

Relatório Analítico dos Investimentos

em setembro e 3º trimestre de 2020

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2020)

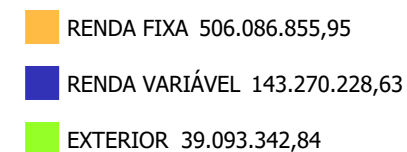
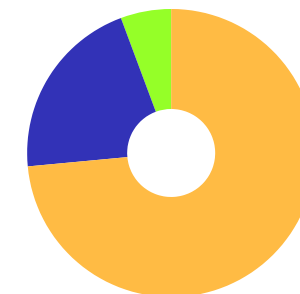
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	76.245.555,97	11,07%	868	0,56%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁR...	D+0	15/08/2024	5.227.103,58	0,76%	93	1,24%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	1.250.994,07	0,18%	1.239	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	15.698.290,97	2,28%	1.361	0,15%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	72.327.703,81	10,51%	336	4,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	128.550.160,54	18,67%	676	2,32%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
WESTERN ASSET ATIVO MAX FI RENDA FIXA	D+1 du	Não há	18.613.750,80	2,70%	4.155	5,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	D+1	Não há	26.829.042,50	3,90%	23.879	4,38%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	D+1	Não há	21.048.981,89	3,06%	26	3,56%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	102.192.033,34	14,84%	121	5,24%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	28.396.398,13	4,12%	48	11,81%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL S...	Não se ...	Não se aplica	0,01	0,00%		0,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	Não se ...	Não se aplica	152.298,51	0,02%		0,00%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO...	D+30 ou...	Não há	9.554.541,83	1,39%	74	1,58%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	D+4	Não há	5.473.316,89	0,80%	43	0,72%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	D+4	Não há	12.003.625,14	1,74%	98	1,26%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	D+4	Não há	4.342.872,87	0,63%	23.153	1,24%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	D+4	Não há	25.726.021,10	3,74%	11.289	1,83%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	13.651.845,06	1,98%	16.425	1,18%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	D+4	Não há	11.867.149,68	1,72%	12.180	1,57%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '

Carteira consolidada de investimentos - base (Setembro / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	D+3	Não há	12.135.723,56	1,76%	42.164	1,04%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	D+4	Não há	22.520.779,41	3,27%	15.468	3,13%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	D+3	Não há	13.219.279,61	1,92%	9.414	4,80%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	D+1	Não há	20.139.349,12	2,93%	15.513	2,03%	Artigo 8º, Inciso III
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	Não se ...	Não se aplica	90.152,22	0,01%		0,00%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE...	Não se ...	Não se aplica	9.462,90	0,00%	105	0,61%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	S/Info	Não se aplica	1.017.785,73	0,15%		2,06%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
ÁQUILLA FII - AQLL11	Não se ...	Não se aplica	1.072.865,34	0,16%		2,73%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
SANTANDER GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERI...	D+8 du	Não há	10.249.530,48	1,49%	4.023	1,28%	Artigo 9º - A, Inciso II
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO...	D+5	Não há	4.779.641,91	0,69%	7.502	0,58%	Artigo 9º - A, Inciso II
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	D+5	Não há	24.064.170,45	3,50%	83.523	1,21%	Artigo 9º - A, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			688.450.427,42				

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

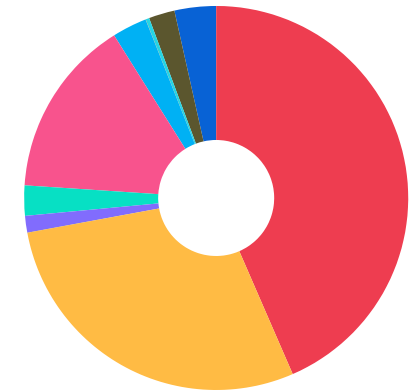
Artigos - Renda Fixa	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	688.450.427,42
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	299.299.808,94	43,47%	10,00%	40,95%	100,00%	389.150.618,48
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	688.450.427,42
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	34.422.521,37
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	65,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	413.070.256,45
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	65,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	413.070.256,45
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	45,00%	197.080.206,66	28,63%	0,00%	23,00%	40,00%	78.299.964,31
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	45,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	275.380.170,97
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	137.690.085,48
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	103.267.564,11
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	103.267.564,11
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	152.298,52	0,02%	0,00%	0,05%	5,00%	34.270.222,85
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	10,00%	9.554.541,83	1,39%	0,00%	1,00%	5,00%	24.867.979,54
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	34.422.521,37
Total Renda Fixa	100,00%	506.086.855,95	73,51%	10,00%	65,00%	570,00%	



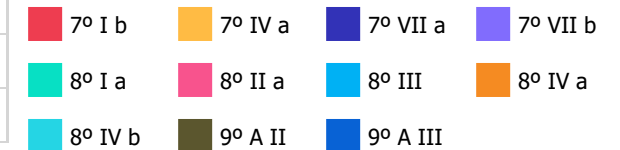
ATENÇÃO! Os limites respeitam as condições previstas na Resolução 4.695/18 em seus Artigo 7º § 10º e Artigo 8º § 10º para RPPS Certificado pelo Pró-Gestão!

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Setembro / 2020)

Artigos - Renda Variável	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	35,00%	17.476.942,03	2,54%	0,00%	4,00%	30,00%	189.058.186,20
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	35,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	206.535.128,23
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	25,00%	103.463.671,29	15,03%	2,00%	20,00%	20,00%	34.226.414,19
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	25,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	137.690.085,48
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	20.139.349,12	2,93%	0,00%	4,00%	10,00%	48.705.693,62
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	99.615,12	0,01%	0,00%	1,00%	5,00%	34.322.906,25
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	2.090.651,07	0,30%	0,00%	1,00%	5,00%	32.331.870,30
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	34.422.521,37
Total Renda Variável	35,00%	143.270.228,63	20,81%	2,00%	30,00%	125,00%	



Artigos - Exterior	Resolução Pró Gestão - Nivel 1	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%	68.845.042,74
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	15.029.172,39	2,18%	0,00%	2,00%	10,00%	53.815.870,35
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	24.064.170,45	3,50%	0,00%	3,00%	10,00%	44.780.872,29
Total Exterior	10,00%	39.093.342,84	5,68%	0,00%	5,00%	30,00%	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	212.447.800,36	30,86	0,04
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	174.280.676,06	25,31	0,01
BRDESCO ASSET MANAGEMENT	130.588.431,47	18,97	0,02
WESTERN ASSET	83.866.252,26	12,18	0,18
ICATU VANGUARDA	52.555.063,60	7,63	0,14
SANTANDER BRASIL ASSET MANAGEM...	15.722.847,37	2,28	0,00
AZ QUEST INVESTIMENTOS	11.867.149,68	1,72	0,04
XP VISTA ASSET MANAGEMENT	4.779.641,91	0,69	0,00
REDITUS INVESTIMENTOS	1.072.865,34	0,16	-
QUELUZ GESTÃO DE RECURSOS	1.017.785,73	0,15	0,19
VILA RICA CAPITAL	152.298,51	0,02	3,70
BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUT...	90.152,23	0,01	0,00
PÁTRIA INVESTIMENTOS	9.462,90	0,00	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 ' a '	0,00	0,00	0,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	299.299.808,94	43,47	10,00	100,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	100,00
Artigo 7º, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	197.080.206,66	28,63	0,00	40,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	40,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	152.298,52	0,02	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	9.554.541,83	1,39	0,00	5,00
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	17.476.942,03	2,54	0,00	30,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	103.463.671,29	15,03	2,00	20,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	20.139.349,12	2,93	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	99.615,12	0,01	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	2.090.651,07	0,30	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' c '	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso I	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º - A, Inciso II	15.029.172,39	2,18	0,00	10,00
Artigo 9º - A, Inciso III	24.064.170,45	3,50	0,00	10,00

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
CDI + 3,50% ao ano (Benchmark)	0,44%	4,93%	1,41%	3,01%	7,17%	17,86%	-	-
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	-1,76%	683,68%	873,73%	632,38%	528,73%	892,00%	-	-
IRF-M 1+ (Benchmark)	-0,91%	5,40%	-0,59%	3,90%	7,61%	30,00%	-	-
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	-2,04%	4,04%	-2,12%	3,03%	6,38%	35,81%	0,04%	0,06%
IMA-B 5+ (Benchmark)	-2,60%	-4,56%	0,75%	6,78%	-1,67%	42,42%	-	-
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	-2,59%	-5,30%	0,65%	6,52%	-2,47%	40,56%	0,06%	0,17%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	-2,64%	-4,82%	0,65%	6,56%	-2,10%	40,98%	0,06%	0,17%
IRF-M 1 (Benchmark)	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%
110% do CDI (Benchmark)	0,17%	2,51%	0,56%	1,38%	3,90%	11,10%	-	-
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR 1	0,00%	-	0,00%	-	-	-	-	-
IMA-B (Benchmark)	-1,51%	-0,72%	0,96%	5,97%	2,11%	34,14%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,56%	-0,93%	0,84%	5,77%	1,83%	33,39%	0,04%	0,11%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	-1,60%	-0,80%	0,92%	6,12%	2,03%	34,42%	0,04%	0,11%

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
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	-2,18%	0,10%	0,14%	6,57%	3,16%	41,32%	0,05%	0,12%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,26%	3,97%	1,04%	4,82%	6,65%	25,37%	0,02%	0,04%
IPCA (Benchmark)	0,64%	1,34%	1,24%	0,81%	3,14%	6,12%	-	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO	-0,08%	4,11%	1,40%	5,06%	6,65%	21,92%	0,01%	0,04%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	-0,50%	4,53%	-0,09%	3,18%	6,41%	25,88%	0,02%	0,03%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
WESTERN ASSET ATIVO MAX FI RENDA FIXA	-1,33%	5,65%	-0,71%	4,01%	7,62%	24,32%	0,03%	0,05%

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
IPCA + 10,50% ao ano (Benchmark)	1,48%	9,18%	3,89%	5,97%	13,96%	29,52%	-	-
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	-0,43%	-	-1,35%	-	-	-96,87%	-	-
S&P 500 (Benchmark)	-3,92%	4,09%	8,47%	30,12%	12,98%	15,41%	-	-
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	-4,88%	0,56%	7,44%	27,61%	9,43%	16,25%	0,11%	0,25%
IBX-50 (Benchmark)	-4,62%	-18,06%	-0,37%	31,30%	-10,02%	16,09%	-	-
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	-4,95%	-18,85%	-0,51%	30,59%	-10,27%	14,44%	0,11%	0,40%
IMOB (Benchmark)	-8,01%	-36,23%	-9,18%	16,93%	-19,69%	44,91%	-	-
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	-8,07%	-36,71%	-9,56%	16,14%	-20,74%	42,62%	0,16%	0,55%
ICON (Benchmark)	-3,96%	-9,26%	1,83%	42,00%	-1,04%	53,03%	-	-
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	-4,06%	-10,06%	1,41%	40,64%	-1,19%	50,69%	0,12%	0,43%
IDIV (Benchmark)	-4,63%	-21,08%	-3,31%	14,78%	-9,81%	37,85%	-	-
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	-5,41%	-24,63%	-5,72%	14,18%	-17,08%	31,03%	0,10%	0,36%
Ibovespa (Benchmark)	-4,80%	-18,20%	-0,48%	29,56%	-9,68%	19,23%	-	-
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	-4,26%	-21,25%	1,01%	30,73%	-11,91%	16,72%	0,11%	0,42%

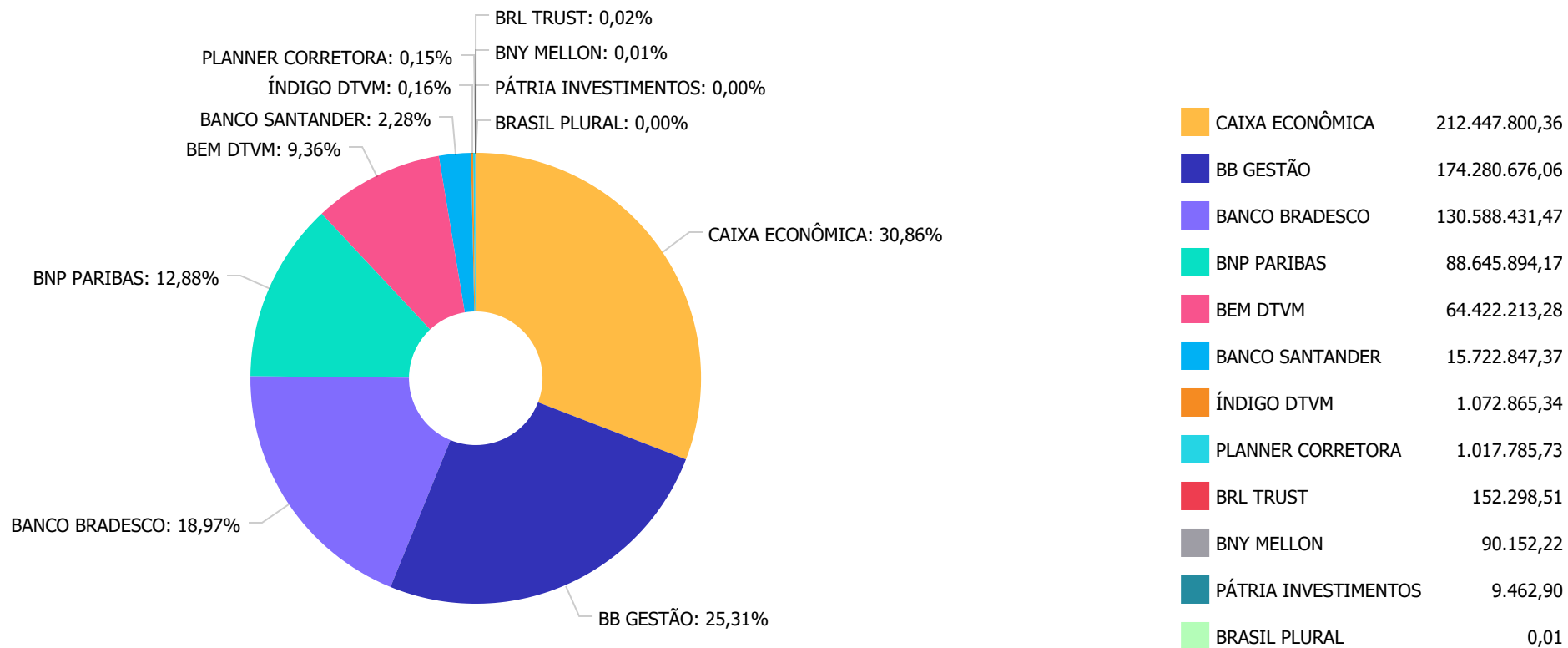
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	-6,19%	-17,68%	0,10%	33,91%	-10,03%	20,62%	0,11%	0,45%
SMLL (Benchmark)	-5,44%	-18,93%	2,27%	35,50%	-1,78%	54,49%	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	-5,93%	-20,37%	1,37%	33,48%	-4,18%	45,25%	0,11%	0,46%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	0,00%	11,11%	-20,00%	10,80%	-14,89%	0,00%	0,00%	0,49%
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE FIP	-0,29%	-	-1,82%	-	-99,73%	-99,73%	0,00%	1,03%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	0,25%	-14,14%	1,98%	4,66%	76,90%	76,90%	-	-
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	-5,40%	-19,80%	-1,40%	22,19%	-6,82%	28,89%	0,12%	0,38%
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	-4,94%	-11,01%	3,01%	39,99%	0,91%	53,79%	0,11%	0,43%

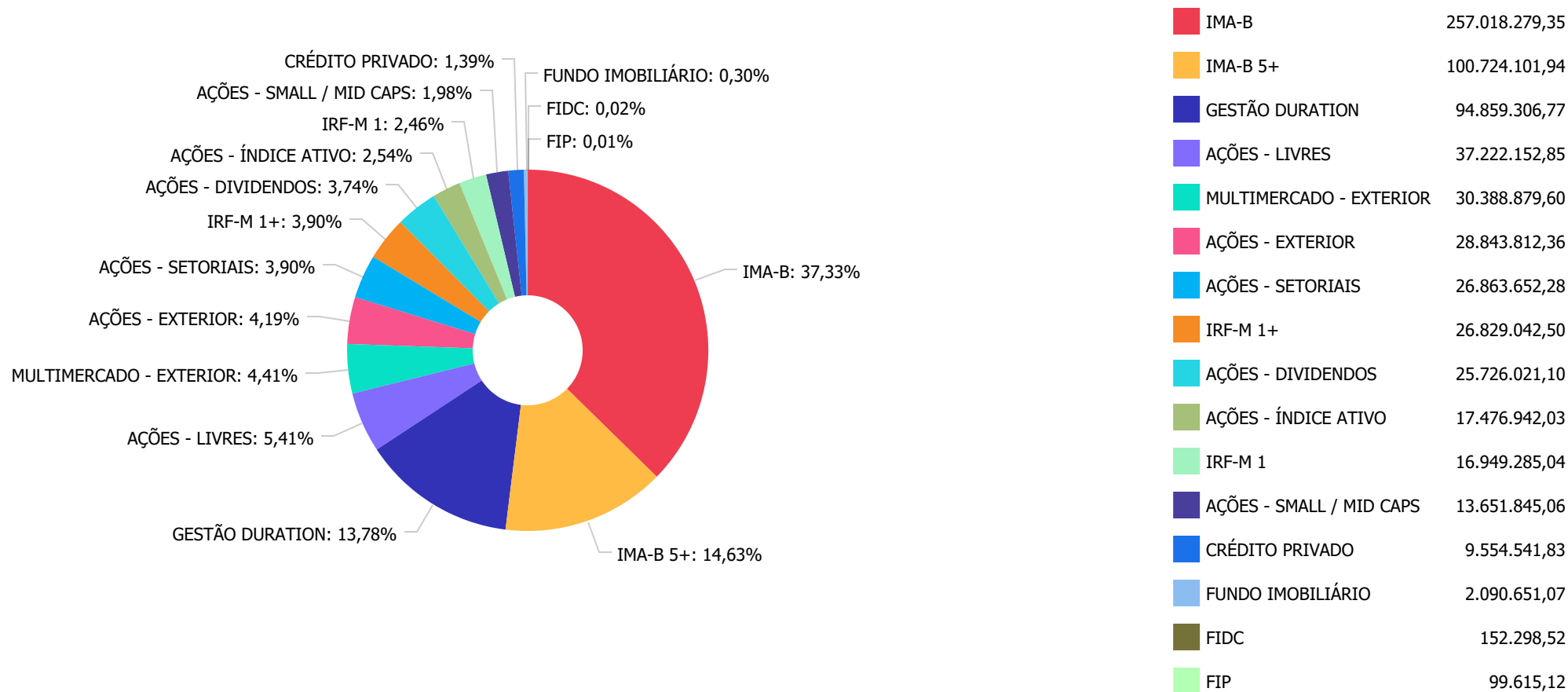
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Setembro/2020 - INVESTIMENTO NO EXTERIOR

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Global BDRX (Benchmark)	-1,97%	51,44%	14,34%	43,02%	60,30%	70,28%	-	-
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	-1,39%	65,29%	17,59%	53,33%	74,32%	84,99%	0,14%	0,25%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO EXTERIOR FIC AÇÕ...	3,00%	86,27%	22,64%	64,22%	-	-	0,16%	-
Não definido (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
SANTANDER GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR FI MULTIMERCAD...	0,54%	54,82%	14,36%	45,87%	61,88%	62,94%	0,12%	0,21%

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



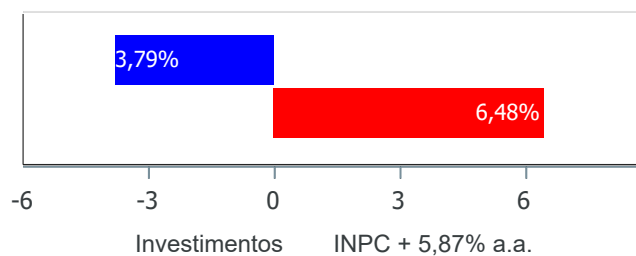
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Setembro / 2020)



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

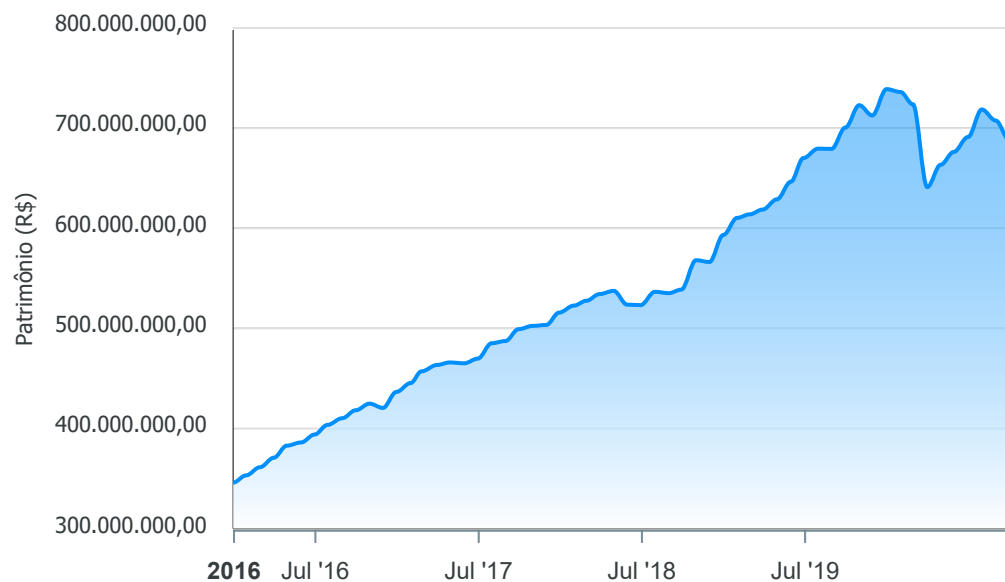
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	738.948.979,87	43.219.308,10	49.983.272,64	736.089.095,98	3.904.080,65	3.904.080,65	0,53%	0,53%	0,69%	0,69%	76,55%	3,62%
Fevereiro	736.089.095,98	8.085.665,26	7.963.323,56	723.797.162,06	-12.414.275,62	-8.510.194,97	-1,69%	-1,17%	0,58%	1,27%	-91,65%	5,75%
Março	723.797.162,06	10.150.834,34	8.531.768,26	641.154.532,77	-84.261.695,37	-92.771.890,34	-11,62%	-12,65%	0,68%	1,96%	-644,62%	24,39%
Abril	641.154.532,77	23.706.289,22	22.986.242,51	663.408.450,64	21.533.871,16	-71.238.019,18	3,35%	-9,72%	0,22%	2,19%	-443,88%	12,30%
Mai	663.408.450,64	59.719.928,86	63.565.028,56	676.172.154,28	16.608.803,34	-54.629.215,84	2,50%	-7,46%	0,20%	2,40%	-311,18%	6,15%
Junho	676.172.154,28	6.277.187,29	10.112.884,72	691.051.160,58	18.714.703,73	-35.914.512,11	2,77%	-4,89%	0,78%	3,19%	-153,31%	5,33%
Julho	691.051.160,58	10.222.938,29	14.046.420,74	718.615.109,49	31.387.431,36	-4.527.080,75	4,54%	-0,58%	0,96%	4,19%	-13,73%	4,17%
Agosto	718.615.109,49	6.639.393,73	10.466.675,38	707.575.762,58	-7.212.065,26	-11.739.146,01	-1,00%	-1,57%	0,84%	5,06%	-31,08%	4,22%
Setembro	707.575.762,58	4.834.999,23	8.016.789,97	688.450.427,42	-15.943.544,42	-27.682.690,43	-2,25%	-3,79%	1,35%	6,48%	-58,50%	6,03%

Investimentos x Meta Atuarial



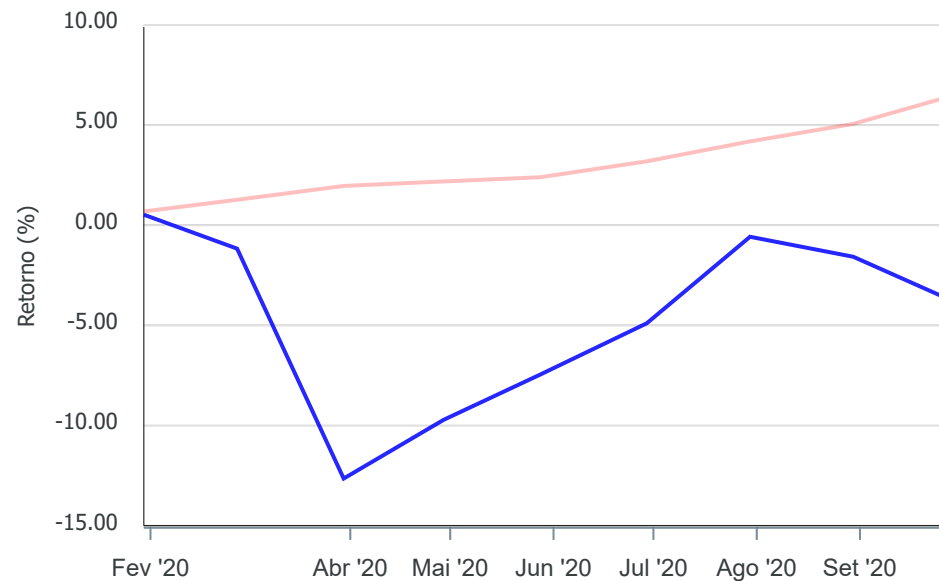
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	155.018,36	0,00	3.719,43	152.298,51	999,58	0,64%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	19.101.666,98	4.389.385,69	7.821.779,16	15.698.290,97	29.017,46	0,12%	0,13%	0,12%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	996.179,81	445.613,54	191.291,38	1.250.994,07	492,10	0,03%	0,04%	0,15%
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊN...	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	-	-
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	9.562.173,50	0,00	0,00	9.554.541,83	-7.631,67	-0,08%	-0,08%	1,24%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	5.240.478,01	0,00	0,00	5.227.103,58	-13.374,43	-0,26%	-0,26%	1,77%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	76.631.132,20	0,00	0,00	76.245.555,97	-385.576,23	-0,50%	-0,50%	1,68%
WESTERN ASSET ATIVO MAX FI RENDA FIXA	18.865.487,66	0,00	0,00	18.613.750,80	-251.736,86	-1,33%	-1,33%	2,90%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	130.581.280,78	0,00	0,00	128.550.160,54	-2.031.120,24	-1,56%	-1,56%	4,15%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	103.855.783,95	0,00	0,00	102.192.033,34	-1.663.750,61	-1,60%	-1,60%	4,24%
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	27.387.009,11	0,00	0,00	26.829.042,50	-557.966,61	-2,04%	-2,04%	4,03%
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	21.518.527,67	0,00	0,00	21.048.981,89	-469.545,78	-2,18%	-2,18%	5,40%
BRADESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	29.152.576,39	0,00	0,00	28.396.398,13	-756.178,26	-2,59%	-2,59%	6,25%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	74.291.222,28	0,00	0,00	72.327.703,81	-1.963.518,47	-2,64%	-2,64%	6,30%
Total Renda Fixa	517.338.536,71	4.834.999,23	8.016.789,97	506.086.855,95	-8.069.890,02	-1,55%		4,01%

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
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	1.015.295,42	0,00	0,00	1.017.785,73	2.490,31	0,25%	0,25%	-
ÁQUILLA FII - AQLL11	1.073.431,09	0,00	0,00	1.072.865,34	-565,75	-0,05%	0,00%	0,00%
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE F...	9.490,02	0,00	0,00	9.462,90	-27,12	-0,29%	-0,29%	0,35%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	90.542,22	0,00	0,00	90.152,22	-390,00	-0,43%	-	-
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	23.473.131,44	0,00	0,00	22.520.779,41	-952.352,03	-4,06%	-4,06%	12,17%
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	5.716.565,67	0,00	0,00	5.473.316,89	-243.248,78	-4,26%	-4,26%	11,13%
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	21.171.602,31	0,00	0,00	20.139.349,12	-1.032.253,19	-4,88%	-4,88%	10,83%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	13.906.550,79	0,00	0,00	13.219.279,61	-687.271,18	-4,94%	-4,94%	10,55%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	12.628.965,78	0,00	0,00	12.003.625,14	-625.340,64	-4,95%	-4,95%	10,91%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	12.828.556,63	0,00	0,00	12.135.723,56	-692.833,07	-5,40%	-5,40%	11,65%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	27.198.386,07	0,00	0,00	25.726.021,10	-1.472.364,97	-5,41%	-5,41%	10,03%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	14.511.937,82	0,00	0,00	13.651.845,06	-860.092,76	-5,93%	-5,93%	10,89%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	12.650.383,22	0,00	0,00	11.867.149,68	-783.233,54	-6,19%	-6,19%	11,43%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	4.724.300,83	0,00	0,00	4.342.872,87	-381.427,96	-8,07%	-8,07%	15,86%
Total Renda Variável	150.999.139,31	0,00	0,00	143.270.228,63	-7.728.910,68	-5,12%		11,09%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de (Setembro / 2020)

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO E...	4.640.377,84	0,00	0,00	4.779.641,91	139.264,07	3,00%	3,00%	15,59%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	10.194.313,20	0,00	0,00	10.249.530,48	55.217,28	0,54%	0,54%	12,35%
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	24.403.395,52	0,00	0,00	24.064.170,45	-339.225,07	-1,39%	-1,39%	14,12%
Total Renda Variável	39.238.086,56	0,00	0,00	39.093.342,84	-144.743,72	-0,37%		13,84%

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 IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	127.486.004,38	0,00	0,00	128.550.160,54	1.064.156,16	0,83%	0,83%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	101.264.505,74	0,00	0,00	102.192.033,34	927.527,60	0,92%	0,92%
CAIXA BRASIL IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	71.860.322,65	0,00	0,00	72.327.703,81	467.381,16	0,65%	0,65%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B 5+ FIC RENDA FIXA	34.077.701,64	0,00	6.000.000,00	28.396.398,13	318.696,49	0,94%	0,65%
ITÁLIA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	15.640,76	0,00	3.719,43	152.298,51	140.377,18	897,51%	873,73%
BB IPCA III FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO P...	9.422.838,37	0,00	0,00	9.554.541,83	131.703,46	1,40%	1,40%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	27.606.204,86	12.372.673,58	24.402.684,17	15.698.290,97	122.096,70	0,31%	0,47%
BB TÍTULOS PÚBLICOS X FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	6.936.266,19	0,00	1.781.814,45	5.227.103,58	72.651,84	1,05%	1,04%
WESTERN ASSET IMA-B ATIVO FI RENDA FIXA	21.019.021,12	0,00	0,00	21.048.981,89	29.960,77	0,14%	0,14%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	49.012,24	1.542.843,22	341.668,04	1.250.994,07	806,65	0,05%	0,36%
TREND BANK BANCO DE FOMENTO FIDC MULTISSETORIAL SÊN...	0,01	0,00	0,00	0,01	0,00	0,00%	0,00%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	76.314.656,58	0,00	0,00	76.245.555,97	-69.100,61	-0,09%	-0,09%
WESTERN ASSET ATIVO MAX FI RENDA FIXA	13.984.788,11	4.781.814,45	0,00	18.613.750,80	-152.851,76	-0,81%	-0,71%
ICATU VANGUARDA PRÉ-FIXADO FI RENDA FIXA LP	27.410.802,68	0,00	0,00	26.829.042,50	-581.760,18	-2,12%	-2,12%
				Total Renda Fixa	2.471.645,46	0,46%	

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
WESTERN ASSET US INDEX 500 FI MULTIMERCADO	18.745.623,19	0,00	0,00	20.139.349,12	1.393.725,93	7,43%	7,43%
BB QUANTITATIVO FIC AÇÕES	12.833.289,76	0,00	0,00	13.219.279,61	385.989,85	3,01%	3,01%
CAIXA CONSUMO FI AÇÕES	22.207.031,13	0,00	0,00	22.520.779,41	313.748,28	1,41%	1,41%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	13.466.758,89	0,00	0,00	13.651.845,06	185.086,17	1,37%	1,37%
SANTANDER IBOVESPA ATIVO INSTITUCIONAL FI AÇÕES	5.418.730,95	0,00	0,00	5.473.316,89	54.585,94	1,01%	1,01%
VECTOR QUELUZ LAJES CORPORATIVAS FII - VLJS11	998.008,86	0,00	0,00	1.017.785,73	19.776,87	1,98%	1,98%
AZ QUEST AÇÕES FIC AÇÕES	11.855.579,77	0,00	0,00	11.867.149,68	11.569,91	0,10%	0,10%
PATRIA SPECIAL OPPORTUNITIES I - FI EM QUOTAS DE F...	9.637,88	0,00	0,00	9.462,90	-174,98	-1,82%	-1,82%
GERAÇÃO DE ENERGIA MULTISTRATÉGIA FIP	91.389,80	0,00	0,00	90.152,22	-1.237,58	-1,35%	-1,35%
ÁQUILLA FII - AQLL11	1.078.049,94	0,00	0,00	1.072.865,34	-5.184,60	-0,48%	-20,00%
CAIXA BRASIL IBX-50 FI AÇÕES	12.064.571,63	0,00	0,00	12.003.625,14	-60.946,49	-0,51%	-0,51%
BB RETORNO TOTAL FIC AÇÕES	12.307.403,03	0,00	0,00	12.135.723,56	-171.679,47	-1,39%	-1,39%
BB CONSTRUÇÃO CIVIL FIC AÇÕES	4.801.708,18	0,00	0,00	4.342.872,87	-458.835,31	-9,56%	-9,56%
ICATU VANGUARDA DIVIDENDOS FI AÇÕES	27.288.115,85	0,00	0,00	25.726.021,10	-1.562.094,75	-5,72%	-5,72%
				Total Renda Variável	104.329,77	0,07%	

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

FUNDOS EXTERIOR

Ativos Exterior	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
WESTERN ASSET FI AÇÕES BDR NÍVEL I	20.464.194,08	0,00	0,00	24.064.170,45	3.599.976,37	17,59%	17,59%
SANTANDER GLOBAL EQUITIES INVESTIMENTO NO EXTERIOR...	8.962.881,16	0,00	0,00	10.249.530,48	1.286.649,32	14,36%	14,36%
MS GLOBAL OPPORTUNITIES ADVISORY INVESTIMENTO NO E...	1.010.421,15	3.000.000,00	0,00	4.779.641,91	769.220,76	19,18%	22,64%
				Total Exterior	5.655.846,45	16,91%	