

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
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVID...	D+0	15/08/2022	1.357.591,05	0,63%	115	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2030	1.420.157,00	0,66%	34	0,65%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	30.806.368,23	14,39%	868	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENC...	D+0	16/05/2023	2.527.619,33	1,18%	51	0,72%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	7.165.974,19	3,35%	676	0,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	6.131.903,28	2,86%	953	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	12.944.050,25	6,05%	597	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	25.640.551,33	11,98%	982	0,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	6.635.380,98	3,10%	1.361	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	14.176.727,42	6,62%	903	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	12.331.162,30	5,76%	648	0,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	8.083,67	0,00%	301	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.005.334,30	1,40%	755	0,16%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3 du	Não há	958.445,40	0,45%	387	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAU SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	D+0	Não há	672.386,24	0,31%	2.055	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAU INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	3.190.434,78	1,49%	83	0,42%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	10.727.142,68	5,01%	290	0,22%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	4.896.866,61	2,29%	194	0,36%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	164.871,18	0,08%	458	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAU IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	5.295.070,46	2,47%	104	0,83%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2020)

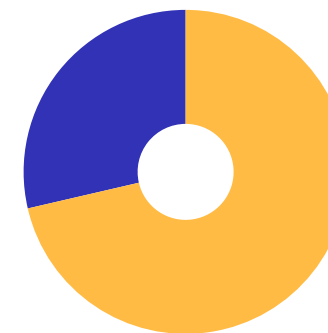
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO...	D+30 ou...	Não há	1.998.125,53	0,93%	74	0,33%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIV...	D+0	3 anos	729.000,00	0,34%	75	0,39%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GENESIS FIC AÇÕ...	D+24	Não há	2.570.454,07	1,20%	14	0,63%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	3.200.071,67	1,49%	2.486	0,39%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	D+33	23/08/2017	3.566.895,47	1,67%	155	0,46%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	D+24	Não há	2.482.954,32	1,16%	46.574	0,06%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	D+24	Não há	2.812.796,13	1,31%	155	0,09%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	D+23	Não há	1.780.638,39	0,83%	115	0,25%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	2.870.071,10	1,34%	205	0,42%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	8.283.427,88	3,87%	1.630	0,96%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	D+4 ou ...	Não há	3.018.404,71	1,41%	6.456	0,12%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	D+15	Não há	2.579.964,88	1,21%	7.879	0,27%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
GERAÇÃO FI AÇÕES	D+4	Não há	2.286.966,61	1,07%	15.708	0,71%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	5.987.545,48	2,80%	197	1,31%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	1.962.155,30	0,92%	85	0,24%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	10.667.360,86	4,98%	19.995	0,21%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	2.214.340,54	1,03%	20.023	0,10%	Artigo 8º, Inciso III
BRASIL AGRO II MULTISTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	3.141.105,17	1,47%	18	4,42%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	1.849.900,00	0,86%		0,63%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
Total para cálculo dos limites da Resolução			214.058.298,79				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			32.913,16				Artigo 6º
PL Total			214.091.211,95				

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%	121.137.485,36	56,59%	15,00%	25,00%	90,00%	71.514.983,55
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	128.434.979,27
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	28.918.635,32	13,51%	10,00%	30,00%	40,00%	56.704.684,20
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	32.108.744,82
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	10.702.914,94
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	2.727.125,53	1,27%	0,00%	5,00%	5,00%	7.975.789,41
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	10.702.914,94
Total Renda Fixa	100,00%	152.783.246,21	71,37%	25,00%	70,00%	220,00%	



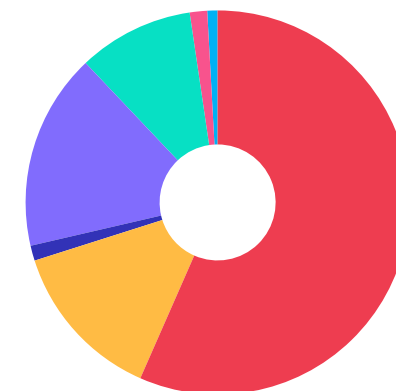
RENDA FIXA 152.783.246,21

RENDA VARIÁVEL 61.275.052,58

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 II, Alínea 'a'	20,00%	35.452.645,23	16,56%	7,00%	15,00%	20,00%	7.359.014,53
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	20.831.402,18	9,73%	7,00%	10,00%	10,00%	574.427,70
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	5,00%	3.141.105,17	1,47%	2,00%	2,00%	5,00%	7.561.809,77
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	5,00%	1.849.900,00	0,86%	1,00%	3,00%	5,00%	8.853.014,94
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	10.702.914,94
Total Renda Variável	30,00%	61.275.052,58	28,63%	17,00%	30,00%	45,00%	

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%	0,00%	10,00%	21.405.829,88
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	91.430.144,04	42,71	0,02
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	70.736.003,13	33,05	0,00
ITAÚ UNIBANCO	25.180.784,61	11,76	0,00
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	7.766.937,71	3,63	0,00
VINCI PARTNERS	5.347.533,86	2,50	0,00
AGBI REAL ASSETS	3.141.105,17	1,47	4,42
BTG PACTUAL ASSET MANAGEMENT S...	3.018.404,71	1,41	0,00
CONSTÂNCIA INVESTIMENTOS	2.579.964,88	1,21	0,17
ITAÚ DTVM	2.570.454,07	1,20	0,00
GENIAL INVESTIMENTOS	2.286.966,61	1,07	0,05

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 '	121.137.485,36	56,59	15,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	28.918.635,32	13,51	10,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	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 '	2.727.125,53	1,27	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	35.452.645,23	16,56	7,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	20.831.402,18	9,73	7,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	3.141.105,17	1,47	2,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	1.849.900,00	0,86	1,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA Geral ex-C (Benchmark)	-0,71%	1,96%	0,25%	2,99%	3,90%	21,11%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,75%	1,86%	0,10%	3,07%	3,70%	21,50%	0,02%	0,04%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,02%	5,41%	1,99%	5,41%	8,00%	21,88%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,11%	4,55%	1,61%	5,24%	7,28%	20,27%	0,01%	0,03%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,04%	4,84%	1,67%	5,27%	7,35%	20,53%	0,01%	0,03%
IPCA + 6,00% ao ano (Benchmark)	1,13%	5,85%	2,78%	3,79%	9,32%	19,21%	-	-
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,30%	5,57%	1,48%	6,07%	8,40%	30,87%	0,02%	0,04%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,15%	3,12%	0,51%	1,66%	4,54%	12,32%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,13%	2,97%	0,47%	1,57%	4,34%	11,93%	0,00%	0,01%
IMA-B 5 (Benchmark)	-0,12%	4,51%	1,30%	5,11%	7,24%	23,75%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,16%	4,29%	1,21%	4,96%	6,91%	23,18%	0,02%	0,04%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	-0,15%	4,30%	1,18%	4,93%	6,95%	23,16%	0,02%	0,04%
IMA-B (Benchmark)	-1,51%	-0,72%	0,96%	5,97%	2,11%	34,14%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,56%	-0,93%	0,84%	5,77%	1,83%	33,39%	0,04%	0,11%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	-1,67%	0,38%	0,73%	5,96%	3,18%	37,20%	0,04%	0,10%

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,16%	2,28%	0,51%	1,25%	3,54%	10,04%	-	-
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	0,01%	2,02%	0,34%	1,04%	3,25%	9,57%	0,00%	0,00%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00%	1,42%	0,18%	0,66%	2,40%	7,66%	0,00%	0,00%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,09%	1,64%	0,29%	0,83%	2,68%	8,21%	0,00%	0,00%
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	0,04%	5,97%	0,50%	1,66%	8,62%	21,95%	0,00%	0,03%
IPCA (Benchmark)	0,64%	1,34%	1,24%	0,81%	3,14%	6,12%	-	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	-0,08%	4,11%	1,40%	5,06%	6,65%	21,92%	0,01%	0,04%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,19%	4,71%	1,65%	5,20%	7,26%	25,36%	0,01%	0,03%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,90%	0,38%	-0,29%	0,63%	3,02%	6,63%	0,00%	0,04%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVADO	-0,63%	4,58%	1,00%	6,07%	7,34%	25,93%	0,02%	0,06%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,23%	2,47%	0,20%	1,32%	3,69%	17,87%	0,00%	0,01%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	-0,50%	4,53%	-0,09%	3,18%	6,41%	25,88%	0,02%	0,03%
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,98%	1,62%	-0,16%	2,97%	3,46%	20,62%	0,02%	0,04%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,88%	-	-0,03%	2,85%	-	-	0,02%	-
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,18%	1,98%	0,15%	0,94%	3,21%	9,64%	0,00%	0,01%

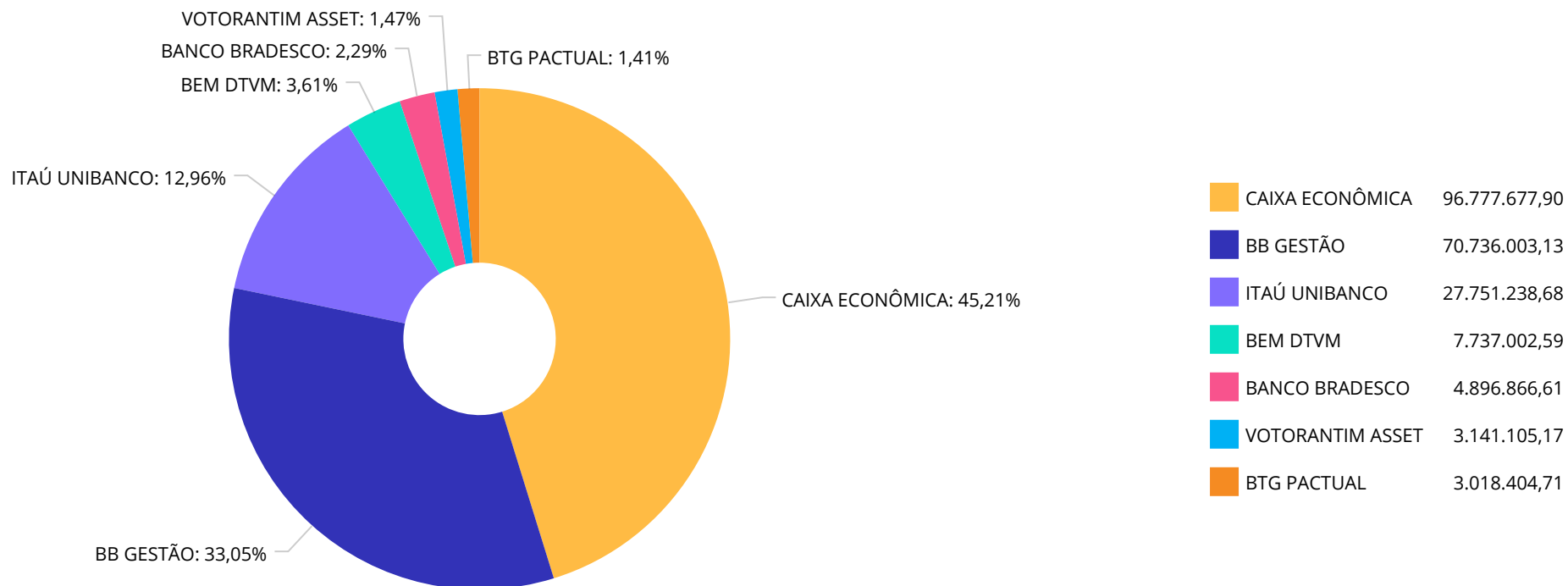
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA + 8,00% ao ano (Benchmark)	1,29%	7,33%	3,27%	4,76%	11,39%	23,74%	-	-
BRASIL AGRO II MULTISTRATÉGIA FIP	-0,09%	-	0,14%	-	-	38,22%	0,00%	0,27%
IDIV (Benchmark)	-4,63%	-21,08%	-3,31%	14,78%	-9,81%	37,85%	-	-
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	-4,93%	-17,58%	-0,96%	19,42%	-6,98%	43,54%	0,09%	0,35%
Ibovespa (Benchmark)	-4,80%	-18,20%	-0,48%	29,56%	-9,68%	19,23%	-	-
GERAÇÃO FI AÇÕES	-4,36%	-17,62%	1,46%	30,02%	-9,78%	22,02%	0,11%	0,38%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	-2,97%	-4,02%	4,71%	48,34%	5,55%	60,69%	0,11%	0,43%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	-4,50%	-20,92%	-2,89%	20,13%	-6,28%	46,96%	0,09%	0,40%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	-8,03%	-33,17%	-6,52%	24,90%	-23,46%	13,87%	0,12%	0,51%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-4,77%	-19,95%	-2,30%	22,29%	-9,26%	41,30%	0,10%	0,36%
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	-2,74%	-20,15%	5,81%	32,85%	-12,72%	15,23%	0,10%	0,40%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	-4,96%	-20,69%	2,00%	30,39%	-10,53%	31,29%	0,11%	0,41%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-5,38%	-14,86%	-0,22%	32,93%	-2,46%	-	0,09%	0,42%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GENESIS FIC AÇÕES	-4,28%	-10,15%	2,46%	38,42%	1,63%	-	0,11%	0,41%
CDI (Benchmark)	0,16%	2,28%	0,51%	1,25%	3,54%	10,04%	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	-0,77%	0,10%	-0,82%	0,90%	2,47%	11,09%	0,01%	0,02%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	-2,05%	-3,54%	-0,45%	8,24%	0,88%	14,18%	0,03%	0,11%

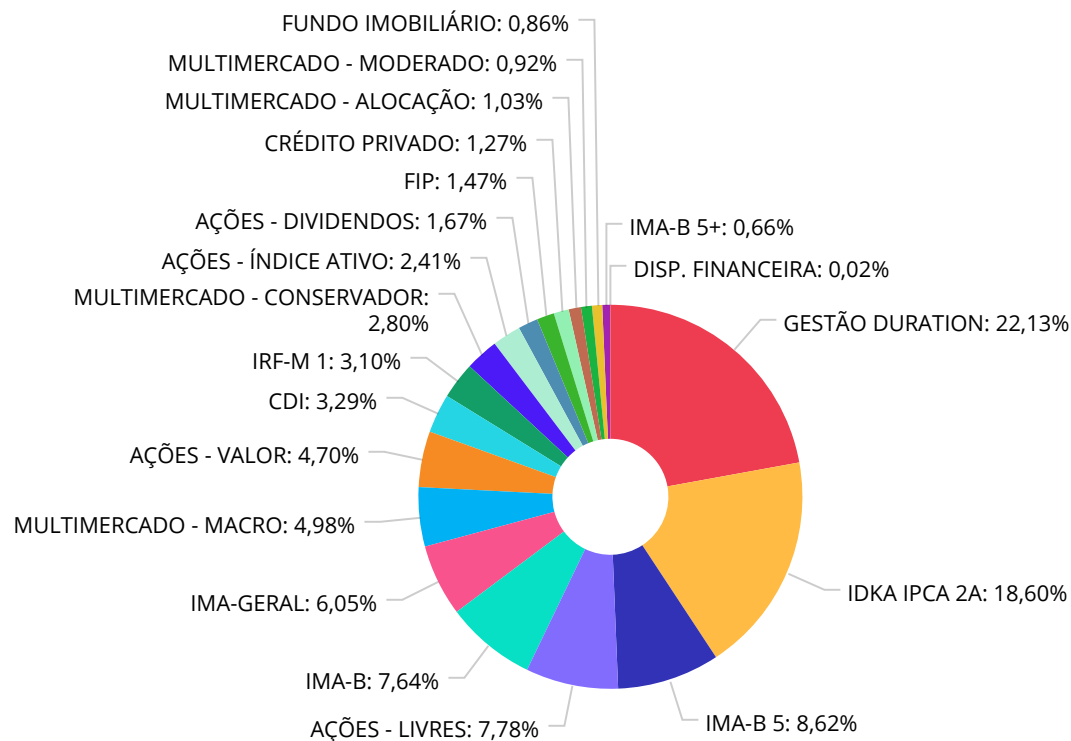
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	-0,91%	-0,69%	0,35%	5,77%	3,05%	22,65%	0,02%	0,07%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	-2,90%	-15,40%	0,62%	29,23%	-0,02%	56,46%	0,10%	0,41%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	-88,07%	-87,58%	-88,14%	-84,07%	-83,34%	-80,63%	0,16%	0,49%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	-1,61%	-1,00%	0,64%	9,72%	-	-	0,03%	-

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



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

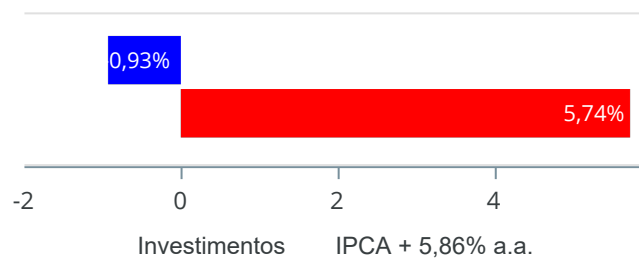


GESTÃO DURATION	47.388.822,92
IDKA IPCA 2A	39.817.278,75
IMA-B 5	18.463.065,58
AÇÕES - LIVRES	16.664.645,78
IMA-B	16.346.255,03
IMA-GERAL	12.944.050,25
MULTIMERCADO - MACRO	10.667.360,86
AÇÕES - VALOR	10.064.066,27
CDI	7.041.110,17
IRF-M 1	6.635.380,98
MULTIMERCADO - CONSERVADOR	5.987.545,48
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	5.157.037,71
AÇÕES - DIVIDENDOS	3.566.895,47
FIP	3.141.105,17
CRÉDITO PRIVADO	2.727.125,53
MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	2.214.340,54
MULTIMERCADO - MODERADO	1.962.155,30
FUNDO IMOBILIÁRIO	1.849.900,00
IMA-B 5+	1.420.157,00

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

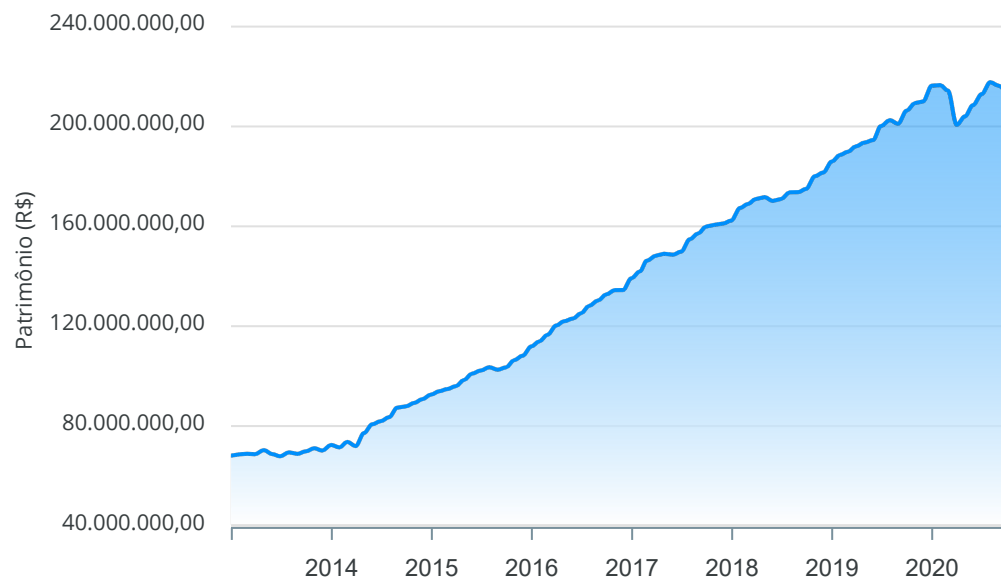
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	214.207.749,87	1.322.881,96	2.484.374,30	214.203.168,74	1.156.911,21	1.156.911,21	0,54%	0,54%	0,71%	0,71%	76,13%	2,29%
Fevereiro	214.203.168,74	5.969.817,04	7.600.836,88	209.874.462,79	-2.697.686,11	-1.540.774,90	-1,26%	-0,73%	0,66%	1,37%	-52,90%	3,69%
Março	209.874.462,79	3.902.301,44	1.064.632,86	198.242.123,80	-14.470.007,57	-16.010.782,47	-6,80%	-7,48%	0,57%	1,95%	-383,70%	12,66%
Abril	198.242.123,80	1.597.480,71	2.250.943,89	201.466.086,24	3.877.425,62	-12.133.356,85	1,96%	-5,67%	0,14%	2,09%	-270,81%	6,37%
Mai	201.466.086,24	1.891.668,55	1.919.718,66	206.003.308,84	4.565.272,71	-7.568.084,14	2,27%	-3,53%	0,07%	2,17%	-163,05%	3,45%
Junho	206.003.308,84	1.639.403,38	1.687.493,22	210.408.821,75	4.453.602,75	-3.114.481,39	2,16%	-1,45%	0,74%	2,92%	-49,55%	2,84%
Julho	210.408.821,75	1.366.148,23	1.362.301,63	215.121.452,70	4.708.784,35	1.594.302,96	2,24%	0,76%	0,88%	3,83%	19,82%	2,34%
Agosto	215.121.452,70	16.590.992,96	16.419.986,16	213.831.466,65	-1.460.992,85	133.310,11	-0,68%	0,08%	0,72%	4,57%	1,64%	2,46%
Setembro	213.831.466,65	1.739.544,86	1.735.052,51	211.682.651,83	-2.153.307,17	-2.019.997,06	-1,01%	-0,93%	1,12%	5,74%	-16,24%	3,15%

Investimentos x Meta Atuarial



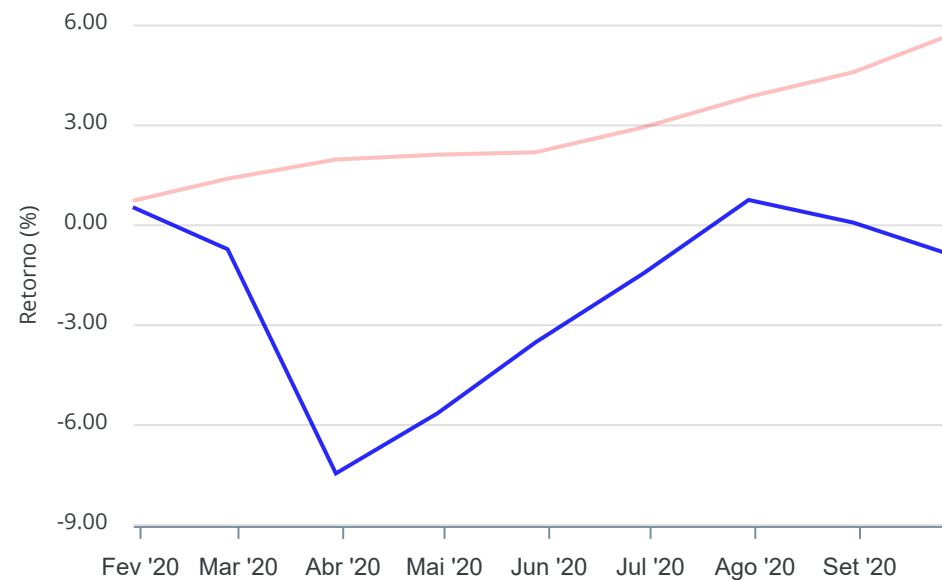
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,00	7.000,00	0,00	8.083,67	1.083,67	15,48%	0,09%	0,00%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.407.563,00	0,00	0,00	1.420.157,00	12.594,00	0,89%	0,89%	0,14%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDEN...	1.354.973,25	0,00	0,00	1.357.591,05	2.617,80	0,19%	0,19%	1,16%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	6.626.545,84	0,00	0,00	6.635.380,98	8.835,14	0,13%	0,13%	0,12%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	14.160.568,71	0,00	0,00	14.176.727,42	16.158,71	0,11%	0,11%	1,35%
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	3.189.054,98	0,00	0,00	3.190.434,78	1.379,80	0,04%	0,04%	0,18%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	25.631.138,36	0,00	0,00	25.640.551,33	9.412,97	0,04%	0,04%	1,38%
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	1.607.379,64	0,00	935.509,08	672.386,24	515,68	0,03%	0,01%	0,05%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.144.201,05	1.732.544,86	1.871.380,84	3.005.334,30	-30,77	0,00%	0,00%	0,03%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	1.999.721,53	0,00	0,00	1.998.125,53	-1.596,00	-0,08%	-0,08%	1,24%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	12.350.137,50	0,00	0,00	12.331.162,30	-18.975,20	-0,15%	-0,15%	1,65%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	6.141.686,41	0,00	0,00	6.131.903,28	-9.783,13	-0,16%	-0,16%	1,65%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	165.171,42	0,00	0,00	164.871,18	-300,24	-0,18%	-0,18%	0,14%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	10.751.791,16	0,00	0,00	10.727.142,68	-24.648,48	-0,23%	-0,23%	0,49%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	2.535.271,93	0,00	0,00	2.527.619,33	-7.652,60	-0,30%	-0,30%	1,94%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	30.962.157,03	0,00	0,00	30.806.368,23	-155.788,80	-0,50%	-0,50%	1,68%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	733.621,20	0,00	0,00	729.000,00	-4.621,20	-0,63%	-0,63%	2,41%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	13.042.199,27	0,00	0,00	12.944.050,25	-98.149,02	-0,75%	-0,75%	2,02%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	0,00	1.000.000,00	32.422,82	958.445,40	-9.131,78	-0,91%	-0,88%	2,33%
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	4.945.492,03	0,00	0,00	4.896.866,61	-48.625,42	-0,98%	-0,98%	2,28%

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 IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	7.279.198,13	0,00	0,00	7.165.974,19	-113.223,94	-1,56%	-1,56%	4,15%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	5.384.893,10	0,00	0,00	5.295.070,46	-89.822,64	-1,67%	-1,67%	4,50%
Total Renda Fixa	153.412.765,54	2.739.544,86	2.839.312,74	152.783.246,21	-529.751,45	-0,34%		1,62%

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	1.550.000,00	0,00	7.000,00	1.849.900,00	306.900,00	19,80%	-88,07%	16,02%
BRASIL AGRO II MULTISTRATÉGIA FIP	3.144.038,04	0,00	0,00	3.141.105,17	-2.932,87	-0,09%	-0,09%	0,03%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	6.033.979,81	0,00	0,00	5.987.545,48	-46.434,33	-0,77%	-0,77%	0,96%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	10.765.256,77	0,00	0,00	10.667.360,86	-97.895,91	-0,91%	-0,91%	1,88%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	1.994.319,79	0,00	0,00	1.962.155,30	-32.164,49	-1,61%	-1,61%	2,75%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	2.260.781,01	0,00	0,00	2.214.340,54	-46.440,47	-2,05%	-2,05%	3,06%
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	2.950.837,88	0,00	0,00	2.870.071,10	-80.766,78	-2,74%	-2,74%	10,29%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	1.833.737,66	0,00	0,00	1.780.638,39	-53.099,27	-2,90%	-2,90%	10,44%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	3.110.649,02	0,00	0,00	3.018.404,71	-92.244,31	-2,97%	-2,97%	11,45%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GENESIS FIC AÇÕES	2.685.446,75	0,00	0,00	2.570.454,07	-114.992,68	-4,28%	-4,28%	10,65%
GERAÇÃO FI AÇÕES	2.391.309,03	0,00	0,00	2.286.966,61	-104.342,42	-4,36%	-4,36%	10,85%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	2.701.636,81	0,00	0,00	2.579.964,88	-121.671,93	-4,50%	-4,50%	8,90%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	8.698.378,58	0,00	0,00	8.283.427,88	-414.950,70	-4,77%	-4,77%	9,73%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	3.751.739,38	0,00	0,00	3.566.895,47	-184.843,91	-4,93%	-4,93%	8,81%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	2.612.569,83	0,00	0,00	2.482.954,32	-129.615,51	-4,96%	-4,96%	10,80%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	3.381.942,14	0,00	0,00	3.200.071,67	-181.870,47	-5,38%	-5,38%	9,30%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	3.058.495,23	0,00	0,00	2.812.796,13	-245.699,10	-8,03%	-8,03%	11,91%
Total Renda Variável	62.925.117,73	0,00	7.000,00	61.275.052,58	-1.643.065,15	-2,61%		6,98%

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
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	25.220.726,86	0,00	0,00	25.640.551,33	419.824,47	1,66%	1,66%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	13.951.531,82	0,00	0,00	14.176.727,42	225.195,60	1,61%	1,61%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	11.151.012,76	1.050.000,00	0,00	12.331.162,30	130.149,54	1,07%	1,18%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	6.058.729,95	0,00	0,00	6.131.903,28	73.173,33	1,21%	1,21%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	10.092.660,89	0,00	3.500.000,00	6.635.380,98	42.720,09	0,42%	0,47%
ITAÚ IMA B ATIVO FIC RENDA FIXA	5.256.963,48	0,00	0,00	5.295.070,46	38.106,98	0,72%	0,72%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	2.490.751,70	0,00	0,00	2.527.619,33	36.867,63	1,48%	1,48%
CAIXA BRASIL 2030 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.424.232,00	0,00	40.060,49	1.420.157,00	35.985,49	2,53%	-0,29%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	1.970.582,61	0,00	0,00	1.998.125,53	27.542,92	1,40%	1,40%
BB TÍTULOS PÚBLICOS IPCA IV FI RENDA FIXA PREVIDEN...	1.571.316,13	0,00	238.715,26	1.357.591,05	24.990,18	1,59%	1,65%
ITAÚ INSTITUCIONAIS LEGEND FIC RENDA FIXA LP	4.668.650,86	0,00	1.500.000,00	3.190.434,78	21.783,92	0,47%	0,50%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	10.706.173,47	0,00	0,00	10.727.142,68	20.969,21	0,20%	0,20%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	12.930.568,68	0,00	0,00	12.944.050,25	13.481,57	0,10%	0,10%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.993.483,69	0,00	3.003.054,69	0,00	9.571,00	0,32%	-0,35%
CAIXA BRASIL 2020 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	4.222.740,81	0,00	4.230.383,26	0,00	7.642,45	0,18%	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.845.689,98	5.629.805,84	6.477.802,68	3.005.334,30	7.641,16	0,08%	0,18%
CAIXA BRASIL IPCA XVI FI RENDA FIXA CRÉDITO PRIVAD...	721.815,20	0,00	0,00	729.000,00	7.184,80	1,00%	1,00%
ITAÚ SOBERANO FIC RENDA FIXA SIMPLES	526.862,23	2.000.000,00	1.857.593,63	672.386,24	3.117,64	0,12%	0,34%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,00	7.000,00	0,00	8.083,67	1.083,67	15,48%	0,29%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	164.622,65	0,00	0,00	164.871,18	248,53	0,15%	0,15%

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 IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	5.167.097,36	2.000.000,00	0,00	7.165.974,19	-1.123,17	-0,02%	0,83%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	4.904.575,05	0,00	0,00	4.896.866,61	-7.708,44	-0,16%	-0,16%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	0,00	1.000.000,00	32.422,82	958.445,40	-9.131,78	-0,91%	-0,03%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	26.555.169,29	4.294.000,41	0,00	30.806.368,23	-42.801,47	-0,14%	-0,09%
				Total Renda Fixa	1.086.515,32	0,63%	

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	1.560.000,00	0,00	36.140,00	1.849.900,00	326.040,00	20,90%	-88,14%
BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	2.712.536,90	0,00	0,00	2.870.071,10	157.534,20	5,81%	5,81%
BTG PACTUAL ABSOLUTO INSTITUCIONAL FIC AÇÕES	2.882.694,53	0,00	0,00	3.018.404,71	135.710,18	4,71%	4,71%
ITAÚ DUNAMIS FIC AÇÕES	2.434.223,72	0,00	0,00	2.482.954,32	48.730,60	2,00%	2,00%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	10.630.523,20	0,00	0,00	10.667.360,86	36.837,66	0,35%	0,35%
GERAÇÃO FI AÇÕES	2.254.113,10	0,00	0,00	2.286.966,61	32.853,51	1,46%	1,46%
CAIXA VALOR RPPS FIC AÇÕES	1.769.676,98	0,00	0,00	1.780.638,39	10.961,41	0,62%	0,62%
BRASIL AGRO II MULTIESTRATÉGIA FIP	3.136.810,41	0,00	0,00	3.141.105,17	4.294,76	0,14%	0,14%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	2.224.249,74	0,00	0,00	2.214.340,54	-9.909,20	-0,45%	-0,45%
CAIXA VALOR DIVIDENDOS RPPS FIC AÇÕES	3.601.337,42	0,00	0,00	3.566.895,47	-34.441,95	-0,96%	-0,96%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	0,00	2.000.000,00	0,00	1.962.155,30	-37.844,70	-1,89%	0,64%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	6.037.294,94	0,00	0,00	5.987.545,48	-49.749,46	-0,82%	-0,82%
ITAÚ INSTITUCIONAL FUND OF FUNDS GENESIS FIC AÇÕES	1.121.705,15	1.500.000,00	0,00	2.570.454,07	-51.251,08	-1,95%	2,46%
CONSTÂNCIA FUNDAMENTO FI AÇÕES	2.656.727,27	0,00	0,00	2.579.964,88	-76.762,39	-2,89%	-2,89%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	1.799.525,94	1.500.000,00	0,00	3.200.071,67	-99.454,27	-3,01%	-0,22%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	8.478.237,67	0,00	0,00	8.283.427,88	-194.809,79	-2,30%	-2,30%
ITAÚ INSTITUCIONAL PHOENIX FIC AÇÕES	3.008.994,16	0,00	0,00	2.812.796,13	-196.198,03	-6,52%	-6,52%
				Total Renda Variável	2.541,45	0,00%	