

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
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	99.329,90	11,29%	874	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	150.406,78	17,10%	988	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1 du	Não há	99.206,53	11,28%	95	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	D+1002	Não há	312.127,37	35,49%	12	3,39%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	109.034,23	12,40%	16.142	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	109.321,62	12,43%	70	0,15%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
Total para cálculo dos limites da Resolução			879.426,43				

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%	249.736,68	28,40%	0,00%	25,00%	90,00%	541.747,11
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	527.655,86
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	520.368,13	59,17%	10,00%	30,00%	40,00%	-168.597,56
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	131.913,96
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	109.321,62	12,43%	0,00%	5,00%	5,00%	-65.350,30
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	43.971,32
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	43.971,32
Total Renda Fixa	100,00%	879.426,43	100,00%	10,00%	70,00%	220,00%	



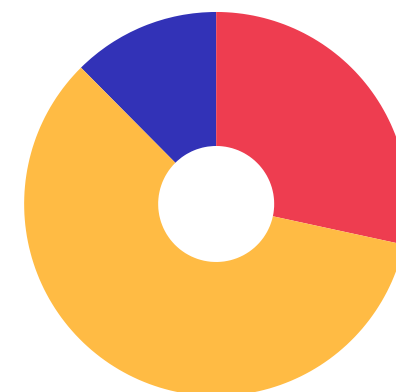
RENDA FIXA 879.426,43

⚠️ ATENÇÃO! O Somatório dos incisos "a" e "b" do Artigo 7º IV não podem ultrapassar 40% (quarenta por cento).

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%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	20,00%	175.885,29
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	10,00%	87.942,64
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	43.971,32
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	43.971,32
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	43.971,32
Total Renda Variável	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	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%	87.942,64
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	



7º I b 7º IV a 7º VII a

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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	457.977,44	52,08	-
VERITAS CAPITAL MANAGEMENT	312.127,37	35,49	-
GRAPHEN INVESTIMENTOS LTDA	109.321,62	12,43	-

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)

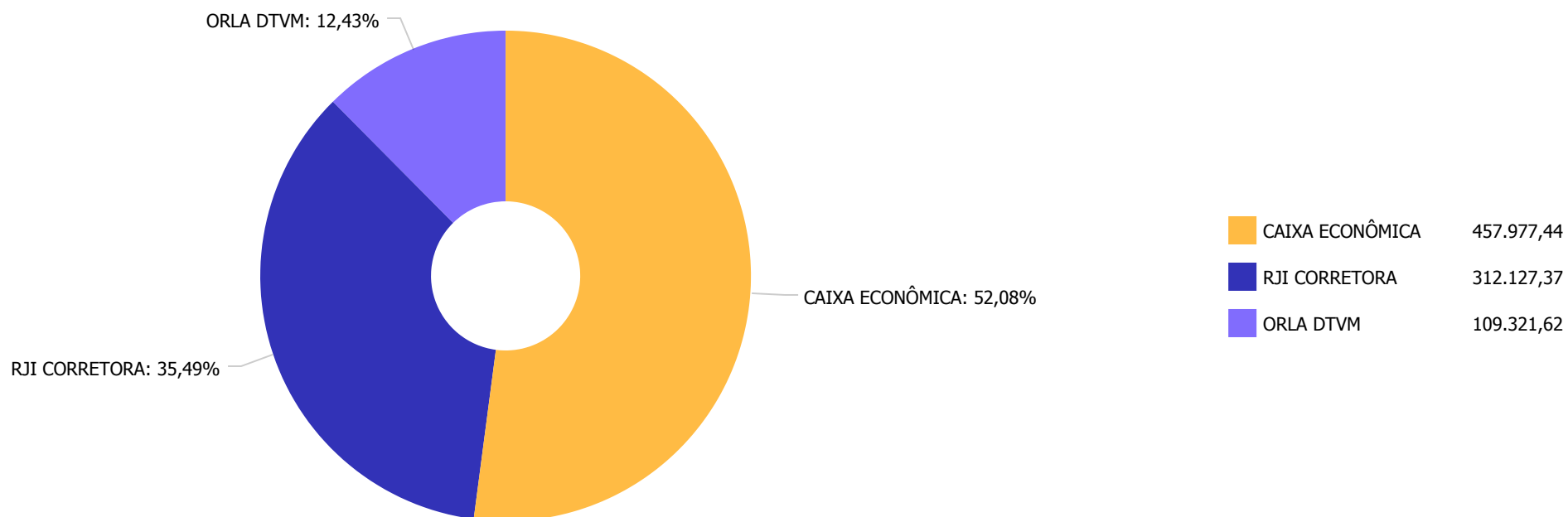
Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2020		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	249.736,68	28,40	0,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	520.368,13	59,17	10,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	109.321,62	12,43	0,00	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 '	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	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

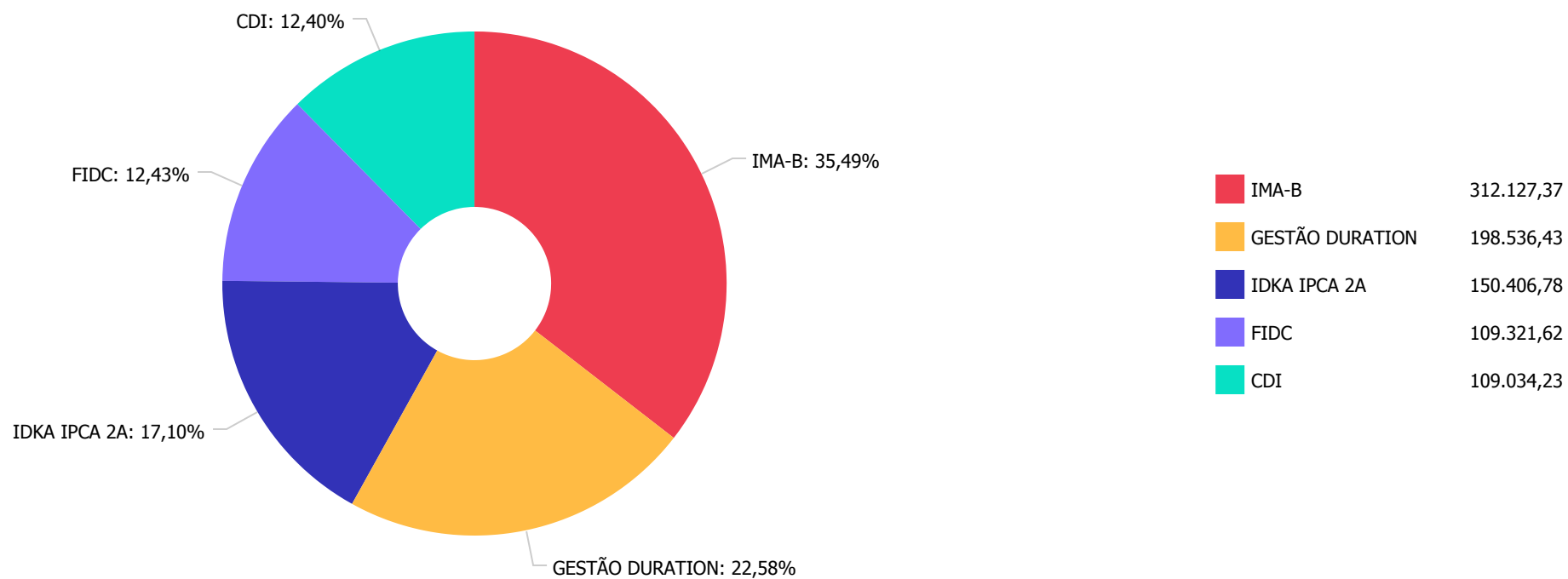
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Outubro/2020 - RENDA FIXA

	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%	-	-
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%
IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)	1,43%	8,12%	3,48%	5,53%	11,13%	21,93%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	1,00%	-4,79%	-1,48%	-2,53%	-5,37%	-2,10%	-	0,03%
IMA-B (Benchmark)	0,21%	-0,51%	-3,08%	4,81%	-1,00%	25,47%	-	-
IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	-9,63%	-74,30%	-64,14%	-69,78%	-75,08%	-72,82%	0,15%	0,52%
IPCA (Benchmark)	0,86%	2,22%	1,75%	1,99%	3,92%	6,55%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	-0,11%	4,42%	-1,16%	1,94%	4,51%	23,65%	0,01%	0,02%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	-0,12%	-	-1,05%	1,98%	-	-	0,01%	-
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%

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



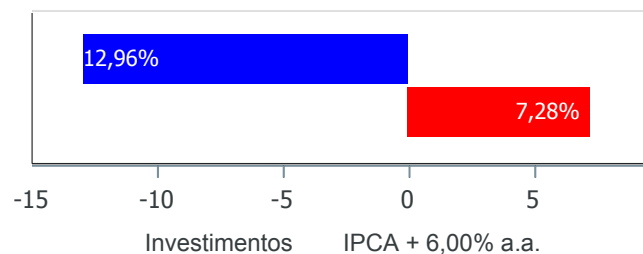
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Outubro / 2020)



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	1.329.452,09	0,00	0,00	1.319.288,87	-10.163,22	-10.163,22	-0,76%	-0,76%	0,72%	0,72%	-106,02%	3,02%
Fevereiro	1.319.288,87	0,00	0,00	1.319.972,00	683,13	-9.480,09	0,05%	-0,71%	0,67%	1,39%	-51,15%	3,97%
Março	1.319.972,00	0,00	0,00	1.123.966,91	-196.005,09	-205.485,18	-14,85%	-15,46%	0,58%	1,98%	-779,67%	43,43%
Abril	1.123.966,91	0,00	0,00	1.145.101,61	21.134,70	-184.350,48	1,88%	-13,87%	0,15%	2,14%	-648,72%	12,56%
Mai	1.145.101,61	0,00	0,00	1.144.384,54	-717,07	-185.067,55	-0,06%	-13,92%	0,08%	2,22%	-626,76%	6,58%
Junho	1.144.384,54	0,00	169.263,14	989.264,28	14.142,88	-170.924,67	1,24%	-12,86%	0,75%	2,99%	-430,62%	25,72%
Julho	989.264,28	122.398,61	140.854,15	1.003.479,02	32.670,28	-138.254,39	3,30%	-9,98%	0,90%	3,91%	-255,37%	7,55%
Agosto	1.003.479,02	671.934,53	697.212,91	950.523,80	-27.676,84	-165.931,23	-2,76%	-12,46%	0,73%	4,66%	-267,19%	3,96%
Setembro	950.523,80	274.870,14	304.624,91	915.301,04	-5.467,99	-171.399,22	-0,58%	-12,97%	1,13%	5,85%	-221,76%	14,60%
Outubro	915.301,04	120.246,33	156.136,60	879.426,43	15,66	-171.383,56	0,00%	-12,96%	1,35%	7,28%	-178,16%	6,81%

Investimentos x Meta Atuarial



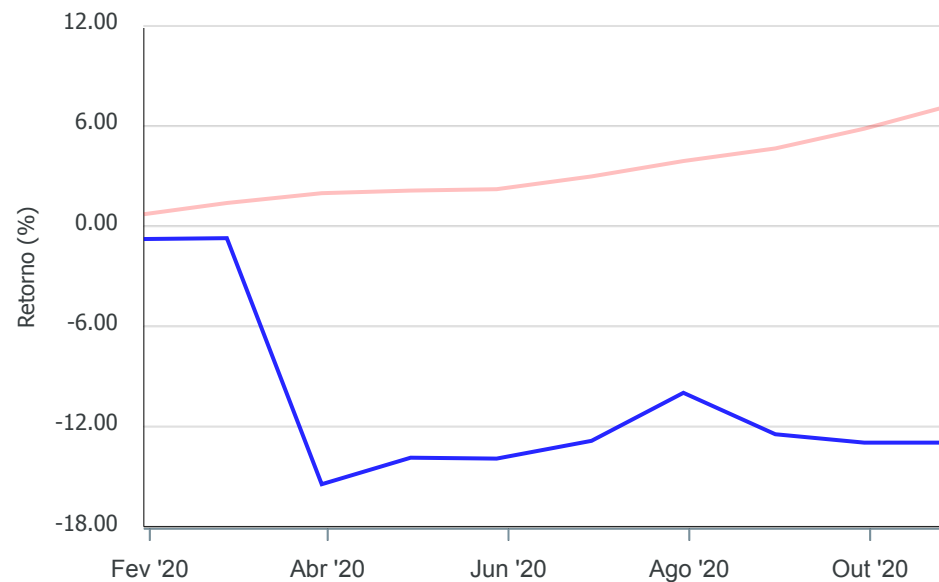
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO



- 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
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	108.240,90	0,00	0,00	109.321,62	1.080,72	1,00%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	150.177,34	0,00	0,00	150.406,78	229,44	0,15%	0,15%	1,15%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	112.750,30	120.246,33	123.976,61	109.034,23	14,21	0,01%	0,01%	0,00%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	99.437,11	0,00	0,00	99.329,90	-107,21	-0,11%	-0,11%	1,18%
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	99.322,21	0,00	0,00	99.206,53	-115,68	-0,12%	-0,12%	1,27%
IMA-B 1000 FIC RENDA FIXA LP	345.373,18	0,00	32.159,99	312.127,37	-1.085,82	-0,31%	-9,63%	15,48%
Total Renda Fixa	915.301,04	120.246,33	156.136,60	879.426,43	15,66	0,00%		6,81%