

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

Relatório Analítico dos Investimentos

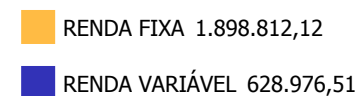
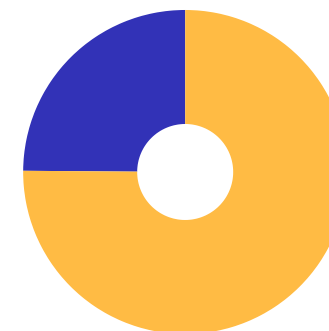
em setembro e 3º trimestre de 2020

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	117.498,30	4,65%	953	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	469.696,29	18,58%	903	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	333.190,91	13,18%	1.239	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPKA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	130.159,76	5,15%	982	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	464.150,82	18,36%	648	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	179.788,44	7,11%	755	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	198.278,34	7,84%	586	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	6.049,26	0,24%	16.114	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	277.167,53	10,96%	1.630	0,03%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	203.816,98	8,06%	197	0,04%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	147.992,00	5,85%		0,51%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
Total para cálculo dos limites da Resolução			2.527.788,63				

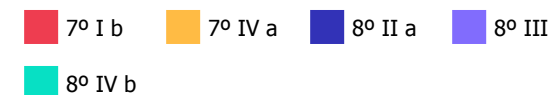
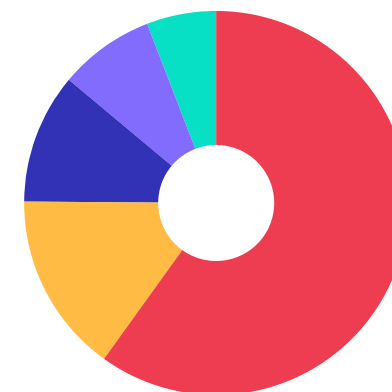
Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Setembro / 2020)

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	1.514.696,08	59,92%	20,00%	30,00%	90,00%	760.313,69
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	1.516.673,18
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	384.116,04	15,20%	10,00%	30,00%	40,00%	626.999,41
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	379.168,29
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	126.389,43
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	126.389,43
Total Renda Fixa	100,00%	1.898.812,12	75,12%	30,00%	70,00%	215,00%	



Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENTA 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%	277.167,53	10,96%	0,00%	15,00%	20,00%	228.390,20
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	203.816,98	8,06%	0,00%	10,00%	10,00%	48.961,88
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	5,00%	147.992,00	5,85%	0,00%	5,00%	5,00%	-21.602,57
Total Renda Variável	30,00%	628.976,51	24,88%	0,00%	30,00%	35,00%	



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

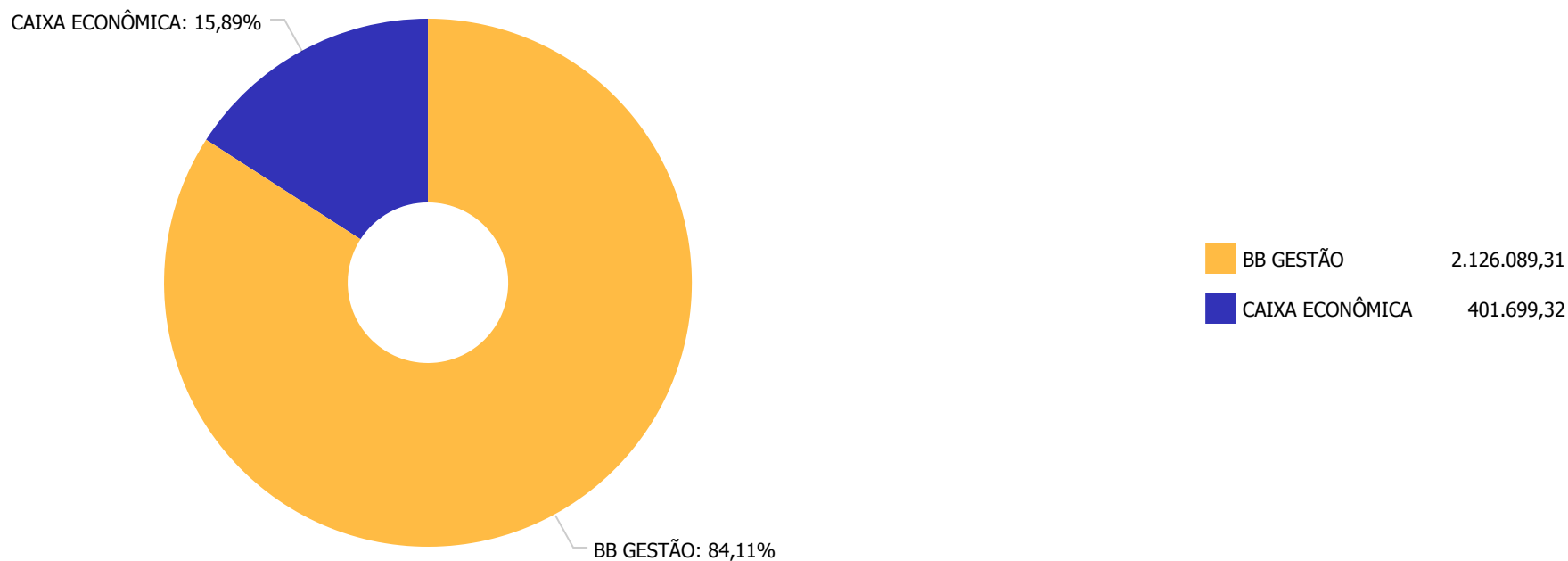
Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	2.126.089,31	84,11	0,00
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	401.699,32	15,89	0,00

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)

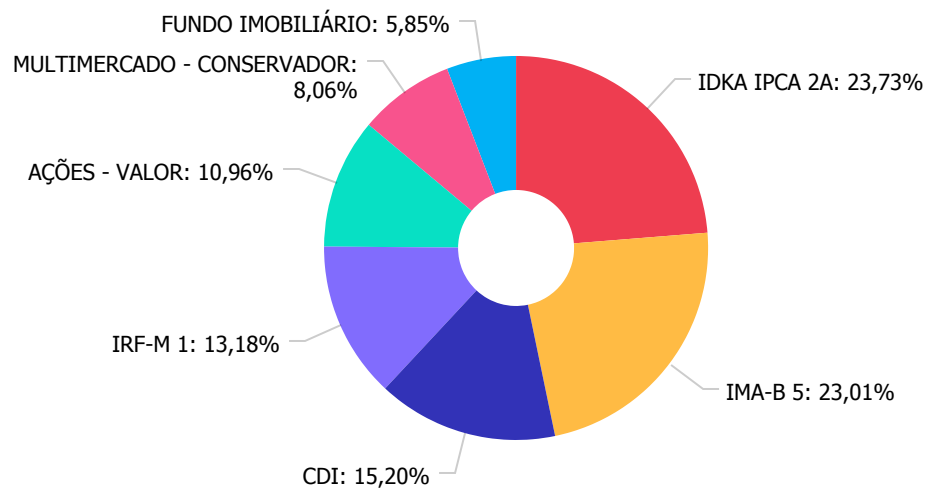
Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2020		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	1.514.696,08	59,92	20,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	384.116,04	15,20	10,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	15,00
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 '	277.167,53	10,96	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	203.816,98	8,06	7,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	147.992,00	5,85	0,00	5,00

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



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

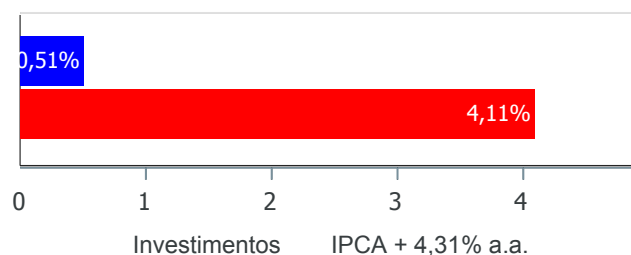


IDKA IPCA 2A	599.856,05
IMA-B 5	581.649,12
CDI	384.116,04
IRF-M 1	333.190,91
AÇÕES - VALOR	277.167,53
MULTIMERCADO - CONSERVADOR	203.816,98
FUNDO IMOBILIÁRIO	147.992,00

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	2.130.336,97	888.634,16	743.794,92	2.296.695,61	21.519,40	21.519,40	0,95%	0,95%	0,58%	0,58%	163,12%	3,07%
Fevereiro	2.296.695,61	638.072,60	588.710,83	2.300.945,76	-45.111,62	-23.592,22	-1,92%	-1,00%	0,55%	1,14%	-87,63%	4,22%
Março	2.300.945,76	714.579,70	734.956,24	2.161.843,64	-118.725,58	-142.317,80	-5,16%	-6,10%	0,44%	1,58%	-386,32%	9,81%
Abril	2.161.843,64	722.530,10	692.334,65	2.222.417,33	30.378,24	-111.939,56	1,39%	-4,80%	0,02%	1,60%	-299,26%	5,17%
Mai	2.222.417,33	837.815,09	807.467,41	2.294.002,53	41.237,52	-70.702,04	1,83%	-3,06%	-0,05%	1,56%	-196,37%	2,81%
Junho	2.294.002,53	1.868.893,64	1.836.697,46	2.379.473,19	53.274,48	-17.427,56	2,29%	-0,84%	0,61%	2,18%	-38,50%	2,82%
Julho	2.379.473,19	902.986,43	868.690,61	2.455.713,04	41.944,03	24.516,47	1,74%	0,88%	0,75%	2,94%	30,00%	2,24%
Agosto	2.455.713,04	998.980,55	958.241,13	2.477.417,40	-19.035,06	5.481,41	-0,76%	0,11%	0,59%	3,56%	3,21%	2,12%
Setembro	2.477.417,40	836.626,52	796.233,28	2.527.788,63	9.977,99	15.459,40	0,40%	0,51%	0,53%	4,11%	12,44%	2,81%

Investimentos x Meta Atuarial



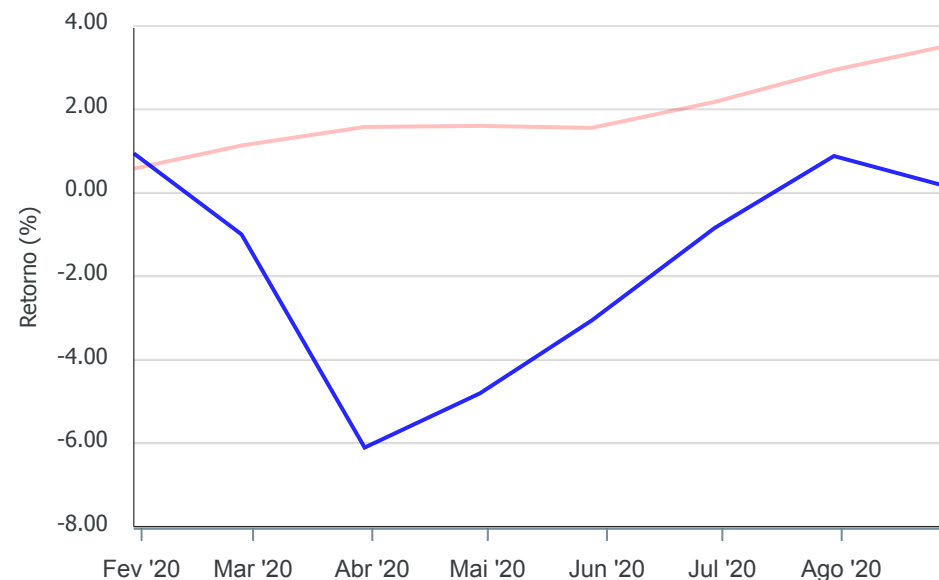
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	457.233,60	211.371,80	200.000,00	469.696,29	1.090,89	0,16%	0,11%	1,35%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	423.837,45	250.000,00	210.000,00	464.150,82	313,37	0,05%	-0,15%	1,65%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	333.048,52	0,00	0,00	333.190,91	142,39	0,04%	0,04%	0,15%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	130.111,98	0,00	0,00	130.159,76	47,78	0,04%	0,04%	1,38%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	198.230,72	0,00	0,00	198.278,34	47,62	0,02%	0,02%	0,06%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	5.538,01	560,00	49,00	6.049,26	0,25	0,00%	0,00%	0,00%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	191.281,76	374.694,72	386.184,28	179.788,44	-3,76	0,00%	0,00%	0,03%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	117.685,76	0,00	0,00	117.498,30	-187,46	-0,16%	-0,16%	1,65%
Total Renda Fixa	1.856.967,80	836.626,52	796.233,28	1.898.812,12	1.451,08	0,08%		0,97%

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 RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	124.000,00	0,00	0,00	147.992,00	23.992,00	19,35%	-88,07%	16,02%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	205.397,61	0,00	0,00	203.816,98	-1.580,63	-0,77%	-0,77%	0,96%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	291.051,99	0,00	0,00	277.167,53	-13.884,46	-4,77%	-4,77%	9,73%
Total Renda Variável	620.449,60	0,00	0,00	628.976,51	8.526,91	1,37%		8,37%

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
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	313.411,91	645.092,17	495.000,00	469.696,29	6.192,21	0,65%	1,61%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	428.287,04	690.148,57	660.000,00	464.150,82	5.715,21	0,51%	1,18%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	128.028,60	0,00	0,00	130.159,76	2.131,16	1,66%	1,66%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	116.096,16	0,00	0,00	117.498,30	1.402,14	1,21%	1,21%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	331.981,52	0,00	0,00	333.190,91	1.209,39	0,36%	0,36%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	197.406,18	0,00	0,00	198.278,34	872,16	0,44%	0,44%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	246.961,34	1.400.461,56	1.468.018,02	179.788,44	383,56	0,02%	0,18%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	3.304,01	2.891,20	147,00	6.049,26	1,05	0,02%	0,02%
			Total Renda Fixa		17.906,88	0,95%	

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
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	124.800,00	0,00	0,00	147.992,00	23.192,00	18,58%	-88,14%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	205.510,47	0,00	0,00	203.816,98	-1.693,49	-0,82%	-0,82%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	283.685,96	0,00	0,00	277.167,53	-6.518,43	-2,30%	-2,30%
			Total Renda Variável		14.980,08	2,44%	