

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

Relatório Analítico dos Investimentos

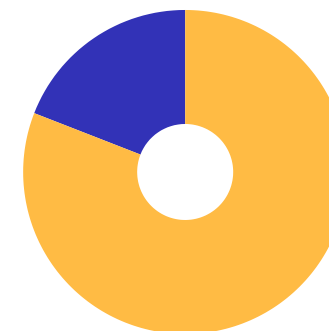
em outubro de 2020

Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
TÍTULOS PÚBLICOS			5.662.769,00	12,45%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	8.099.575,89	17,81%	874	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	3.463.672,65	7,61%	590	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.304.329,11	2,87%	1.366	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	6.113.478,26	13,44%	954	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	2.283.223,73	5,02%	988	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3 du	Não há	5.902.831,54	12,98%	397	0,30%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.746.141,69	3,84%	271	0,13%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	2.229.316,28	4,90%	121	0,11%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	D+15	Não há	3.095.563,25	6,81%	63	1,19%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	1.442.879,47	3,17%	205	0,20%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
CAIXA PETROBRAS FI AÇÕES	D+4	Não há	659.573,85	1,45%	27.047	0,13%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	2.983.994,49	6,56%	95	0,36%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	498.808,06	1,10%	19.825	0,01%	Artigo 8º, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			45.486.157,27				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	5.662.769,00	12,45%	0,00%	15,00%	17,00%	2.069.877,74
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	21.264.279,64	46,75%	15,00%	35,00%	100,00%	24.221.877,63
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	27.291.694,36
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	40,00%	9.878.289,51	21,72%	10,00%	20,00%	40,00%	8.316.173,40
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea 'a'	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	6.822.923,59
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.274.307,86
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.274.307,86
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.274.307,86
Total Renda Fixa	100,00%	36.805.338,15	80,92%	25,00%	70,00%	247,00%	



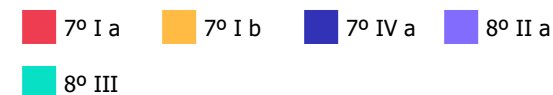
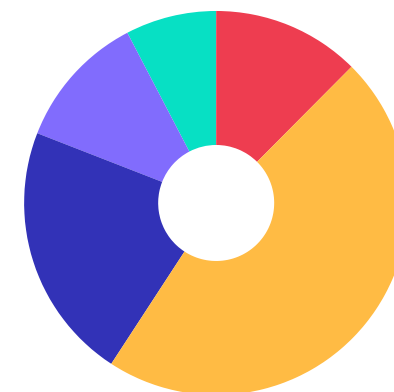
RENTA FIXA 36.805.338,15

RENTA VARIÁVEL 8.680.819,12

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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	5.198.016,57	11,43%	0,00%	12,50%	20,00%	3.899.214,88
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	3.482.802,55	7,66%	0,00%	10,00%	10,00%	1.065.813,18
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	2.274.307,86
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	2.274.307,86
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.274.307,86
Total Renda Variável	30,00%	8.680.819,12	19,08%	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%	4.548.615,73
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	10,00%	4.548.615,73
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	20,00%	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	25.038.546,64	55,05	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	11.112.645,88	24,43	-
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	5.662.769,00	12,45	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	3.672.195,75	8,07	-

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 '	5.662.769,00	12,45	0,00	17,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	21.264.279,64	46,75	15,00	100,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	9.878.289,51	21,72	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 '	5.198.016,57	11,43	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	3.482.802,55	7,66	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

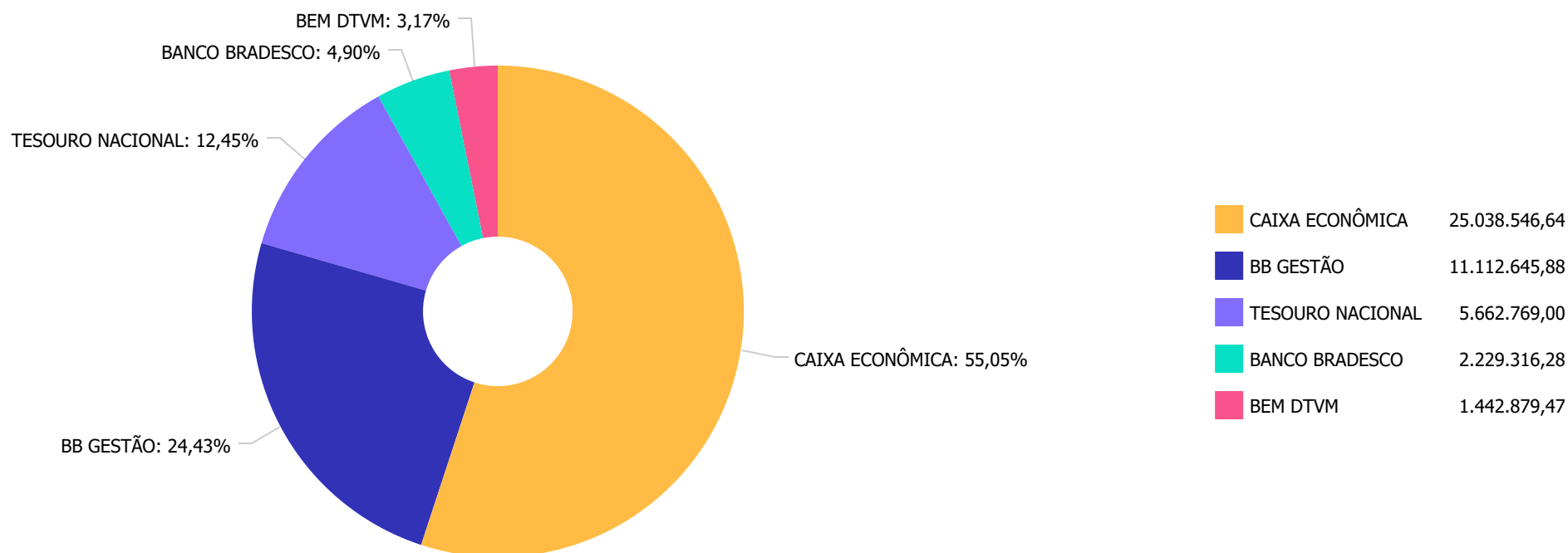
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Outubro/2020 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA Geral ex-C (Benchmark)	0,00%	1,96%	-1,39%	2,13%	2,16%	17,10%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,07%	1,79%	-1,70%	2,07%	1,80%	17,32%	0,01%	0,04%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,04%	5,45%	1,09%	4,85%	6,73%	19,60%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,15%	5,00%	0,98%	4,98%	6,16%	18,25%	0,01%	0,03%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,16%	3,29%	0,43%	1,38%	4,06%	11,49%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,14%	3,12%	0,37%	1,27%	3,86%	11,05%	0,00%	0,01%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,20%	4,72%	0,50%	4,81%	5,71%	20,28%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,18%	4,48%	0,41%	4,66%	5,38%	19,69%	0,01%	0,03%
IMA-B (Benchmark)	0,21%	-0,51%	-3,08%	4,81%	-1,00%	25,47%	-	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,18%	-0,88%	-3,16%	4,73%	-1,40%	24,57%	0,02%	0,10%
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	0,10%	-0,70%	-3,31%	4,80%	-1,30%	25,25%	0,02%	0,10%
IPCA (Benchmark)	0,86%	2,22%	1,75%	1,99%	3,92%	6,55%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	-0,11%	4,42%	-1,16%	1,94%	4,51%	23,65%	0,01%	0,02%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,07%	-	-1,99%	2,03%	-	-	0,01%	-

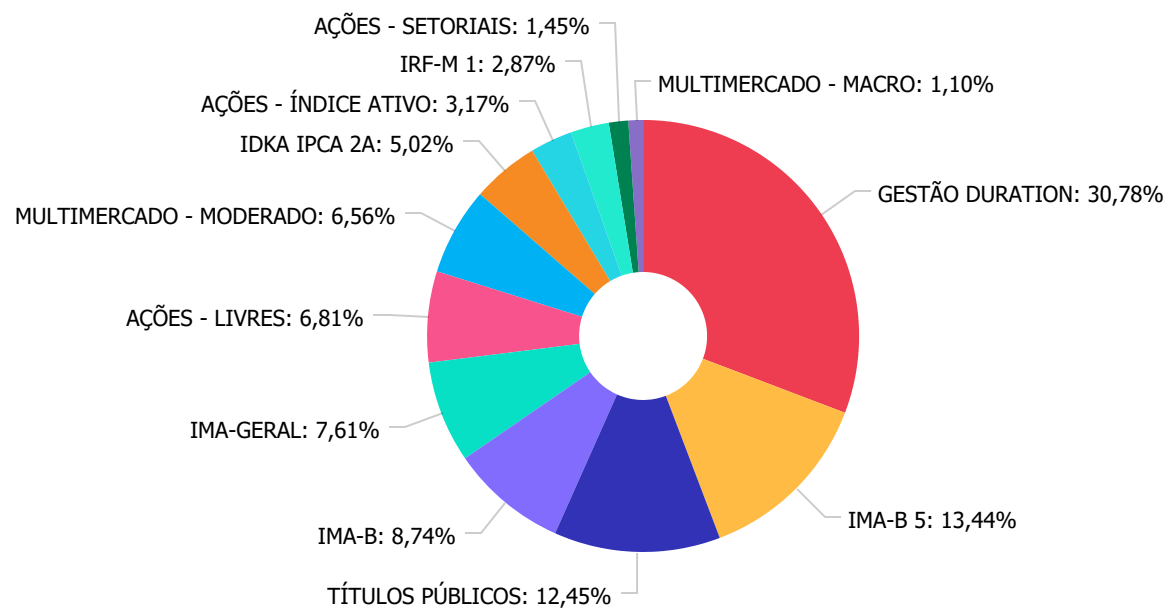
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Outubro/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
PETROBRAS ON - PETR3 (Benchmark)	-3,89%	-40,02%	-16,30%	2,91%	-40,95%	-35,26%	-	-
CAIXA PETROBRAS FI AÇÕES	-3,96%	-40,49%	-16,41%	2,31%	-41,56%	-36,93%	0,21%	0,64%
Ibovespa (Benchmark)	-0,69%	-18,76%	-8,71%	16,70%	-12,37%	7,47%	-	-
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	3,33%	-17,49%	-0,65%	28,48%	-12,83%	6,67%	0,12%	0,40%
CDI (Benchmark)	0,16%	2,44%	0,47%	1,12%	3,21%	9,62%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	-0,34%	-1,03%	-1,38%	2,71%	1,82%	18,95%	0,02%	0,07%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	0,71%	-13,76%	-5,80%	19,14%	-0,84%	-	0,11%	0,39%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	-0,54%	-1,53%	-2,37%	4,77%	1,08%	-	0,03%	0,11%

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



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



GESTÃO DURATION	14.002.407,43
IMA-B 5	6.113.478,26
TÍTULOS PÚBLICOS	5.662.769,00
IMA-B	3.975.457,97
IMA-GERAL	3.463.672,65
AÇÕES - LIVRES	3.095.563,25
MULTIMERCADO - MODERADO	2.983.994,49
IDKA IPCA 2A	2.283.223,73
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	1.442.879,47
IRF-M 1	1.304.329,11
AÇÕES - SETORIAIS	659.573,85
MULTIMERCADO - MACRO	498.808,06

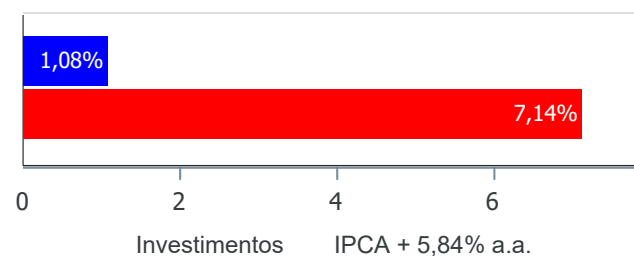
Carteira de Títulos Públicos no mês de (Outubro / 2020)

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	3.857,226867	743.672,41	1.928.613,43	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	02/12/2004	270	1.494,58526	3.857,226867	403.538,02	1.041.451,25	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	02/03/2009	630	1.104,73659	4.274,133823	695.984,05	2.692.704,31	Mercado

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

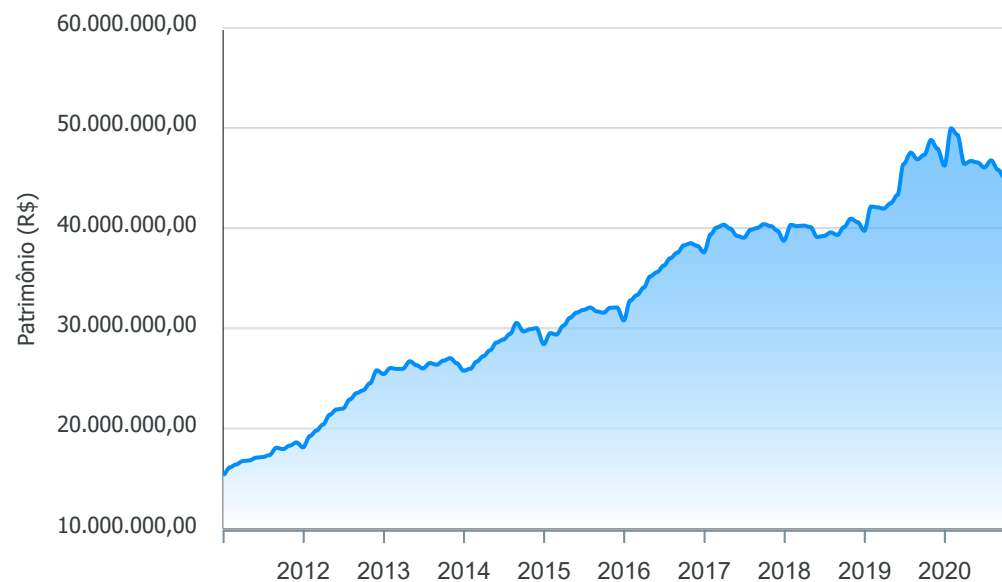
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	46.257.303,55	4.687.607,61	1.129.800,83	49.977.467,59	162.357,26	162.357,26	0,33%	0,33%	0,71%	0,71%	46,05%	1,32%
Fevereiro	49.977.467,59	2.555.988,54	3.177.692,23	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%
Maio	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%	1,12%	5,73%	18,71%	2,93%
Outubro	45.077.473,48	10.577.868,52	10.172.873,18	45.486.157,27	3.688,45	466.836,08	0,01%	1,08%	1,34%	7,14%	15,12%	2,93%

Investimentos x Meta Atuarial



Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

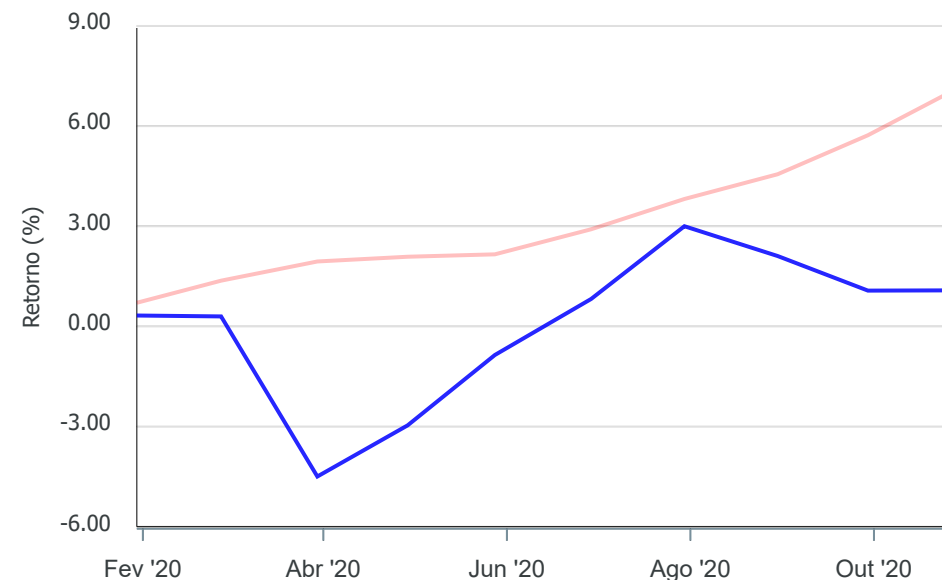
Evolução do Patrimônio



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 Outubro/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	1.737.598,62	0,00	1.746.141,69	8.543,07	0,49%	0,18%	2,23%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	6.229.391,85	0,00	127.000,00	6.113.478,26	11.086,41	0,18%	0,18%	1,10%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	2.279.740,81	0,00	0,00	2.283.223,73	3.482,92	0,15%	0,15%	1,15%
TÍTULOS PÚBLICOS	5.659.404,84	0,00	0,00	5.662.769,00	3.364,16	0,06%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	2.880.472,64	3.019.968,57	0,00	5.902.831,54	2.390,33	0,04%	-0,07%	1,48%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.315.265,83	1.288.105,23	1.300.000,00	1.304.329,11	958,05	0,04%	0,14%	0,24%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.466.107,15	0,00	0,00	3.463.672,65	-2.434,50	-0,07%	-0,07%	1,35%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	8.084.446,47	23.921,54	0,00	8.099.575,89	-8.792,12	-0,11%	-0,11%	1,18%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	3.234.399,08	0,00	1.000.000,00	2.229.316,28	-5.082,80	-0,16%	0,10%	2,31%
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA L...	3.514.148,20	0,00	3.508.274,56	0,00	-5.873,64	-0,17%	0,16%	1,08%
Total Renda Fixa	36.663.376,87	6.069.593,96	5.935.274,56	36.805.338,15	7.641,88	0,02%		1,34%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	412.132,28	1.000.000,00	0,00	1.442.879,47	30.747,19	2,18%	3,33%	11,66%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	3.073.616,04	0,00	0,00	3.095.563,25	21.947,21	0,71%	0,71%	11,03%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	4.241.616,78	0,00	4.237.598,62	0,00	-4.018,16	-0,09%	-0,21%	1,31%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,00	500.000,00	0,00	498.808,06	-1.191,94	-0,24%	-0,34%	2,29%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	0,00	3.008.274,56	0,00	2.983.994,49	-24.280,07	-0,81%	-0,54%	3,06%
CAIXA PETROBRAS FI AÇÕES	686.731,51	0,00	0,00	659.573,85	-27.157,66	-3,95%	-3,95%	20,72%
Total Renda Variável	8.414.096,61	4.508.274,56	4.237.598,62	8.680.819,12	-3.953,43	-0,05%		8,63%

