

CRÉDITO E MERCADO

Engenharia Financeira
Relatório Analítico dos Investimentos

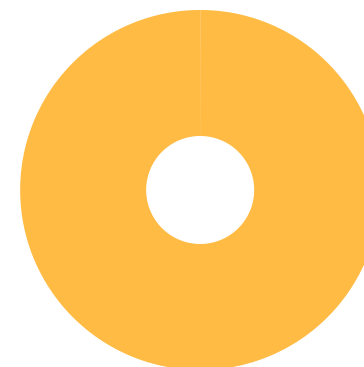
em outubro de 2020

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	2.757.828,01	18,90%	874	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIX...	D+1	Não há	1.856.211,03	12,72%	31	1,92%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	2.055.802,22	14,09%	988	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	548.693,41	3,76%	1.366	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	1.632.324,27	11,19%	263	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	2.493.279,66	17,09%	954	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	1.443.667,38	9,90%	910	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	215.642,99	1,48%	902	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	1.295.273,87	8,88%	400	0,04%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	290.599,64	1,99%	297	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
Total para cálculo dos limites da Resolução			14.589.322,48				

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

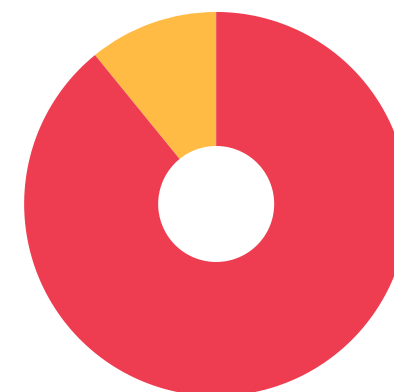
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	13.003.448,97	89,13%	20,00%	30,00%	100,00%	1.585.873,51
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	8.753.593,49
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	1.585.873,51	10,87%	7,00%	30,00%	40,00%	4.249.855,48
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	2.188.398,37
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	729.466,12
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	729.466,12
Total Renda Fixa	100,00%	14.589.322,48	100,00%	27,00%	70,00%	225,00%	



RENDA FIXA 14.589.322,48

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (REDA 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%	15,00%	20,00%	2.917.864,50
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	10,00%	1.458.932,25
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	729.466,12
Total Renda Variável	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	30,00%	35,00%	



7º I b 7º IV a

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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	9.657.119,80	66,19	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	1.856.211,03	12,72	-
BRADESCO ASSET MANAGEMENT	1.632.324,27	11,19	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	1.443.667,38	9,90	-

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 '	13.003.448,97	89,13	20,00	100,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	1.585.873,51	10,87	7,00	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 '	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 ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00

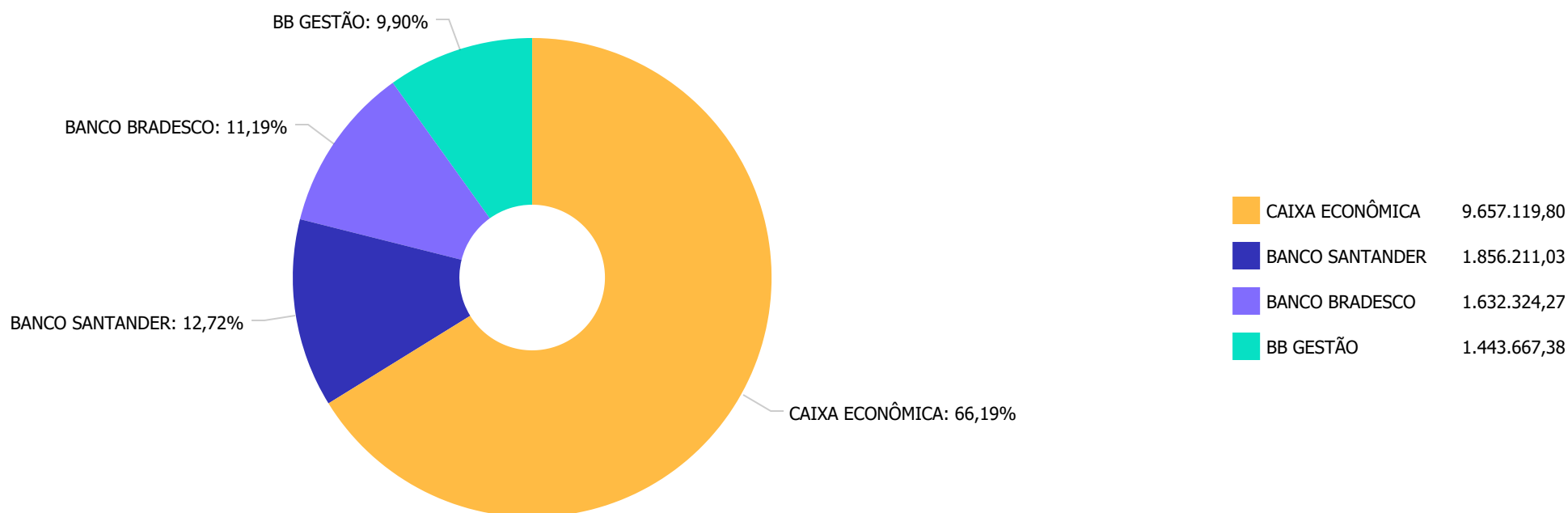
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Outubro/2020 - RENDA FIXA

	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%	-	-
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	0,13%	2,62%	0,06%	0,89%	3,31%	10,26%	0,01%	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%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,15%	2,94%	0,27%	1,15%	3,67%	10,78%	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%
IMA-B (Benchmark)	0,21%	-0,51%	-3,08%	4,81%	-1,00%	25,47%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,19%	-0,81%	-3,15%	4,68%	-1,41%	24,69%	0,02%	0,10%
CDI (Benchmark)	0,16%	2,44%	0,47%	1,12%	3,21%	9,62%	-	-
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,09%	1,73%	0,27%	0,70%	2,36%	7,80%	0,00%	0,00%
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%

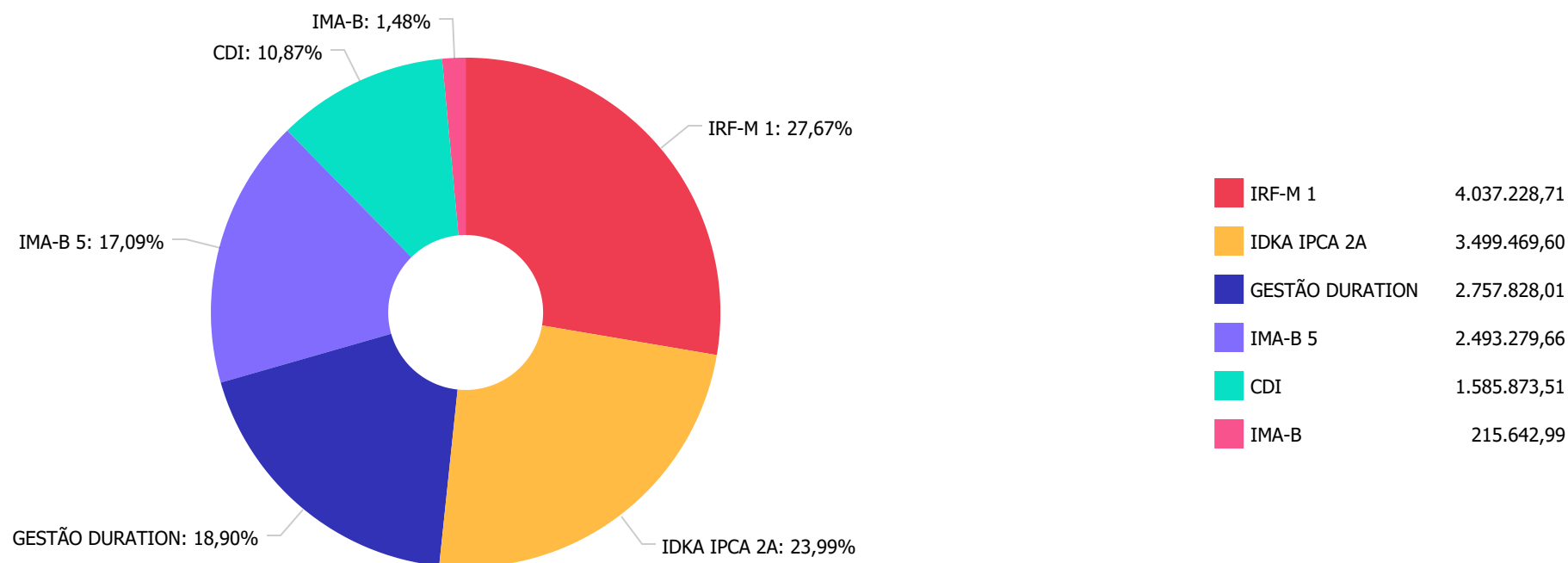
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Outubro/2020 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,12%	2,10%	0,08%	0,74%	2,82%	9,17%	0,01%	0,01%

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



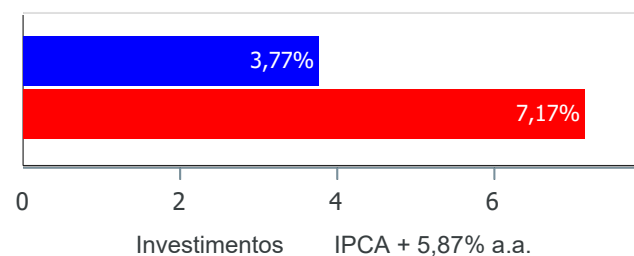
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Outubro / 2020)



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

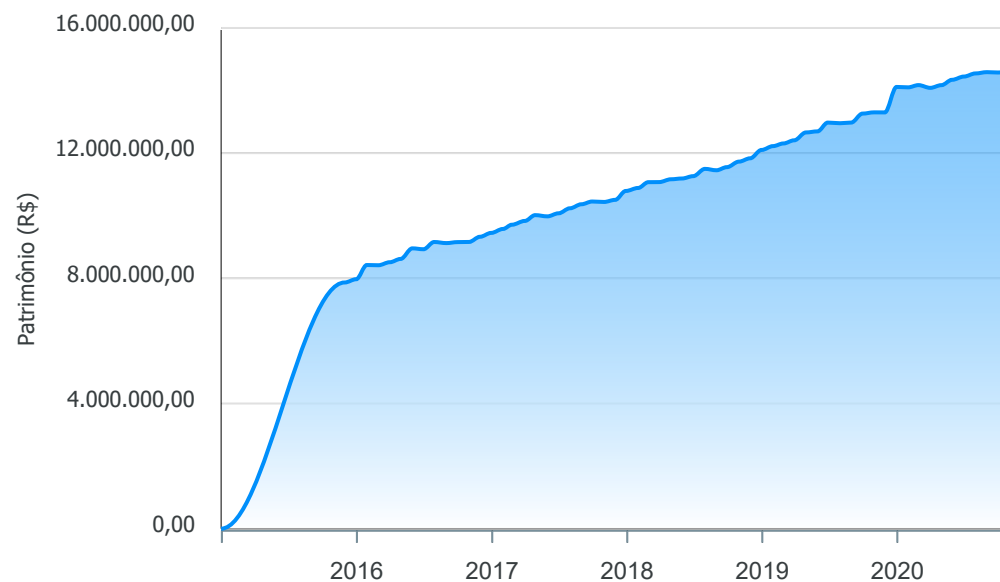
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	13.641.751,87	612.749,82	223.001,15	14.103.153,89	71.653,35	71.653,35	0,51%	0,51%	0,71%	0,71%	71,90%	0,41%
Fevereiro	14.103.153,89	138.266,63	137.799,42	14.174.712,64	71.091,54	142.744,89	0,50%	1,02%	0,66%	1,37%	74,03%	0,54%
Março	14.174.712,64	142.779,40	144.218,06	14.087.047,37	-86.226,61	56.518,28	-0,61%	0,40%	0,57%	1,95%	20,64%	4,34%
Abril	14.087.047,37	141.655,39	132.544,68	14.173.340,61	77.182,53	133.700,81	0,55%	0,95%	0,14%	2,10%	45,43%	2,41%
Maio	14.173.340,61	132.466,61	135.742,89	14.344.392,71	174.328,38	308.029,19	1,23%	2,19%	0,07%	2,17%	101,10%	0,90%
Junho	14.344.392,71	135.518,73	136.625,79	14.448.195,59	104.909,94	412.939,13	0,73%	2,94%	0,74%	2,92%	100,60%	0,64%
Julho	14.448.195,59	143.028,16	143.823,36	14.547.748,81	100.348,42	513.287,55	0,69%	3,66%	0,88%	3,83%	95,38%	0,58%
Agosto	14.547.748,81	153.700,42	134.451,92	14.588.623,93	21.626,62	534.914,17	0,15%	3,81%	0,72%	4,58%	83,22%	0,58%
Setembro	14.588.623,93	155.300,96	144.282,15	14.577.250,52	-22.392,22	512.521,95	-0,15%	3,65%	1,12%	5,75%	63,50%	1,04%
Outubro	14.577.250,52	154.755,64	159.956,61	14.589.322,48	17.272,93	529.794,88	0,12%	3,77%	1,34%	7,17%	52,66%	0,90%

Investimentos x Meta Atuarial



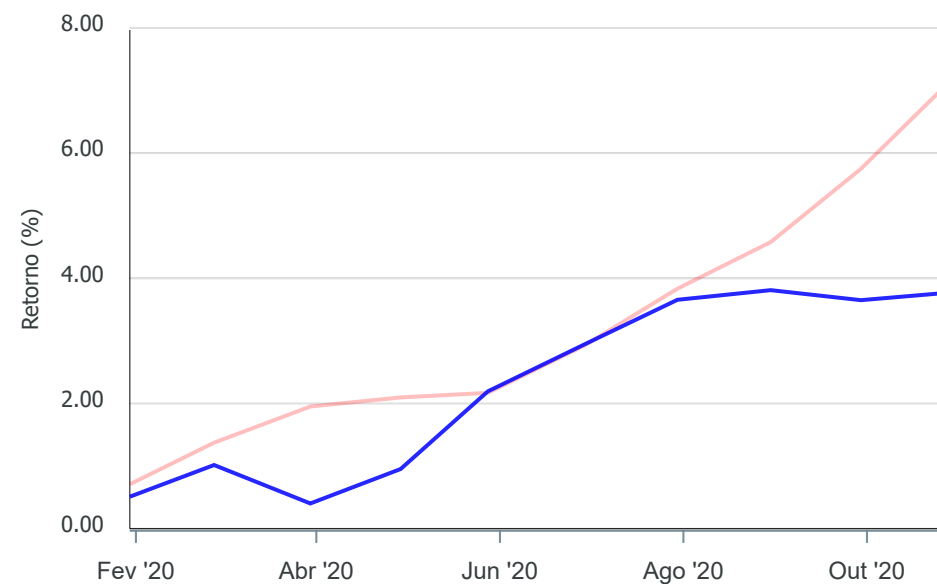
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.438.939,22	0,00	0,00	1.443.667,38	4.728,16	0,33%	0,33%	1,02%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	215.226,48	0,00	0,00	215.642,99	416,51	0,19%	0,19%	2,25%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.488.769,02	0,00	0,00	2.493.279,66	4.510,64	0,18%	0,18%	1,10%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	2.052.666,22	0,00	0,00	2.055.802,22	3.136,00	0,15%	0,15%	1,15%
BRDESCO IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	1.629.923,40	0,00	0,00	1.632.324,27	2.400,87	0,15%	0,15%	0,33%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	547.910,45	0,00	0,00	548.693,41	782,96	0,14%	0,14%	0,24%
SANTANDER IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA	1.853.770,45	0,00	0,00	1.856.211,03	2.440,58	0,13%	0,13%	0,61%
CAIXA BRASIL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	1.293.770,30	0,00	0,00	1.295.273,87	1.503,57	0,12%	0,12%	0,75%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	295.470,50	154.755,64	159.956,61	290.599,64	330,11	0,07%	0,09%	0,00%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	2.760.804,48	0,00	0,00	2.757.828,01	-2.976,47	-0,11%	-0,11%	1,18%
Total Renda Fixa	14.577.250,52	154.755,64	159.956,61	14.589.322,48	17.272,93	0,12%		0,90%