

# Relatório Analítico dos Investimentos

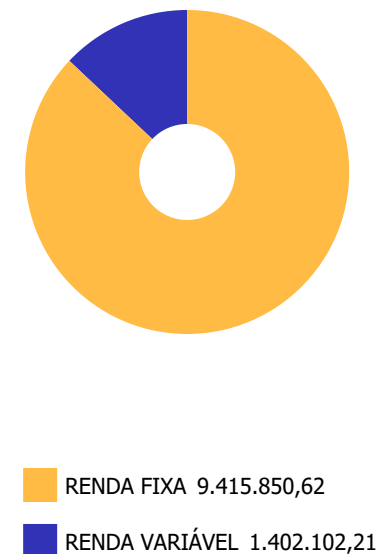
em agosto de 2020

**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 GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA       | D+0     | Não possui | 3.268.457,33         | 30,21%             | 852      | 0,02%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '  |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE... | D+0     | Não há     | 1.105.129,52         | 10,22%             | 970      | 0,01%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '  |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO     | D+3     | Não há     | 3.296.029,37         | 30,47%             | 600      | 0,03%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '  |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI... | D+0     | Não há     | 1.746.234,40         | 16,14%             | 1.244    | 0,02%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '  |
| BB GOVERNANÇA FI AÇÕES                              | D+4     | Não há     | 670.723,33           | 6,20%              | 1.633    | 0,07%            | Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '  |
| CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES                           | D+4     | Não há     | 731.378,88           | 6,76%              | 5.989    | 0,27%            | Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' |
| <b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>  |         |            | <b>10.817.952,83</b> |                    |          |                  |                                    |
| DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS                        |         |            | <b>5.261,21</b>      | Artigo 6º          |          |                  |                                    |
| <b>PL Total</b>                                     |         |            | <b>10.823.214,04</b> |                    |          |                  |                                    |

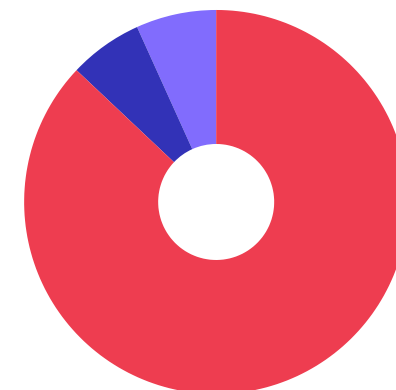
**Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENTA FIXA) - base (Agosto / 2020)**

| 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%         | 100,00%        | 10.817.952,83 |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'   | 100,00%        | 9.415.850,62        | 87,04%        | 40,00%                        | 70,00%        | 100,00%        | 1.402.102,21  |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'   | 100,00%        | 0,00                | 0,00%         | 0,00%                         | 0,00%         | 100,00%        | 10.817.952,83 |
| Artigo 7º, Inciso II              | 5,00%          | 0,00                | 0,00%         | 0,00%                         | 0,00%         | 5,00%          | 540.897,64    |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a' | 60,00%         | 0,00                | 0,00%         | 0,00%                         | 1,00%         | 60,00%         | 6.490.771,70  |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b' | 60,00%         | 0,00                | 0,00%         | 0,00%                         | 0,00%         | 60,00%         | 6.490.771,70  |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'  | 40,00%         | 0,00                | 0,00%         | 0,00%                         | 10,00%        | 40,00%         | 4.327.181,13  |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'b'  | 40,00%         | 0,00                | 0,00%         | 0,00%                         | 1,00%         | 40,00%         | 4.327.181,13  |
| Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'   | 20,00%         | 0,00                | 0,00%         | 0,00%                         | 0,00%         | 20,00%         | 2.163.590,57  |
| Artigo 7º, Inciso VI, Alínea 'a'  | 15,00%         | 0,00                | 0,00%         | 0,00%                         | 0,00%         | 15,00%         | 1.622.692,92  |
| Artigo 7º, Inciso VI, Alínea 'b'  | 15,00%         | 0,00                | 0,00%         | 0,00%                         | 0,00%         | 15,00%         | 1.622.692,92  |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a' | 5,00%          | 0,00                | 0,00%         | 0,00%                         | 0,00%         | 5,00%          | 540.897,64    |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b' | 5,00%          | 0,00                | 0,00%         | 0,00%                         | 2,00%         | 5,00%          | 540.897,64    |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'c' | 5,00%          | 0,00                | 0,00%         | 0,00%                         | 1,00%         | 5,00%          | 540.897,64    |
| <b>Total Renda Fixa</b>           | <b>100,00%</b> | <b>9.415.850,62</b> | <b>87,04%</b> | <b>40,00%</b>                 | <b>85,00%</b> | <b>570,00%</b> |               |



**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%        | 670.723,33          | 6,20%         | 0,00%                         | 3,00%         | 30,00%         | 2.574.662,52 |
| Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'b'  | 30,00%        | 0,00                | 0,00%         | 0,00%                         | 1,00%         | 30,00%         | 3.245.385,85 |
| Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a' | 20,00%        | 731.378,88          | 6,76%         | 0,00%                         | 3,00%         | 20,00%         | 1.432.211,69 |
| Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'b' | 20,00%        | 0,00                | 0,00%         | 0,00%                         | 1,00%         | 20,00%         | 2.163.590,57 |
| Artigo 8º, Inciso III            | 10,00%        | 0,00                | 0,00%         | 0,00%                         | 4,00%         | 10,00%         | 1.081.795,28 |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a' | 5,00%         | 0,00                | 0,00%         | 0,00%                         | 0,00%         | 5,00%          | 540.897,64   |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b' | 5,00%         | 0,00                | 0,00%         | 0,00%                         | 0,00%         | 5,00%          | 540.897,64   |
| <b>Total Renda Variável</b>      | <b>30,00%</b> | <b>1.402.102,21</b> | <b>12,96%</b> | <b>0,00%</b>                  | <b>12,00%</b> | <b>120,00%</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%        | 10,00%        | 1.081.795,28 |
| Artigo 9º - A, Inciso II  | 10,00%        | 0,00        | 0,00%        | 0,00%                                  | 0,00%        | 10,00%        | 1.081.795,28 |
| Artigo 9º - A, Inciso III | 10,00%        | 0,00        | 0,00%        | 0,00%                                  | 0,00%        | 10,00%        | 1.081.795,28 |
| <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>30,00%</b> |              |

7º I b 7º IV a 8º I a 8º II a

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

| Gestão                     | Valor        | % S/ Carteira | % S/ PL Gestão |
|----------------------------|--------------|---------------|----------------|
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM | 5.712.987,10 | 52,81         | 0,00           |
| CAIXA ECONÔMICA FEDERAL    | 5.104.965,73 | 47,19         | 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'   | 0,00                          | 0,00       | 0,00                | 100,00              |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'   | 9.415.850,62                  | 87,04      | 40,00               | 100,00              |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'   | 0,00                          | 0,00       | 0,00                | 100,00              |
| Artigo 7º, Inciso II              | 0,00                          | 0,00       | 0,00                | 5,00                |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a' | 0,00                          | 0,00       | 0,00                | 60,00               |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b' | 0,00                          | 0,00       | 0,00                | 60,00               |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'  | 0,00                          | 0,00       | 0,00                | 40,00               |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'b'  | 0,00                          | 0,00       | 0,00                | 40,00               |
| Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'   | 0,00                          | 0,00       | 0,00                | 20,00               |
| Artigo 7º, Inciso VI, Alínea 'a'  | 0,00                          | 0,00       | 0,00                | 15,00               |
| Artigo 7º, Inciso VI, Alínea 'b'  | 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 I, Alínea 'a'   | 670.723,33                    | 6,20       | 0,00                | 30,00               |
| Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'b'   | 0,00                          | 0,00       | 0,00                | 30,00               |
| Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'  | 731.378,88                    | 6,76       | 0,00                | 20,00               |
| Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'b'  | 0,00                          | 0,00       | 0,00                | 20,00               |
| Artigo 8º, Inciso III             | 0,00                          | 0,00       | 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 9º - A, Inciso I           | 0,00                          | 0,00       | 0,00                | 10,00               |
| 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               |

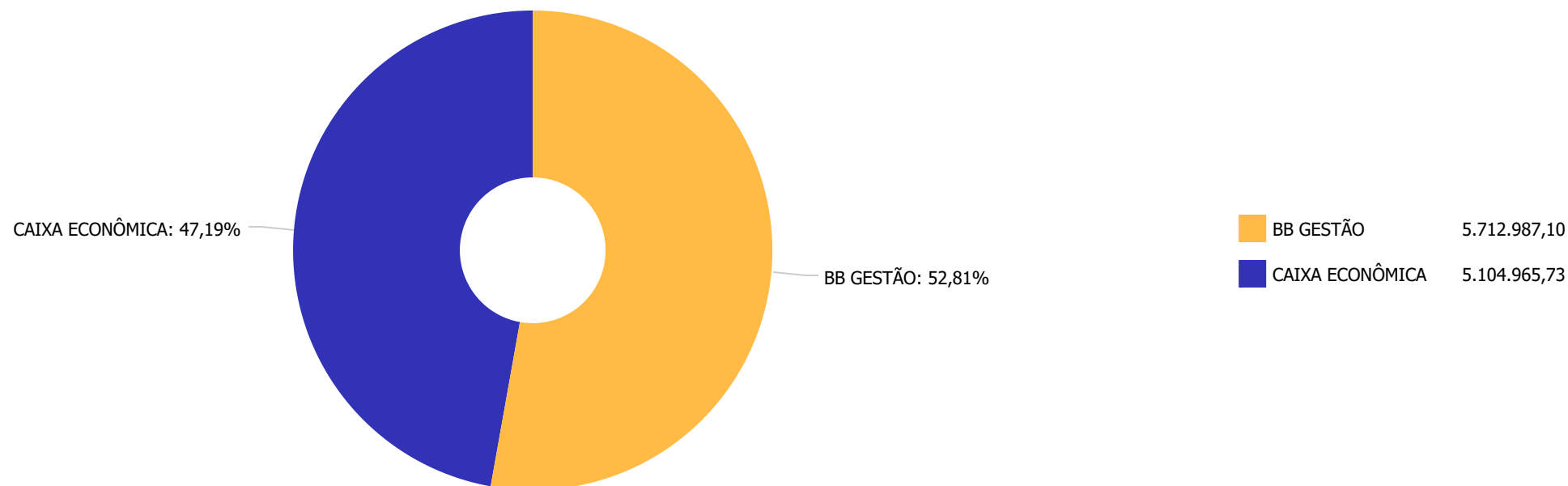
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2020 - RENDA FIXA

|                                                             | Mês    | Ano   | 3M    | 6M    | 12M   | 24M    | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|-------------------------------------------------------------|--------|-------|-------|-------|-------|--------|---------|------------------|
| <b>IMA Geral ex-C (Benchmark)</b>                           | -0,68% | 2,69% | 1,88% | 1,72% | 6,16% | 22,72% | -       | -                |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO             | -0,89% | 2,63% | 1,82% | 1,67% | 6,05% | 23,16% | 0,01%   | 0,04%            |
| <b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>                         | 1,03%  | 5,39% | 2,99% | 4,11% | 9,71% | 23,52% | -       | -                |
| 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%            |
| <b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>                                  | 0,12%  | 2,96% | 0,64% | 2,12% | 5,06% | 12,83% | -       | -                |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO   | 0,09%  | 2,78% | 0,58% | 1,99% | 4,77% | 12,31% | 0,00%   | 0,01%            |
| <b>IPCA (Benchmark)</b>                                     | 0,24%  | 0,70% | 0,86% | 0,24% | 2,44% | 5,95%  | -       | -                |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA               | -0,56% | 5,06% | 1,17% | 3,57% | 9,21% | 27,35% | 0,01%   | 0,03%            |

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

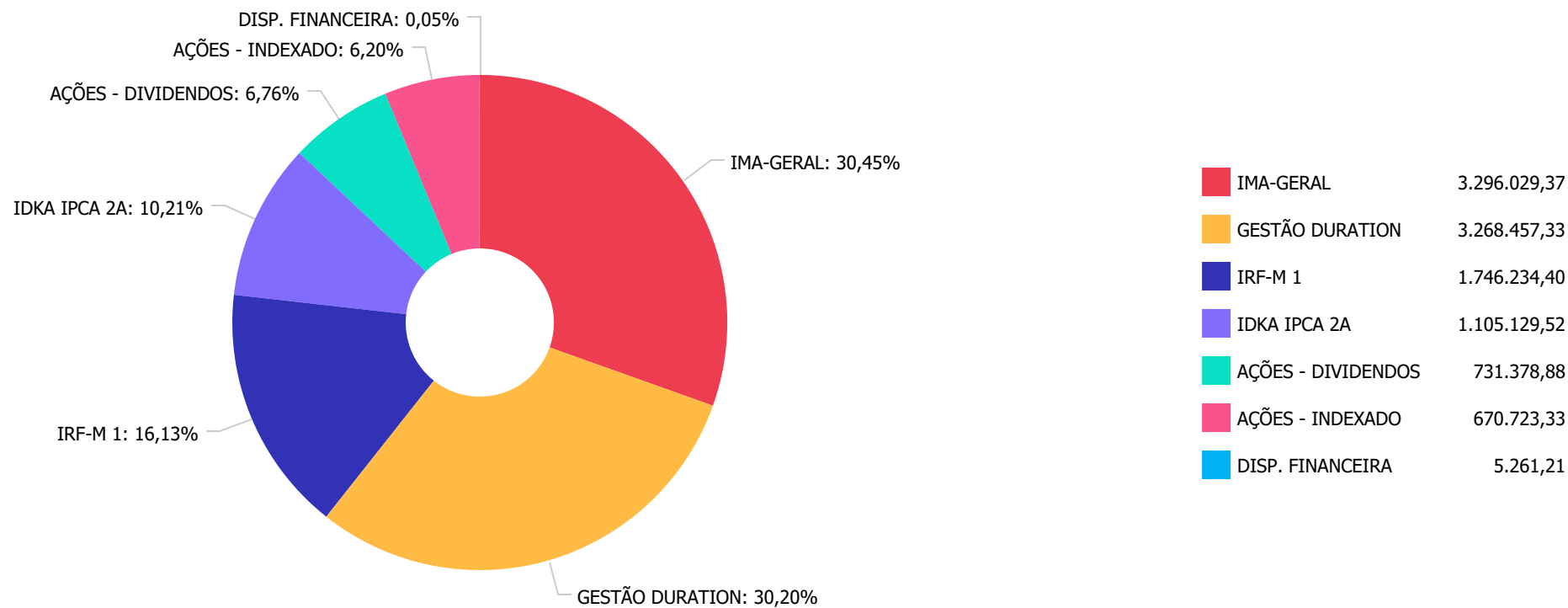
|                           | Mês    | Ano     | 3M     | 6M      | 12M    | 24M    | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|---------------------------|--------|---------|--------|---------|--------|--------|---------|------------------|
| IGC (Benchmark)           | -2,61% | -10,30% | 15,64% | -2,60%  | 4,04%  | 44,08% | -       | -                |
| BB GOVERNANÇA FI AÇÕES    | -3,27% | -13,42% | 14,23% | -5,10%  | -0,39% | 35,87% | 0,10%   | 0,40%            |
| Não Informado (Benchmark) | -      | -       | -      | -       | -      | -      | -       | -                |
| CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES | -6,01% | -22,50% | 0,60%  | -16,67% | -7,25% | 31,54% | 0,09%   | 0,36%            |

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





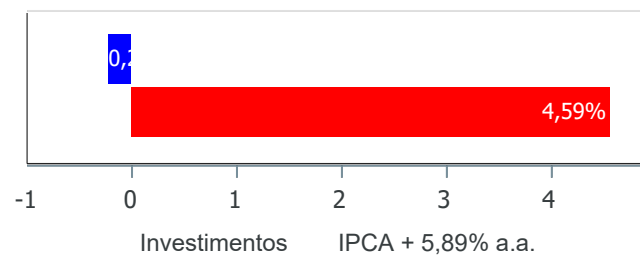
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Agosto / 2020)



**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   | 10.946.197,54  | 3.366.778,47 | 2.660.441,01 | 11.637.209,72 | -15.325,28  | -15.325,28   | -0,13%      | -0,13%       | 0,71%    | 0,71%     | -18,47%  | 1,81%  |
| Fevereiro | 11.637.209,72  | 516.812,59   | 445.320,08   | 11.617.964,83 | -90.737,40  | -106.062,68  | -0,77%      | -0,91%       | 0,66%    | 1,38%     | -65,74%  | 2,81%  |
| Março     | 11.617.964,83  | 546.364,39   | 463.210,41   | 11.167.195,87 | -533.922,94 | -639.985,62  | -4,56%      | -5,43%       | 0,57%    | 1,96%     | -277,41% | 10,34% |
| Abril     | 11.167.195,87  | 201.766,86   | 440.672,63   | 11.129.038,11 | 200.748,01  | -439.237,61  | 1,80%       | -3,73%       | 0,14%    | 2,10%     | -177,22% | 5,72%  |
| Maio      | 11.129.038,11  | 241.015,84   | 442.307,41   | 11.101.464,55 | 173.718,01  | -265.519,60  | 1,56%       | -2,22%       | 0,07%    | 2,18%     | -102,12% | 2,91%  |
| Junho     | 11.101.464,55  | 137.899,85   | 318.090,41   | 11.064.345,62 | 143.071,63  | -122.447,97  | 1,29%       | -0,96%       | 0,74%    | 2,93%     | -32,87%  | 2,39%  |
| Julho     | 11.064.345,62  | 98.466,39    | 145.099,99   | 11.208.382,69 | 190.670,67  | 68.222,70    | 1,72%       | 0,74%        | 0,89%    | 3,85%     | 19,31%   | 1,93%  |
| Agosto    | 11.208.382,69  | 61.934,38    | 345.476,40   | 10.817.952,83 | -106.887,84 | -38.665,14   | -0,95%      | -0,22%       | 0,72%    | 4,59%     | -4,75%   | 1,93%  |

**Investimentos x Meta Atuarial**



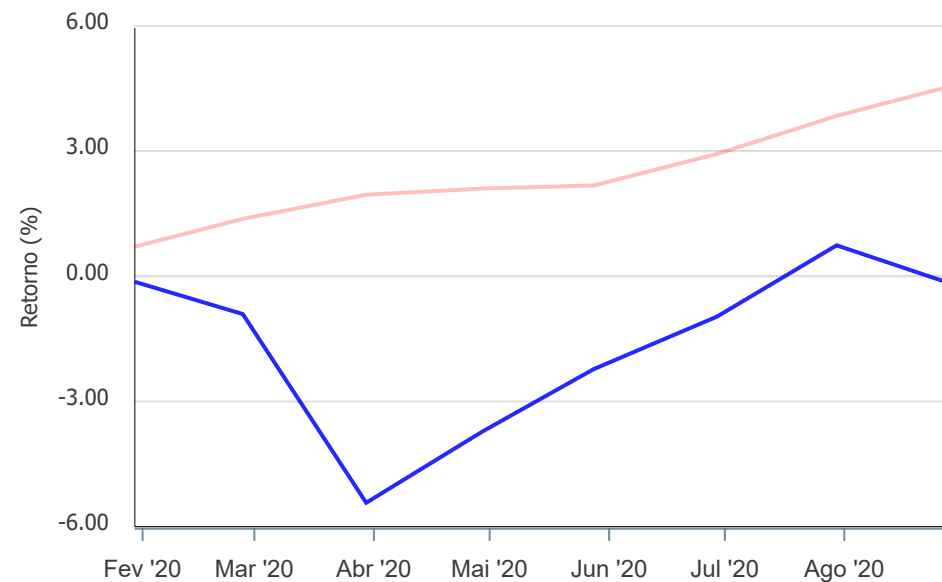
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Agosto/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... | 1.096.450,68        | 0,00             | 0,00              | 1.105.129,52        | 8.678,84          | 0,79%         | 0,79%      | 0,77%        |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE... | 1.845.602,68        | 0,00             | 101.000,00        | 1.746.234,40        | 1.631,72          | 0,09%         | 0,09%      | 0,15%        |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO                | 182.452,43          | 61.934,38        | 244.476,40        | 0,00                | 89,59             | 0,04%         | 0,08%      | 0,00%        |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA         | 3.286.769,83        | 0,00             | 0,00              | 3.268.457,33        | -18.312,50        | -0,56%        | -0,56%     | 0,92%        |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO       | 3.325.585,52        | 0,00             | 0,00              | 3.296.029,37        | -29.556,15        | -0,89%        | -0,89%     | 1,05%        |
| <b>Total Renda Fixa</b>                               | <b>9.736.861,14</b> | <b>61.934,38</b> | <b>345.476,40</b> | <b>9.415.850,62</b> | <b>-37.468,50</b> | <b>-0,38%</b> |            | <b>0,80%</b> |

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    |
|-----------------------------|---------------------|-------------|-------------|---------------------|-------------------|---------------|------------|--------------|
| BB GOVERNANÇA FI AÇÕES      | 693.362,21          | 0,00        | 0,00        | 670.723,33          | -22.638,88        | -3,27%        | -3,27%     | 9,81%        |
| CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES   | 778.159,34          | 0,00        | 0,00        | 731.378,88          | -46.780,46        | -6,01%        | -6,01%     | 9,22%        |
| <b>Total Renda Variável</b> | <b>1.471.521,55</b> | <b>0,00</b> | <b>0,00</b> | <b>1.402.102,21</b> | <b>-69.419,34</b> | <b>-4,72%</b> |            | <b>9,50%</b> |