

Relatório Analítico dos Investimentos

em outubro de 2020

Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 2020)

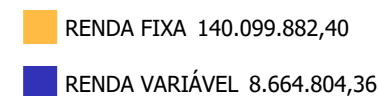
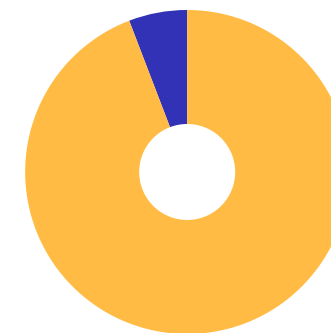
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não possui	378.368,28	0,25%	874	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	D+0	15/08/2022	4.040.350,34	2,72%	45	2,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	17.665.098,18	11,87%	988	0,18%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	6.842.200,66	4,60%	1.366	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	9.546.888,24	6,42%	590	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	28.255.017,15	18,99%	954	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	12.145.560,59	8,16%	910	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	17.645.352,44	11,86%	1.234	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVID...	D+0	15/08/2022	409.291,73	0,28%	115	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	6.953.039,51	4,67%	397	0,35%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	4.185.667,68	2,81%	276	0,09%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.003.091,27	2,02%	762	0,19%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	16.109.689,75	10,83%	664	0,35%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	10.825.732,36	7,28%	582	0,45%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ILLUMINATI FIDC	D+1 ou ...	30 dias	2.094.534,22	1,41%	11	1,43%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
ITAU DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	899.170,00	0,60%	45.375	0,02%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+91 ou...	Não há	2.893.722,74	1,95%	14	1,58%	Artigo 8º, Inciso III
BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP	Não se ...	Não se aplica	2.380.509,13	1,60%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
SÃO DOMINGOS FII - FISD11	Não se ...	Não se aplica	2.491.402,49	1,67%		6,67%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '

Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
Total para cálculo dos limites da Resolução			148.764.686,76				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			9.058,44				Artigo 6º
		PL Total	148.773.745,20				

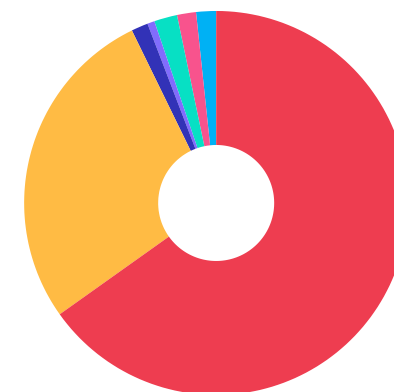
Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Outubro / 2020)

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	96.928.127,61	65,16%	15,00%	25,00%	70,00%	7.207.153,12
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	60,00%	89.258.812,06
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	41.077.220,57	27,61%	10,00%	30,00%	40,00%	18.428.654,13
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	22.314.703,01
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	2.094.534,22	1,41%	2,00%	5,00%	5,00%	5.343.700,12
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	7.438.234,34
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	7.438.234,34
Total Renda Fixa	100,00%	140.099.882,40	94,18%	32,00%	70,00%	200,00%	



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%	899.170,00	0,60%	7,00%	10,00%	10,00%	13.977.298,68
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	2.893.722,74	1,95%	7,00%	10,00%	10,00%	11.982.745,94
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	2.380.509,13	1,60%	2,00%	5,00%	5,00%	5.057.725,21
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	2.491.402,49	1,67%	2,00%	5,00%	5,00%	4.946.831,85
Total Renda Variável	30,00%	8.664.804,36	5,82%	18,00%	30,00%	30,00%	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	69.250.374,02	46,55	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	64.569.306,48	43,40	-
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	5.274.231,87	3,55	-
ITAÚ UNIBANCO	5.084.837,68	3,42	-
VERITAS CAPITAL MANAGEMENT	2.491.402,49	1,67	-
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	2.094.534,22	1,41	-

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 '	96.928.127,61	65,16	15,00	70,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	5,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	41.077.220,57	27,61	10,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	2.094.534,22	1,41	2,00	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 II, Alínea ' a '	899.170,00	0,60	7,00	10,00
Artigo 8º, Inciso III	2.893.722,74	1,95	7,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	2.380.509,13	1,60	2,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	2.491.402,49	1,67	2,00	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 3 Anos (Benchmark)	-0,27%	5,18%	-0,52%	4,91%	6,05%	22,79%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,49%	5,75%	1,52%	5,69%	6,58%	22,96%	0,01%	0,03%
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%
IPCA + 8,50% ao ano (Benchmark)	1,55%	9,37%	3,85%	6,27%	12,68%	25,36%	-	-
ILLUMINATI FIDC	1,30%	-16,59%	-3,88%	-10,40%	-18,74%	-24,77%	0,06%	0,15%
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%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,14%	3,12%	0,37%	1,27%	3,86%	11,05%	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%

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

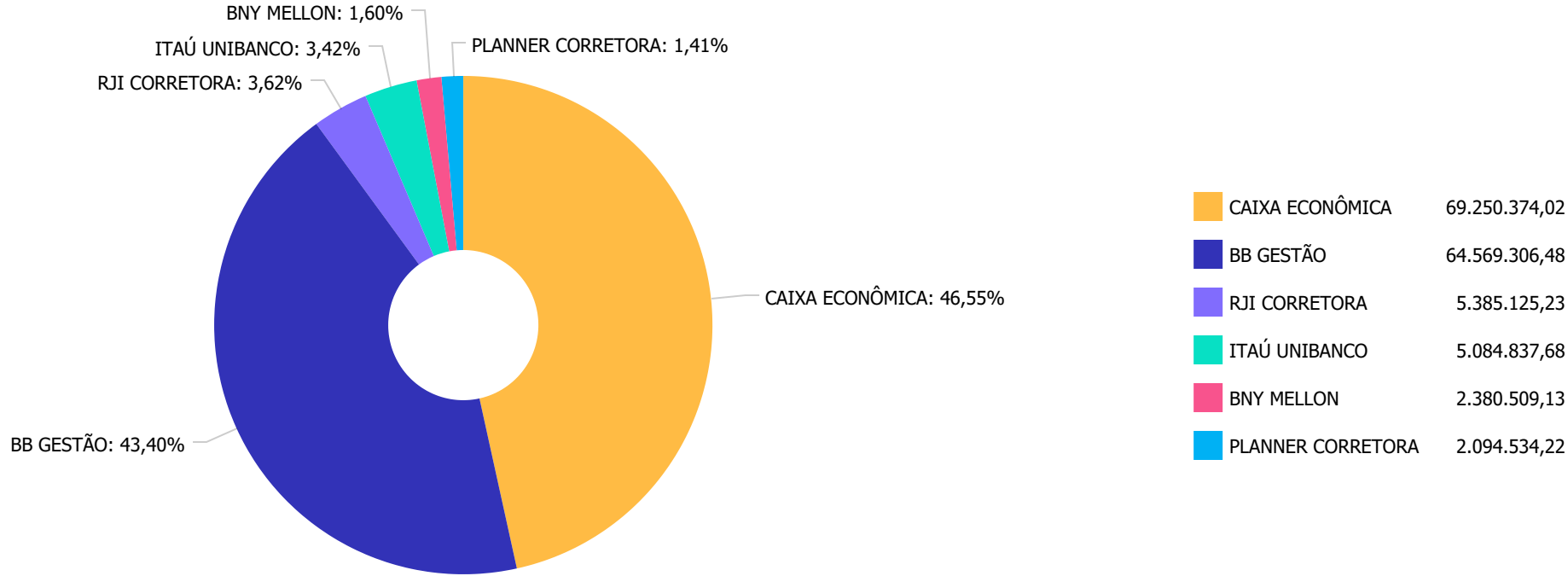
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,16%	2,44%	0,47%	1,12%	3,21%	9,62%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,12%	1,89%	0,26%	1,09%	2,56%	8,75%	0,00%	0,00%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,06%	1,48%	0,13%	0,52%	2,07%	7,24%	0,00%	0,00%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,16%	1,98%	0,37%	1,12%	2,69%	8,87%	0,00%	0,00%

IPCA (Benchmark)	0,86%	2,22%	1,75%	1,99%	3,92%	6,55%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,50%	5,23%	1,45%	5,30%	6,18%	21,41%	0,01%	0,03%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,08%	2,55%	-0,28%	1,26%	3,26%	17,36%	0,00%	0,01%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC 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%	-

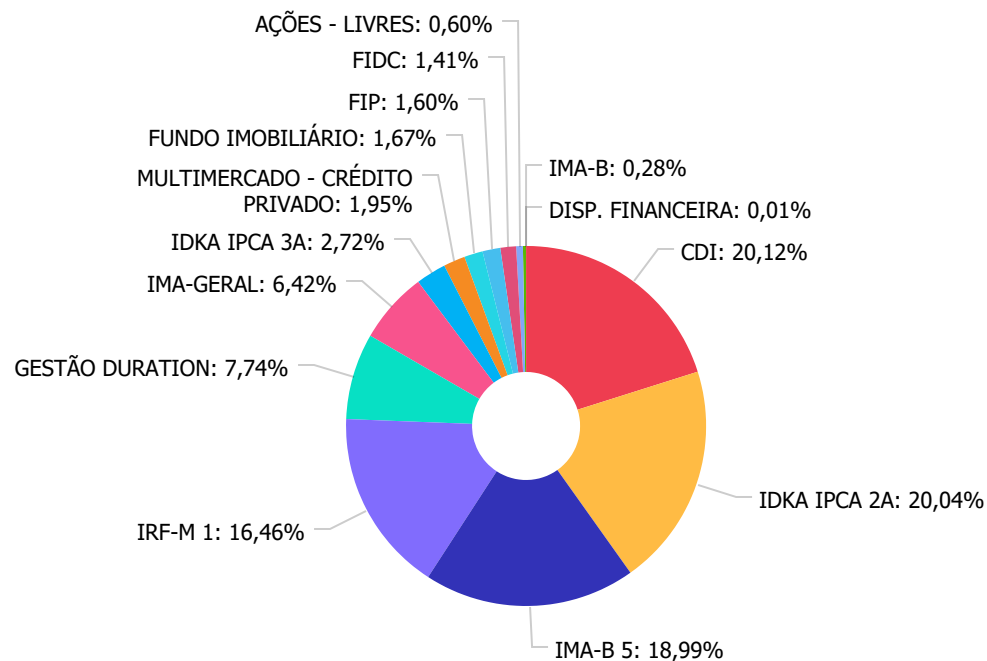
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Outubro/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	1,35%	7,28%	3,24%	5,03%	10,10%	19,67%	-	-
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	1,44%	-8,78%	3,07%	1,24%	-8,93%	-	0,02%	0,11%
Ibovespa (Benchmark)	-0,69%	-18,76%	-8,71%	16,70%	-12,37%	7,47%	-	-
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	0,50%	-20,29%	-4,68%	18,03%	-12,18%	19,23%	0,11%	0,41%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
SÃO DOMINGOS FII - FISD11	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%	0,00%
BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP	-0,16%	-	-	-	32,77%	-	-	-

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



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

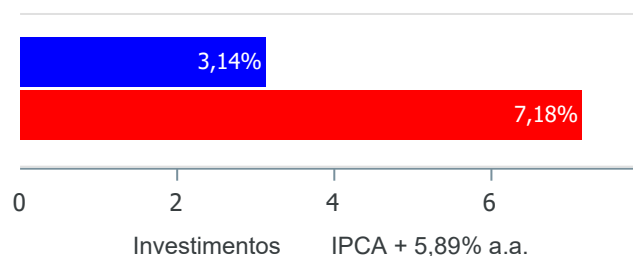


CDI	29.938.513,38
IDKA IPCA 2A	29.810.658,77
IMA-B 5	28.255.017,15
IRF-M 1	24.487.553,10
GESTÃO DURATION	11.517.075,47
IMA-GERAL	9.546.888,24
IDKA IPCA 3A	4.040.350,34
MULTIMERCADO - CRÉDITO PRIVADO	2.893.722,74
FUNDO IMOBILIÁRIO	2.491.402,49
FIP	2.380.509,13
FIDC	2.094.534,22
AÇÕES - LIVRES	899.170,00
IMA-B	409.291,73
DISP. FINANCEIRA	9.058,44

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

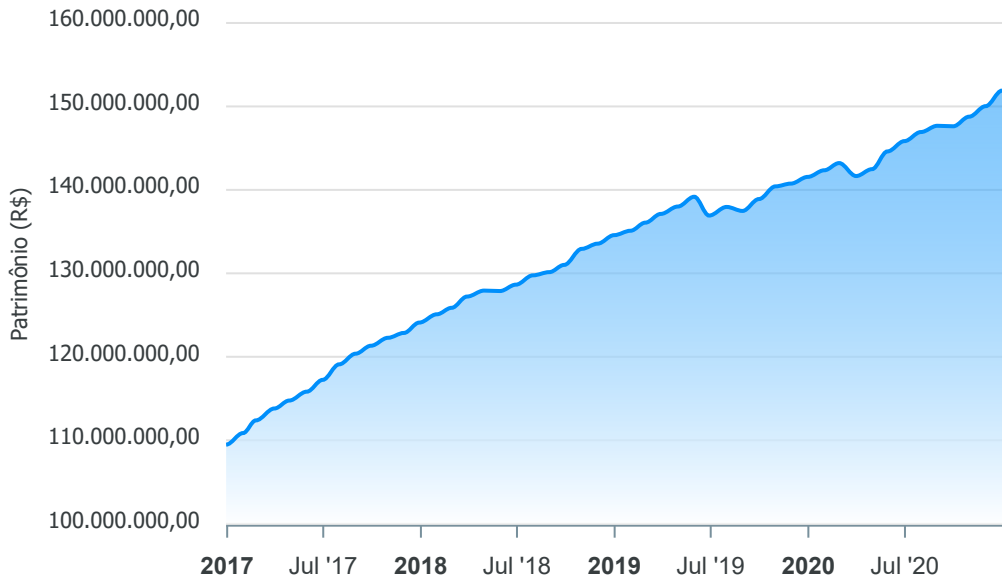
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	141.552.054,93	4.963.230,63	4.720.757,28	142.338.403,89	543.875,61	543.875,61	0,38%	0,38%	0,71%	0,71%	53,88%	0,68%
Fevereiro	142.338.403,89	1.171.922,76	802.832,35	143.197.304,22	489.809,92	1.033.685,53	0,34%	0,73%	0,66%	1,38%	52,87%	0,73%
Março	143.197.304,22	1.052.525,96	891.879,05	141.651.179,02	-1.706.772,11	-673.086,58	-1,19%	-0,47%	0,57%	1,96%	-24,08%	4,53%
Abril	141.651.179,02	606.384,54	344.289,78	142.471.790,73	558.516,95	-114.569,63	0,39%	-0,08%	0,14%	2,10%	-3,78%	2,56%
Mai	142.471.790,73	10.920.070,99	10.652.780,22	144.601.761,28	1.862.679,78	1.748.110,15	1,30%	1,22%	0,07%	2,18%	56,22%	0,81%
Junho	144.601.761,28	589.241,87	705.550,01	145.459.936,84	974.483,70	2.722.593,85	0,67%	1,91%	0,74%	2,93%	65,00%	0,65%
Julho	145.459.936,84	8.556.658,99	7.919.865,19	146.924.382,00	827.651,36	3.550.245,21	0,57%	2,48%	0,89%	3,85%	64,60%	0,64%
Agosto	146.924.382,00	1.481.535,16	967.096,81	147.665.633,94	226.813,59	3.777.058,80	0,15%	2,64%	0,72%	4,59%	57,53%	0,63%
Setembro	147.665.633,94	1.664.192,40	1.434.170,32	147.613.012,95	-282.643,07	3.494.415,73	-0,19%	2,45%	1,12%	5,76%	42,42%	1,14%
Outubro	147.613.012,95	5.232.533,00	5.087.423,40	148.764.686,76	1.006.564,21	4.500.979,94	0,68%	3,14%	1,34%	7,18%	43,75%	0,93%

Investimentos x Meta Atuarial



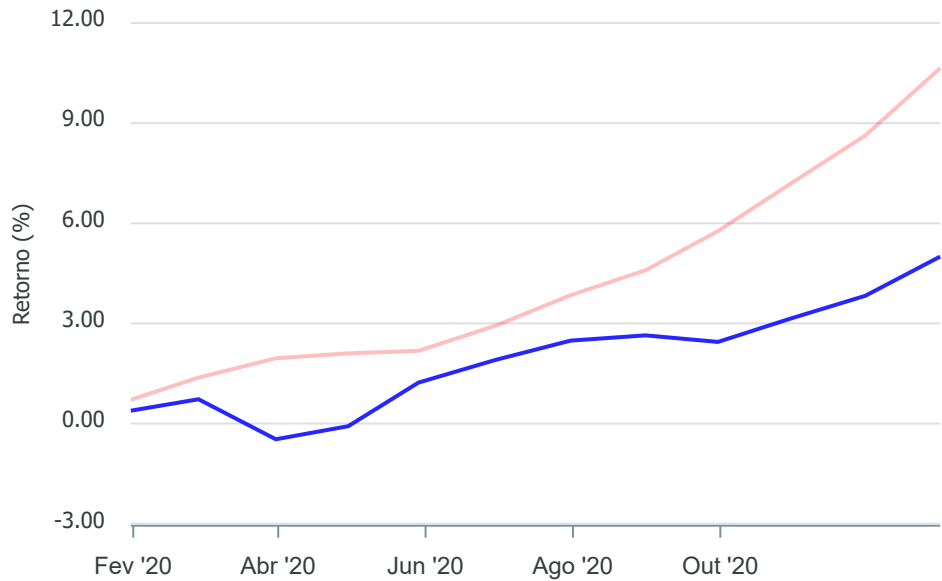
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Outubro/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
ILLUMINATI FIDC	2.067.746,72	0,00	0,00	2.094.534,22	26.787,50	1,30%	-0,38%	5,52%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDEN...	407.277,31	0,00	0,00	409.291,73	2.014,42	0,49%	0,49%	0,95%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRI...	4.020.483,16	0,00	0,00	4.040.350,34	19.867,18	0,49%	0,49%	0,95%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	12.105.782,60	0,00	0,00	12.145.560,59	39.777,99	0,33%	0,33%	1,02%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	28.203.900,45	0,00	0,00	28.255.017,15	51.116,70	0,18%	0,18%	1,10%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	13.889.578,92	3.743.813,71	0,00	17.665.098,18	31.705,55	0,18%	0,15%	1,15%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	10.808.505,75	0,00	0,00	10.825.732,36	17.226,61	0,16%	0,16%	0,26%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	6.173.793,90	658.802,02	0,00	6.842.200,66	9.604,74	0,14%	0,14%	0,24%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	16.090.337,23	0,00	0,00	16.109.689,75	19.352,52	0,12%	0,12%	0,34%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	17.625.365,38	0,00	0,00	17.645.352,44	19.987,06	0,11%	0,11%	0,29%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	4.182.422,03	0,00	0,00	4.185.667,68	3.245,65	0,08%	0,08%	0,34%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.865.451,38	829.917,27	693.866,11	3.003.091,27	1.588,73	0,04%	0,06%	0,24%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	9.553.598,43	0,00	0,00	9.546.888,24	-6.710,19	-0,07%	-0,07%	1,35%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	6.958.055,48	0,00	0,00	6.953.039,51	-5.015,97	-0,07%	-0,07%	1,48%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	378.776,65	0,00	0,00	378.368,28	-408,37	-0,11%	-0,11%	1,18%
Total Renda Fixa	135.331.075,39	5.232.533,00	693.866,11	140.099.882,40	230.140,12	0,16%		0,86%

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
SÃO DOMINGOS FII - FISD11	1.745.018,88	0,00	0,00	2.491.402,49	746.383,61	42,77%	0,00%	0,00%
SCULPTOR FI MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	2.853.618,80	0,00	0,00	2.893.722,74	40.103,94	1,41%	1,43%	1,91%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	894.715,06	0,00	0,00	899.170,00	4.454,94	0,50%	0,50%	10,68%
BRASIL FLORESTAL FIC DE FIP	2.384.257,21	0,00	0,00	2.380.509,13	-3.748,08	-0,16%	-	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTI...	4.404.327,61	0,00	4.393.557,29	0,00	-10.770,32	-0,24%	-	-
Total Renda Variável	12.281.937,56	0,00	4.393.557,29	8.664.804,36	776.424,09	6,32%		2,41%