

Relatório Analítico dos Investimentos

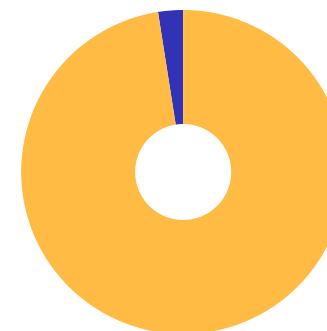
em outubro de 2020

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	6.006.846,15	17,64%	874	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	D+0	Não há	1.924.786,51	5,65%	902	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	16/08/2024	455.885,40	1,34%	17	0,21%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.309.866,15	3,85%	1.366	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	5.961.602,33	17,51%	988	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	2.014.811,24	5,92%	590	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA...	D+0	Não há	1.291.251,85	3,79%	227	0,11%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	D+0	16/08/2024	2.536.693,50	7,45%	104	0,56%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.163.466,02	3,42%	954	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BANRISUL PREVIDÊNCIA IPCA 2024 FI RENDA FIXA LP	D+0	15/08/2024	1.446.110,00	4,25%	96	1,13%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA ...	D+0	Não há	2.093.852,41	6,15%	96	1,16%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO...	D+1	Não há	2.046.351,23	6,01%	438	0,64%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
SICREDI INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIAD...	D+1	Não há	3.060.693,36	8,99%	436	0,68%	Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	1.102.843,62	3,24%	582	0,05%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BANRISUL ABSOLUTO FI RENDA FIXA LP	D+0	Não há	783.750,10	2,30%	111	0,09%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BANRISUL AÇÕES FI AÇÕES	D+4	Não há	846.030,78	2,49%	4.601	0,42%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
Total para cálculo dos limites da Resolução			34.044.840,65				

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

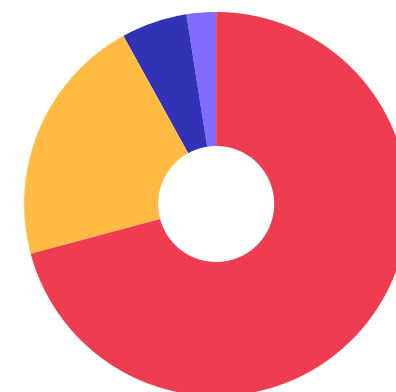
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	24.111.319,15	70,82%	20,00%	50,00%	10,00%	-20.706.835,09
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	7.200.897,00	21,15%	15,00%	30,00%	60,00%	13.226.007,39
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	1.886.593,72	5,54%	5,00%	5,00%	40,00%	11.731.342,54
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	5.106.726,10
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.702.242,03
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	5,00%	1.702.242,03
Total Renda Fixa	100,00%	33.198.809,87	97,51%	40,00%	90,00%	135,00%	



REDA FIXA 33.198.809,87
REDA VARIÁVEL 846.030,78

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 I, Alínea 'a'	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	3.404.484,07
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	846.030,78	2,49%	0,00%	5,00%	20,00%	5.962.937,35
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	5,00%	5,00%	10,00%	3.404.484,07
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.702.242,03
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.702.242,03
Total Renda Variável	30,00%	846.030,78	2,49%	5,00%	10,00%	50,00%	



■ 7º I b
 ■ 7º III a
 ■ 7º IV a
 ■ 8º II a

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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	20.650.397,91	60,66	-
BANRISUL CORRETORA	5.169.743,29	15,19	-
SICREDI	5.107.044,59	15,00	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	3.117.654,86	9,16	-

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 '	24.111.319,15	70,82	20,00	100,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	7.200.897,00	21,15	15,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	1.886.593,72	5,54	5,00	40,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	846.030,78	2,49	5,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	0,00	0,00	5,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	0,00	0,00	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 Outubro/2020 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA Geral ex-C (Benchmark)	0,00%	1,96%	-1,39%	2,13%	2,16%	17,10%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,07%	1,79%	-1,70%	2,07%	1,80%	17,32%	0,01%	0,04%
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%
IMA Geral (Benchmark)	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%	0,01%	0,04%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-...	-0,01%	1,64%	-1,43%	2,16%	1,78%	16,03%	0,01%	0,04%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,16%	3,29%	0,43%	1,38%	4,06%	11,49%	-	-
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%
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO IRF-M 1	0,15%	3,22%	0,00%	1,16%	3,87%	11,36%	0,01%	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%
SICREDI INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO IMA-B LP	-0,01%	-1,54%	-3,44%	4,39%	-2,36%	23,78%	0,02%	0,11%

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
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,18%	-0,30%	-3,41%	2,65%	0,19%	13,56%	0,01%	0,06%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	-0,19%	-0,30%	-3,41%	2,65%	0,18%	13,56%	0,01%	0,06%

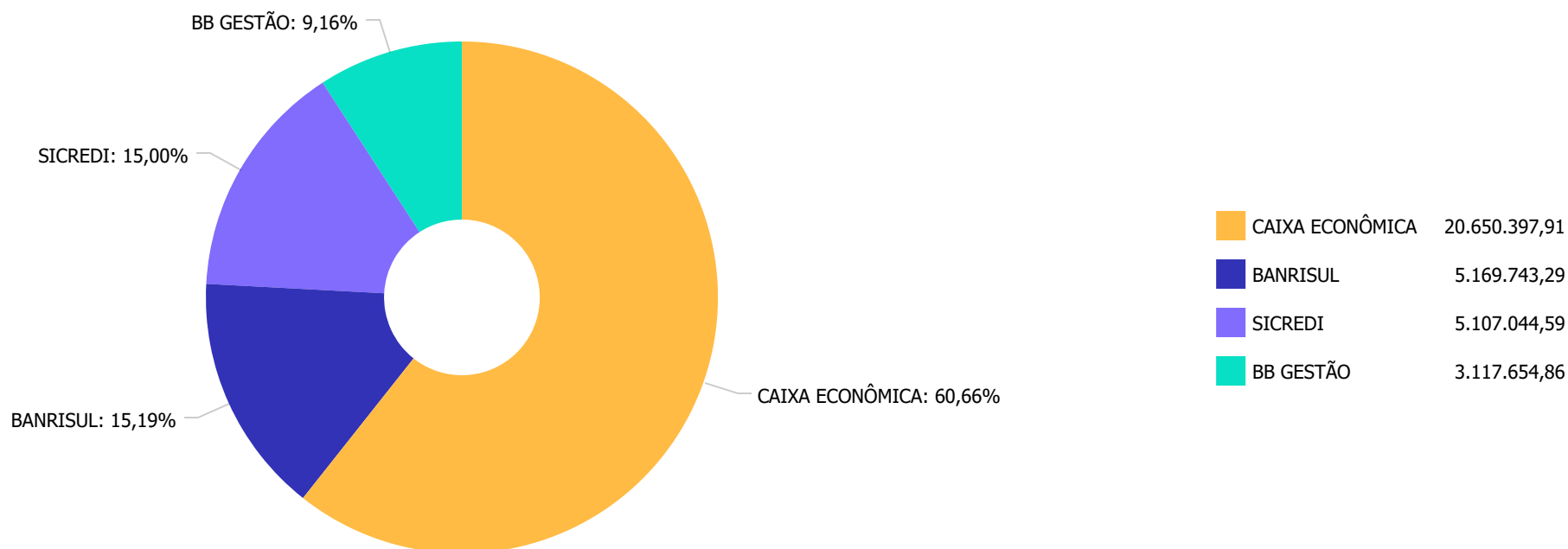
CDI (Benchmark)	0,16%	2,44%	0,47%	1,12%	3,21%	9,62%	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,16%	1,98%	0,37%	1,12%	2,69%	8,87%	0,00%	0,00%
BANRISUL ABSOLUTO FI RENDA FIXA LP	0,13%	1,90%	0,11%	0,71%	2,65%	8,84%	0,01%	0,01%

IPCA (Benchmark)	0,86%	2,22%	1,75%	1,99%	3,92%	6,55%	-	-
BANRISUL PREVIDÊNCIA IPCA 2024 FI RENDA FIXA LP	1,32%	2,04%	0,28%	1,71%	4,19%	7,40%	0,00%	0,04%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	-0,11%	4,42%	-1,16%	1,94%	4,51%	23,65%	0,01%	0,02%

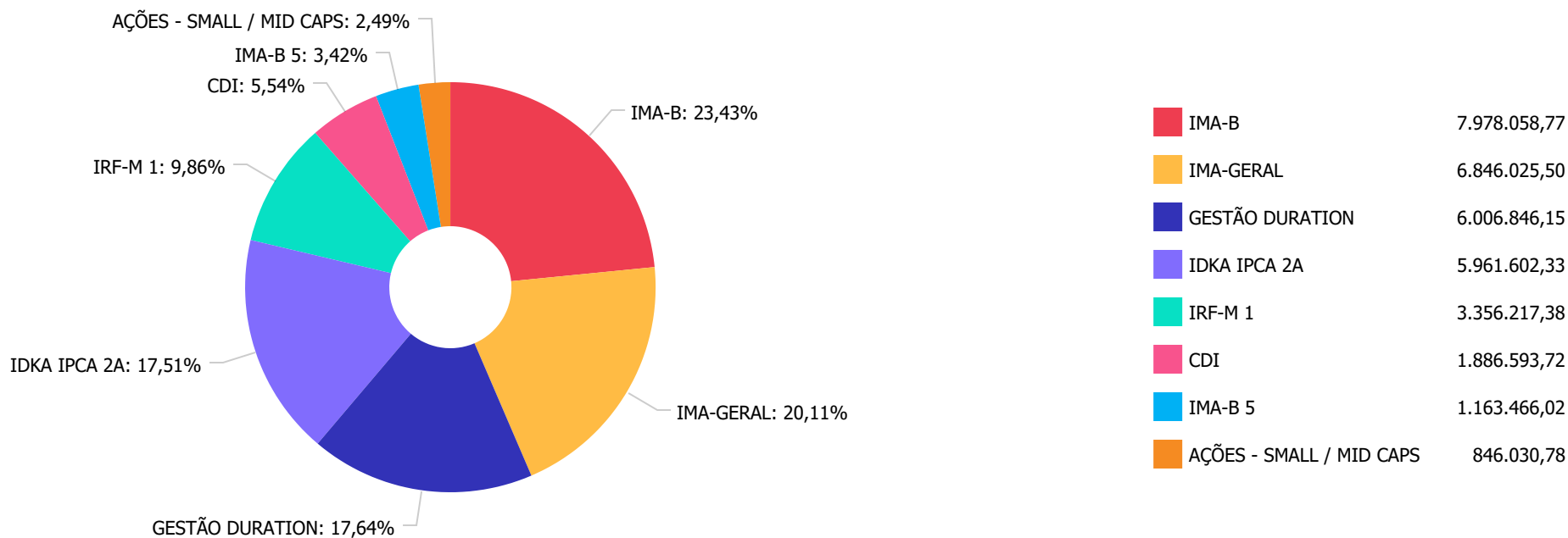
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Outubro/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
SMLL (Benchmark)	-2,28%	-20,78%	-8,74%	20,16%	-6,17%	34,08%	-	-
BANRISUL AÇÕES FI AÇÕES	-0,94%	-12,97%	-6,76%	17,98%	5,99%	58,49%	0,10%	0,43%

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



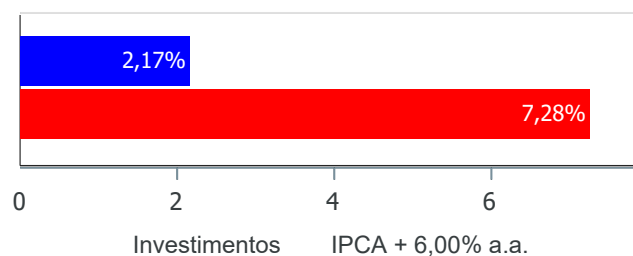
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Outubro / 2020)



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	33.462.076,05	44.215,83	148.680,36	33.543.481,70	185.870,18	185.870,18	0,56%	0,56%	0,72%	0,72%	77,03%	0,74%
Fevereiro	33.543.481,70	10.933.393,34	10.824.367,56	33.640.594,15	-11.913,33	173.956,85	-0,04%	0,52%	0,67%	1,39%	37,29%	1,97%
Março	33.640.594,15	145.050,60	156.852,36	32.678.513,90	-950.278,49	-776.321,64	-2,82%	-2,32%	0,58%	1,98%	-117,01%	8,31%
Abril	32.678.513,90	148.441,77	171.572,36	32.983.367,74	327.984,43	-448.337,21	1,00%	-1,34%	0,15%	2,14%	-62,65%	4,49%
Mai	32.983.367,74	146.195,63	165.592,36	33.464.706,89	500.735,88	52.398,67	1,52%	0,16%	0,08%	2,22%	7,14%	1,85%
Junho	33.464.706,89	171.364,99	243.945,46	33.792.702,76	400.576,34	452.975,01	1,20%	1,36%	0,75%	2,99%	45,47%	1,46%
Julho	33.792.702,76	148.110,08	168.690,38	34.350.591,37	578.468,91	1.031.443,92	1,71%	3,09%	0,90%	3,91%	79,14%	1,20%
Agosto	34.350.591,37	256.822,98	277.284,75	34.221.667,44	-108.462,16	922.981,76	-0,32%	2,77%	0,73%	4,66%	59,33%	1,20%
Setembro	34.221.667,44	108.280,19	169.432,31	33.942.222,46	-218.292,86	704.688,90	-0,64%	2,11%	1,13%	5,85%	36,12%	1,99%
Outubro	33.942.222,46	252.385,35	169.767,69	34.044.840,65	20.000,53	724.689,43	0,06%	2,17%	1,35%	7,28%	29,84%	1,44%

Investimentos x Meta Atuarial



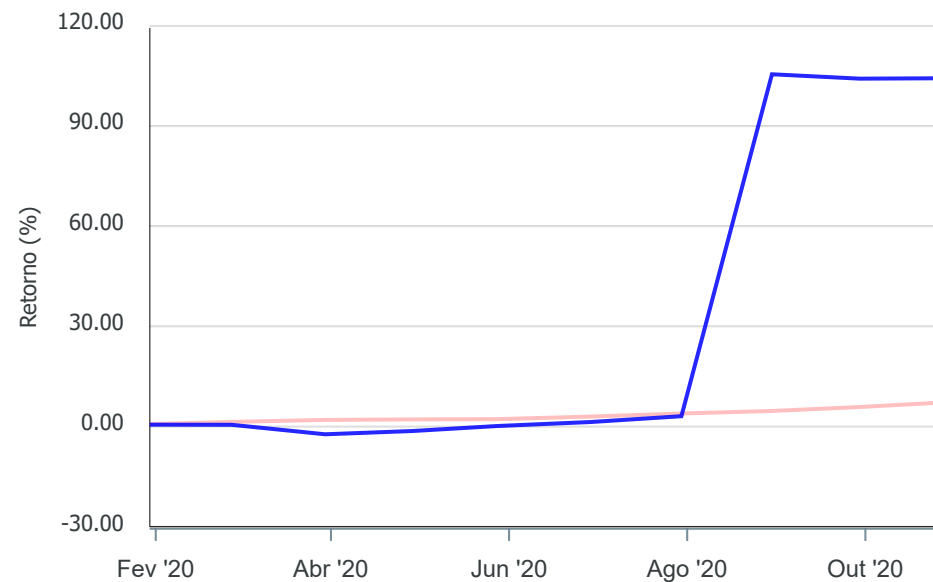
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
BANRISUL PREVIDÊNCIA IPCA 2024 FI RENDA FIXA LP	1.427.320,00	0,00	0,00	1.446.110,00	18.790,00	1,32%	1,32%	0,21%
CAIXA BRASIL IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ...	1.921.068,75	0,00	0,00	1.924.786,51	3.717,76	0,19%	0,19%	2,25%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.161.361,17	0,00	0,00	1.163.466,02	2.104,85	0,18%	0,18%	1,10%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	1.101.088,70	0,00	0,00	1.102.843,62	1.754,92	0,16%	0,16%	0,26%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	5.952.508,26	0,00	0,00	5.961.602,33	9.094,07	0,15%	0,15%	1,15%
SICREDI INSTITUCIONAL FI RENDA FIXA REFERENCIADO I...	2.043.392,60	0,00	0,00	2.046.351,23	2.958,63	0,14%	0,14%	0,77%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.306.906,53	1.090,80	0,00	1.309.866,15	1.868,82	0,14%	0,14%	0,24%
BANRISUL ABSOLUTO FI RENDA FIXA LP	782.754,46	0,00	0,00	783.750,10	995,64	0,13%	0,13%	0,54%
CAIXA BRASIL IMA GERAL TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	1.295.489,09	0,00	4.592,36	1.291.251,85	355,12	0,03%	0,03%	1,12%
BANRISUL PREVIDÊNCIA MUNICIPAL II FI RENDA FIXA RE...	2.007.774,53	251.294,55	165.175,33	2.093.852,41	-41,34	0,00%	-0,01%	1,14%
SICREDI INSTITUCIONAL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO ...	3.060.895,08	0,00	0,00	3.060.693,36	-201,72	-0,01%	-0,01%	2,29%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.016.227,38	0,00	0,00	2.014.811,24	-1.416,14	-0,07%	-0,07%	1,35%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	6.013.329,21	0,00	0,00	6.006.846,15	-6.483,06	-0,11%	-0,11%	1,18%
CAIXA BRASIL 2024 I TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	2.541.361,50	0,00	0,00	2.536.693,50	-4.668,00	-0,18%	-0,18%	1,37%
CAIXA BRASIL 2024 VI TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	456.731,40	0,00	0,00	455.885,40	-846,00	-0,19%	-0,19%	1,37%
Total Renda Fixa	33.088.208,66	252.385,35	169.767,69	33.198.809,87	27.983,55	0,08%		1,21%

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
BANRISUL AÇÕES FI AÇÕES	854.013,80	0,00	0,00	846.030,78	-7.983,02	-0,93%	-0,93%	10,49%
Total Renda Variável	854.013,80	0,00	0,00	846.030,78	-7.983,02	-0,93%		10,49%