

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

Relatório Analítico dos Investimentos

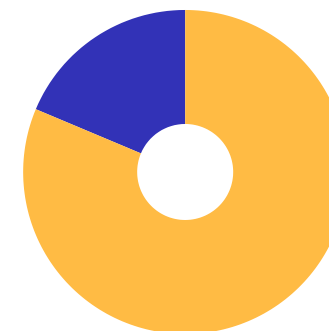
em setembro e 3º trimestre de 2020

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			5.659.404,84	12,55%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	8.084.446,47	17,93%	868	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	2.279.740,81	5,06%	982	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	3.466.107,15	7,69%	597	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.315.265,83	2,92%	1.361	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	6.229.391,85	13,82%	953	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3 du	Não há	2.880.472,64	6,39%	387	0,14%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	3.234.399,08	7,18%	121	0,17%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA...	D+3	Não há	3.514.148,20	7,80%	600	0,99%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	D+15	Não há	3.073.616,04	6,82%	61	1,25%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	412.132,28	0,91%	205	0,06%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
CAIXA PETROBRAS FI AÇÕES	D+4	Não há	686.731,51	1,52%	27.228	0,13%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	4.241.616,78	9,41%	197	0,93%	Artigo 8º, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			45.077.473,48				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENTA 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%	5.659.404,84	12,55%	0,00%	15,00%	17,00%	2.003.765,65
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	21.374.952,11	47,42%	15,00%	35,00%	100,00%	23.702.521,37
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	27.046.484,09
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	40,00%	9.629.019,92	21,36%	10,00%	20,00%	40,00%	8.401.969,47
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea 'a'	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	6.761.621,02
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.253.873,67
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.253.873,67
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.253.873,67
Total Renda Fixa	100,00%	36.663.376,87	81,33%	25,00%	70,00%	247,00%	

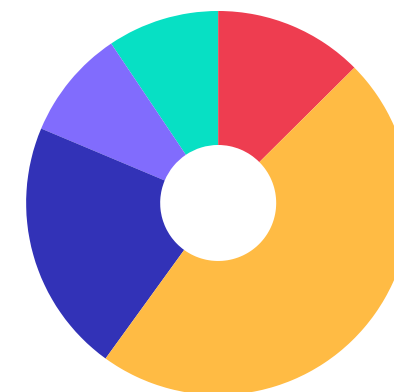


RENTA FIXA 36.663.376,87
RENTA VARIÁVEL 8.414.096,61

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 II, Alínea 'a'	20,00%	4.172.479,83	9,26%	0,00%	12,50%	20,00%	4.843.014,87
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	4.241.616,78	9,41%	0,00%	10,00%	10,00%	266.130,57
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	2.253.873,67
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	2.253.873,67
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.253.873,67
Total Renda Variável	30,00%	8.414.096,61	18,67%	0,00%	27,50%	45,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2020			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	4.507.747,35
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	10,00%	4.507.747,35
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	20,00%	



7º I a 7º I b 7º IV a 8º II a
8º III

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

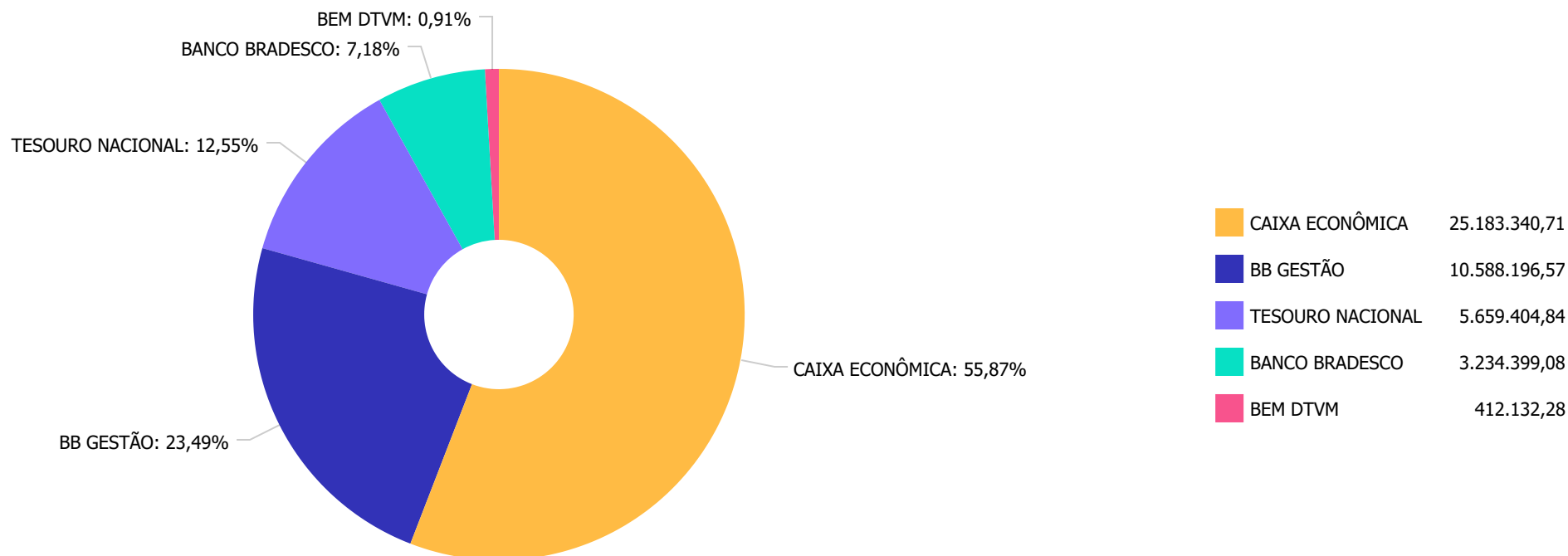
Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	25.183.340,71	55,87	0,00
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	10.588.196,57	23,49	0,00
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	5.659.404,84	12,55	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	3.646.531,36	8,09	0,00

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)

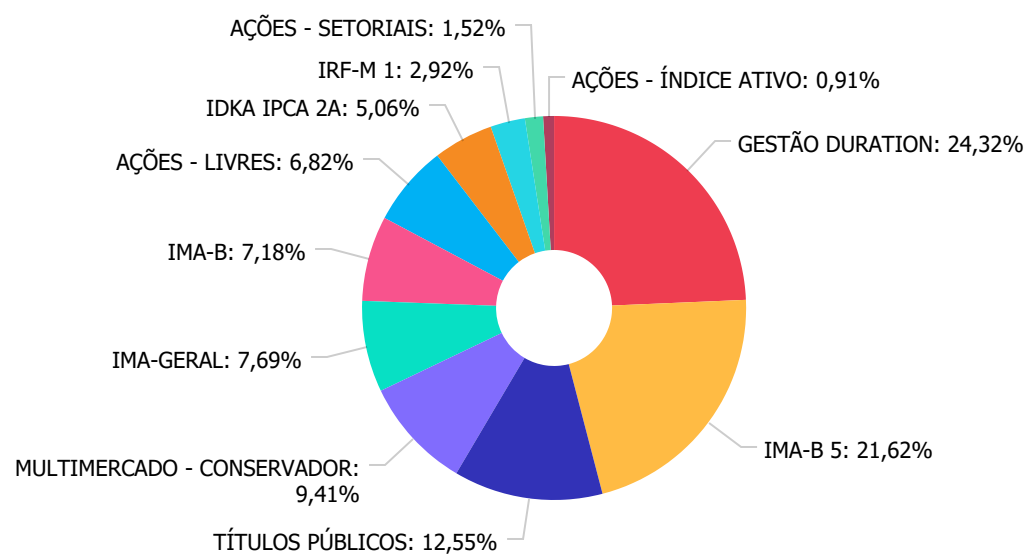
Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2020		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	5.659.404,84	12,55	0,00	17,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	21.374.952,11	47,42	15,00	100,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	9.629.019,92	21,36	10,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	4.172.479,83	9,26	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	4.241.616,78	9,41	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º - A, Inciso III	0,00	0,00	0,00	10,00

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



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



GESTÃO DURATION	10.964.919,11
IMA-B 5	9.743.540,05
TÍTULOS PÚBLICOS	5.659.404,84
MULTIMERCADO - CONSERVADOR	4.241.616,78
IMA-GERAL	3.466.107,15
IMA-B	3.234.399,08
AÇÕES - LIVRES	3.073.616,04
IDKA IPCA 2A	2.279.740,81
IRF-M 1	1.315.265,83
AÇÕES - SETORIAIS	686.731,51
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	412.132,28

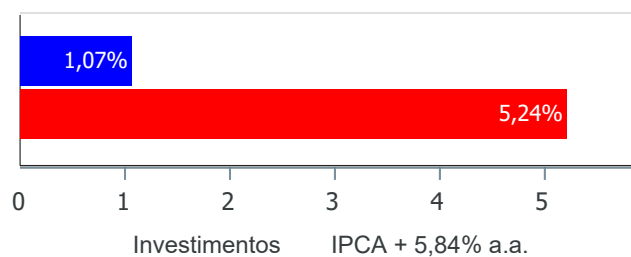
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Setembro / 2020)

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	11/08/2004	500	1.487,344824	3.863,612977	743.672,41	1.931.806,49	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	02/12/2004	270	1.494,58526	3.863,612977	403.538,02	1.043.175,50	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	02/03/2009	630	1.104,73659	4.260,988647	695.984,05	2.684.422,85	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	46.257.303,55	4.687.607,61	1.129.800,83	49.977.467,59	162.357,26	162.357,26	0,33%	0,33%	0,71%	0,71%	46,05%	1,32%
Fevereiro	49.977.467,59	2.555.988,54	3.177.692,23	49.342.435,95	-13.327,95	149.029,31	-0,03%	0,30%	0,66%	1,37%	21,84%	1,94%
Março	49.342.435,95	5.970.786,83	6.522.296,25	46.431.459,58	-2.359.466,95	-2.210.437,64	-4,78%	-4,50%	0,57%	1,94%	-231,26%	11,00%
Abril	46.431.459,58	3.552.730,24	4.009.642,48	46.719.539,52	744.992,18	-1.465.445,46	1,60%	-2,96%	0,14%	2,09%	-142,03%	5,77%
Mai	46.719.539,52	2.395.269,49	3.549.879,90	46.579.598,83	1.014.669,72	-450.775,74	2,17%	-0,86%	0,07%	2,16%	-39,71%	3,19%
Junho	46.579.598,83	6.460.489,43	7.752.019,78	46.077.093,07	789.024,59	338.248,85	1,69%	0,82%	0,74%	2,91%	28,26%	2,47%
Julho	46.077.093,07	1.192.889,42	1.485.000,00	46.780.780,85	995.798,36	1.334.047,21	2,16%	3,00%	0,88%	3,82%	78,63%	1,94%
Agosto	46.780.780,85	1.235.584,42	1.770.350,59	45.840.472,58	-405.542,10	928.505,11	-0,87%	2,11%	0,72%	4,56%	46,24%	1,93%
Setembro	45.840.472,58	1.312.358,38	1.610.000,00	45.077.473,48	-465.357,48	463.147,63	-1,02%	1,07%	0,65%	5,24%	20,44%	2,93%

Investimentos x Meta Atuarial



Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

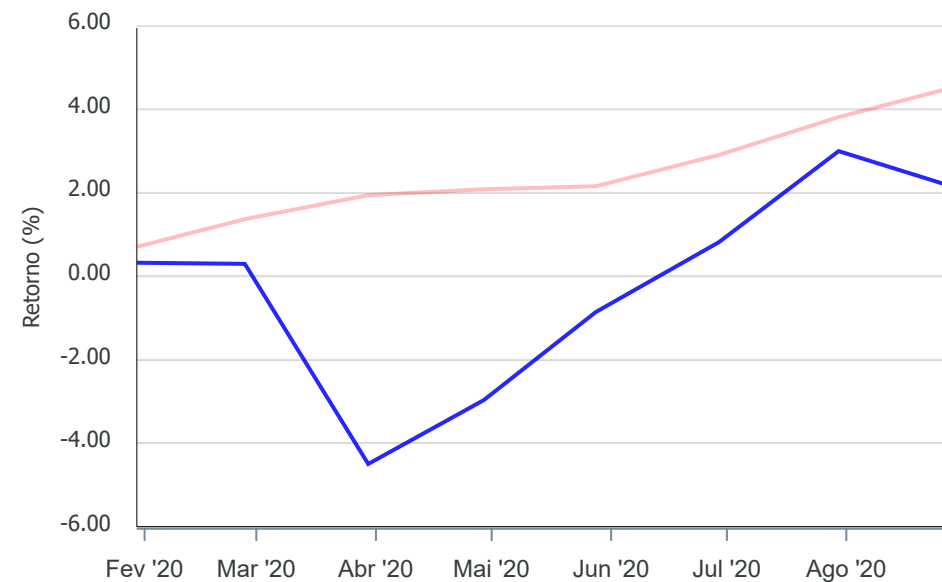
Evolução do Patrimônio



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
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	2.688.543,82	0,00	410.000,00	2.279.740,81	1.196,99	0,04%	0,04%	1,38%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.225.889,55	1.288.436,84	1.200.000,00	1.315.265,83	939,44	0,04%	0,13%	0,12%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	6.239.330,50	0,00	0,00	6.229.391,85	-9.938,65	-0,16%	-0,16%	1,65%
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA L...	3.520.248,61	0,00	0,00	3.514.148,20	-6.100,41	-0,17%	-0,17%	1,63%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	8.101.438,60	23.921,54	0,00	8.084.446,47	-40.913,67	-0,50%	-0,50%	1,68%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.492.389,11	0,00	0,00	3.466.107,15	-26.281,96	-0,75%	-0,75%	2,02%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	2.905.996,07	0,00	0,00	2.880.472,64	-25.523,43	-0,88%	-0,88%	2,33%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	3.287.057,13	0,00	0,00	3.234.399,08	-52.658,05	-1,60%	-1,60%	4,24%
TÍTULOS PÚBLICOS	5.754.954,59	0,00	0,00	5.659.404,84	-95.549,75	-1,66%	-	-
Total Renda Fixa	37.215.847,98	1.312.358,38	1.610.000,00	36.663.376,87	-254.829,49	-0,66%		1,95%

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
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	4.274.511,17	0,00	0,00	4.241.616,78	-32.894,39	-0,77%	-0,77%	0,96%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	3.151.502,47	0,00	0,00	3.073.616,04	-77.886,43	-2,47%	-2,47%	11,70%
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	423.730,12	0,00	0,00	412.132,28	-11.597,84	-2,74%	-2,74%	10,29%
CAIXA PETROBRAS FI AÇÕES	774.880,84	0,00	0,00	686.731,51	-88.149,33	-11,38%	-11,38%	15,68%
Total Renda Variável	8.624.624,60	0,00	0,00	8.414.096,61	-210.527,99	-2,44%		6,54%

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
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	6.155.055,16	0,00	0,00	6.229.391,85	74.336,69	1,21%	1,21%
TÍTULOS PÚBLICOS	5.684.330,57	0,00	75.350,59	5.659.404,84	50.424,86	0,89%	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	2.838.811,73	0,00	605.000,00	2.279.740,81	45.929,08	1,62%	1,66%
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA L...	3.472.263,90	0,00	0,00	3.514.148,20	41.884,30	1,21%	1,21%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	3.205.042,64	0,00	0,00	3.234.399,08	29.356,44	0,92%	0,92%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.826.747,07	3.669.067,60	4.185.000,00	1.315.265,83	4.451,16	0,08%	0,47%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.462.497,11	0,00	0,00	3.466.107,15	3.610,04	0,10%	0,10%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	2.881.388,08	0,00	0,00	2.880.472,64	-915,44	-0,03%	-0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	8.020.342,45	71.764,62	0,00	8.084.446,47	-7.660,60	-0,09%	-0,09%
			Total Renda Fixa		241.416,53	0,58%	

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
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	389.510,92	0,00	0,00	412.132,28	22.621,36	5,81%	5,81%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	3.094.685,98	0,00	0,00	3.073.616,04	-21.069,94	-0,68%	-0,68%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	4.276.859,63	0,00	0,00	4.241.616,78	-35.242,85	-0,82%	-0,82%
CAIXA PETROBRAS FI AÇÕES	769.557,83	0,00	0,00	686.731,51	-82.826,32	-10,76%	-10,76%
				Total Renda Variável	-116.517,75	-1,37%	

