

Relatório Analítico dos Investimentos

em outubro de 2020

Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 2020)

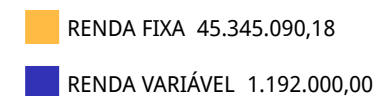
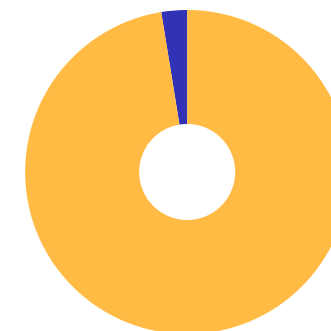
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	D+1	Não há	4.178.407,17	8,98%	23	2,17%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	705.720,71	1,52%	902	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	9.304.248,88	19,99%	36	3,40%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVI...	D+2	Não há	2.750.425,92	5,91%	312	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	1.480.949,37	3,18%	874	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	3.579.961,30	7,69%	705	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	741.873,99	1,59%	331	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	2.250.337,11	4,84%	1.234	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	2.046.504,75	4,40%	390	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	3.921.607,52	8,43%	137	0,20%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BANESTES INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	D+0	Não há	9.315.081,48	20,02%	212	3,49%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	94.442,37	0,20%	582	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BANESTES VIP DI FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	D+0	Não há	3.895.749,02	8,37%	2.136	1,20%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CUR...	D+0	Não há	752.099,80	1,62%	12.416	0,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	15.215,97	0,03%	297	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO...	D+0	Não há	167.259,25	0,36%	168.670	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	D+2	Não há	145.205,57	0,31%	398	0,08%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	1.192.000,00	2,56%		0,51%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '

Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
Total para cálculo dos limites da Resolução			46.537.090,18				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			800.983,75				Artigo 6º
		PL Total	47.338.073,93				

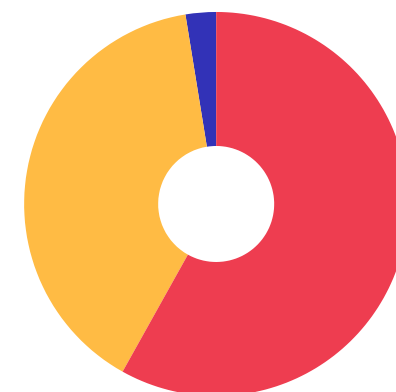
Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Outubro / 2020)

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%	5,00%	19,00%	90,00%	41.883.381,16
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	27.038.429,20	58,10%	15,00%	30,00%	90,00%	14.844.951,96
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	60,00%	27.922.254,11
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	18.306.660,98	39,34%	5,00%	13,00%	40,00%	308.175,09
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.326.854,51
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	2,00%	930.741,80
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	2.326.854,51
Total Renda Fixa	100,00%	45.345.090,18	97,44%	30,00%	73,00%	292,00%	



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 ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	10,00%	4.653.709,02
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	0,00	0,00%	6,00%	7,00%	20,00%	9.307.418,04
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	20,00%	9.307.418,04
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	5,00%	6,00%	10,00%	4.653.709,02
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	2,00%	5,00%	2.326.854,51
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	1.192.000,00	2,56%	2,00%	2,00%	5,00%	1.134.854,51
Total Renda Variável	30,00%	1.192.000,00	2,56%	15,00%	24,00%	70,00%	



7º I b 7º IV a 8º IV b

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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BANESTES DTVM	31.512.399,44	67,71	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	8.842.425,95	19,00	-
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	6.182.264,79	13,28	-

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	5,00	90,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	27.038.429,20	58,10	15,00	90,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	5,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	18.306.660,98	39,34	5,00	40,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	0,00	0,00	6,00	20,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00	5,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	2,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	1.192.000,00	2,56	2,00	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
IRF-M 1+ (Benchmark)	-0,61%	4,76%	-2,63%	1,75%	4,63%	23,41%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-0,56%	4,57%	-2,70%	1,66%	4,41%	22,74%	0,02%	0,04%
IMA-B 5+ (Benchmark)	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%	0,03%	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%	0,03%	0,16%
IRF-M 1 (Benchmark)	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%	0,00%	0,01%
BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	-0,35%	4,76%	-0,75%	1,20%	5,35%	17,23%	0,01%	0,02%
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%
BANESTES INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	0,99%	-9,64%	-7,50%	2,26%	-11,64%	20,12%	0,04%	0,18%
BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,92%	-9,01%	-7,58%	2,35%	-10,73%	23,20%	0,04%	0,18%
IRF-M (Benchmark)	-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%	0,01%	0,03%
CDI (Benchmark)	0,16%	2,44%	0,47%	1,12%	3,21%	9,62%	-	-

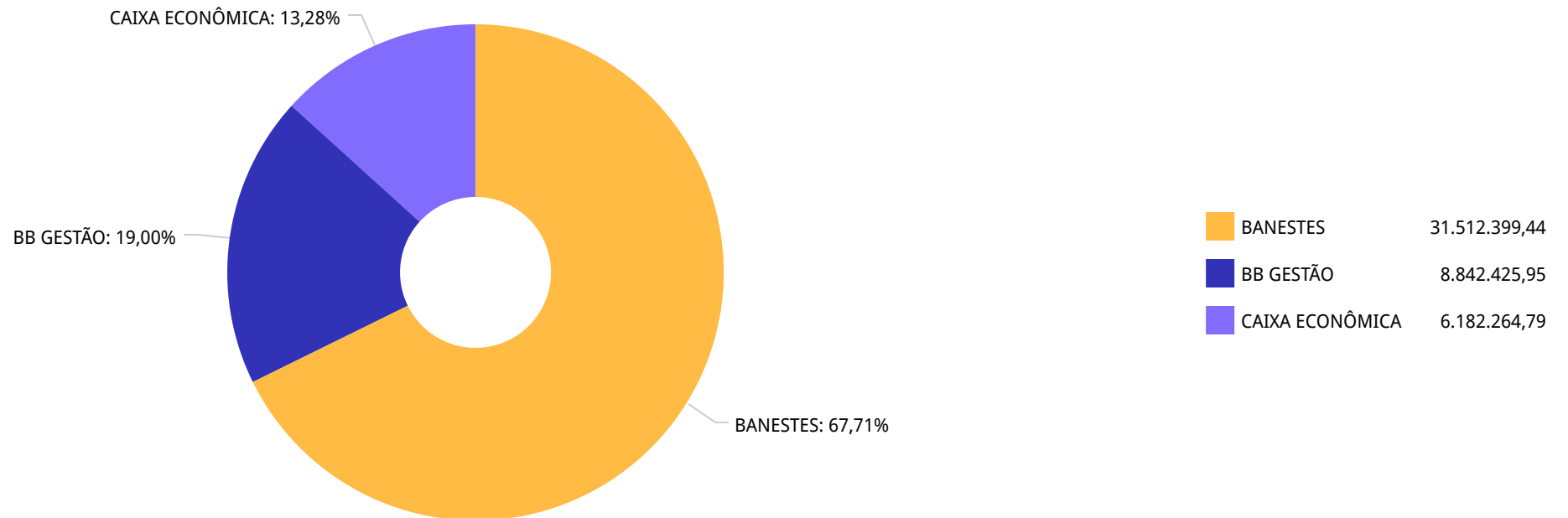
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Outubro/2020 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,16%	1,98%	0,37%	1,12%	2,69%	8,87%	0,00%	0,00%
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,01%	0,47%	0,03%	0,16%	0,74%	2,89%	0,00%	0,00%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,09%	1,73%	0,27%	0,70%	2,36%	7,80%	0,00%	0,00%
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	0,03%	-0,37%	0,58%	1,91%	0,30%	6,81%	0,00%	0,02%
BANESTES VIP DI FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	-0,02%	-0,67%	0,42%	1,75%	-0,11%	6,07%	0,00%	0,02%
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,02%	0,46%	0,06%	0,13%	0,73%	3,86%	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%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	0,17%	-1,46%	-1,98%	0,82%	-0,34%	18,19%	0,01%	0,04%

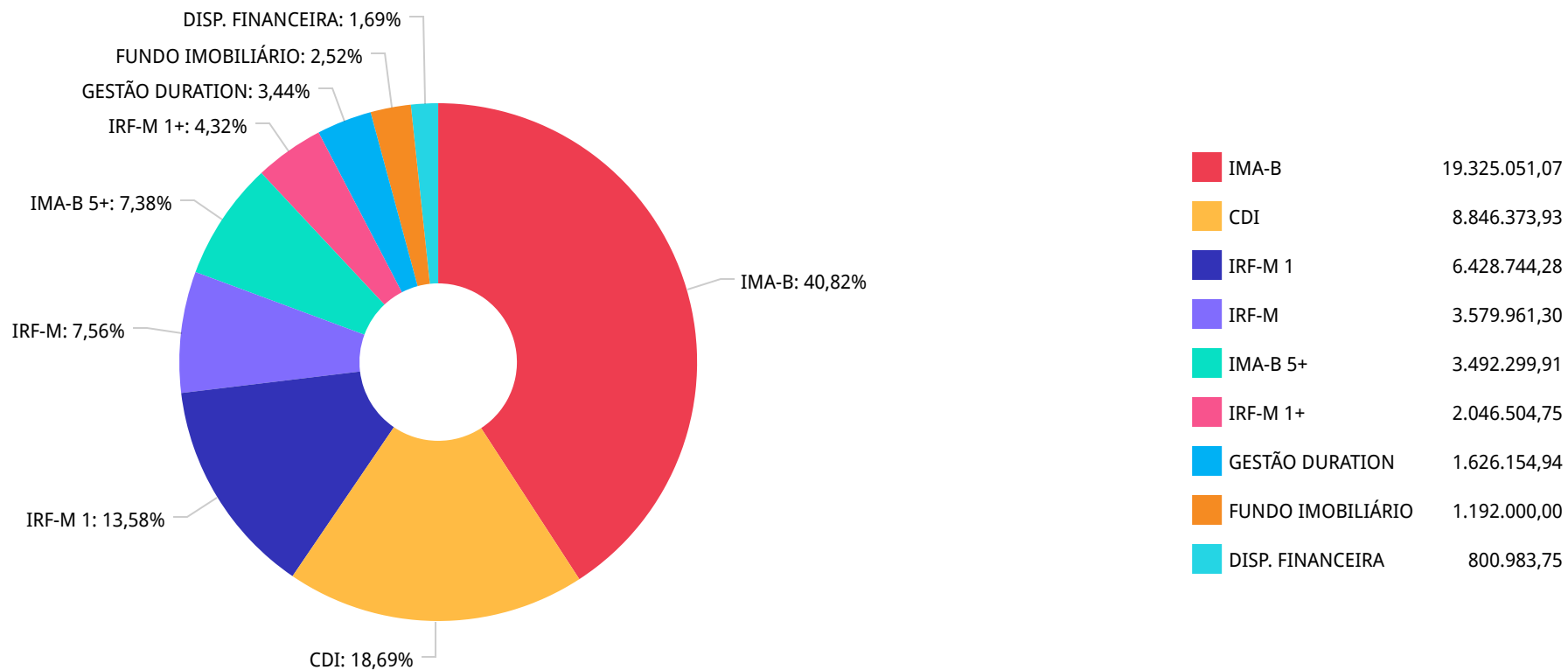
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Outubro/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	-19,46%	-90,00%	-91,39%	-88,10%	-87,52%	-84,80%	0,26%	0,55%

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



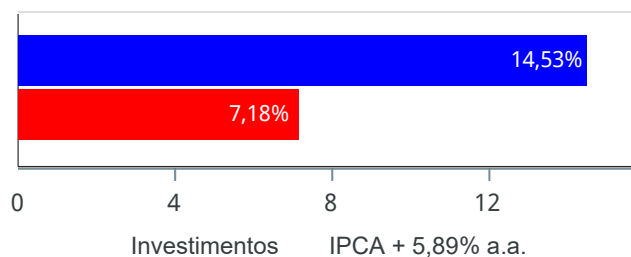
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Outubro / 2020)



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	41.708.995,45	70.282.314,89	70.910.071,28	41.350.050,74	268.811,68	268.811,68	0,64%	0,64%	0,71%	0,71%	90,53%	2,67%
Fevereiro	41.350.050,74	81.991.739,49	82.008.192,99	41.278.277,57	-55.319,67	213.492,01	-0,13%	0,51%	0,66%	1,38%	37,02%	2,29%
Março	41.278.277,57	172.538.259,16	172.631.699,95	42.808.766,55	1.623.929,77	1.837.421,78	3,93%	4,46%	0,57%	1,96%	228,18%	11,07%
Abril	42.808.766,55	33.790.585,62	33.646.457,84	43.154.591,25	201.696,92	2.039.118,70	0,47%	4,95%	0,14%	2,10%	235,59%	8,22%
Maio	43.154.591,25	3.164.640,44	3.471.122,34	43.393.860,44	545.751,09	2.584.869,79	1,26%	6,28%	0,07%	2,18%	288,41%	3,43%
Junho	43.393.860,44	161.885.061,47	162.093.888,17	44.613.929,27	1.428.895,53	4.013.765,32	3,29%	9,78%	0,74%	2,93%	333,44%	2,55%
Julho	44.613.929,27	109.691.745,07	109.716.045,24	46.810.801,26	2.221.172,16	6.234.937,48	4,98%	15,25%	0,89%	3,85%	396,54%	2,93%
Agosto	46.810.801,26	119.244.479,31	119.326.245,75	46.783.842,41	54.807,59	6.289.745,07	0,12%	15,38%	0,72%	4,59%	334,98%	2,32%
Setembro	46.783.842,41	51.332.828,68	51.524.017,55	46.340.915,46	-251.738,08	6.038.006,99	-0,54%	14,76%	1,12%	5,76%	256,07%	1,80%
Outubro	46.340.915,46	19.176.832,16	18.888.498,56	46.537.090,18	-92.158,88	5.945.848,11	-0,20%	14,53%	1,34%	7,18%	202,31%	3,06%

Investimentos x Meta Atuarial



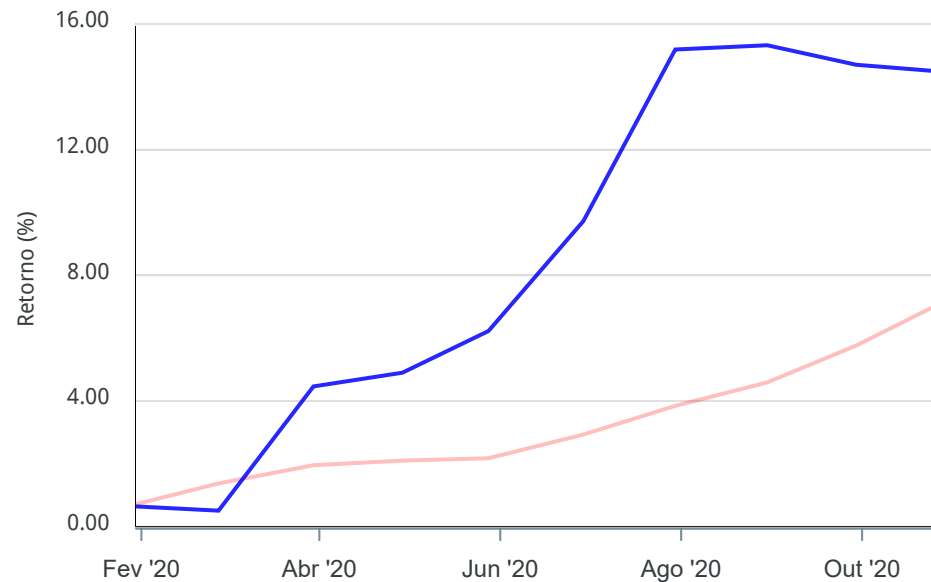
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
BANESTES INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA	1.117.087,47	8.200.000,00	120.000,00	9.315.081,48	117.994,01	1,27%	0,99%	4,28%
BANESTES IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	936.523,61	8.500.000,00	250.000,00	9.304.248,88	117.725,27	1,25%	0,92%	4,23%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	740.261,43	0,00	0,00	741.873,99	1.612,56	0,22%	0,22%	3,31%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	2.744.804,21	0,00	0,00	2.750.425,92	5.621,71	0,20%	0,20%	3,30%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	704.357,60	0,00	0,00	705.720,71	1.363,11	0,19%	0,19%	2,25%
BANESTES ESTRATÉGIA FIC RENDA FIXA	144.956,76	0,00	0,00	145.205,57	248,81	0,17%	0,17%	1,24%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	94.292,09	0,00	0,00	94.442,37	150,28	0,16%	0,16%	0,26%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	2.247.788,12	0,00	0,00	2.250.337,11	2.548,99	0,11%	0,11%	0,29%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	48.278,23	13.986,59	47.066,15	15.215,97	17,30	0,03%	0,09%	0,00%
BANESTES INVESTIDOR AUTOMÁTICO FI RENDA FIXA CURTO...	7.604.856,87	643.407,10	7.496.408,88	752.099,80	244,71	0,00%	0,02%	0,00%
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO P...	146.794,02	1.035.466,59	1.015.023,53	167.259,25	22,17	0,00%	0,01%	0,01%
BANESTES LIQUIDEZ FI RENDA FIXA REFERENCIADO DI	8.627.285,29	0,00	4.700.000,00	3.921.607,52	-5.677,77	-0,07%	0,03%	0,25%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1.632.482,79	0,00	150.000,00	1.480.949,37	-1.533,42	-0,09%	-0,11%	1,18%
BANESTES VIP DI FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI	8.964.307,65	0,00	5.060.000,00	3.895.749,02	-8.558,63	-0,10%	-0,02%	0,25%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.855.915,30	783.971,88	50.000,00	3.579.961,30	-9.925,88	-0,27%	-0,31%	1,45%
BANESTES REFERENCIAL IRF-M 1 FI RENDA FIXA	4.192.956,37	0,00	0,00	4.178.407,17	-14.549,20	-0,35%	-0,35%	1,06%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	2.058.047,65	0,00	0,00	2.046.504,75	-11.542,90	-0,56%	-0,56%	2,16%
Total Renda Fixa	44.860.995,46	19.176.832,16	18.888.498,56	45.345.090,18	195.761,12	0,43%		2,45%

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
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	1.479.920,00	0,00	0,00	1.192.000,00	-287.920,00	-19,46%	-19,46%	26,40%
Total Renda Variável	1.479.920,00	0,00	0,00	1.192.000,00	-287.920,00	-19,46%		26,40%