

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

Relatório Analítico dos Investimentos

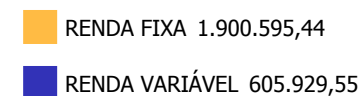
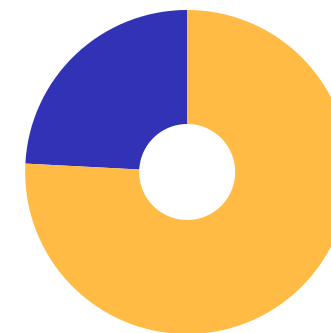
em outubro de 2020

Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	490.178,79	19,56%	910	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	333.568,74	13,31%	1.234	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	130.358,62	5,20%	988	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	494.114,97	19,71%	653	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	117.711,24	4,70%	954	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	6.561,02	0,26%	16.142	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	129.507,71	5,17%	762	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	198.594,35	7,92%	582	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	283.331,93	11,30%	1.678	0,03%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	203.397,62	8,11%	196	0,05%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	119.200,00	4,76%		0,05%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
Total para cálculo dos limites da Resolução			2.506.524,99				

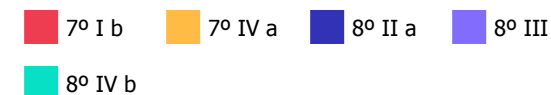
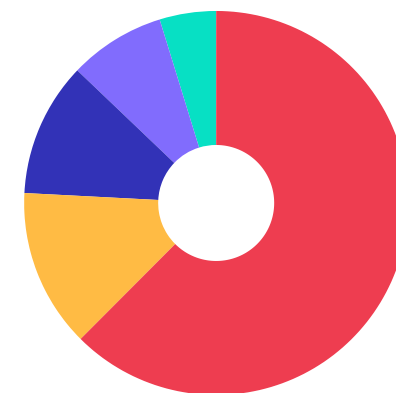
Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Outubro / 2020)

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	1.565.932,36	62,47%	20,00%	30,00%	90,00%	689.940,13
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	1.503.914,99
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	334.663,08	13,35%	10,00%	30,00%	40,00%	667.946,92
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	375.978,75
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	125.326,25
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	125.326,25
Total Renda Fixa	100,00%	1.900.595,44	75,83%	30,00%	70,00%	215,00%	



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 II, Alínea ' a '	20,00%	283.331,93	11,30%	0,00%	15,00%	20,00%	217.973,07
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	203.397,62	8,11%	0,00%	10,00%	10,00%	47.254,88
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	119.200,00	4,76%	0,00%	5,00%	5,00%	6.126,25
Total Renda Variável	30,00%	605.929,55	24,17%	0,00%	30,00%	35,00%	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	2.132.694,11	85,09	-
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	373.830,88	14,91	-

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 '	1.565.932,36	62,47	20,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	334.663,08	13,35	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 '	283.331,93	11,30	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	203.397,62	8,11	7,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	119.200,00	4,76	0,00	5,00

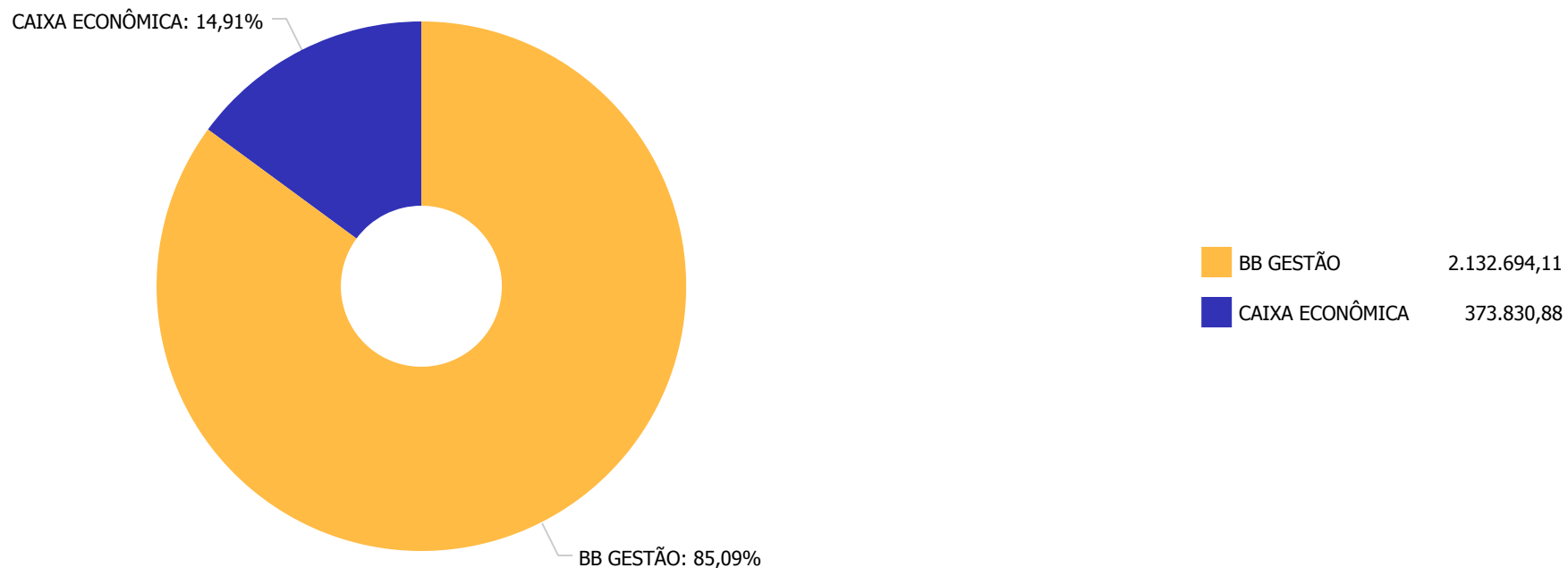
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Outubro/2020 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,04%	5,45%	1,09%	4,85%	6,73%	19,60%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,33%	4,89%	1,13%	5,25%	6,32%	18,19%	0,01%	0,03%
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%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,19%	4,50%	0,40%	4,62%	5,42%	19,71%	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%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,16%	1,98%	0,37%	1,12%	2,69%	8,87%	0,00%	0,00%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,01%	0,12%	0,02%	0,06%	0,24%	1,29%	0,00%	0,00%

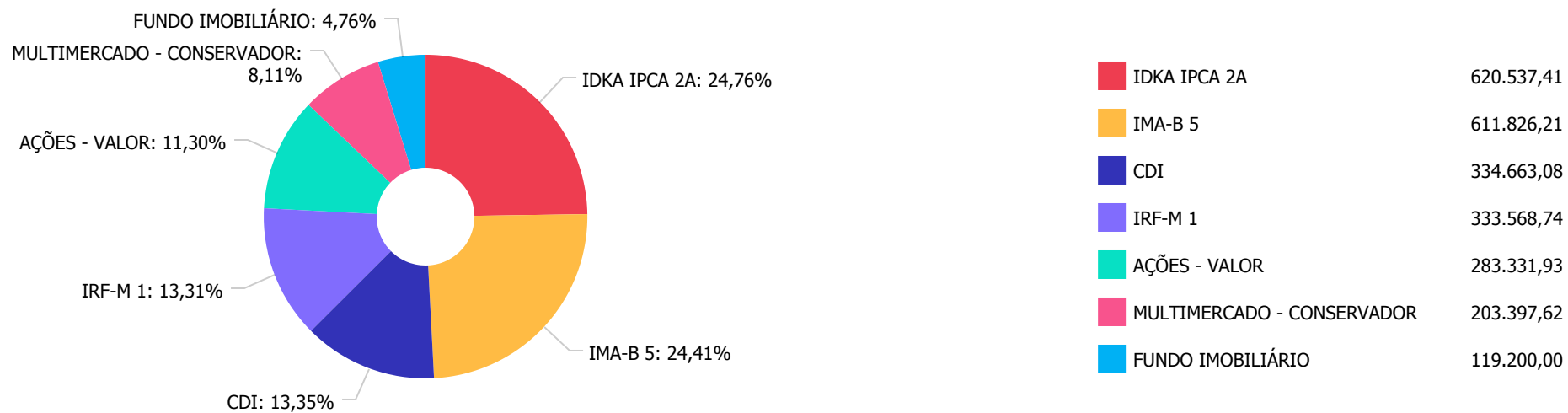
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Outubro/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Ibovespa (Benchmark)	-0,69%	-18,76%	-8,71%	16,70%	-12,37%	7,47%	-	-
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	2,22%	-18,17%	-6,11%	15,33%	-8,40%	20,65%	0,12%	0,36%
CDI (Benchmark)	0,16%	2,44%	0,47%	1,12%	3,21%	9,62%	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	-0,21%	-0,11%	-1,39%	0,00%	1,47%	10,06%	0,01%	0,02%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	-19,46%	-90,00%	-91,39%	-88,10%	-87,52%	-84,80%	0,26%	0,55%

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



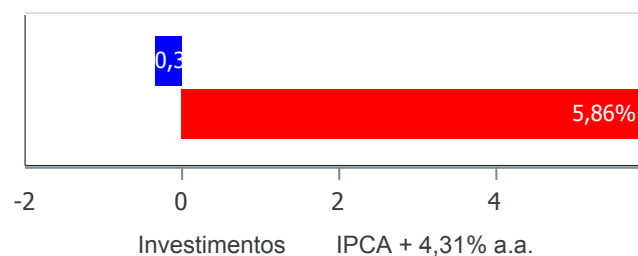
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Outubro / 2020)



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	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%	0,99%	4,58%	11,14%	2,81%
Outubro	2.527.788,63	873.158,38	873.036,89	2.506.524,99	-21.385,13	-5.925,73	-0,85%	-0,34%	1,22%	5,86%	-5,80%	3,33%

Investimentos x Meta Atuarial



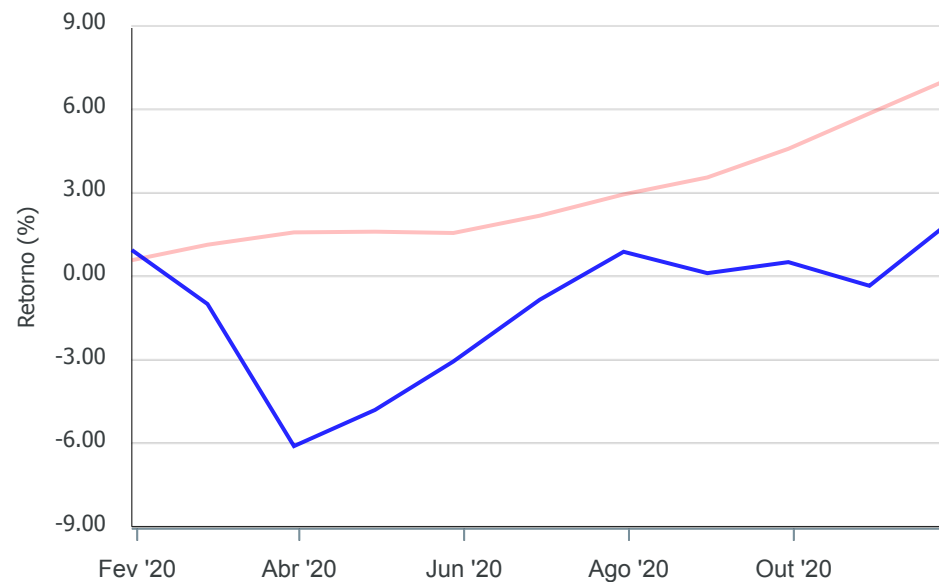
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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...	117.498,30	0,00	0,00	117.711,24	212,94	0,18%	0,18%	1,10%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	198.278,34	0,00	0,00	198.594,35	316,01	0,16%	0,16%	0,26%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	130.159,76	0,00	0,00	130.358,62	198,86	0,15%	0,15%	1,15%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	333.190,91	0,00	0,00	333.568,74	377,83	0,11%	0,11%	0,29%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	469.696,29	220.000,00	200.000,00	490.178,79	482,50	0,07%	0,33%	1,02%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	179.788,44	432.598,38	482.987,89	129.507,71	108,78	0,02%	0,06%	0,24%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	6.049,26	560,00	49,00	6.561,02	0,76	0,01%	0,01%	0,00%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	464.150,82	220.000,00	190.000,00	494.114,97	-35,85	-0,01%	0,19%	1,12%
Total Renda Fixa	1.898.812,12	873.158,38	873.036,89	1.900.595,44	1.661,83	0,09%		0,80%

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
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	277.167,53	0,00	0,00	283.331,93	6.164,40	2,22%	2,22%	12,04%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	203.816,98	0,00	0,00	203.397,62	-419,36	-0,21%	-0,21%	1,31%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	147.992,00	0,00	0,00	119.200,00	-28.792,00	-19,46%	-19,46%	26,40%
Total Renda Variável	628.976,51	0,00	0,00	605.929,55	-23.046,96	-3,66%		11,26%