

Relatório Analítico dos Investimentos

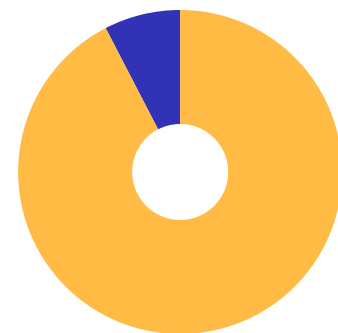
em setembro e 3º trimestre de 2020

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 GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	14.976.431,39	13,78%	868	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	22.606.170,73	20,80%	1.239	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	D+1	Não há	18.335.758,86	16,87%	126	7,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	20.639.243,48	18,99%	597	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	21.533.468,09	19,82%	903	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	1.118.908,02	1,03%	648	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	1.193.601,17	1,10%	755	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	3.095.537,84	2,85%	16.425	0,27%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	2.284.102,80	2,10%	197	0,50%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	2.885.013,34	2,65%	20.023	0,13%	Artigo 8º, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			108.668.235,72				

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%	108.668.235,72
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	99.209.980,57	91,30%	40,00%	60,00%	100,00%	9.458.255,15
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	100,00%	108.668.235,72
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	5.433.411,79
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	60,00%	65.200.941,43
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	65.200.941,43
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	40,00%	1.193.601,17	1,10%	0,00%	15,00%	40,00%	42.273.693,12
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'b'	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	40,00%	43.467.294,29
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	16.300.235,36
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	16.300.235,36
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	5.433.411,79
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	5.433.411,79
Total Renda Fixa	100,00%	100.403.581,74	92,39%	40,00%	85,00%	545,00%	

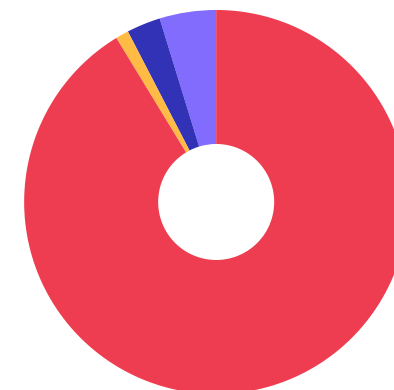


RENDA FIXA 100.403.581,74
RENDA VARIÁVEL 8.264.653,98

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%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	30,00%	32.600.470,72
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'b'	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	32.600.470,72
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	3.095.537,84	2,85%	0,00%	2,00%	20,00%	18.638.109,30
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'b'	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	21.733.647,14
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	5.169.116,14	4,76%	0,00%	6,00%	10,00%	5.697.707,43
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	5.433.411,79
Total Renda Variável	30,00%	8.264.653,98	7,61%	0,00%	13,00%	115,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2020			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	10.866.823,57
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	10.866.823,57
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	20,00%	



7º I b 7º IV a 8º II a 8º III

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

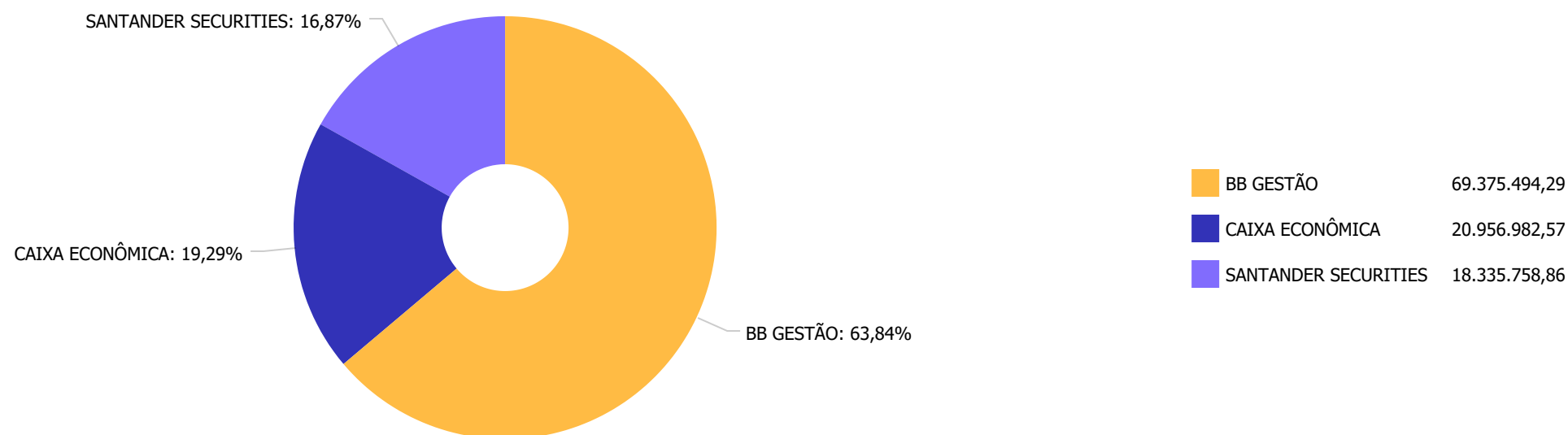
Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	69.375.494,29	63,84	0,00
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	20.956.982,57	19,29	0,00
BANCO DO NORDESTE DO BRASIL	18.335.758,86	16,87	0,17

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)

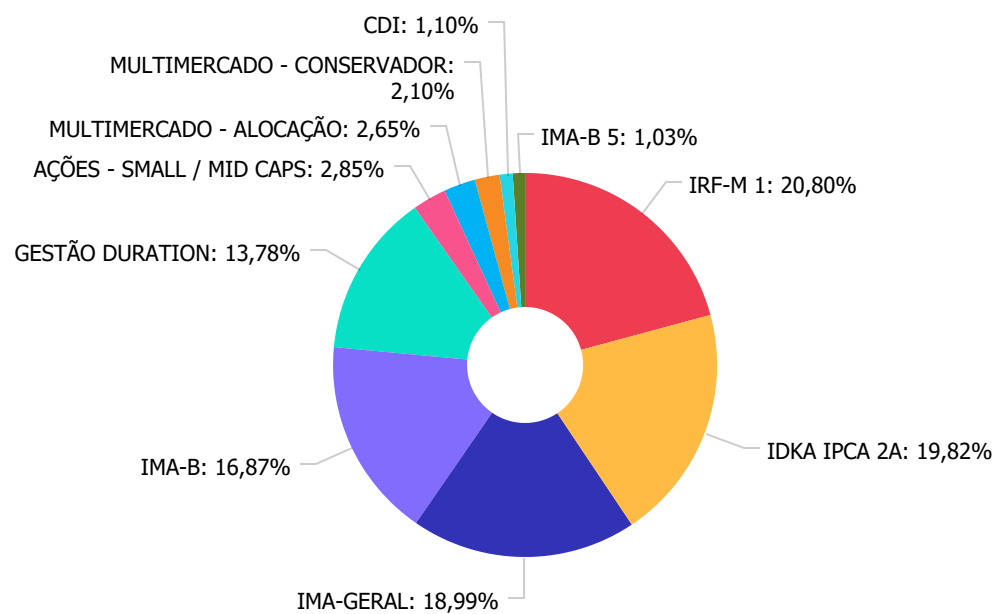
Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

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 '	99.209.980,57	91,30	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 '	1.193.601,17	1,10	0,00	40,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	40,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso V, 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 8º, Inciso I	0,00	0,00	0,00	30,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	30,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	3.095.537,84	2,85	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	5.169.116,14	4,76	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
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

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



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

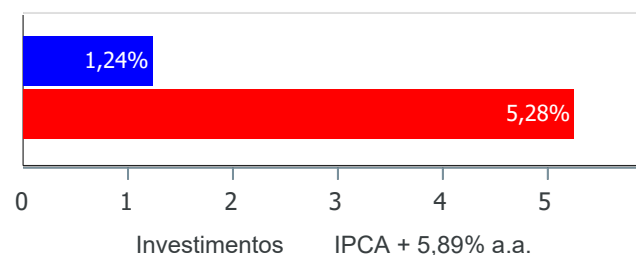


IRF-M 1	22.606.170,73
IDKA IPCA 2A	21.533.468,09
IMA-GERAL	20.639.243,48
IMA-B	18.335.758,86
GESTÃO DURATION	14.976.431,39
AÇÕES - SMALL / MID CAPS	3.095.537,84
MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	2.885.013,34
MULTIMERCADO - CONSERVADOR	2.284.102,80
CDI	1.193.601,17
IMA-B 5	1.118.908,02

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

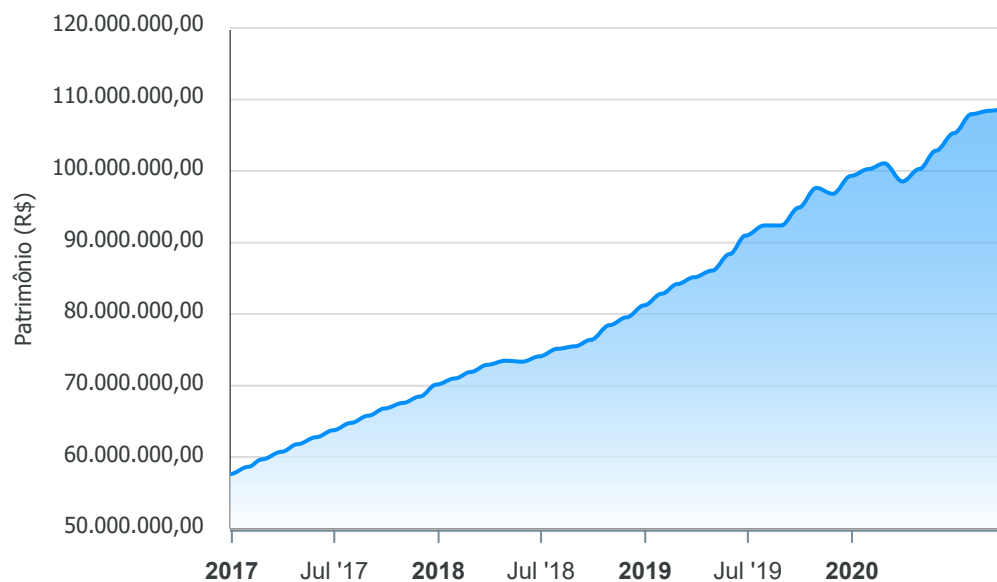
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	99.312.207,22	43.023.569,75	42.437.880,56	100.273.234,48	375.338,07	375.338,07	0,38%	0,38%	0,71%	0,71%	52,77%	0,81%
Fevereiro	100.273.234,48	18.693.006,57	17.894.387,13	101.079.088,66	7.234,74	382.572,81	0,01%	0,38%	0,66%	1,38%	27,80%	1,67%
Março	101.079.088,66	1.010.923,59	240.443,33	98.539.528,08	-3.310.040,84	-2.927.468,03	-3,25%	-2,88%	0,57%	1,96%	-147,18%	8,47%
Abril	98.539.528,08	3.040.194,94	2.333.022,78	100.285.211,34	1.038.511,10	-1.888.956,93	1,05%	-1,86%	0,14%	2,10%	-88,60%	4,44%
Maiο	100.285.211,34	3.316.011,84	2.082.688,45	102.840.897,77	1.322.363,04	-566.593,89	1,30%	-0,58%	0,07%	2,18%	-26,85%	1,98%
Junho	102.840.897,77	2.564.467,46	1.451.705,96	105.298.306,14	1.344.646,87	778.052,98	1,29%	0,70%	0,74%	2,93%	23,90%	1,59%
Julho	105.298.306,14	2.468.820,00	1.541.551,20	107.956.429,96	1.730.855,02	2.508.908,00	1,63%	2,34%	0,89%	3,85%	60,91%	1,22%
Agosto	107.956.429,96	2.308.593,18	1.377.815,73	108.426.821,97	-460.385,44	2.048.522,56	-0,42%	1,91%	0,72%	4,59%	41,58%	1,22%
Setembro	108.426.821,97	2.320.241,56	1.361.743,02	108.668.235,72	-717.084,79	1.331.437,77	-0,66%	1,24%	0,66%	5,28%	23,50%	1,94%

Investimentos x Meta Atuarial



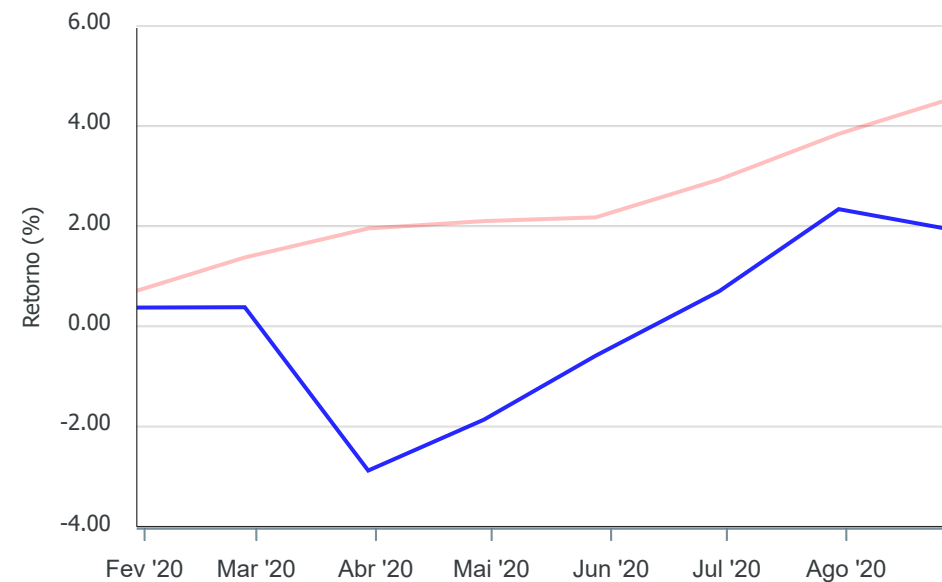
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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...	21.508.924,12	0,00	0,00	21.533.468,09	24.543,97	0,11%	0,11%	1,35%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	22.831.263,79	0,00	235.005,09	22.606.170,73	9.912,03	0,04%	0,04%	0,15%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.125.704,02	1.194.433,09	1.126.737,93	1.193.601,17	201,99	0,01%	0,00%	0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	15.052.167,71	0,00	0,00	14.976.431,39	-75.736,32	-0,50%	-0,50%	1,68%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,00	1.125.808,47	0,00	1.118.908,02	-6.900,45	-0,61%	-0,15%	1,65%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	20.795.741,75	0,00	0,00	20.639.243,48	-156.498,27	-0,75%	-0,75%	2,02%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	18.575.121,89	0,00	0,00	18.335.758,86	-239.363,03	-1,29%	-1,29%	3,51%
Total Renda Fixa	99.888.923,28	2.320.241,56	1.361.743,02	100.403.581,74	-443.840,08	-0,44%		1,65%

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
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	2.301.816,37	0,00	0,00	2.284.102,80	-17.713,57	-0,77%	-0,77%	0,96%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	2.945.519,58	0,00	0,00	2.885.013,34	-60.506,24	-2,05%	-2,05%	3,06%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	3.290.562,74	0,00	0,00	3.095.537,84	-195.024,90	-5,93%	-5,93%	10,89%
Total Renda Variável	8.537.898,69	0,00	0,00	8.264.653,98	-273.244,71	-3,20%		5,42%

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...	18.896.343,22	2.318.388,22	0,00	21.533.468,09	318.736,65	1,50%	1,61%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	18.197.817,24	0,00	0,00	18.335.758,86	137.941,62	0,76%	0,76%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	23.352.851,76	0,00	831.024,00	22.606.170,73	84.342,97	0,36%	0,36%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	20.617.747,17	0,00	0,00	20.639.243,48	21.496,31	0,10%	0,10%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	988.967,72	3.653.458,05	3.450.085,95	1.193.601,17	1.261,35	0,03%	0,18%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,00	1.125.808,47	0,00	1.118.908,02	-6.900,45	-0,61%	1,18%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	14.990.004,40	0,00	0,00	14.976.431,39	-13.573,01	-0,09%	-0,09%
			Total Renda Fixa		543.305,44	0,54%	

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 SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	3.053.569,80	0,00	0,00	3.095.537,84	41.968,04	1,37%	1,37%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	2.897.923,82	0,00	0,00	2.885.013,34	-12.910,48	-0,45%	-0,45%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	2.303.081,01	0,00	0,00	2.284.102,80	-18.978,21	-0,82%	-0,82%
				Total Renda Variável	10.079,35	0,12%	