

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

Relatório Analítico dos Investimentos

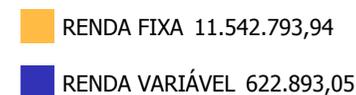
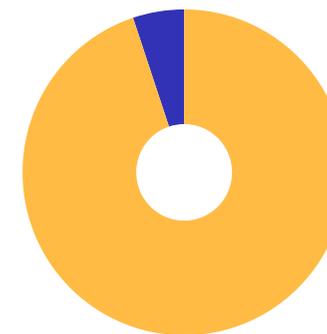
em agosto de 2020

Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 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	1.549.069,46	12,73%	852	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.058.683,40	8,70%	1.359	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.810.427,95	14,88%	932	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	1.451.658,80	11,93%	970	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	2.024.279,34	16,64%	673	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	1.968.622,68	16,18%	627	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.054,00	0,03%	755	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	D+0	Não há	680.650,58	5,59%	316	0,14%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	D+0	Não há	996.347,73	8,19%	696	0,02%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	622.893,05	5,12%	1.650	0,07%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
Total para cálculo dos limites da Resolução			12.165.686,99				

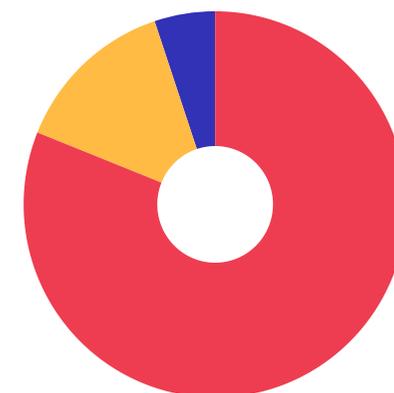
Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Agosto / 2020)

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	9.862.741,63	81,07%	20,00%	30,00%	90,00%	1.086.376,66
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	7.299.412,19
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	1.680.052,31	13,81%	10,00%	30,00%	40,00%	3.186.222,49
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	1.824.853,05
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	608.284,35
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	608.284,35
Total Renda Fixa	100,00%	11.542.793,94	94,88%	30,00%	70,00%	215,00%	



Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Agosto / 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%	0,00%	10,00%	1.216.568,70
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	622.893,05	5,12%	3,00%	13,00%	20,00%	1.810.244,35
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	10,00%	1.216.568,70
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	608.284,35
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	608.284,35
Total Renda Variável	30,00%	622.893,05	5,12%	3,00%	30,00%	50,00%	



7º I b 7º IV a 8º II a

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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	7.546.837,92	62,03	0,00
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	4.618.849,07	37,97	0,00

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 '	9.862.741,63	81,07	20,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	1.680.052,31	13,81	10,00	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 '	0,00	0,00	0,00	0,10
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	622.893,05	5,12	3,00	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

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	1,03%	5,39%	2,99%	4,11%	9,71%	23,52%	-	-
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,79%	4,80%	2,82%	3,70%	8,84%	21,88%	0,01%	0,03%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,12%	2,96%	0,64%	2,12%	5,06%	12,83%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,10%	2,83%	0,60%	2,03%	4,85%	12,44%	0,00%	0,01%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,43%	4,63%	2,55%	3,39%	9,24%	25,01%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,39%	4,45%	2,48%	3,24%	8,93%	24,43%	0,01%	0,04%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,37%	4,46%	2,43%	3,21%	8,96%	24,42%	0,01%	0,04%
IMA-B (Benchmark)	-1,80%	0,80%	4,61%	0,09%	6,64%	36,00%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,85%	0,64%	4,50%	-0,06%	6,38%	35,28%	0,02%	0,11%
CDI (Benchmark)	0,16%	2,12%	0,57%	1,43%	3,86%	10,38%	-	-
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	0,15%	1,77%	0,64%	1,12%	3,36%	9,69%	0,00%	0,00%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,08%	1,42%	0,31%	0,92%	2,78%	8,08%	0,00%	0,00%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	0,09%	1,55%	0,35%	1,01%	3,00%	8,56%	0,00%	0,00%
IPCA (Benchmark)	0,24%	0,70%	0,86%	0,24%	2,44%	5,95%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	-0,56%	5,06%	1,17%	3,57%	9,21%	27,35%	0,01%	0,03%

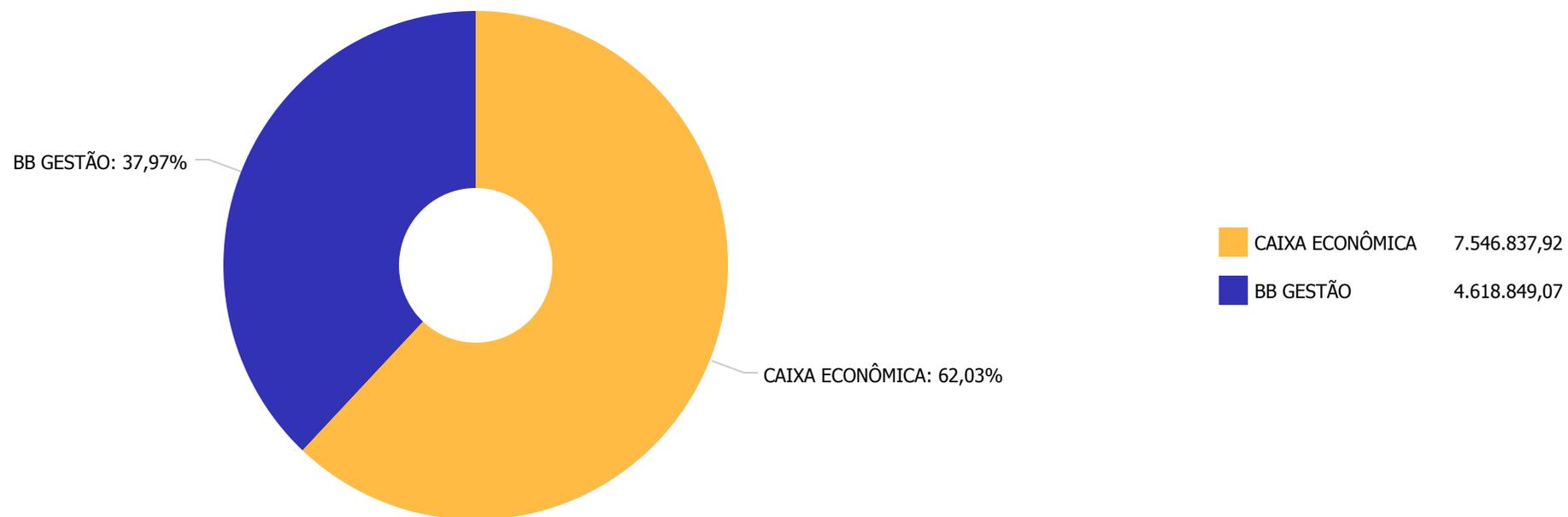
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2020 - RENDA FIXA

Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
-----	-----	----	----	-----	-----	---------	------------------

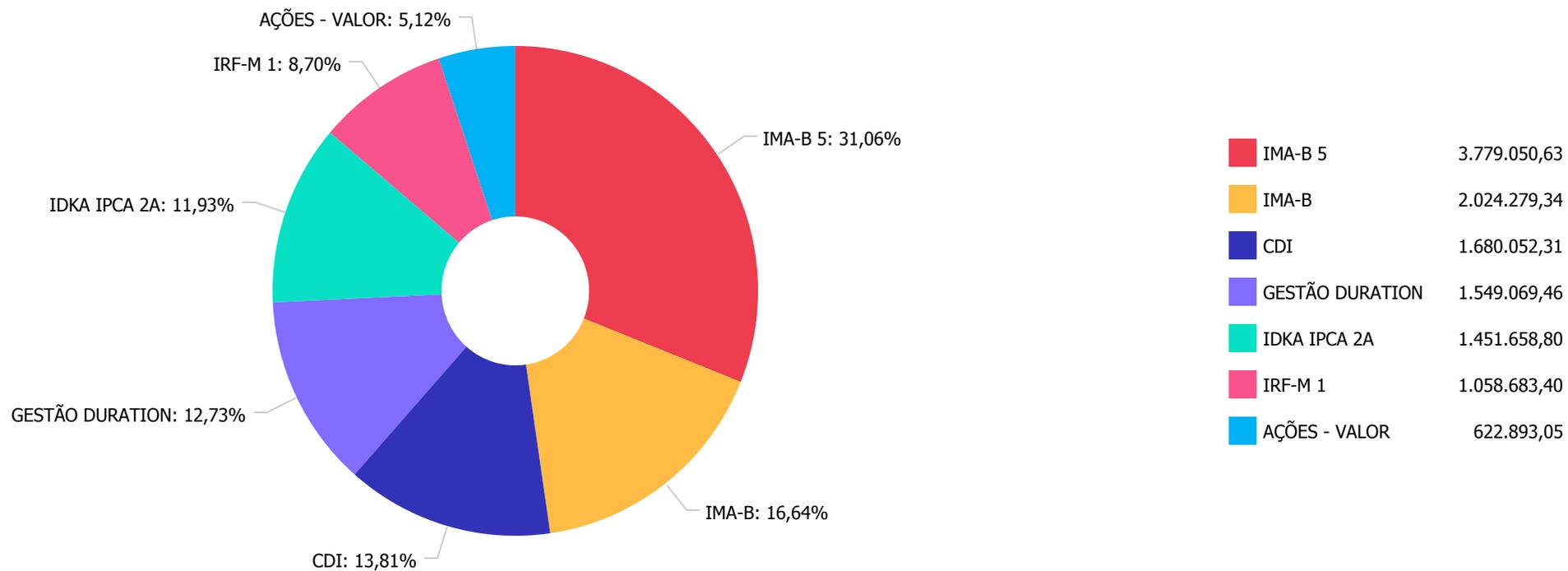
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Ibovespa (Benchmark)	-3,44%	-14,07%	13,69%	-4,61%	-1,75%	29,59%	-	-
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-3,55%	-15,94%	10,23%	-6,32%	-2,66%	48,05%	0,10%	0,35%

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



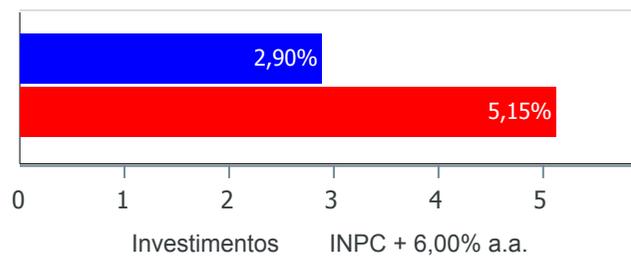
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Agosto / 2020)



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	16.862.461,14	1.808.661,56	1.612.060,90	17.123.769,40	64.707,60	64.707,60	0,38%	0,38%	0,70%	0,70%	54,11%	0,74%
Fevereiro	17.123.769,40	1.738.947,23	1.872.870,74	17.003.804,94	13.959,05	78.666,65	0,08%	0,46%	0,59%	1,29%	35,67%	1,04%
Março	17.003.804,94	2.544.287,34	653.969,84	18.584.582,52	-309.539,92	-230.873,27	-1,64%	-1,18%	0,69%	1,99%	-59,45%	4,56%
Abril	18.584.582,52	0,00	1.913.036,00	16.767.343,02	95.796,50	-135.076,77	0,52%	-0,68%	0,23%	2,23%	-30,29%	2,53%
Mai	16.767.343,02	3.806.528,05	4.692.934,70	16.122.425,34	241.488,97	106.412,20	1,44%	0,76%	0,21%	2,45%	30,86%	1,20%
Junho	16.122.425,34	2.116.456,42	3.677.737,44	14.717.513,66	156.369,34	262.781,54	0,97%	1,73%	0,79%	3,25%	53,23%	1,25%
Julho	14.717.513,66	811.480,69	1.504.171,56	14.192.122,74	167.299,95	430.081,49	1,14%	2,89%	0,98%	4,26%	67,78%	1,09%
Agosto	14.192.122,74	4.280.309,29	6.307.839,11	12.165.686,99	1.094,07	431.175,56	0,01%	2,90%	0,85%	5,15%	56,29%	1,35%

Investimentos x Meta Atuarial



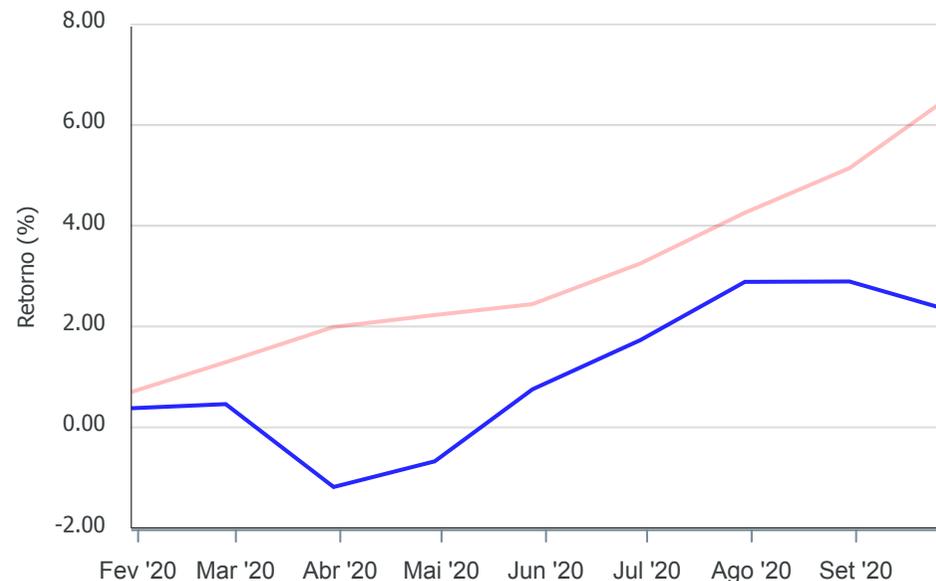
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Agosto/2020**FUNDOS DE RENDA FIXA**

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	3.131.843,66	0,00	1.700.000,00	1.451.658,80	19.815,14	0,63%	0,79%	0,77%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.251.706,12	0,00	450.000,00	1.810.427,95	8.721,83	0,39%	0,39%	0,83%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2.957.775,50	0,00	1.000.000,00	1.968.622,68	10.847,18	0,37%	0,37%	0,81%
BRADESCO PREMIUM FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	1.248.386,83	0,00	1.250.528,34	0,00	2.141,51	0,17%	0,17%	0,03%
CAIXA BRASIL FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI LP	994.905,41	0,00	0,00	996.347,73	1.442,32	0,14%	0,14%	0,03%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.057.663,02	0,00	0,00	1.058.683,40	1.020,38	0,10%	0,10%	0,15%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.051,70	0,00	0,00	3.054,00	2,30	0,08%	0,08%	0,00%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FI RENDA FIXA	857.320,69	1.730.309,29	1.907.310,77	680.650,58	331,37	0,01%	0,09%	0,00%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,00	1.550.000,00	0,00	1.549.069,46	-930,54	-0,06%	-0,56%	0,92%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.043.624,54	1.000.000,00	0,00	2.024.279,34	-19.345,20	-0,95%	-1,85%	2,27%
Total Renda Fixa	13.546.277,47	4.280.309,29	6.307.839,11	11.542.793,94	24.046,29	0,13%		0,90%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Agosto/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	645.845,27	0,00	0,00	622.893,05	-22.952,22	-3,55%	-3,55%	9,60%
Total Renda Variável	645.845,27	0,00	0,00	622.893,05	-22.952,22	-3,55%		9,60%