

# Relatório Analítico dos Investimentos

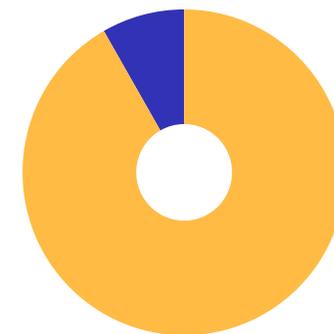
em agosto de 2020

**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 | 5.839.010,01         | 29,28%             | 852      | 0,04%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '  |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F... | D+0     | Não há     | 1.905.071,22         | 9,55%              | 932      | 0,01%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '  |
| CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | D+0     | Não há     | 1.247.176,30         | 6,25%              | 464      | 0,01%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '  |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE... | D+0     | Não há     | 2.553.915,74         | 12,81%             | 970      | 0,03%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '  |
| BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA                        | D+1     | Não há     | 806.624,13           | 4,04%              | 125      | 0,31%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '  |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F... | D+0     | Não há     | 5.940.522,10         | 29,79%             | 1.359    | 0,06%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '  |
| CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES                     | D+4     | Não há     | 676.401,02           | 3,39%              | 16.747   | 0,06%            | Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' ' |
| CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES                           | D+4     | Não há     | 463.974,83           | 2,33%              | 5.989    | 0,17%            | Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' ' |
| CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP            | D+4     | Não há     | 509.719,65           | 2,56%              | 19.855   | 0,01%            | Artigo 8º, Inciso III                |
| <b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>  |         |            | <b>19.942.415,00</b> |                    |          |                  |                                      |
| DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS                        |         |            | <b>53.485,46</b>     |                    |          |                  | Artigo 6º                            |
| <b>PL Total</b>                                     |         |            | <b>19.995.900,46</b> |                    |          |                  |                                      |

**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 ' a '   | 100,00%        | 0,00                 | 0,00%         | 0,00%                         | 0,00%         | 100,00%        | 19.942.415,00 |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   | 100,00%        | 18.292.319,50        | 91,73%        | 40,00%                        | 75,00%        | 100,00%        | 1.650.095,50  |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '   | 100,00%        | 0,00                 | 0,00%         | 0,00%                         | 1,00%         | 100,00%        | 19.942.415,00 |
| Artigo 7º, Inciso II                | 5,00%          | 0,00                 | 0,00%         | 0,00%                         | 0,00%         | 5,00%          | 997.120,75    |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' | 60,00%         | 0,00                 | 0,00%         | 0,00%                         | 1,00%         | 60,00%         | 11.965.449,00 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b ' | 60,00%         | 0,00                 | 0,00%         | 0,00%                         | 0,00%         | 60,00%         | 11.965.449,00 |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '  | 40,00%         | 0,00                 | 0,00%         | 0,00%                         | 10,00%        | 40,00%         | 7.976.966,00  |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '  | 40,00%         | 0,00                 | 0,00%         | 0,00%                         | 1,00%         | 40,00%         | 7.976.966,00  |
| Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '   | 20,00%         | 0,00                 | 0,00%         | 0,00%                         | 0,00%         | 20,00%         | 3.988.483,00  |
| Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '  | 15,00%         | 0,00                 | 0,00%         | 0,00%                         | 0,00%         | 15,00%         | 2.991.362,25  |
| Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '  | 15,00%         | 0,00                 | 0,00%         | 0,00%                         | 0,00%         | 15,00%         | 2.991.362,25  |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a ' | 5,00%          | 0,00                 | 0,00%         | 0,00%                         | 1,00%         | 5,00%          | 997.120,75    |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b ' | 5,00%          | 0,00                 | 0,00%         | 0,00%                         | 1,00%         | 5,00%          | 997.120,75    |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c ' | 5,00%          | 0,00                 | 0,00%         | 0,00%                         | 0,00%         | 5,00%          | 997.120,75    |
| <b>Total Renda Fixa</b>             | <b>100,00%</b> | <b>18.292.319,50</b> | <b>91,73%</b> | <b>40,00%</b>                 | <b>90,00%</b> | <b>570,00%</b> |               |

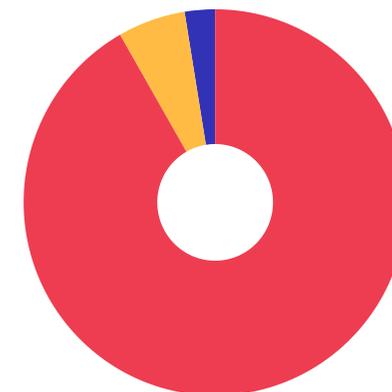


RENDA FIXA 18.292.319,50  
RENDA VARIÁVEL 1.650.095,50

**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%                         | 1,00%         | 30,00%         | 5.982.724,50 |
| Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '  | 30,00%        | 0,00                | 0,00%        | 0,00%                         | 1,00%         | 30,00%         | 5.982.724,50 |
| Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' | 20,00%        | 1.140.375,85        | 5,72%        | 0,00%                         | 3,00%         | 20,00%         | 2.848.107,15 |
| Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b ' | 20,00%        | 0,00                | 0,00%        | 0,00%                         | 1,00%         | 20,00%         | 3.988.483,00 |
| Artigo 8º, Inciso III              | 10,00%        | 509.719,65          | 2,56%        | 0,00%                         | 3,00%         | 10,00%         | 1.484.521,85 |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a ' | 5,00%         | 0,00                | 0,00%        | 0,00%                         | 0,00%         | 5,00%          | 997.120,75   |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b ' | 5,00%         | 0,00                | 0,00%        | 0,00%                         | 1,00%         | 5,00%          | 997.120,75   |
| <b>Total Renda Variável</b>        | <b>30,00%</b> | <b>1.650.095,50</b> | <b>8,27%</b> | <b>0,00%</b>                  | <b>10,00%</b> | <b>120,00%</b> |              |

| Artigos - Exterior        | Resolução     | Carteira \$ | Carteira     | Estratégia de Alocação - Limite - 2020 |              |               | GAP Superior |
|---------------------------|---------------|-------------|--------------|--|--------------|---------------|--------------|
|                           |               |             |              | Inferior                               | Alvo         | Superior      |              |
| Artigo 9º - A, Inciso I   | 10,00%        | 0,00        | 0,00%        | 0,00%                                  | 0,00%        | 10,00%        | 1.994.241,50 |
| Artigo 9º - A, Inciso II  | 10,00%        | 0,00        | 0,00%        | 0,00%                                  | 0,00%        | 10,00%        | 1.994.241,50 |
| Artigo 9º - A, Inciso III | 10,00%        | 0,00        | 0,00%        | 0,00%                                  | 0,00%        | 10,00%        | 1.994.241,50 |
| <b>Total Exterior</b>     | <b>10,00%</b> | <b>0,00</b> | <b>0,00%</b> | <b>0,00%</b>                           | <b>0,00%</b> | <b>30,00%</b> |              |



7º I b    8º II a    8º III

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

| Gestão                      | Valor         | % S/ Carteira | % S/ PL Gestão |
|-----------------------------|---------------|---------------|----------------|
| CAIXA ECONÔMICA FEDERAL     | 19.135.790,87 | 95,96         | 0,00           |
| BANCO DO NORDESTE DO BRASIL | 806.624,13    | 4,04          | 0,01           |

**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 % |                     |                     |

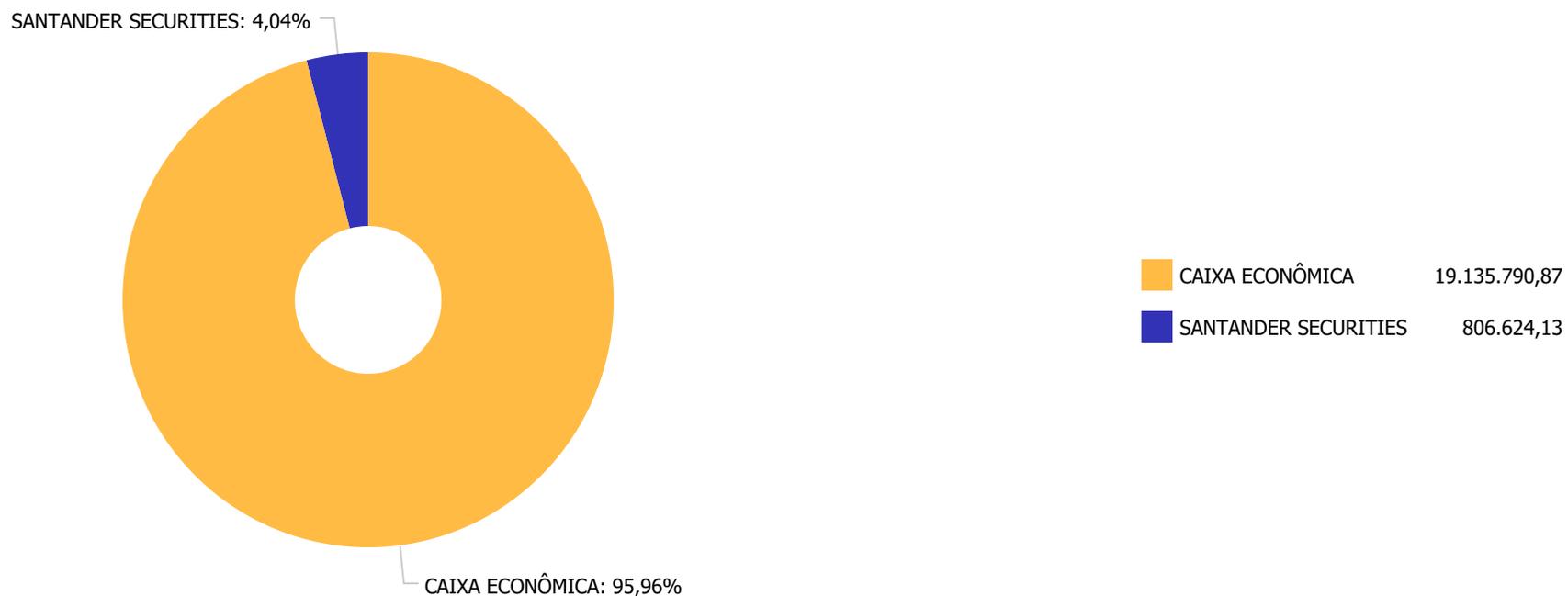
**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2020 - RENDA FIXA**

|   | Mês    | Ano   | 3M    | 6M     | 12M   | 24M    | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|---|--------|-------|-------|--------|-------|--------|---------|------------------|
| <b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>                         | 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%            |
| <b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>                                  | 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%            |
| <b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>                                  | 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%            |
| <b>IMA-B (Benchmark)</b>                                    | -1,80% | 0,80% | 4,61% | 0,09%  | 6,64% | 36,00% | -       | -                |
| BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA                                | -1,44% | 0,34% | 3,91% | -0,45% | 6,01% | 31,42% | 0,02%   | 0,10%            |
| <b>IRF-M (Benchmark)</b>                                    | -0,75% | 5,20% | 1,11% | 3,62%  | 8,70% | 26,82% | -       | -                |
| CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP        | -0,77% | 5,06% | 1,08% | 3,53%  | 8,49% | 26,36% | 0,01%   | 0,03%            |
| <b>IPCA (Benchmark)</b>                                     | 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%            |

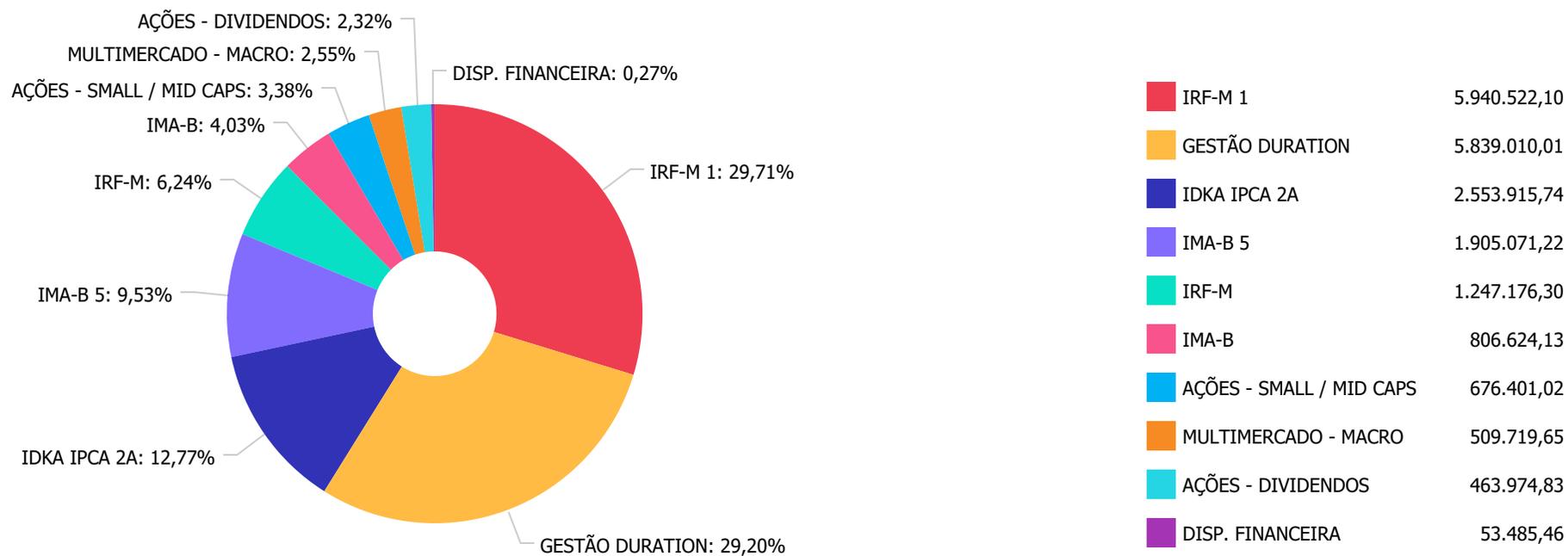
**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2020 - RENDA VARIÁVEL**

|  | Mês    | Ano     | 3M     | 6M      | 12M    | 24M    | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|--|--------|---------|--------|---------|--------|--------|---------|------------------|
| <b>SMLL (Benchmark)</b>                  | -1,23% | -14,27% | 23,76% | -6,96%  | 6,02%  | 60,17% | -       | -                |
| CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES          | -1,39% | -15,36% | 21,66% | -7,86%  | 3,92%  | 51,07% | 0,10%   | 0,45%            |
| <b>CDI (Benchmark)</b>                   | 0,16%  | 2,12%   | 0,57%  | 1,43%   | 3,86%  | 10,38% | -       | -                |
| CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP | -0,14% | 0,22%   | 2,54%  | 1,07%   | 5,57%  | 24,78% | 0,01%   | 0,07%            |
| <b>Não Informado (Benchmark)</b>         | -      | -       | -      | -       | -      | -      | -       | -                |
| CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES                | -6,01% | -22,50% | 0,60%  | -16,67% | -7,25% | 31,54% | 0,09%   | 0,36%            |

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



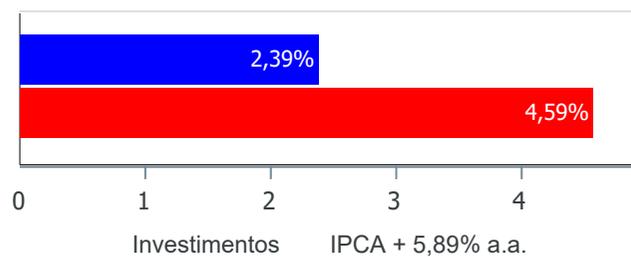
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Agosto / 2020)



**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   | 18.161.665,93  | 688.998,08   | 331.058,75   | 18.623.842,43 | 104.237,17  | 104.237,17   | 0,56%       | 0,56%        | 0,71%    | 0,71%     | 79,06%   | 0,96% |
| Fevereiro | 18.623.842,43  | 628.633,70   | 363.584,52   | 18.886.766,53 | -2.125,08   | 102.112,09   | -0,01%      | 0,55%        | 0,66%    | 1,38%     | 40,04%   | 1,99% |
| Março     | 18.886.766,53  | 1.692.375,92 | 1.303.367,05 | 18.745.028,76 | -530.746,64 | -428.634,55  | -2,75%      | -2,22%       | 0,57%    | 1,96%     | -113,33% | 7,55% |
| Abril     | 18.745.028,76  | 209.578,07   | 342.118,94   | 18.844.331,69 | 231.843,80  | -196.790,75  | 1,24%       | -1,01%       | 0,14%    | 2,10%     | -47,92%  | 4,05% |
| Mai       | 18.844.331,69  | 234.437,18   | 342.403,16   | 18.989.415,35 | 253.049,64  | 56.258,89    | 1,34%       | 0,32%        | 0,07%    | 2,18%     | 14,77%   | 1,96% |
| Junho     | 18.989.415,35  | 245.254,50   | 350.297,60   | 19.101.851,26 | 217.479,01  | 273.737,90   | 1,15%       | 1,47%        | 0,74%    | 2,93%     | 50,13%   | 1,57% |
| Julho     | 19.101.851,26  | 350.412,36   | 22.737,65    | 19.659.952,38 | 230.426,41  | 504.164,31   | 1,19%       | 2,67%        | 0,89%    | 3,85%     | 69,54%   | 1,22% |
| Agosto    | 19.659.952,38  | 690.927,30   | 352.915,35   | 19.942.415,00 | -55.549,33  | 448.614,98   | -0,28%      | 2,39%        | 0,72%    | 4,59%     | 52,02%   | 1,22% |

**Investimentos x Meta Atuarial**



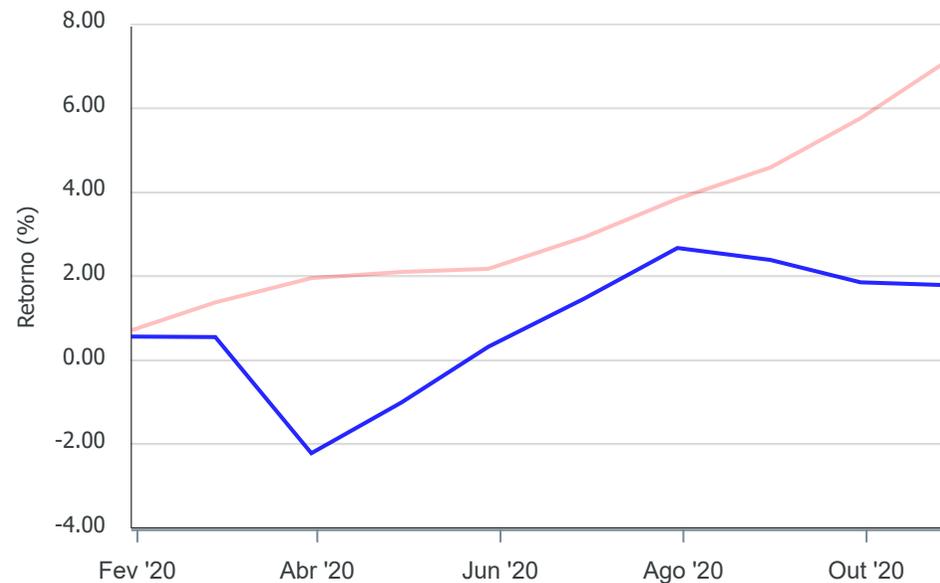
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 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... | 2.533.859,25         | 0,00              | 0,00              | 2.553.915,74         | 20.056,49         | 0,79%         | 0,79%      | 0,77%        |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 1.897.636,26         | 0,00              | 0,00              | 1.905.071,22         | 7.434,96          | 0,39%         | 0,39%      | 0,83%        |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 6.287.363,97         | 0,00              | 352.915,35        | 5.940.522,10         | 6.073,48          | 0,10%         | 0,10%      | 0,15%        |
| CAIXA BRASIL IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA ... | 561.011,86           | 690.927,30        | 0,00              | 1.247.176,30         | -4.762,86         | -0,38%        | -0,77%     | 1,04%        |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA         | 5.871.724,76         | 0,00              | 0,00              | 5.839.010,01         | -32.714,75        | -0,56%        | -0,56%     | 0,92%        |
| BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA                          | 818.387,05           | 0,00              | 0,00              | 806.624,13           | -11.762,92        | -1,44%        | -1,44%     | 1,87%        |
| <b>Total Renda Fixa</b>                               | <b>17.969.983,15</b> | <b>690.927,30</b> | <b>352.915,35</b> | <b>18.292.319,50</b> | <b>-15.675,60</b> | <b>-0,09%</b> |            | <b>0,69%</b> |

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    |
|--|---------------------|-------------|-------------|---------------------|-------------------|---------------|------------|--------------|
| CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP | 510.416,97          | 0,00        | 0,00        | 509.719,65          | -697,32           | -0,14%        | -0,14%     | 1,46%        |
| CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES          | 685.900,67          | 0,00        | 0,00        | 676.401,02          | -9.499,65         | -1,38%        | -1,38%     | 9,90%        |
| CAIXA DIVIDENDOS FI AÇÕES                | 493.651,59          | 0,00        | 0,00        | 463.974,83          | -29.676,76        | -6,01%        | -6,01%     | 9,22%        |
| <b>Total Renda Variável</b>              | <b>1.689.969,23</b> | <b>0,00</b> | <b>0,00</b> | <b>1.650.095,50</b> | <b>-39.873,73</b> | <b>-2,36%</b> |            | <b>7,10%</b> |