14	0,04%	0,00%	0,50%	3,00%	17.084.031,83
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	1.763.994,62	0,31%	0,00%	1,00%	5,00%	27.097.795,33
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	7.790.045,59	1,35%	0,00%	1,00%	5,00%	21.071.744,36
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	28.861.789,95
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>95.645.304,27</b>	<b>16,57%</b>	<b>0,00%</b>	<b>22,00%</b>	<b>78,00%</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%	28.861.789,95
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	28.861.789,95
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	28.861.789,95
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>15,00%</b>	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	171.702.415,83	29,75	0,01
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	162.449.312,11	28,14	0,03
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	91.358.145,96	15,83	-
ITAÚ UNIBANCO	70.557.495,84	12,22	0,00
AZ QUEST INVESTIMENTOS	41.909.424,64	7,26	0,14
BNP PARIBAS ASSET MANAGEMENT	20.368.580,21	3,53	0,03
GRAPHEN INVESTIMENTOS LTDA	5.746.652,60	1,00	21,76
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	5.251.682,85	0,91	-
RIO BRAVO INVESTIMENTOS	2.398.000,00	0,42	0,69
REDITUS INVESTIMENTOS	2.016.189,25	0,35	-
PETRA CAPITAL	1.779.007,93	0,31	0,03
VERITAS CAPITAL MANAGEMENT	1.177.741,56	0,20	0,05
BTG PACTUAL GESTORA DE RECURSO...	295.386,00	0,05	0,00
BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUT...	225.380,58	0,04	0,01
VALORA INVESTIMENTOS	383,61	0,00	0,00

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 '	91.358.145,96	15,83	50,00	90,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	334.151.727,94	57,89	20,00	50,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	52.485.380,36	9,09	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	5,00	10,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	85.858.221,92	14,87	10,00	20,00

**Artigo 14º** - O total das aplicações dos recursos do regime próprio de previdência social em fundos de investimento e carteiras administradas não pode exceder a 5% (cinco por cento) do volume total de recursos de terceiros gerido por um mesmo gestor ou por gestoras ligadas ao seu respectivo grupo econômico, assim definido pela CVM em regulamentação específica. (NR)

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IMA Geral ex-C (Benchmark)</b>	-0,71%	1,96%	0,25%	2,99%	3,90%	21,11%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,75%	1,86%	0,10%	3,07%	3,70%	21,50%	0,02%	0,04%
<b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>	0,02%	5,41%	1,99%	5,41%	8,00%	21,88%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,04%	4,84%	1,67%	5,27%	7,35%	20,53%	0,01%	0,03%
<b>IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)</b>	1,21%	6,59%	3,03%	4,28%	10,35%	21,46%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-2,27%	-5,73%	-2,86%	-3,74%	-6,52%	-3,07%	-	-
<b>120% do CDI (Benchmark)</b>	0,19%	2,74%	0,61%	1,50%	4,27%	12,16%	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	0,00%	-	0,00%	-	-	-	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 3	0,00%	-	0,00%	-	-	-	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 4	0,00%	-	0,00%	-	-	-	-	-
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	0,15%	3,12%	0,51%	1,66%	4,54%	12,32%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,04%	2,83%	0,36%	1,43%	4,17%	11,70%	0,00%	0,01%
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	-0,12%	4,51%	1,30%	5,11%	7,24%	23,75%	-	-
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	-4,11%	-6,61%	-8,89%	-8,92%	-7,14%	-25,11%	0,06%	0,06%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IMA-B (Benchmark)</b>	-1,51%	-0,72%	0,96%	5,97%	2,11%	34,14%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,56%	-0,93%	0,84%	5,77%	1,83%	33,39%	0,04%	0,11%
BRA1 FI RENDA FIXA	-7,43%	-34,88%	-7,45%	-17,61%	-54,06%	-74,27%	0,11%	0,34%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	-	-3,53%	-0,38%	1,33%	-2,75%	14,77%	-	-

<b>IRF-M (Benchmark)</b>	-0,56%	4,62%	-0,24%	3,15%	6,56%	24,50%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,61%	4,41%	-0,30%	3,01%	6,31%	24,12%	0,02%	0,03%

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

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)</b>	1,48%	9,18%	3,89%	5,97%	13,96%	29,52%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	-	-	-	-	-	-	-	-

<b>IPCA + 11,00% ao ano (Benchmark)</b>	1,52%	9,55%	4,01%	6,21%	14,48%	30,70%	-	-
BRASIL ÓLEO & GÁS MULTISTRATÉGIA FIP	-7,68%	-	-19,23%	-	-62,08%	-99,79%	0,01%	0,51%

<b>Ibovespa (Benchmark)</b>	-4,80%	-18,20%	-0,48%	29,56%	-9,68%	19,23%	-	-
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	-6,19%	-17,68%	0,10%	33,91%	-10,03%	20,62%	0,11%	0,45%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	-4,54%	-16,33%	-0,64%	28,99%	-7,90%	38,38%	0,11%	0,38%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-4,96%	-20,69%	2,00%	30,39%	-10,53%	31,29%	0,11%	0,41%

<b>SMLL (Benchmark)</b>	-5,44%	-18,93%	2,27%	35,50%	-1,78%	54,49%	-	-
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	-5,97%	-17,19%	3,84%	32,93%	-0,96%	56,53%	0,11%	0,48%

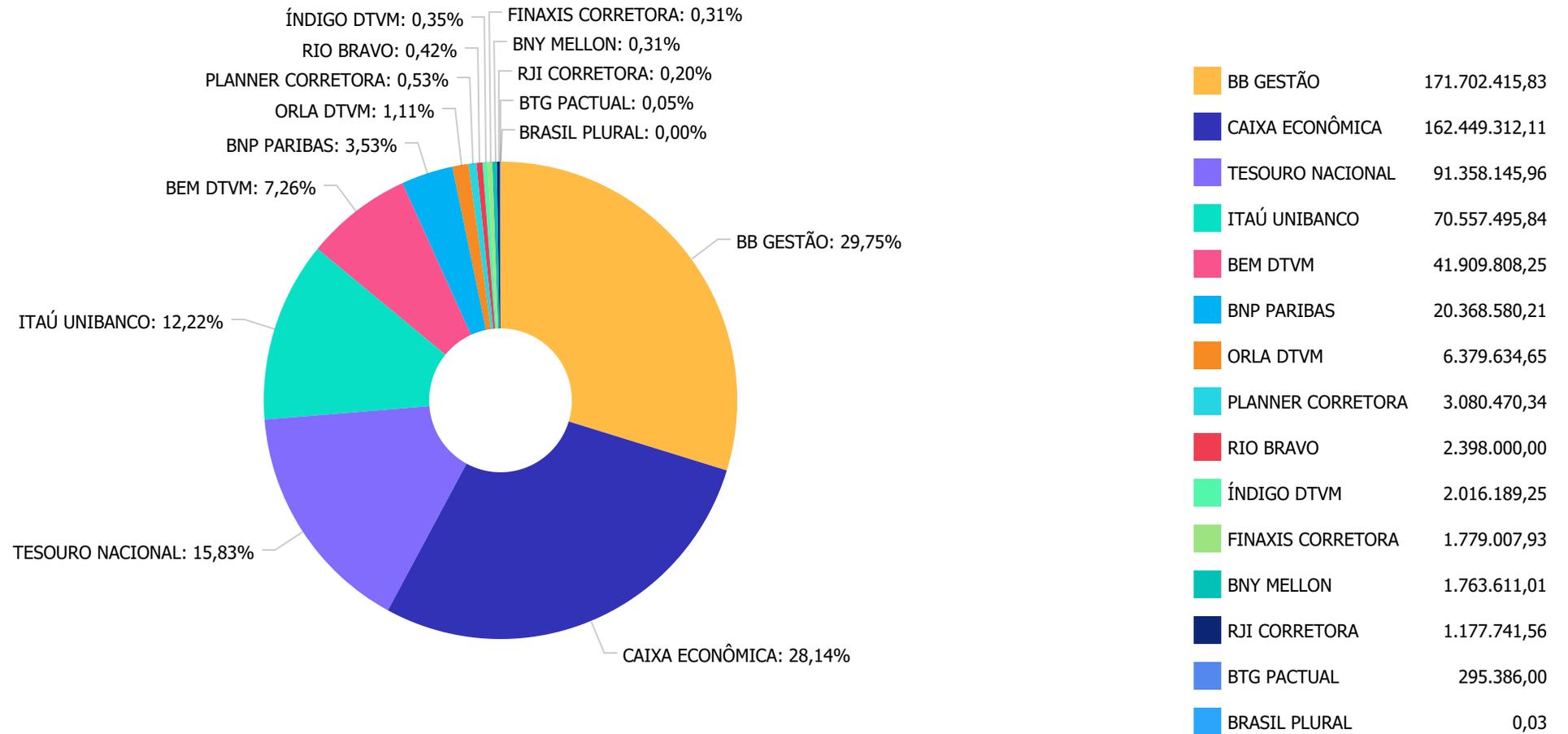
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,16%	2,28%	0,51%	1,25%	3,54%	10,04%	-	-
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-0,72%	5,06%	-1,23%	-2,20%	2,30%	7,97%	0,00%	0,08%

<b>Não Informado (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRGR11	3,96%	-22,69%	-1,53%	2,46%	0,22%	-6,17%	0,05%	0,30%
ÁQUILLA FII - AQLL11	0,00%	11,11%	-20,00%	10,80%	-14,89%	0,00%	0,00%	0,49%

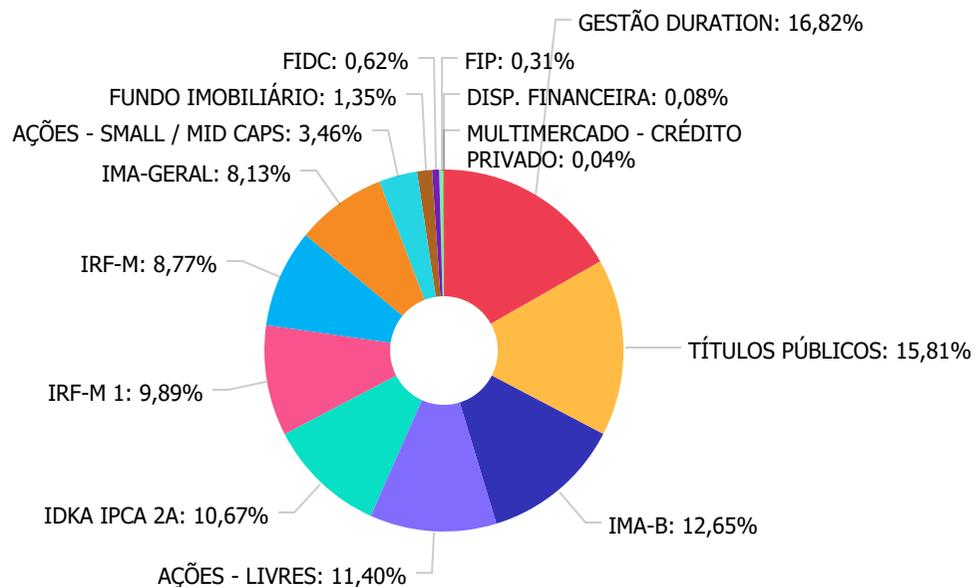
## Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	0,00%	-14,35%	1,73%	4,41%	76,46%	76,46%	-	-
ÁTICO FLORESTAL BRASIL FICFIP	-	-	-	-	-	-	-	-
RIO BRAVO RENDA VAREJO FII - RBVA11	3,38%	-29,05%	-19,53%	-4,22%	-5,96%	-87,84%	0,05%	0,37%

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



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



GESTÃO DURATION	97.145.355,38
TÍTULOS PÚBLICOS	91.358.145,96
IMA-B	73.101.683,13
AÇÕES - LIVRES	65.855.151,25
IDKA IPCA 2A	61.636.292,69
IRF-M 1	57.124.913,83
IRF-M	50.644.942,81
IMA-GERAL	46.983.920,46
AÇÕES - SMALL / MID CAPS	20.003.070,67
FUNDO IMOBILIÁRIO	7.790.045,59
FIDC	3.595.240,44
FIP	1.763.994,62
DISP. FINANCEIRA	490.838,89
MULTIMERCADO - CRÉDITO PRIVADO	233.042,14

Carteira de Títulos Públicos no mês de (Setembro / 2020)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	08/10/2004	750	1.322,840000	3.863,612977	992.130,00	2.897.709,73	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	22/09/2004	760	1.314,210000	3.863,612977	998.799,60	2.936.345,86	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	02/09/2004	770	1.299,461390	3.863,612977	1.000.585,27	2.974.981,99	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	22/07/2004	850	1.322,487235	3.863,612977	1.124.114,15	3.284.071,03	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	06/04/2004	750	1.342,192893	3.863,612977	1.006.644,67	2.897.709,73	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	17/03/2004	750	1.333,000000	3.863,612977	999.750,00	2.897.709,73	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	14/12/2004	1.100	1.352,073136	3.863,612977	1.487.280,45	4.249.974,27	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	04/01/2005	630	1.364,164873	3.863,612977	859.423,87	2.434.076,18	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	04/01/2005	100	1.364,164800	3.863,612977	136.416,48	386.361,30	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	07/01/2005	730	1.366,595342	3.863,612977	997.614,60	2.820.437,47	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	20/01/2004	1.100	1.345,077073	3.863,612977	1.479.584,78	4.249.974,27	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	18/11/2003	880	1.247,941000	3.863,612977	1.098.188,08	3.399.979,42	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	17/11/2004	610	1.468,534148	4.260,988647	895.805,83	2.599.203,07	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	18/11/2004	1.010	1.468,534139	4.260,988647	1.483.219,48	4.303.598,53	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	19/11/2004	1.180	1.468,534144	4.260,988647	1.732.870,29	5.027.966,60	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	29/04/2005	916	1.363,723504	4.260,988647	1.249.170,73	3.903.065,60	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	29/05/2003	500	1.596,101000	5.057,389161	798.050,50	2.528.694,58	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	15/04/2003	662	1.580,468218	5.057,389161	1.046.269,96	3.347.991,62	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	20/03/2003	600	1.601,028617	5.057,389161	960.617,17	3.034.433,50	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	15/04/2003	938	1.577,117868	5.057,389161	1.479.336,56	4.743.831,03	Mercado

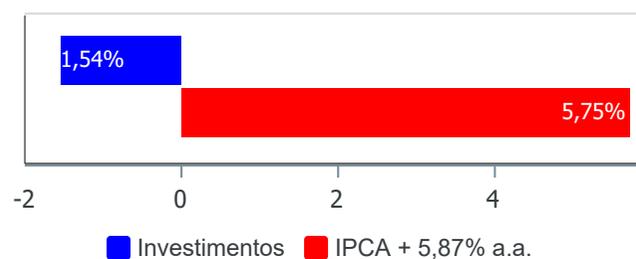
## Carteira de Títulos Públicos no mês de (Setembro / 2020)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	20/03/2003	600	1.601,028617	5.057,389161	960.617,17	3.034.433,50	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	15/04/2003	938	1.577,117868	5.057,389161	1.479.336,56	4.743.831,03	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	29/05/2003	500	1.596,101000	5.057,389161	798.050,50	2.528.694,58	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	09/09/2003	690	1.452,455942	5.057,389161	1.002.194,60	3.489.598,52	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	03/07/2003	180	1.433,575000	5.057,389161	258.043,50	910.330,05	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	18/06/2003	631	1.441,834834	5.057,389161	909.797,78	3.191.212,56	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	08/10/2003	300	1.432,180667	5.057,389161	429.654,20	1.517.216,75	Mercado
NTN-C - Nota do Tesouro Nacional - Série C	01/04/2021	21/03/2003	1.300	1.602,545169	5.057,389161	2.083.308,72	6.574.605,91	Mercado

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

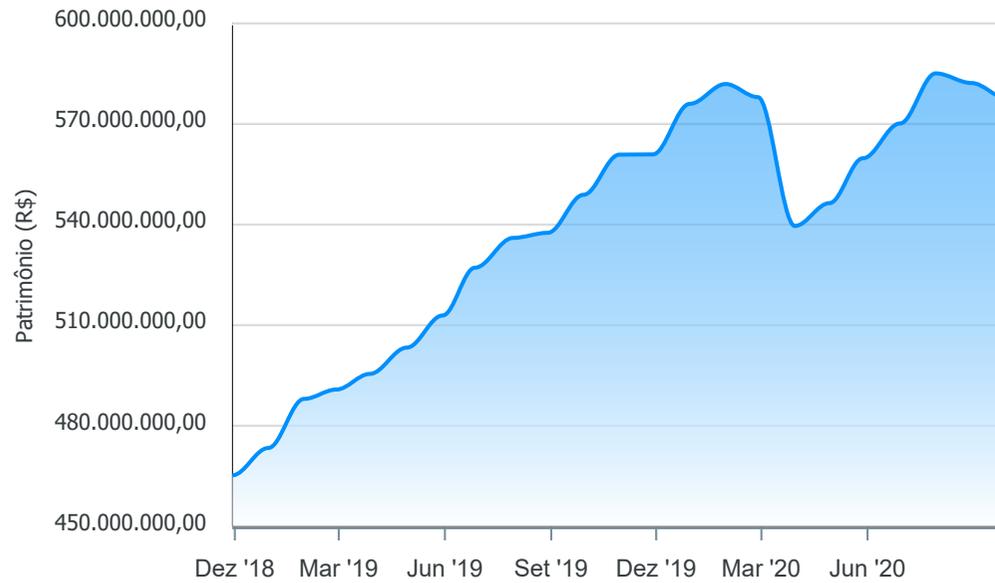
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	567.916.838,93	5.240.000,00	3.230.017,76	574.187.723,07	4.260.901,90	4.260.901,90	0,75%	0,75%	0,71%	0,71%	105,26%	2,48%
Fevereiro	574.187.723,07	5.920.000,00	4.345.165,69	570.157.905,78	-5.604.651,60	-1.343.749,70	-0,97%	-0,23%	0,66%	1,37%	-16,96%	3,66%
Março	570.157.905,78	5.020.000,00	5.551.658,99	530.327.168,84	-39.299.077,95	-40.642.827,65	-6,89%	-7,11%	0,57%	1,95%	-364,29%	13,31%
Abril	530.327.168,84	7.911.841,23	3.742.196,14	539.069.244,48	4.572.430,55	-36.070.397,10	0,86%	-6,32%	0,14%	2,10%	-301,18%	7,06%
Mai	539.069.244,48	5.820.000,00	3.207.049,14	552.741.587,69	11.059.392,35	-25.011.004,75	2,04%	-4,40%	0,07%	2,17%	-202,84%	3,40%
Junho	552.741.587,69	0,00	3.474.274,59	560.160.858,91	10.893.545,81	-14.117.458,94	1,97%	-2,52%	0,74%	2,92%	-86,12%	3,59%
Julho	560.160.858,91	5.740.000,00	6.288.420,50	574.800.139,22	15.187.700,81	1.070.241,87	2,71%	0,12%	0,88%	3,83%	3,26%	2,90%
Agosto	574.800.139,22	7.340.000,00	7.175.855,53	571.856.333,35	-3.107.950,34	-2.037.708,47	-0,54%	-0,42%	0,72%	4,58%	-9,09%	2,82%
Setembro	571.856.333,35	7.955.000,00	6.306.934,10	567.007.141,77	-6.497.257,48	-8.534.965,95	-1,13%	-1,54%	1,12%	5,75%	-26,86%	3,41%

Investimentos x Meta Atuarial



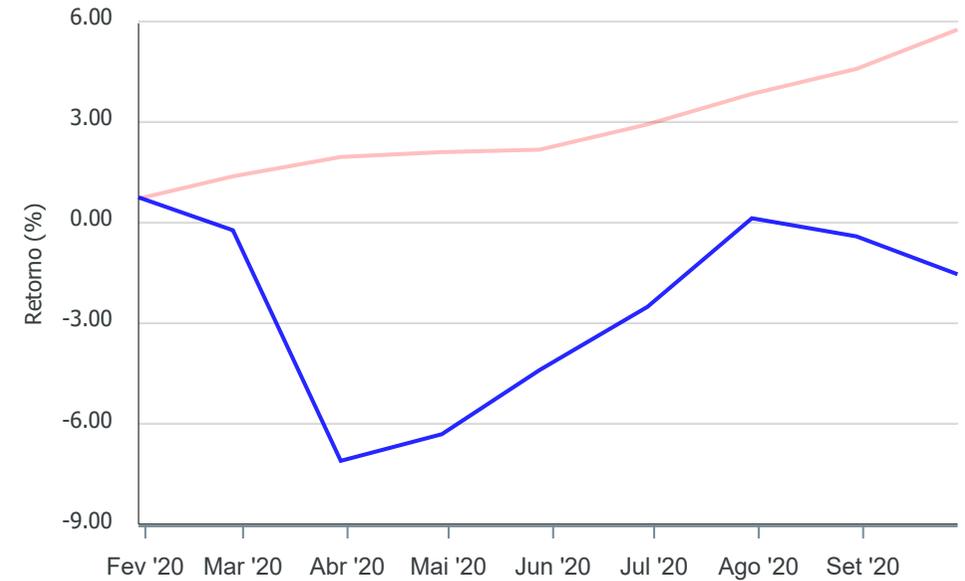
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Setembro/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
TÍTULOS PÚBLICOS	90.301.486,01	0,00	0,00	91.358.145,96	1.056.659,95	1,17%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	55.116.707,33	4.955.000,00	2.970.000,00	57.124.913,83	23.206,50	0,04%	0,04%	0,15%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	61.613.665,26	0,00	0,00	61.636.292,69	22.627,43	0,04%	0,04%	1,38%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 3	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 4	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.782.020,23	0,00	0,00	1.779.007,93	-3.012,30	-0,17%	-0,17%	0,01%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	47.085.221,61	0,00	0,00	46.977.278,77	-107.942,84	-0,23%	-0,23%	0,49%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	50.421.778,19	0,00	0,00	50.168.076,61	-253.701,58	-0,50%	-0,50%	1,68%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	54.353.540,31	0,00	3.400.000,00	50.644.942,81	-308.597,50	-0,57%	-0,61%	1,79%
BRA1 FI RENDA FIXA	683.818,80	0,00	45.878,81	632.982,05	-4.957,94	-0,73%	-7,45%	11,17%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	47.340.178,78	0,00	0,00	46.983.920,46	-356.258,32	-0,75%	-0,75%	2,02%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.228.166,45	0,00	39.353,78	1.177.741,56	-11.071,11	-0,90%	-4,11%	5,67%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	68.661.574,70	0,00	0,00	67.593.581,54	-1.067.993,16	-1,56%	-1,56%	4,15%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1.858.042,37	0,00	0,00	1.816.232,48	-41.809,89	-2,25%	-	-
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	4.316.390,08	0,00	0,00	3.697.377,98	-619.012,10	-14,34%	-	-
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>484.762.590,15</b>	<b>4.955.000,00</b>	<b>6.455.232,59</b>	<b>481.590.494,70</b>	<b>-1.671.862,86</b>	<b>-0,34%</b>		<b>1,77%</b>

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BRASIL ÓLEO & GÁS MULTISTRATÉGIA FIP	415,55	0,00	3.200,02	383,61	3.168,08	762,38%	-7,68%	1,48%
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRGR11	282.661,68	0,00	1.501,49	295.386,00	14.225,81	5,03%	3,96%	4,63%
RIO BRAVO RENDA VAREJO FII - RBVA11	2.338.800,00	0,00	17.000,00	2.398.000,00	76.200,00	3,26%	3,38%	4,71%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	3.072.933,07	0,00	0,00	3.080.470,34	7.537,27	0,25%	0,00%	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	2.017.252,44	0,00	0,00	2.016.189,25	-1.063,19	-0,05%	0,00%	0,00%
ÁTICO FLORESTAL BRASIL FICFIP	1.540.626,04	0,00	0,00	1.538.230,46	-2.395,58	-0,16%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	226.355,55	0,00	0,00	225.380,55	-975,00	-0,43%	-	-
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	234.720,72	0,00	0,00	233.042,14	-1.678,58	-0,72%	-0,71%	0,43%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	19.355.296,73	2.000.000,00	0,00	20.368.580,21	-986.716,52	-4,62%	-4,54%	10,52%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	24.811.154,62	0,00	0,00	23.580.217,07	-1.230.937,55	-4,96%	-4,96%	10,80%
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	21.272.931,73	0,00	0,00	20.003.070,67	-1.269.861,06	-5,97%	-5,97%	10,55%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	21.935.002,18	1.400.000,00	0,00	21.906.353,97	-1.428.648,21	-6,12%	-6,19%	11,43%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>97.088.150,31</b>	<b>3.400.000,00</b>	<b>21.701,51</b>	<b>95.645.304,27</b>	<b>-4.821.144,53</b>	<b>-4,80%</b>		<b>10,39%</b>

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
TÍTULOS PÚBLICOS	88.147.284,59	0,00	897.357,00	91.358.145,96	4.108.218,37	4,66%	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	59.711.532,88	930.000,00	0,00	61.636.292,69	994.759,81	1,64%	1,66%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	67.034.032,44	0,00	0,00	67.593.581,54	559.549,10	0,83%	0,83%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	54.665.413,69	11.215.000,00	8.960.000,00	57.124.913,83	204.500,14	0,31%	0,36%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	46.885.448,48	0,00	0,00	46.977.278,77	91.830,29	0,20%	0,20%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	46.934.985,47	0,00	0,00	46.983.920,46	48.934,99	0,10%	0,10%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 2	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	0,00%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 4	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	0,00%
TREND BANK FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 3	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	0,00%
BRA1 FI RENDA FIXA	683.967,80	0,00	45.878,81	632.982,05	-5.106,94	-0,75%	-7,45%
LME REC IMA-B FI RENDA FIXA	3.711.417,57	0,00	0,00	3.697.377,98	-14.039,59	-0,38%	-0,38%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	50.213.543,45	0,00	0,00	50.168.076,61	-45.466,84	-0,09%	-0,09%
MONTE CARLO INSTITUCIONAL IMA-B 5 FI RENDA FIXA	1.292.633,08	0,00	65.589,63	1.177.741,56	-49.301,89	-3,81%	-8,89%
PREMIUM FIDC SÊNIOR	1.831.845,17	0,00	0,00	1.779.007,93	-52.837,24	-2,88%	-2,88%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1.869.729,73	0,00	0,00	1.816.232,48	-53.497,25	-2,86%	-2,86%
CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	60.936.139,52	0,00	10.200.000,00	50.644.942,81	-91.196,71	-0,15%	-0,30%
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>5.696.346,24</b>	<b>1,15%</b>	

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
AZ QUEST SMALL MID CAPS FIC AÇÕES	19.262.739,56	0,00	0,00	20.003.070,67	740.331,11	3,84%	3,84%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	23.117.430,35	0,00	0,00	23.580.217,07	462.786,72	2,00%	2,00%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	3.020.612,91	0,00	43.788,87	3.080.470,34	103.646,30	3,43%	1,73%
BRASIL ÓLEO & GÁS MULTISTRATÉGIA FIP	474,95	0,00	3.200,02	383,61	3.108,68	654,53%	-19,23%
BTG PACTUAL CORPORATE OFFICE FUND FII - BRRCR11	299.962,86	0,00	4.395,80	295.386,00	-181,06	-0,06%	-1,53%
LEME FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	235.943,79	0,00	0,00	233.042,14	-2.901,65	-1,23%	-1,23%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	228.474,50	0,00	0,00	225.380,55	-3.093,95	-1,35%	-
ÁTICO FLORESTAL BRASIL FICFIP	1.546.862,11	0,00	0,00	1.538.230,46	-8.631,65	-0,56%	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	2.025.932,44	0,00	0,00	2.016.189,25	-9.743,19	-0,48%	-20,00%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	17.991.622,25	4.200.000,00	0,00	21.906.353,97	-285.268,28	-1,29%	0,10%
RIO BRAVO RENDA VAREJO FII - RBVA11	2.980.000,00	0,00	51.000,00	2.398.000,00	-531.000,00	-17,82%	-19,53%
BNP PARIBAS ACTION FIC AÇÕES	14.915.827,57	6.000.000,00	0,00	20.368.580,21	-547.247,36	-2,62%	-0,64%
<b>Total Renda Variável</b>					<b>-78.194,33</b>	<b>-0,08%</b>	