

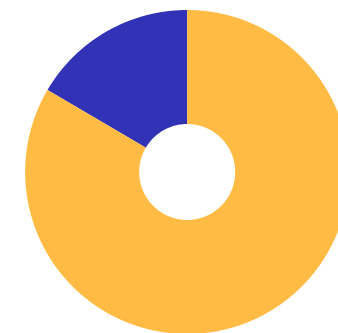
# Relatório Analítico dos Investimentos em setembro e 3º trimestre de 2020

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	798.399,95	7,62%	953	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	2.054.009,73	19,61%	868	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	1.105.535,37	10,56%	982	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	1.434.534,58	13,70%	1.239	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	3.271.225,11	31,23%	597	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	77.049,61	0,74%	755	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	D+4	Não há	636.888,73	6,08%	1.637	0,07%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	701.923,00	6,70%	5.931	0,27%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	394.443,27	3,77%	20.023	0,02%	Artigo 8º, Inciso III
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>10.474.009,35</b>				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			<b>3.687,38</b>				Artigo 6º
<b>PL Total</b>			<b>10.477.696,73</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%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	10.474.009,35
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	8.663.704,74	82,72%	40,00%	70,00%	100,00%	1.810.304,61
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	10.474.009,35
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	523.700,47
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	6.284.405,61
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	6.284.405,61
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	77.049,61	0,74%	0,00%	10,00%	40,00%	4.112.554,13
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	40,00%	4.189.603,74
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	2.094.801,87
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	1.571.101,40
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	1.571.101,40
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	523.700,47
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	523.700,47
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	523.700,47
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>8.740.754,35</b>	<b>83,45%</b>	<b>40,00%</b>	<b>85,00%</b>	<b>570,00%</b>	

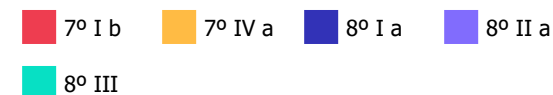
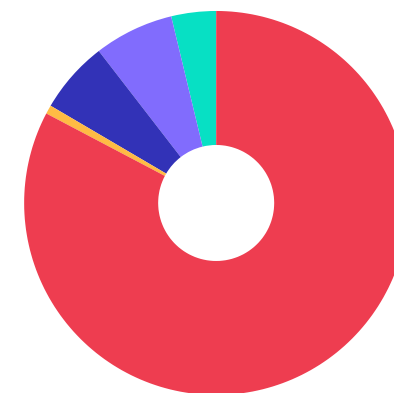


RENDA FIXA 8.740.754,35  
RENDA VARIÁVEL 1.733.255,00

**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%	636.888,73	6,08%	0,00%	3,00%	30,00%	2.505.314,08
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	3.142.202,81
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	701.923,00	6,70%	0,00%	3,00%	20,00%	1.392.878,87
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	2.094.801,87
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	394.443,27	3,77%	0,00%	4,00%	10,00%	652.957,67
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	523.700,47
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	523.700,47
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>1.733.255,00</b>	<b>16,55%</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%	1.047.400,94
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	1.047.400,94
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	1.047.400,94
<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>	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	5.419.698,03	51,74	0,00
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	5.054.311,32	48,26	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 '	8.663.704,74	82,72	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 '	77.049,61	0,74	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 '	636.888,73	6,08	0,00	30,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	701.923,00	6,70	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	394.443,27	3,77	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

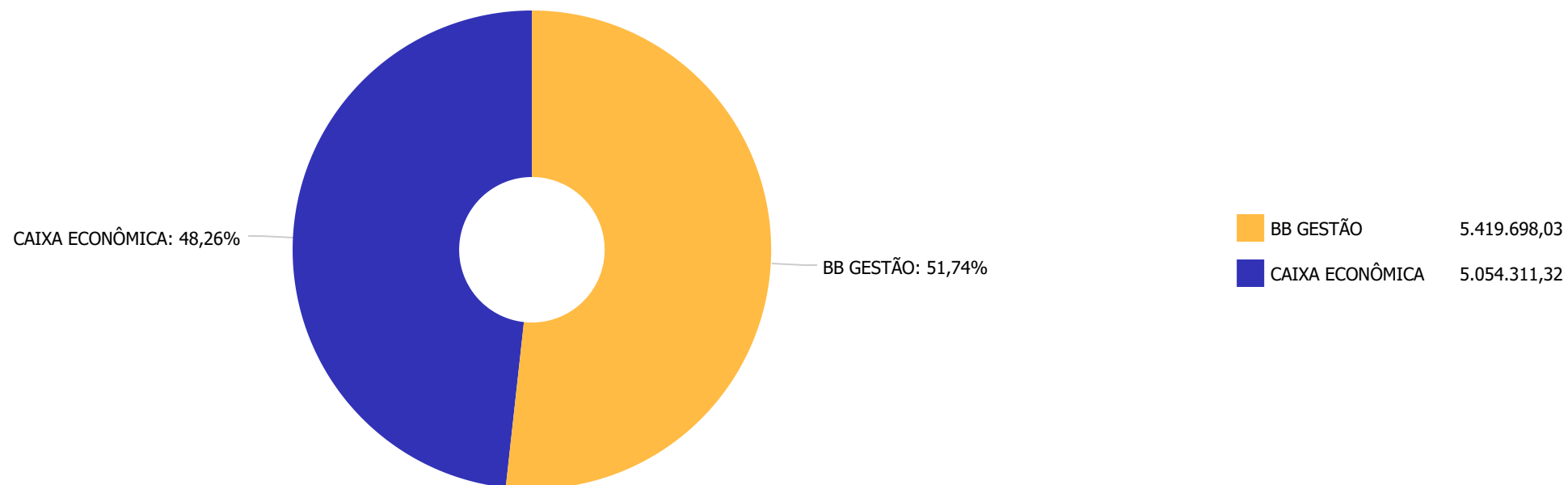
**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2020 - RENDA FIXA**

	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>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%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,16%	4,29%	1,21%	4,96%	6,91%	23,18%	0,02%	0,04%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,16%	2,28%	0,51%	1,25%	3,54%	10,04%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00%	1,42%	0,18%	0,66%	2,40%	7,66%	0,00%	0,00%
<b>IPCA (Benchmark)</b>	0,64%	1,34%	1,24%	0,81%	3,14%	6,12%	-	-
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**

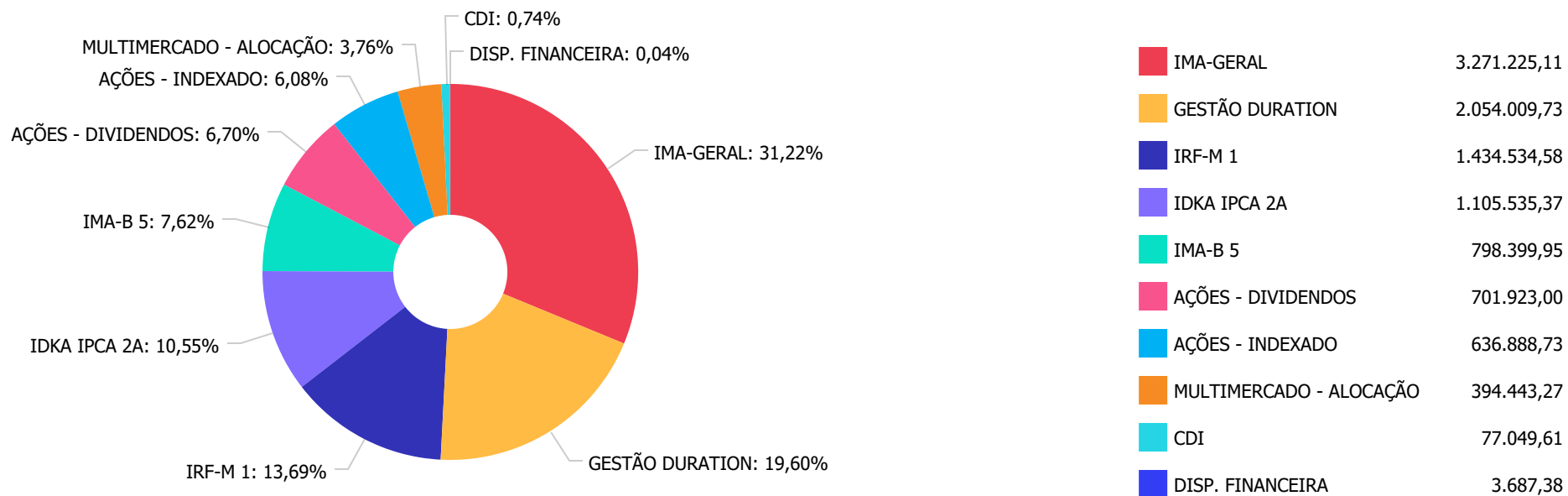
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IGC (Benchmark)</b>	-4,81%	-14,61%	0,77%	33,69%	-3,97%	32,91%	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	-5,04%	-17,78%	-0,39%	30,27%	-8,20%	24,95%	0,10%	0,40%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,16%	2,28%	0,51%	1,25%	3,54%	10,04%	-	-
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	-2,05%	-3,54%	-0,45%	8,24%	0,88%	14,18%	0,03%	0,11%
<b>Não Informado (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	-4,03%	-25,62%	-5,76%	10,43%	-12,22%	26,84%	0,10%	0,36%

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





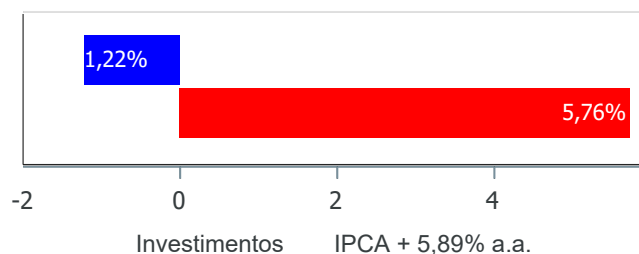
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Setembro / 2020)



**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%
Mai	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%
Setembro	10.817.952,83	1.521.941,75	1.757.362,75	10.474.009,35	-108.522,48	-147.187,62	-1,00%	-1,22%	1,12%	5,76%	-21,15%	2,67%

**Investimentos x Meta Atuarial**



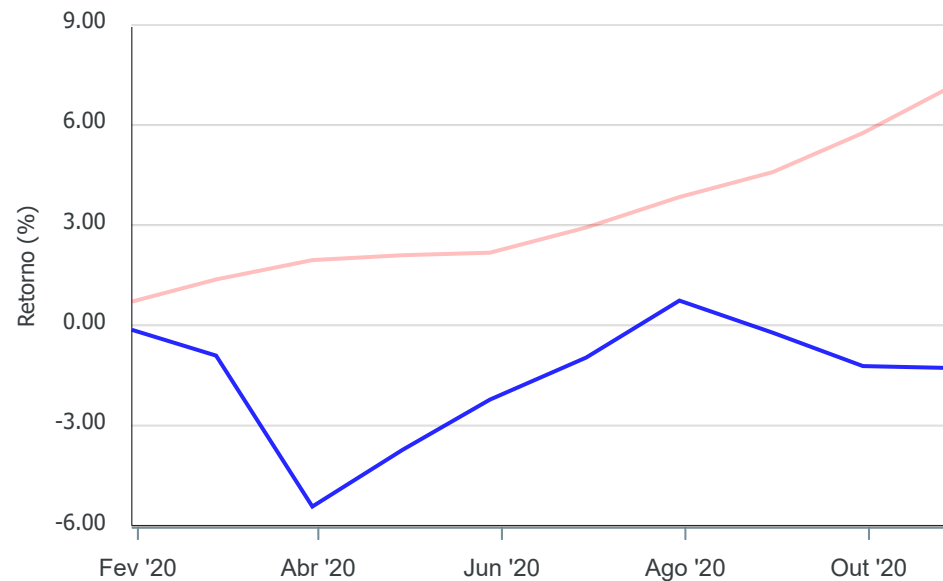
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.746.234,40	0,00	312.474,95	1.434.534,58	775,13	0,04%	0,04%	0,15%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.105.129,52	0,00	0,00	1.105.535,37	405,85	0,04%	0,04%	1,38%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	321.941,75	244.887,80	77.049,61	-4,34	0,00%	0,00%	0,03%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	0,00	800.000,00	0,00	798.399,95	-1.600,05	-0,20%	-0,16%	1,65%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	3.268.457,33	0,00	1.200.000,00	2.054.009,73	-14.447,60	-0,44%	-0,50%	1,68%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.296.029,37	0,00	0,00	3.271.225,11	-24.804,26	-0,75%	-0,75%	2,02%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>9.415.850,62</b>	<b>1.121.941,75</b>	<b>1.757.362,75</b>	<b>8.740.754,35</b>	<b>-39.675,27</b>	<b>-0,38%</b>		<b>1,50%</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
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	0,00	400.000,00	0,00	394.443,27	-5.556,73	-1,39%	-2,05%	3,06%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	731.378,88	0,00	0,00	701.923,00	-29.455,88	-4,03%	-4,03%	10,06%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	670.723,33	0,00	0,00	636.888,73	-33.834,60	-5,04%	-5,04%	10,36%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>1.402.102,21</b>	<b>400.000,00</b>	<b>0,00</b>	<b>1.733.255,00</b>	<b>-68.847,21</b>	<b>-3,82%</b>		<b>8,58%</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
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.087.433,94	0,00	0,00	1.105.535,37	18.101,43	1,66%	1,66%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.975.010,55	0,00	547.474,95	1.434.534,58	6.998,98	0,35%	0,36%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.267.818,05	0,00	0,00	3.271.225,11	3.407,06	0,10%	0,10%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	94.925,57	482.342,52	500.464,19	77.049,61	245,71	0,04%	0,18%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	3.254.959,08	0,00	1.200.000,00	2.054.009,73	-949,35	-0,03%	-0,09%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	0,00	800.000,00	0,00	798.399,95	-1.600,05	-0,20%	1,21%
				<b>Total Renda Fixa</b>	<b>26.203,78</b>	<b>0,24%</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
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	639.383,94	0,00	0,00	636.888,73	-2.495,21	-0,39%	-0,39%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	0,00	400.000,00	0,00	394.443,27	-5.556,73	-1,39%	-0,45%
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	744.814,49	0,00	0,00	701.923,00	-42.891,49	-5,76%	-5,76%
				<b>Total Renda Variável</b>	<b>-50.943,43</b>	<b>-2,86%</b>	