

Relatório Analítico dos Investimentos

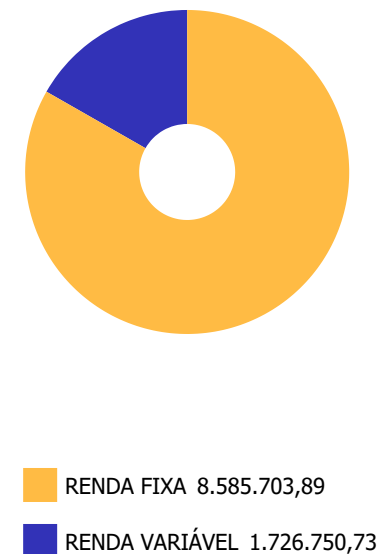
em outubro de 2020

Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	2.051.795,27	19,90%	874	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	799.846,97	7,76%	954	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	1.107.224,38	10,74%	988	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	1.201.173,54	11,65%	1.234	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	2.069.555,34	20,07%	590	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3 du	Não há	1.199.294,31	11,63%	397	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	156.814,08	1,52%	762	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	D+4	Não há	631.688,79	6,13%	1.618	0,07%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	702.101,60	6,81%	5.848	0,27%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	392.960,34	3,81%	19.351	0,02%	Artigo 8º, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			10.312.454,62				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			756,41	Artigo 6º			
PL Total			10.313.211,03				

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

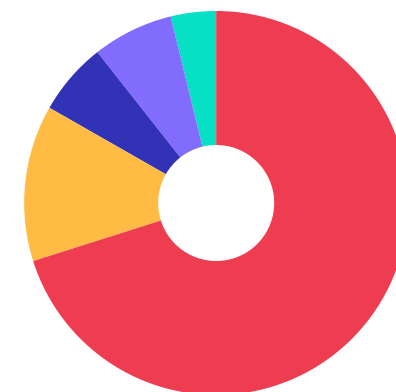
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	10.312.454,62
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	7.229.595,50	70,11%	40,00%	70,00%	100,00%	3.082.859,12
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	10.312.454,62
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	515.622,73
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	6.187.472,77
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	6.187.472,77
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	40,00%	1.356.108,39	13,15%	0,00%	10,00%	40,00%	2.768.873,46
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'b'	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	40,00%	4.124.981,85
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	2.062.490,92
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea 'a'	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	1.546.868,19
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea 'b'	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	1.546.868,19
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	515.622,73
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	515.622,73
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	515.622,73
Total Renda Fixa	100,00%	8.585.703,89	83,26%	40,00%	85,00%	570,00%	



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 I, Alínea 'a'	30,00%	631.688,79	6,13%	0,00%	3,00%	30,00%	2.462.047,60
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'b'	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	3.093.736,39
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	702.101,60	6,81%	0,00%	3,00%	20,00%	1.360.389,32
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'b'	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	2.062.490,92
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	392.960,34	3,81%	0,00%	4,00%	10,00%	638.285,12
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	515.622,73
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	515.622,73
Total Renda Variável	30,00%	1.726.750,73	16,74%	0,00%	12,00%	120,00%	

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%	1.031.245,46
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	1.031.245,46
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	1.031.245,46
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	



7º I b 7º IV a 8º I a 8º II a
8º III

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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	5.258.526,06	50,99	-
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	5.053.928,56	49,01	-

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'	7.229.595,50	70,11	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'	1.356.108,39	13,15	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'	631.688,79	6,13	0,00	30,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'b'	0,00	0,00	0,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	702.101,60	6,81	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'b'	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	392.960,34	3,81	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

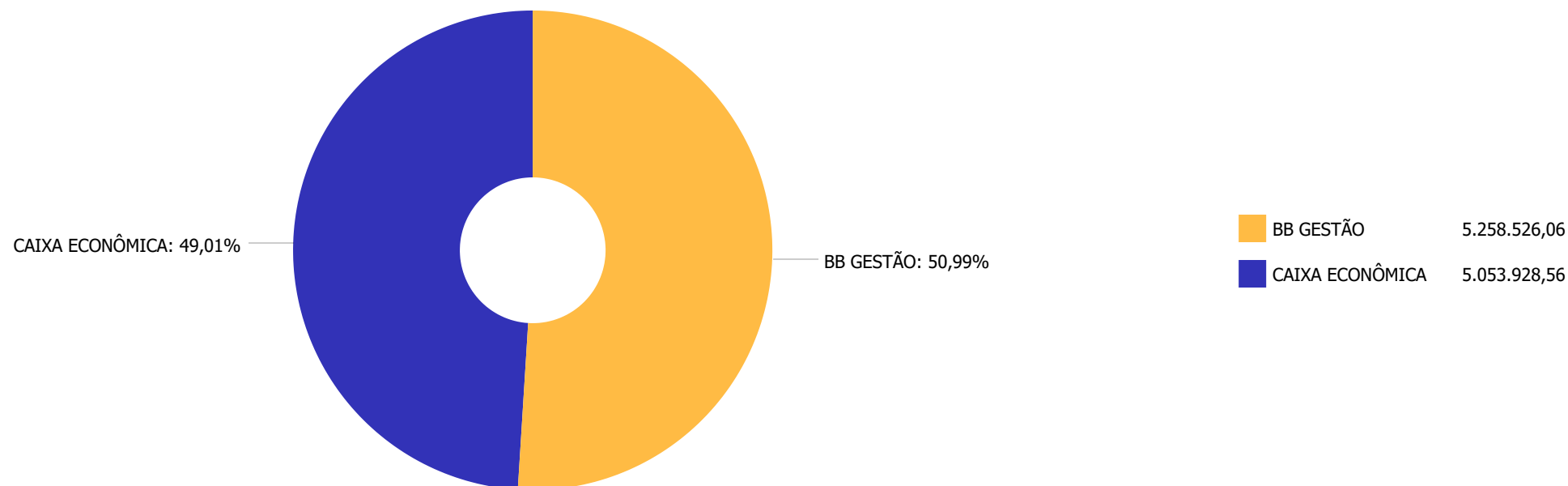
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Outubro/2020 - RENDA FIXA

	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%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,11%	2,94%	0,25%	1,13%	3,67%	10,79%	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%
CDI (Benchmark)	0,16%	2,44%	0,47%	1,12%	3,21%	9,62%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,06%	1,48%	0,13%	0,52%	2,07%	7,24%	0,00%	0,00%
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%	-

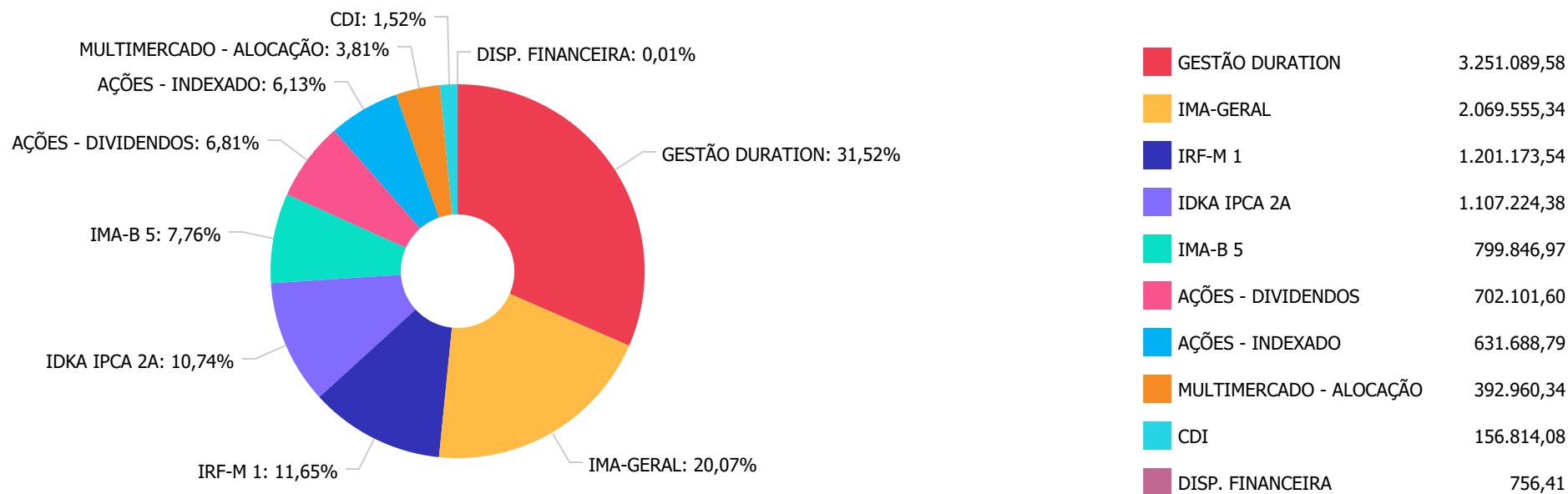
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Outubro/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IGC (Benchmark)	-1,00%	-15,47%	-8,22%	18,56%	-7,28%	18,78%	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	-0,82%	-18,46%	-8,90%	16,42%	-11,42%	11,13%	0,12%	0,40%
CDI (Benchmark)	0,16%	2,44%	0,47%	1,12%	3,21%	9,62%	-	-
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	-0,38%	-3,90%	-3,18%	4,29%	-0,68%	10,17%	0,04%	0,11%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	0,03%	-25,60%	-9,77%	-0,37%	-13,48%	13,00%	0,12%	0,36%

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



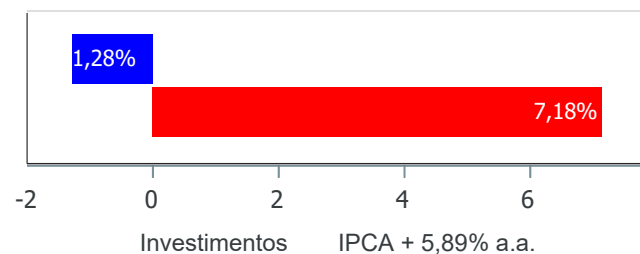
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Outubro / 2020)



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%
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%
Outubro	10.474.009,35	1.415.718,64	1.571.012,98	10.312.454,62	-6.260,39	-153.448,01	-0,06%	-1,28%	1,34%	7,18%	-17,79%	2,61%

Investimentos x Meta Atuarial



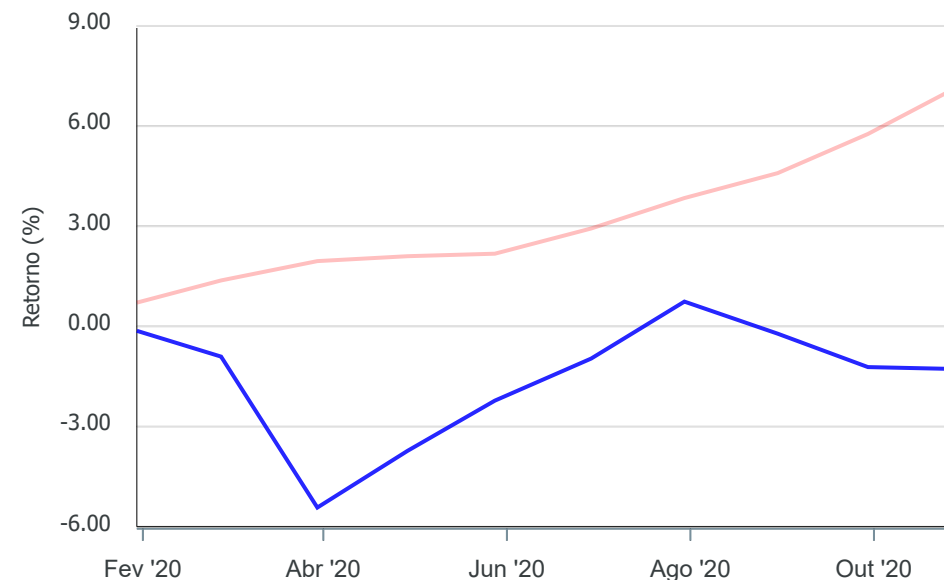
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	798.399,95	0,00	0,00	799.846,97	1.447,02	0,18%	0,18%	1,10%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	1.105.535,37	0,00	0,00	1.107.224,38	1.689,01	0,15%	0,15%	1,15%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.434.534,58	0,00	235.000,00	1.201.173,54	1.638,96	0,11%	0,11%	0,29%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	77.049,61	215.718,64	136.012,98	156.814,08	58,81	0,02%	0,06%	0,24%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.271.225,11	0,00	1.200.000,00	2.069.555,34	-1.669,77	-0,05%	-0,07%	1,35%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	0,00	1.200.000,00	0,00	1.199.294,31	-705,69	-0,06%	-0,07%	1,48%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	2.054.009,73	0,00	0,00	2.051.795,27	-2.214,46	-0,11%	-0,11%	1,18%
Total Renda Fixa	8.740.754,35	1.415.718,64	1.571.012,98	8.585.703,89	243,88	0,00%		1,11%

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
CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES	701.923,00	0,00	0,00	702.101,60	178,60	0,03%	0,03%	11,98%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	394.443,27	0,00	0,00	392.960,34	-1.482,93	-0,38%	-0,38%	3,54%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	636.888,73	0,00	0,00	631.688,79	-5.199,94	-0,82%	-0,82%	11,99%
Total Renda Variável	1.733.255,00	0,00	0,00	1.726.750,73	-6.504,27	-0,38%		10,06%