

# CRÉDITO E MERCADO

*Consultoria em Investimentos*

Relatório Analítico dos Investimentos

em outubro de 2020

**Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 2020)**

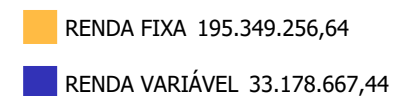
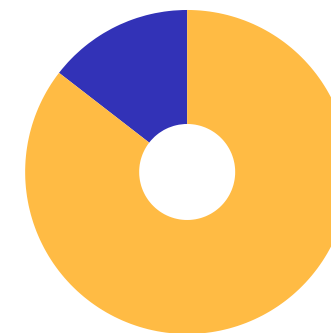
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	7.539.217,87	3,30%	590	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	24.575.698,02	10,75%	910	0,34%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	2.330.781,54	1,02%	653	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVI...	D+2	Não há	1.634.013,40	0,72%	312	0,08%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	11.244.703,20	4,92%	675	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	1.678.986,41	0,73%	1.234	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	9.221.413,57	4,04%	705	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁ...	D+0	15/08/2022	2.322.223,10	1,02%	45	1,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	D+0	Não há	2.292.559,51	1,00%	126	0,23%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	15/08/2024	7.490.961,46	3,28%	74	0,53%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	38.398.398,05	16,80%	874	0,28%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	33.607.069,24	14,71%	988	0,35%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	7.304.528,13	3,20%	954	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	3.124.505,99	1,37%	331	0,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	12.531.768,70	5,48%	902	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA...	D+0	Não há	5.662.207,20	2,48%	227	0,49%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	2.052.702,68	0,90%	1.366	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IM...	D+0	Não há	1.017.457,25	0,45%	303	0,04%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	4.185.127,18	1,83%	397	0,21%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	499.998,74	0,22%	762	0,03%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '

**Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 2020)**

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BRDESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	D+4	Não há	3.323.549,46	1,45%	193	0,25%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	D+1	Não há	5.986.890,48	2,62%	95	0,90%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	3.467.202,57	1,52%	297	0,56%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ITAU INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA F...	D+1	Não há	2.332.421,78	1,02%	276	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	1.524.871,11	0,67%	123	0,15%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	D+4	Não há	4.274.641,71	1,87%	1.618	0,48%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	D+4	Não há	8.159.959,20	3,57%	99	0,78%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	5.183.578,08	2,27%	1.678	0,60%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	D+25	Não há	2.995.720,45	1,31%	2.447	0,36%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	1.470.251,09	0,64%	196	0,33%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	4.710.869,93	2,06%	19.825	0,09%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES II FIC ...	D+2	27 meses	1.556.967,33	0,68%	723	1,55%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	4.826.679,65	2,11%	19.351	0,22%	Artigo 8º, Inciso III
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS	D+0		24.382,54	0,01%		0,00%	DF - Artigo 6º
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>228.527.924,08</b>				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			<b>24.382,54</b>				Artigo 6º
<b>PL Total</b>			<b>228.552.306,62</b>				

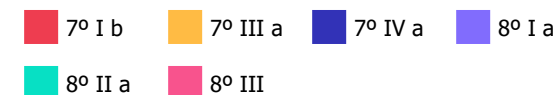
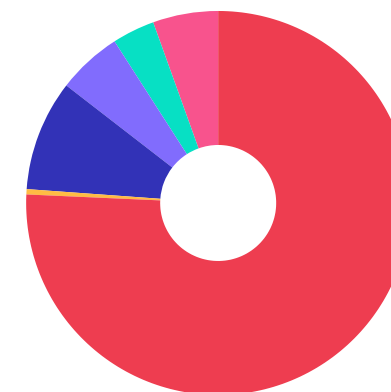
**Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Outubro / 2020)**

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	45.705.584,82
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	173.011.738,07	75,71%	20,00%	30,00%	100,00%	55.516.186,01
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	1.017.457,25	0,45%	0,00%	10,00%	60,00%	136.099.297,20
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	21.320.061,32	9,33%	1,00%	30,00%	40,00%	70.091.108,31
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	34.279.188,61
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	11.426.396,20
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	11.426.396,20
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>195.349.256,64</b>	<b>85,48%</b>	<b>21,00%</b>	<b>70,00%</b>	<b>245,00%</b>	



**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 I, Alínea ' a '	30,00%	12.434.600,91	5,44%	0,00%	0,00%	5,00%	-1.008.204,71
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	8.179.298,53	3,58%	0,00%	15,00%	20,00%	37.526.286,29
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	12.564.768,00	5,50%	0,00%	10,00%	10,00%	10.288.024,41
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	11.426.396,20
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>33.178.667,44</b>	<b>14,52%</b>	<b>0,00%</b>	<b>30,00%</b>	<b>40,00%</b>	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	142.893.888,31	62,53	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	76.160.633,91	33,33	-
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	5.616.108,97	2,46	-
ITAÚ UNIBANCO	2.332.421,78	1,02	-
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	1.524.871,11	0,67	-

**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	20,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	173.011.738,07	75,71	20,00	100,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	1.017.457,25	0,45	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	21.320.061,32	9,33	1,00	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 I, Alínea ' a '	12.434.600,91	5,44	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	8.179.298,53	3,58	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	12.564.768,00	5,50	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
<b>IDKA PRÉ 2 ANOS (Benchmark)</b>	-0,71%	5,91%	-1,53%	1,34%	6,18%	21,62%	-	-
BRDESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	-0,74%	5,66%	-1,68%	1,11%	5,80%	20,99%	1,82%	0,03%
<b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>	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%	1,15%	0,03%
<b>IMA Geral (Benchmark)</b>	0,09%	2,49%	-1,11%	2,64%	2,67%	17,87%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,03%	1,95%	-1,30%	2,19%	2,10%	16,74%	1,12%	0,04%
<b>IMA-B 5+ (Benchmark)</b>	0,22%	-4,35%	-5,92%	4,90%	-5,85%	28,98%	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,21%	-4,63%	-6,05%	4,65%	-6,05%	28,32%	3,30%	0,16%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,22%	-4,61%	-5,99%	4,76%	-6,25%	27,85%	3,31%	0,16%
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	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%	0,29%	0,01%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,14%	3,12%	0,37%	1,27%	3,86%	11,05%	0,24%	0,01%
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	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%	1,10%	0,03%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,19%	4,50%	0,40%	4,62%	5,42%	19,71%	1,12%	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
<b>IMA-B (Benchmark)</b>	0,21%	-0,51%	-3,08%	4,81%	-1,00%	25,47%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,20%	-0,73%	-3,19%	4,62%	-1,29%	24,83%	2,26%	0,10%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	0,20%	-0,79%	-3,17%	4,67%	-1,38%	24,61%	2,23%	0,10%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,19%	-0,81%	-3,15%	4,68%	-1,41%	24,69%	2,25%	0,10%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,18%	-0,33%	-3,44%	2,62%	0,16%	13,54%	1,37%	0,06%
<b>IRF-M (Benchmark)</b>	-0,33%	4,27%	-1,63%	1,64%	4,44%	19,78%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,31%	3,99%	-1,77%	1,49%	4,12%	19,16%	1,45%	0,03%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,16%	2,44%	0,47%	1,12%	3,21%	9,62%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,06%	1,48%	0,13%	0,52%	2,07%	7,24%	0,24%	0,00%
<b>IPCA (Benchmark)</b>	0,86%	2,22%	1,75%	1,99%	3,92%	6,55%	-	-
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	0,08%	2,55%	-0,28%	1,26%	3,26%	17,36%	0,34%	0,01%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	-0,11%	4,42%	-1,16%	1,94%	4,51%	23,65%	1,18%	0,02%
BRANCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	-0,28%	1,34%	-2,11%	1,64%	1,24%	16,26%	1,64%	0,04%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,07%	-	-1,99%	2,03%	-	-	1,48%	-
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	-0,12%	-	-1,05%	1,98%	-	-	1,27%	-



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

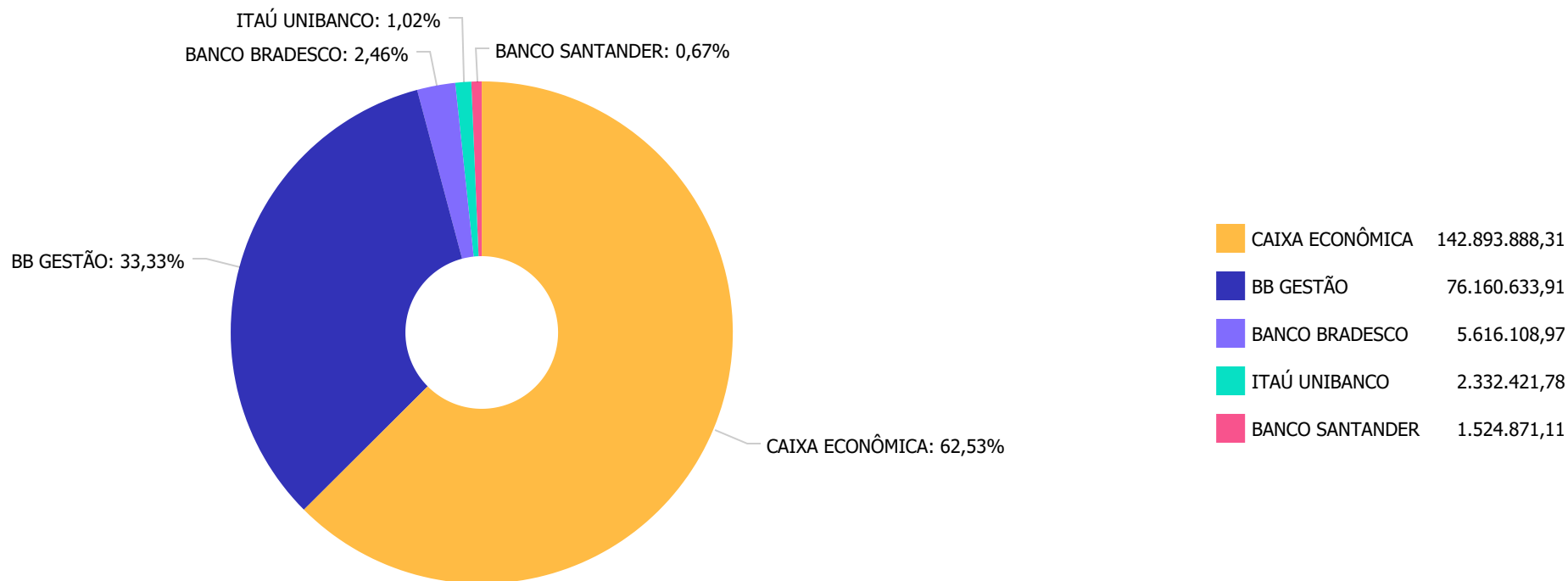
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>Não Informado (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,09%	1,73%	0,27%	0,70%	2,36%	7,80%	0,00%	0,00%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	0,00%	1,94%	-0,57%	0,78%	2,54%	18,02%	0,50%	0,01%

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>Não definido (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,33%	4,89%	1,13%	5,25%	6,32%	18,19%	1,02%	0,03%
BB TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,49%	5,75%	1,52%	5,69%	6,58%	22,96%	0,95%	0,03%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,07%	1,79%	-1,70%	2,07%	1,80%	17,32%	1,35%	0,04%

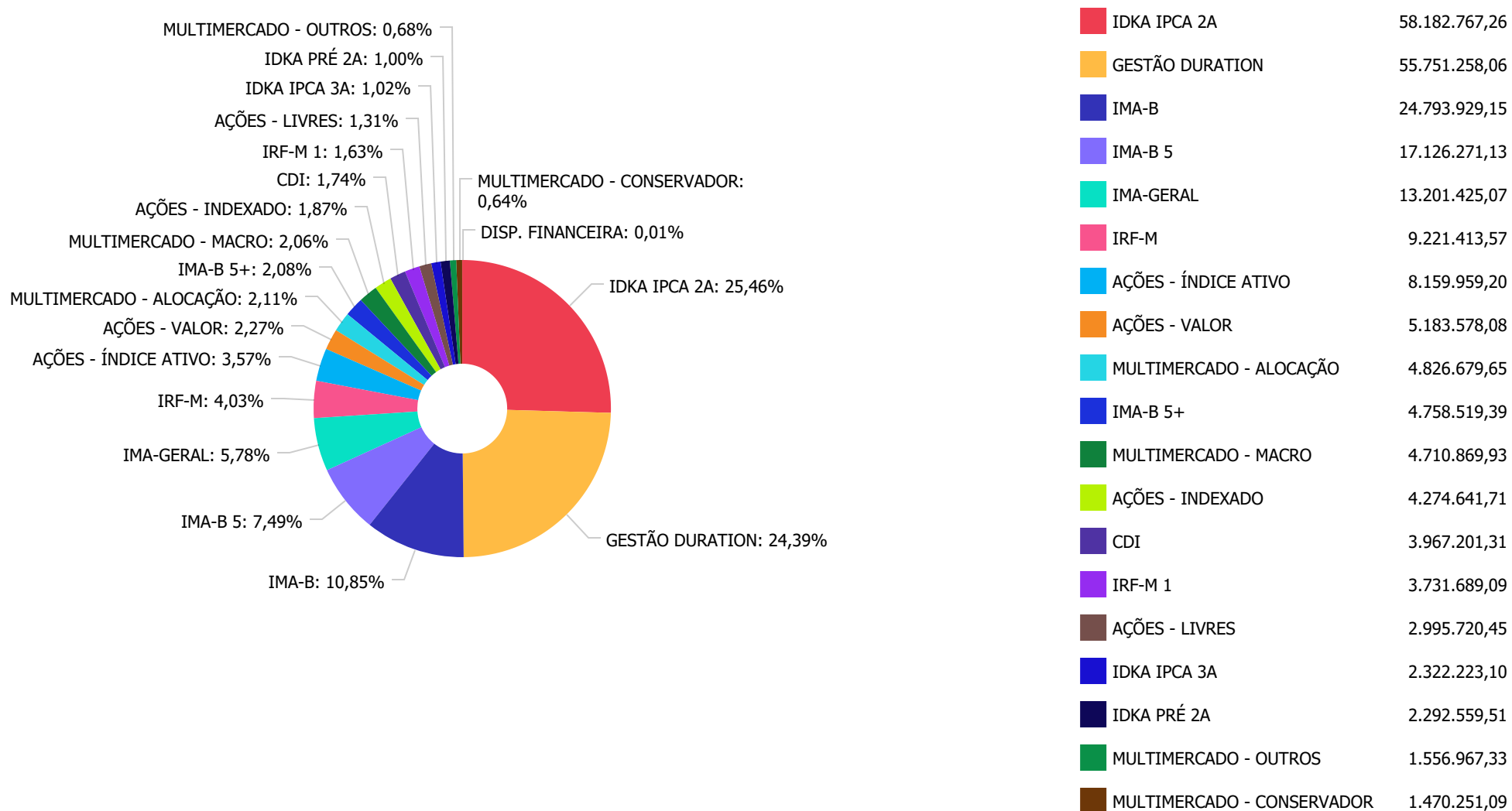
**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Outubro/2020 - RENDA VARIÁVEL**

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IBX-50 (Benchmark)</b>	-0,54%	-18,50%	-8,37%	18,20%	-12,42%	5,25%	-	-
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	-0,87%	-19,56%	-8,84%	17,74%	-12,96%	3,63%	12,57%	0,40%
<b>Ibovespa (Benchmark)</b>	-0,69%	-18,76%	-8,71%	16,70%	-12,37%	7,47%	-	-
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	2,22%	-18,17%	-6,11%	15,33%	-8,40%	20,65%	12,04%	0,36%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES II FIC MULTIMERCADO	-0,55%	2,86%	-1,73%	0,91%	3,14%	-	1,55%	0,02%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,16%	2,44%	0,47%	1,12%	3,21%	9,62%	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	-0,21%	-0,11%	-1,39%	0,00%	1,47%	10,06%	1,31%	0,02%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	-0,34%	-1,03%	-1,38%	2,71%	1,82%	18,95%	2,29%	0,07%
<b>Não Informado (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	-0,38%	-3,90%	-3,18%	4,29%	-0,68%	10,17%	3,54%	0,11%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	-1,91%	-16,48%	-10,39%	15,76%	-6,94%	-	10,01%	0,42%
<b>Não definido (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	-0,82%	-18,46%	-8,90%	16,42%	-11,42%	11,13%	11,99%	0,40%

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



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



**Retorno e Meta de Rentabilidade acumulados no ano de 2020**

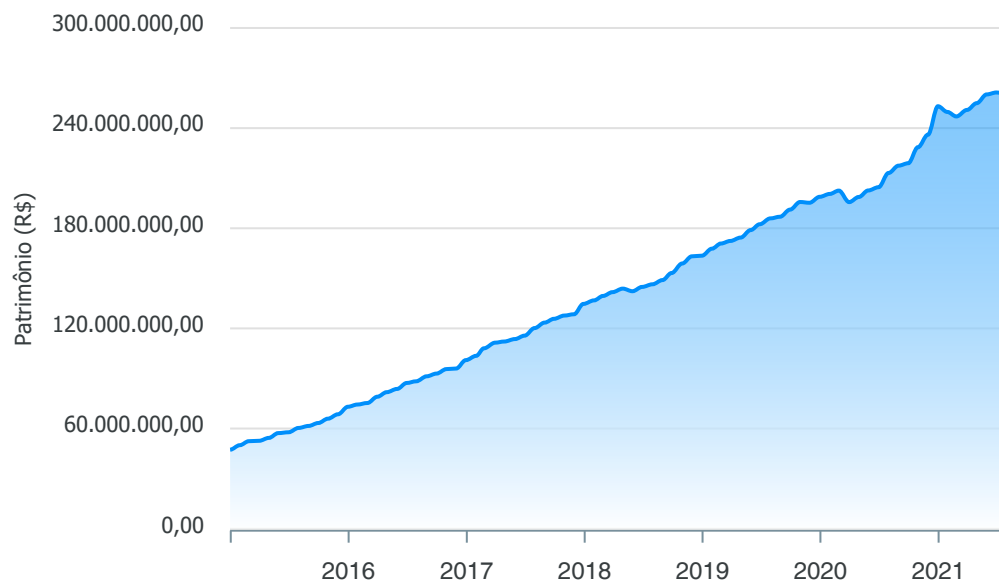
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	198.859.953,22	1.591.702,41	754.383,91	200.571.576,40	874.304,68	874.304,68	0,44%	0,44%	0,71%	0,71%	61,50%	1,25%
Fevereiro	200.571.576,40	8.226.132,40	6.056.323,21	202.557.968,84	-183.416,75	690.887,93	-0,09%	0,35%	0,66%	1,38%	25,19%	2,15%
Março	202.557.968,84	4.435.630,60	3.723.823,29	195.665.115,61	-7.604.660,54	-6.913.772,61	-3,74%	-3,41%	0,57%	1,96%	-174,16%	9,97%
Abril	195.665.115,61	3.805.087,07	3.115.870,21	198.753.405,24	2.399.072,77	-4.514.699,84	1,22%	-2,23%	0,14%	2,10%	-105,90%	5,24%
Mai	198.753.405,24	1.173.551,55	908.085,80	202.644.890,37	3.626.019,38	-888.680,46	1,82%	-0,45%	0,07%	2,18%	-20,46%	2,34%
Junho	202.644.890,37	1.778.237,91	2.849.984,09	204.598.547,80	3.025.403,61	2.136.723,15	1,49%	1,04%	0,74%	2,93%	35,48%	1,90%
Julho	204.598.547,80	21.074.896,56	16.576.795,00	213.128.206,94	4.031.557,58	6.168.280,73	1,93%	2,99%	0,89%	3,85%	77,73%	1,70%
Agosto	213.128.206,94	14.215.814,03	8.639.566,54	217.491.251,06	-1.213.203,37	4.955.077,36	-0,55%	2,42%	0,72%	4,59%	52,65%	1,78%
Setembro	217.491.251,06	8.802.881,26	5.436.501,70	218.945.151,02	-1.912.479,60	3.042.597,76	-0,87%	1,53%	1,12%	5,76%	26,55%	2,55%
Outubro	218.945.151,02	22.799.958,91	12.916.322,28	228.527.924,08	-300.863,57	2.741.734,19	-0,13%	1,40%	1,34%	7,18%	19,45%	2,36%

**Investimentos x Meta de Rentabilidade**



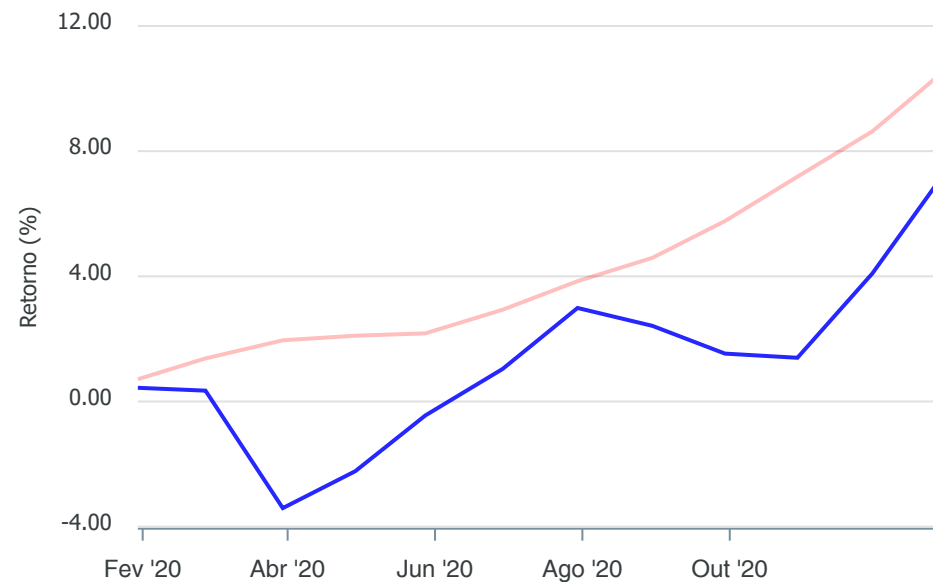
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



- Investimentos    Meta de Rentabilidade     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 TÍTULOS PÚBLICOS XI FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRI...	2.310.804,27	0,00	0,00	2.322.223,10	11.418,83	0,49%	0,49%	0,95%
BB IMA-GERAL EX-C TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA P...	249.972,12	0,00	250.973,82	0,00	1.001,70	0,40%	0,02%	1,20%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	24.495.210,04	0,00	0,00	24.575.698,02	80.487,98	0,33%	0,33%	1,02%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	3.117.714,43	0,00	0,00	3.124.505,99	6.791,56	0,22%	0,22%	3,31%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	1.630.673,58	0,00	0,00	1.634.013,40	3.339,82	0,20%	0,20%	3,30%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	11.222.728,38	0,00	0,00	11.244.703,20	21.974,82	0,20%	0,20%	2,26%
CAIXA NOVO BRASIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	1.015.472,67	0,00	0,00	1.017.457,25	1.984,58	0,20%	0,20%	2,23%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	12.507.563,38	0,00	0,00	12.531.768,70	24.205,32	0,19%	0,19%	2,25%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.291.313,37	0,00	0,00	7.304.528,13	13.214,76	0,18%	0,18%	1,10%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	8.787.943,92	8.301.828,75	499.998,74	13.883,57	0,16%	0,06%	0,24%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2.076.158,78	250.973,82	0,00	2.330.781,54	3.648,94	0,16%	0,19%	1,12%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	33.555.803,63	0,00	0,00	33.607.069,24	51.265,61	0,15%	0,15%	1,15%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.049.773,62	0,00	0,00	2.052.702,68	2.929,06	0,14%	0,14%	0,24%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.677.084,60	0,00	0,00	1.678.986,41	1.901,81	0,11%	0,11%	0,29%
ITAÚ INSTITUCIONAL ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIX...	2.330.613,18	0,00	0,00	2.332.421,78	1.808,60	0,08%	0,08%	0,34%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	3.304.389,87	2.184.744,41	2.025.306,36	3.467.202,57	3.374,65	0,06%	0,09%	0,00%
CAIXA BRASIL IMA-GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	5.660.665,62	0,00	0,00	5.662.207,20	1.541,58	0,03%	0,03%	1,12%
SANTANDER ATIVO FIC RENDA FIXA	1.524.827,11	0,00	0,00	1.524.871,11	44,00	0,00%	0,00%	0,50%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	4.188.146,35	0,00	0,00	4.185.127,18	-3.019,17	-0,07%	-0,07%	1,48%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	37.501.954,82	936.254,66	0,00	38.398.398,05	-39.811,43	-0,10%	-0,11%	1,18%

**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
CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP	5.993.871,87	0,00	0,00	5.986.890,48	-6.981,39	-0,12%	-0,12%	1,27%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.548.980,64	2.000.000,00	0,00	7.539.217,87	-9.762,77	-0,13%	-0,07%	1,35%
CAIXA BRASIL 2024 IV TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	7.504.720,45	0,00	0,00	7.490.961,46	-13.758,99	-0,18%	-0,18%	1,37%
BRADESCO ALOCAÇÃO DINÂMICA FIC RENDA FIXA	3.332.812,47	0,00	0,00	3.323.549,46	-9.263,01	-0,28%	-0,28%	1,64%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	6.950.327,03	2.301.828,75	0,00	9.221.413,57	-30.742,21	-0,33%	-0,31%	1,45%
BRADESCO IDKA PRÉ 2 FI RENDA FIXA	2.309.702,19	0,00	0,00	2.292.559,51	-17.142,68	-0,74%	-0,74%	1,82%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>189.351.284,47</b>	<b>16.461.745,56</b>	<b>10.578.108,93</b>	<b>195.349.256,64</b>	<b>114.335,54</b>	<b>0,06%</b>		<b>1,33%</b>



**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
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	3.188.581,51	2.000.000,00	0,00	5.183.578,08	-5.003,43	-0,10%	2,22%	12,04%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1.473.282,42	0,00	0,00	1.470.251,09	-3.031,33	-0,21%	-0,21%	1,31%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTI...	2.343.945,22	0,00	2.338.213,35	0,00	-5.731,87	-0,24%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	4.726.902,03	0,00	0,00	4.710.869,93	-16.032,10	-0,34%	-0,34%	2,29%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	4.844.894,37	0,00	0,00	4.826.679,65	-18.214,72	-0,38%	-0,38%	3,54%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES II FIC MU...	1.565.634,36	0,00	0,00	1.556.967,33	-8.667,03	-0,55%	-0,55%	1,55%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	6.952.176,74	1.338.213,35	0,00	8.159.959,20	-130.430,89	-1,57%	-0,87%	12,57%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	2.398.396,04	2.000.000,00	0,00	4.274.641,71	-123.754,33	-2,81%	-0,82%	11,99%
CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES	2.100.053,86	1.000.000,00	0,00	2.995.720,45	-104.333,41	-3,37%	-1,91%	10,01%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>29.593.866,55</b>	<b>6.338.213,35</b>	<b>2.338.213,35</b>	<b>33.178.667,44</b>	<b>-415.199,11</b>	<b>-1,24%</b>		<b>8,39%</b>

## Disclaimer

Este documento (caracterizado como relatório, parecer ou análise) foi preparado para uso exclusivo do destinatário, não podendo ser reproduzido ou distribuído por este a qualquer pessoa sem expressa autorização da empresa. As informações aqui contidas são somente com o objetivo de prover informações e não representa, em nenhuma hipótese, uma oferta de compra e venda ou solicitação de compra e venda de qualquer valor mobiliário ou instrumento financeiro. Trata-se apenas uma OPINIÃO que reflete o momento da análise e são consubstanciadas em informações coletadas em fontes públicas e que julgamos confiáveis.

A utilização destas informações em suas tomadas de decisão e consequentes perdas e ganhos não nos torna responsáveis diretos. As informações aqui contidas não representam garantia de exatidão das informações prestadas ou julgamento sobre a qualidade delas, e não devem ser consideradas como tais.

As informações deste documento estão em consonância com as informações sobre os produtos mencionados, entretanto não substituem seus materiais oficiais, como regulamentos, prospectos de divulgação e outros. É recomendada a leitura cuidadosa destes materiais, com especial atenção para as cláusulas relativas ao objetivo, aos riscos e à política de investimento dos produtos. Todas as informações podem ser obtidas com o responsável pela distribuição, gestão ou no site da CVM (Comissão de Valores Mobiliários).

Sua elaboração buscou atender os objetivos de investimentos do cliente, considerando a sua situação financeira e seu perfil.

A rentabilidade obtida no passado não representa garantia de rentabilidade futura e os produtos estruturados e/ou de longo prazo possuem, além da volatilidade, riscos associados à sua carteira de crédito e estruturação. Os riscos inerentes aos diversos tipos de operações com valores mobiliários de bolsa, balcão, nos mercados de liquidação futura e de derivativos, podem resultar em perdas aos investimentos realizados, bem como o inverso proporcionalmente. Todos e qualquer outro valor exibido está representado em Real (BRL) e para os cálculos, foram utilizadas observações diárias, sendo sua fonte o Sistema Quantum Axis e a CVM.

A contratação de empresa de consultoria de valores mobiliários para a emissão deste documento não assegura ou sugere a existência de garantia de resultados futuros ou a isenção de risco. Cabe a consultoria de valores mobiliários a prestação dos serviços de orientação, recomendação e aconselhamento, de forma profissional, independente e individualizada, sobre investimentos no mercado de valores mobiliários, cuja adoção e implementação sejam exclusivas do cliente.

Na apuração do cálculo de rentabilidade da carteira de investimentos são considerados os recursos descritos no art. 6º da Resolução CMN nº 3.922/2010, provenientes do recolhimento das alíquotas de contribuição dos servidores, exclusivamente com finalidade previdenciária, excluindo qualquer tipo de recurso recebidos com finalidade administrativa, em consonância com a Portaria nº 402/2008, art. 15, inciso III, alínea "a".

Os RPPS devem estar adequados às normativas pertinentes e principalmente a Portaria nº 519, de 24 de agosto de 2011 e suas alterações, além da Resolução CMN nº 3.922 de 25 de novembro de 2010 e suas alterações, que dispõem sobre as aplicações dos recursos financeiros dos Regimes Próprios de Previdência Social, instituídos pela União, Estados, Distrito Federal e Municípios e dá outras providências.