

# CRÉDITO E MERCADO

*Consultoria em Investimentos*

Relatório Analítico dos Investimentos

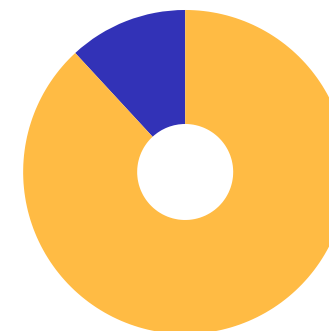
em setembro e 3º trimestre de 2020

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

| Produto / Fundo                                     | Resgate | Carência   | Saldo                | Particip. S/ Total | Cotistas | % S/ PL do Fundo | RESOLUÇÃO - 3.922                |
|-----------------------------------------------------|---------|------------|----------------------|--------------------|----------|------------------|----------------------------------|
| TÍTULOS PÚBLICOS                                    |         |            | 887.144,30           | 4,81%              |          | 0,00%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'  |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA       | D+0     | Não possui | 2.191.207,69         | 11,89%             | 868      | 0,02%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'  |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F... | D+0     | Não há     | 558.400,84           | 3,03%              | 1.361    | 0,01%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'  |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F... | D+0     | Não há     | 1.760.465,64         | 9,55%              | 953      | 0,01%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'  |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO     | D+3     | Não há     | 2.426.633,72         | 13,17%             | 597      | 0,02%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'  |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE... | D+1     | Não há     | 2.514.522,60         | 13,64%             | 903      | 0,04%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'  |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE... | D+0     | Não há     | 458.219,78           | 2,49%              | 982      | 0,00%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'  |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI... | D+0     | Não há     | 374.735,05           | 2,03%              | 1.239    | 0,01%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'  |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP         | D+1     | Não há     | 3.074.845,24         | 16,68%             | 648      | 0,07%            | Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'  |
| CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP                | D+1 du  | Não há     | 999.545,35           | 5,42%              | 89       | 0,18%            | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a' |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P... | D+3 du  | Não há     | 997.219,75           | 5,41%              | 387      | 0,05%            | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a' |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO              | D+0     | Não há     | 531,30               | 0,00%              | 755      | 0,00%            | Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a' |
| CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES                  | D+15    | Não há     | 341.455,80           | 1,85%              | 61       | 0,14%            | Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a' |
| CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES                   | D+25    | Não há     | 329.407,51           | 1,79%              | 2.486    | 0,04%            | Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a' |
| BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES                            | D+33    | Não há     | 603.992,47           | 3,28%              | 1.630    | 0,07%            | Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a' |
| BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES                          | D+3     | Não há     | 242.193,80           | 1,31%              | 42.164   | 0,02%            | Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a' |
| CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP            | D+4     | Não há     | 671.262,00           | 3,64%              | 19.995   | 0,01%            | Artigo 8º, Inciso III            |
| <b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>  |         |            | <b>18.431.782,84</b> |                    |          |                  |                                  |

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

| Artigos - Renda Fixa              | Resolução      | Carteira \$          | Carteira      | Estratégia de Alocação - 2020 |               |                | GAP Superior |
|-----------------------------------|----------------|----------------------|---------------|-------------------------------|---------------|----------------|--------------|
|                                   |                |                      |               | Inf                           | Alvo          | Sup            |              |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'   | 100,00%        | 887.144,30           | 4,81%         | 0,00%                         | 7,00%         | 10,00%         | 956.033,98   |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'   | 100,00%        | 13.359.030,56        | 72,48%        | 20,00%                        | 50,00%        | 100,00%        | 5.072.752,28 |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a' | 60,00%         | 0,00                 | 0,00%         | 0,00%                         | 3,00%         | 40,00%         | 7.372.713,14 |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'  | 40,00%         | 1.997.296,40         | 10,84%        | 0,00%                         | 10,00%        | 40,00%         | 5.375.416,74 |
| Artigo 7º, Inciso VI, Alínea 'a'  | 15,00%         | 0,00                 | 0,00%         | 0,00%                         | 0,00%         | 10,00%         | 1.843.178,28 |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b' | 5,00%          | 0,00                 | 0,00%         | 0,00%                         | 0,00%         | 5,00%          | 921.589,14   |
| Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'c' | 5,00%          | 0,00                 | 0,00%         | 0,00%                         | 0,00%         | 5,00%          | 921.589,14   |
| <b>Total Renda Fixa</b>           | <b>100,00%</b> | <b>16.243.471,26</b> | <b>88,13%</b> | <b>20,00%</b>                 | <b>70,00%</b> | <b>210,00%</b> |              |



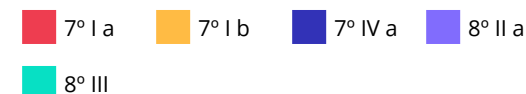
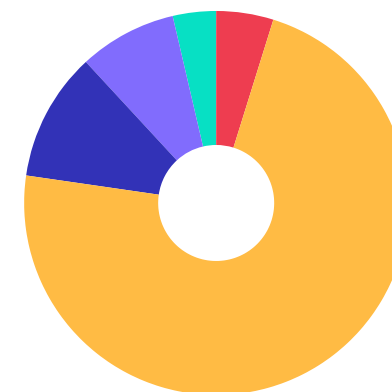
RENTA FIXA 16.243.471,26

RENTA VARIÁVEL 2.188.311,58

**Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Setembro / 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%                         | 5,00%         | 10,00%        | 1.843.178,28 |
| Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a' | 20,00%        | 1.517.049,58        | 8,23%         | 0,00%                         | 15,00%        | 20,00%        | 2.169.306,99 |
| Artigo 8º, Inciso III            | 10,00%        | 671.262,00          | 3,64%         | 0,00%                         | 10,00%        | 10,00%        | 1.171.916,28 |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a' | 5,00%         | 0,00                | 0,00%         | 0,00%                         | 0,00%         | 2,50%         | 460.794,57   |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b' | 5,00%         | 0,00                | 0,00%         | 0,00%                         | 0,00%         | 2,50%         | 460.794,57   |
| <b>Total Renda Variável</b>      | <b>30,00%</b> | <b>2.188.311,58</b> | <b>11,87%</b> | <b>0,00%</b>                  | <b>30,00%</b> | <b>45,00%</b> |              |

| Artigos - Exterior        | Resolução     | Carteira \$ | Carteira     | Estratégia de Alocação - Limite - 2020 |              |              | GAP Superior |
|---------------------------|---------------|-------------|--------------|----------------------------------------|--------------|--------------|--------------|
|                           |               |             |              | Inferior                               | Alvo         | Superior     |              |
| Artigo 9º - A, Inciso III | 10,00%        | 0,00        | 0,00%        | 0,00%                                  | 0,00%        | 1,00%        | 184.317,83   |
| <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>1,00%</b> |              |



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

| Gestão                            | Valor         | % S/ Carteira | % S/ PL Gestão |
|-----------------------------------|---------------|---------------|----------------|
| BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM        | 10.234.673,93 | 55,53         | 0,00           |
| CAIXA ECONÔMICA FEDERAL           | 7.309.964,61  | 39,66         | 0,00           |
| TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL... | 887.144,30    | 4,81          | -              |

**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 '   | 887.144,30                    | 4,81       | 0,00                | 10,00               |
| Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '   | 13.359.030,56                 | 72,48      | 20,00               | 100,00              |
| Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a ' | 0,00                          | 0,00       | 0,00                | 40,00               |
| Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '  | 1.997.296,40                  | 10,84      | 0,00                | 40,00               |
| Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '  | 0,00                          | 0,00       | 0,00                | 10,00               |
| 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                | 10,00               |
| Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '  | 1.517.049,58                  | 8,23       | 3,00                | 20,00               |
| Artigo 8º, Inciso III               | 671.262,00                    | 3,64       | 0,00                | 10,00               |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '  | 0,00                          | 0,00       | 0,00                | 2,50                |
| Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '  | 0,00                          | 0,00       | 0,00                | 2,50                |
| Artigo 9º - A, Inciso III           | 0,00                          | 0,00       | 0,00                | 1,00                |

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

|                                                             | Mês    | Ano   | 3M     | 6M    | 12M   | 24M    | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|-------------------------------------------------------------|--------|-------|--------|-------|-------|--------|---------|------------------|
| <b>IMA Geral ex-C (Benchmark)</b>                           | -0,71% | 1,96% | 0,25%  | 2,99% | 3,90% | 21,11% | -       | -                |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO             | -0,75% | 1,86% | 0,10%  | 3,07% | 3,70% | 21,50% | 0,02%   | 0,04%            |
| <b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>                         | 0,02%  | 5,41% | 1,99%  | 5,41% | 8,00% | 21,88% | -       | -                |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO     | 0,11%  | 4,55% | 1,61%  | 5,24% | 7,28% | 20,27% | 0,01%   | 0,03%            |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP | 0,04%  | 4,84% | 1,67%  | 5,27% | 7,35% | 20,53% | 0,01%   | 0,03%            |
| <b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>                                  | 0,15%  | 3,12% | 0,51%  | 1,66% | 4,54% | 12,32% | -       | -                |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO   | 0,04%  | 2,83% | 0,36%  | 1,43% | 4,17% | 11,70% | 0,00%   | 0,01%            |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA         | 0,13%  | 2,97% | 0,47%  | 1,57% | 4,34% | 11,93% | 0,00%   | 0,01%            |
| <b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>                                  | -0,12% | 4,51% | 1,30%  | 5,11% | 7,24% | 23,75% | -       | -                |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP      | -0,16% | 4,29% | 1,21%  | 4,96% | 6,91% | 23,18% | 0,02%   | 0,04%            |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP                 | -0,15% | 4,30% | 1,18%  | 4,93% | 6,95% | 23,16% | 0,02%   | 0,04%            |
| <b>CDI (Benchmark)</b>                                      | 0,16%  | 2,28% | 0,51%  | 1,25% | 3,54% | 10,04% | -       | -                |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO                      | 0,00%  | 1,42% | 0,18%  | 0,66% | 2,40% | 7,66%  | 0,00%   | 0,00%            |
| <b>IPCA (Benchmark)</b>                                     | 0,64%  | 1,34% | 1,24%  | 0,81% | 3,14% | 6,12%  | -       | -                |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA               | -0,50% | 4,53% | -0,09% | 3,18% | 6,41% | 25,88% | 0,02%   | 0,03%            |

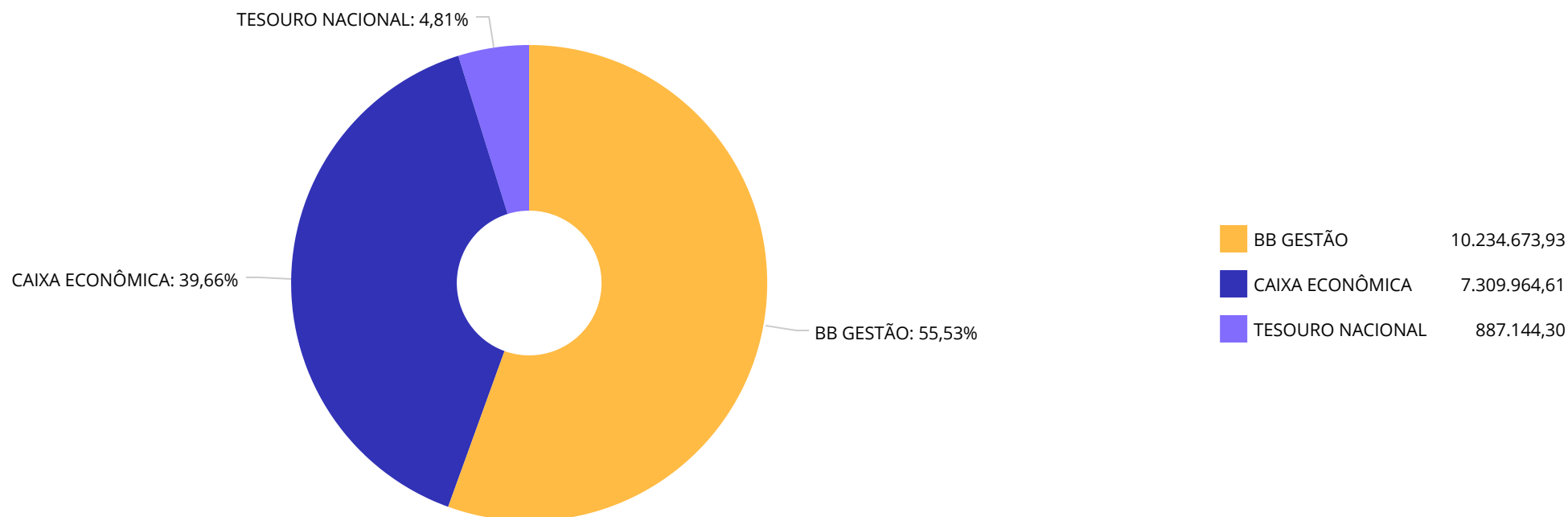
**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2020 - RENDA FIXA**

|                                                               | Mês    | Ano | 3M     | 6M    | 12M | 24M | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|---------------------------------------------------------------|--------|-----|--------|-------|-----|-----|---------|------------------|
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO | -0,88% | -   | -0,03% | 2,85% | -   | -   | 0,02%   | -                |
| CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP                          | -0,59% | -   | -0,01% | -     | -   | -   | 0,02%   | -                |

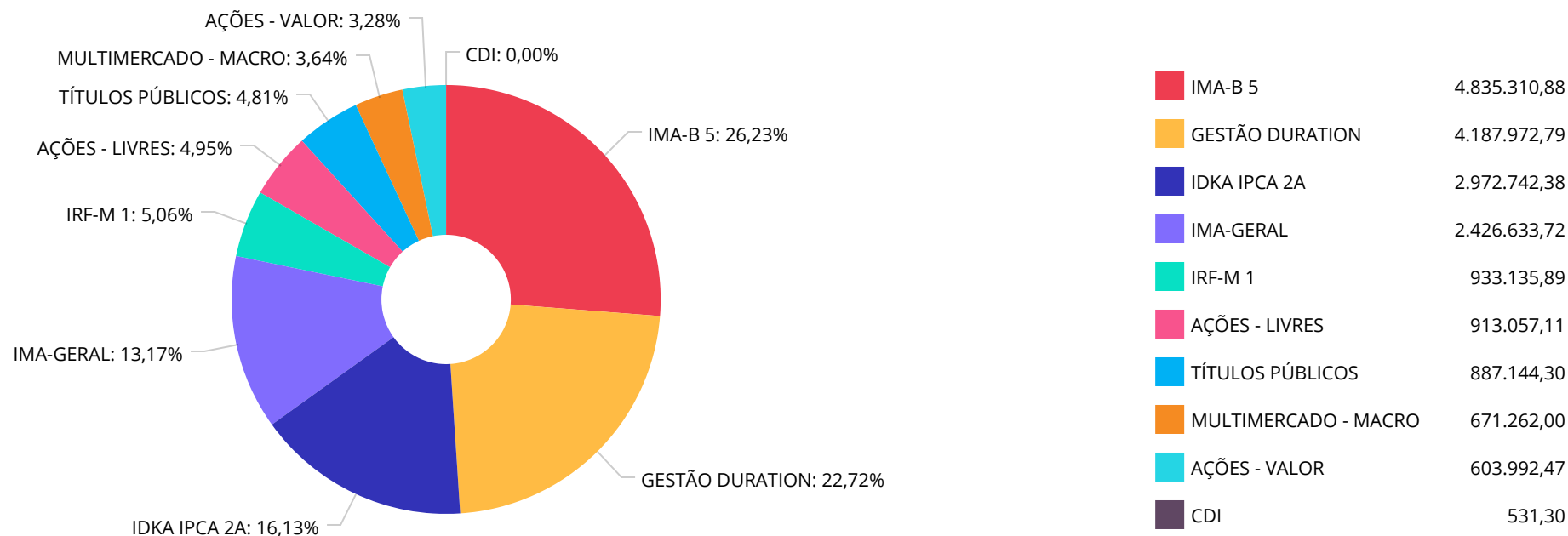
**Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2020 - RENDA VARIÁVEL**

|                                          | Mês    | Ano     | 3M     | 6M     | 12M    | 24M    | VaR Mês | Volatilidade 12M |
|------------------------------------------|--------|---------|--------|--------|--------|--------|---------|------------------|
| <b>Ibovespa (Benchmark)</b>              | -4,80% | -18,20% | -0,48% | 29,56% | -9,68% | 19,23% | -       | -                |
| BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES                 | -4,77% | -19,95% | -2,30% | 22,29% | -9,26% | 41,30% | 0,10%   | 0,36%            |
| CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES        | -5,38% | -14,86% | -0,22% | 32,93% | -2,46% | -      | 0,09%   | 0,42%            |
|                                          |        |         |        |        |        |        |         |                  |
| <b>CDI (Benchmark)</b>                   | 0,16%  | 2,28%   | 0,51%  | 1,25%  | 3,54%  | 10,04% | -       | -                |
| CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP | -0,91% | -0,69%  | 0,35%  | 5,77%  | 3,05%  | 22,65% | 0,02%   | 0,07%            |
|                                          |        |         |        |        |        |        |         |                  |
| <b>Não Informado (Benchmark)</b>         | -      | -       | -      | -      | -      | -      | -       | -                |
| BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES               | -5,40% | -19,80% | -1,40% | 22,19% | -6,82% | 28,89% | 0,12%   | 0,38%            |
| CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES       | -2,47% | -14,37% | -0,68% | 29,13% | 0,95%  | -      | 0,12%   | 0,39%            |

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



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



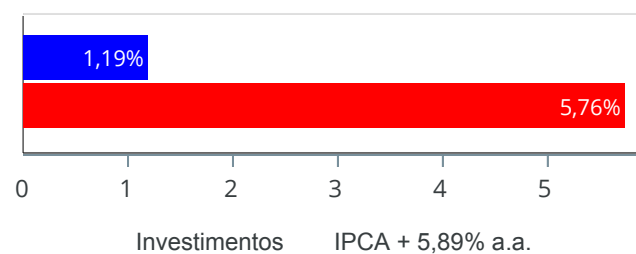
**Carteira de Títulos Públicos no mês de (Setembro / 2020)**

| Títulos Públicos                           | Vencimento | Compra     | Qtde | P.U. Compra  | P.U. Atual   | \$ Pago    | \$ Atual   | Marcação |
|--------------------------------------------|------------|------------|------|--------------|--------------|------------|------------|----------|
| NTN-F - Nota do Tesouro Nacional - Série F | 01/01/2021 | 16/07/2010 | 850  | 932,47882400 | 1.043,699177 | 792.607,00 | 887.144,30 | Mercado  |

**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   | 16.806.637,53  | 581.695,82   | 440.462,42   | 16.997.158,09 | 49.287,16   | 49.287,16    | 0,29%       | 0,29%        | 0,71%    | 0,71%     | 40,85%   | 1,39% |
| Fevereiro | 16.997.158,09  | 556.000,00   | 189.500,00   | 17.312.736,25 | -50.921,84  | -1.634,68    | -0,29%      | 0,00%        | 0,66%    | 1,38%     | -0,24%   | 2,09% |
| Março     | 17.312.736,25  | 0,00         | 15.500,00    | 16.698.287,74 | -598.948,51 | -600.583,19  | -3,46%      | -3,46%       | 0,57%    | 1,96%     | -177,00% | 9,14% |
| Abril     | 16.698.287,74  | 687.000,00   | 485.000,00   | 17.094.416,12 | 194.128,38  | -406.454,81  | 1,15%       | -2,35%       | 0,14%    | 2,10%     | -111,93% | 4,88% |
| Mai       | 17.094.416,12  | 2.166.000,00 | 1.161.000,00 | 18.447.599,89 | 348.183,77  | -58.271,04   | 1,92%       | -0,48%       | 0,07%    | 2,18%     | -21,83%  | 2,24% |
| Junho     | 18.447.599,89  | 0,00         | 15.500,00    | 18.692.430,60 | 260.330,71  | 202.059,67   | 1,41%       | 0,93%        | 0,74%    | 2,93%     | 31,67%   | 1,79% |
| Julho     | 18.692.430,60  | 2.412.000,00 | 2.571.500,00 | 18.775.894,92 | 242.964,32  | 445.023,99   | 1,30%       | 2,24%        | 0,89%    | 3,85%     | 58,28%   | 1,63% |
| Agosto    | 18.775.894,92  | 0,00         | 82.500,00    | 18.625.496,47 | -67.898,45  | 377.125,54   | -0,36%      | 1,87%        | 0,72%    | 4,59%     | 40,75%   | 1,61% |
| Setembro  | 18.625.496,47  | 0,00         | 70.000,00    | 18.431.782,84 | -123.713,63 | 253.411,91   | -0,66%      | 1,19%        | 1,12%    | 5,76%     | 20,72%   | 2,38% |

Investimentos x Meta Atuarial



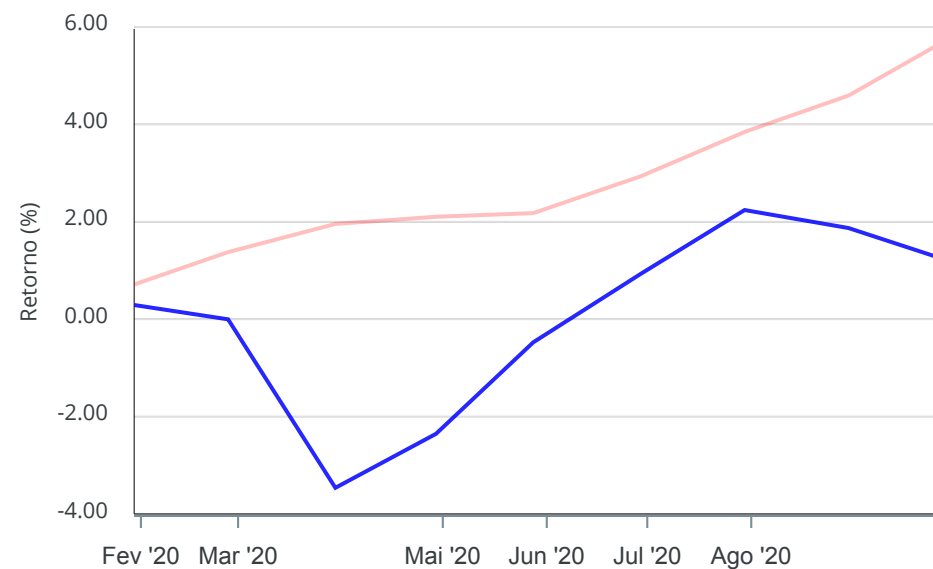
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Setembro/2020**

**FUNDOS DE RENDA FIXA**

| Ativos Renda Fixa                                     | Saldo Anterior       | Aplicações  | Resgates         | Saldo Atual          | Retorno (R\$)     | Retorno (%)   | (%) Instit | Var - Mês    |
|-------------------------------------------------------|----------------------|-------------|------------------|----------------------|-------------------|---------------|------------|--------------|
| TÍTULOS PÚBLICOS                                      | 885.545,68           | 0,00        | 0,00             | 887.144,30           | 1.598,62          | 0,18%         | -          | -            |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 557.657,32           | 0,00        | 0,00             | 558.400,84           | 743,52            | 0,13%         | 0,13%      | 0,12%        |
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC... | 2.511.656,53         | 0,00        | 0,00             | 2.514.522,60         | 2.866,07          | 0,11%         | 0,11%      | 1,35%        |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE... | 429.537,36           | 0,00        | 55.000,00        | 374.735,05           | 197,69            | 0,05%         | 0,04%      | 0,15%        |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND... | 458.051,57           | 0,00        | 0,00             | 458.219,78           | 168,21            | 0,04%         | 0,04%      | 1,38%        |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO                | 531,30               | 0,00        | 0,00             | 531,30               | 0,00              | 0,00%         | 0,00%      | 0,03%        |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP           | 3.094.501,51         | 0,00        | 15.000,00        | 3.074.845,24         | -4.656,27         | -0,15%        | -0,15%     | 1,65%        |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 1.763.274,37         | 0,00        | 0,00             | 1.760.465,64         | -2.808,73         | -0,16%        | -0,16%     | 1,65%        |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA         | 2.202.288,69         | 0,00        | 0,00             | 2.191.207,69         | -11.081,00        | -0,50%        | -0,50%     | 1,68%        |
| CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP                  | 1.005.433,23         | 0,00        | 0,00             | 999.545,35           | -5.887,88         | -0,59%        | -0,59%     | 1,65%        |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO       | 2.445.033,82         | 0,00        | 0,00             | 2.426.633,72         | -18.400,10        | -0,75%        | -0,75%     | 2,02%        |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE... | 1.006.055,96         | 0,00        | 0,00             | 997.219,75           | -8.836,21         | -0,88%        | -0,88%     | 2,33%        |
| <b>Total Renda Fixa</b>                               | <b>16.359.567,34</b> | <b>0,00</b> | <b>70.000,00</b> | <b>16.243.471,26</b> | <b>-46.096,08</b> | <b>-0,28%</b> |            | <b>1,61%</b> |

**Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Setembro/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 | 677.422,27          | 0,00        | 0,00        | 671.262,00          | -6.160,27         | -0,91%        | -0,91%     | 1,88%        |
| CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES       | 350.108,40          | 0,00        | 0,00        | 341.455,80          | -8.652,60         | -2,47%        | -2,47%     | 11,70%       |
| BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES                 | 634.248,92          | 0,00        | 0,00        | 603.992,47          | -30.256,45        | -4,77%        | -4,77%     | 9,73%        |
| CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES        | 348.128,81          | 0,00        | 0,00        | 329.407,51          | -18.721,30        | -5,38%        | -5,38%     | 9,30%        |
| BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES               | 256.020,73          | 0,00        | 0,00        | 242.193,80          | -13.826,93        | -5,40%        | -5,40%     | 11,65%       |
| <b>Total Renda Variável</b>              | <b>2.265.929,13</b> | <b>0,00</b> | <b>0,00</b> | <b>2.188.311,58</b> | <b>-77.617,55</b> | <b>-3,43%</b> |            | <b>7,78%</b> |

**Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre/2020**

**FUNDOS DE RENDA FIXA**

| Ativos Renda Fixa                                     | Saldo Anterior | Aplicações   | Resgates                | Saldo Atual  | Retorno (R\$)    | Retorno (%)  | (%) Instit |
|-------------------------------------------------------|----------------|--------------|-------------------------|--------------|------------------|--------------|------------|
| BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC... | 3.721.375,51   | 0,00         | 1.250.000,00            | 2.514.522,60 | 43.147,09        | 1,16%        | 1,61%      |
| BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP           | 3.083.433,85   | 0,00         | 45.000,00               | 3.074.845,24 | 36.411,39        | 1,18%        | 1,18%      |
| CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 1.739.457,61   | 0,00         | 0,00                    | 1.760.465,64 | 21.008,03        | 1,21%        | 1,21%      |
| CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND... | 450.717,14     | 0,00         | 0,00                    | 458.219,78   | 7.502,64         | 1,66%        | 1,66%      |
| CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX... | 805.758,07     | 0,00         | 250.000,00              | 558.400,84   | 2.642,77         | 0,33%        | 0,47%      |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO       | 2.424.106,32   | 0,00         | 0,00                    | 2.426.633,72 | 2.527,40         | 0,10%        | 0,10%      |
| BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE... | 446.603,11     | 0,00         | 73.500,00               | 374.735,05   | 1.631,94         | 0,37%        | 0,36%      |
| BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO                | 105.895,99     | 0,00         | 105.500,00              | 531,30       | 135,31           | 0,13%        | 0,18%      |
| CAIXA BRASIL ATIVA FIC RENDA FIXA LP                  | 0,00           | 1.000.000,00 | 0,00                    | 999.545,35   | -454,65          | -0,05%       | -0,01%     |
| CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA         | 3.191.896,61   | 0,00         | 1.000.000,00            | 2.191.207,69 | -688,92          | -0,02%       | -0,09%     |
| BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE... | 0,00           | 1.000.000,00 | 0,00                    | 997.219,75   | -2.780,25        | -0,28%       | -0,03%     |
| TÍTULOS PÚBLICOS                                      | 923.880,70     | 0,00         | 0,00                    | 887.144,30   | -36.736,40       | -3,98%       | -          |
|                                                       |                |              | <b>Total Renda Fixa</b> |              | <b>74.346,35</b> | <b>0,39%</b> |            |

**Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 3º Trimestre/2020**

**FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL**

| Ativos Renda Variável                    | Saldo Anterior | Aplicações | Resgates                    | Saldo Atual | Retorno (R\$)     | Retorno (%)   | (%) Instit |
|------------------------------------------|----------------|------------|-----------------------------|-------------|-------------------|---------------|------------|
| CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP | 507.174,43     | 162.000,00 | 0,00                        | 671.262,00  | 2.087,57          | 0,31%         | 0,35%      |
| CAIXA AÇÕES MULTIGESTOR FIC AÇÕES        | 330.137,58     | 0,00       | 0,00                        | 329.407,51  | -730,07           | -0,22%        | -0,22%     |
| CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES       | 343.796,51     | 0,00       | 0,00                        | 341.455,80  | -2.340,71         | -0,68%        | -0,68%     |
| BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES               | 0,00           | 250.000,00 | 0,00                        | 242.193,80  | -7.806,20         | -3,12%        | -1,39%     |
| BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES                 | 618.197,17     | 0,00       | 0,00                        | 603.992,47  | -14.204,70        | -2,30%        | -2,30%     |
|                                          |                |            | <b>Total Renda Variável</b> |             | <b>-22.994,11</b> | <b>-1,04%</b> |            |