



# INSTITUTO MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DE JALES

Rua 07, nº 2072 - Centro - CEP 15700-014 - Fone: (17) 3632-6906  
EMAIL: contato@impsjales.com.br — SITE: www.impsjales.com.br  
CNPJ: 65.711.129/0001-53

## Parecer do Comitê de Investimentos – Outubro/2020

Este parecer tem por finalidade a análise do comportamento da carteira de investimento do IMPSJALES na competência Outubro/2020.

### I) Cenário Econômico – Outubro/2020 – Resumo

Novamente tivemos um mês e alta volatilidade nos mercados financeiros, principalmente o de bolsa, devido principalmente a fatores políticos, como proximidade e incertezas das eleições nos E.U.A., e pelo aumento da contaminação pela covid-19 em países da Europa e nos Estados Unidos, que levaram alguns países, como Alemanha e França a ampliarem as restrições sociais e outros decretaram estado de emergência. Sobre as eleições americanas, o foco ou preocupações do mercado não é nem tanto em relação ao vencedor e sim pela possibilidade de não aceitação do resultado por parte dos candidatos, o que poderá gerar ações judiciais, atrasando o resultado e conseqüentemente maior volatilidade no mercado financeiro. Sobre o mercado interno, o destaque foi a decisão do Copom que manteve a taxa de juros inalterada, porém os aspectos negativos advindo do exterior impactaram o nosso mercado, como consequência tivemos queda na bolsa que fechou em negativo o mês de outubro/2020.

### II) Retorno e Meta Atuarial:

E esta queda global nos mercados financeiros, teve novamente impacto em nossa carteira de investimentos, fechando o mês com retorno de somente 0,01%, ou seja, de R\$ 3.688,45 (três mil, seiscentos e oitenta e oito reais e quarenta e cinco centavos), e considerando que a meta atuarial no mês foi de 1,34%, nos distanciamos ainda mais de conseguir neste exercício "bater meta prevista", ou seja, no acumulado estamos com retorno de 1,08% enquanto a meta no mesmo período foi de 7,14%. Que no mês, a nossa carteira não teve em nenhum segmento altas performances, ou seja, na renda fixa destacamos o melhor rendimento foi o Fundo Arelado ao IMA-B Títulos Públicos com retorno de 0,18%, enquanto que os Fundos BB alocação ativa e BB retorno total (-0,07%) e o Caixa Brasil Gestão Estratégica(-0,11%) tiveram retorno negativos, enquanto que na renda variável os destaques positivos foi o Fundo Bradesco Selection FI Ações com retorno de 3,33% e o Caixa Brasil Ações Livres com 0,71% de retorno, enquanto todos os outros performaram negativamente, onde destacamos o Fundo Caixa Petrobras FI Ações com retorno de -3,95%.

### III) Sobre a distribuição dos fundos de investimentos

Que atualmente estamos com total na carteira de R\$ 45.486.157,27 (quarenta e cinco milhões, quatrocentos e oitenta e seis mil, cento e cinquenta e sete reais e vinte e sete centavos), distribuídas em 80,92% (R\$ 36.805.338,15) em renda fixa e 19,08% (R\$



# INSTITUTO MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DE JALES

Rua 07, nº 2072 - Centro - CEP 15700-014 - Fone: (17) 3632-6906  
EMAIL: contato@impsjales.com.br — SITE: www.impsjales.com.br  
CNPJ: 65.711.129/0001-53

8.680.819,12) em renda variável, sendo os ativos divididos nos seguintes segmentos: Títulos Públicos: 12,45%; Gestão Duration: 30,78%; IMA-B5: 13,44%; IMA- Geral: 7,61%; IMA-B: 8,74%; IDKA2: 5,02% e IRF-M1: 2,87%. NA RENDA VARIÁVEL - Multimercado: 7,66%; Ações Livres: 6,81%; Ações Setoriais: 1,45% e Ações Índice Ativo: 3,17%.

Sobre Distribuição dos Ativos por Administradores a carteira está assim distribuída: Caixa Econômica Federal: 55,05%; BB Gestão de Recursos: 24,43%, Tesouro Nacional: 12,45%; Banco Bradesco: 4,90% e BEM DTVM: 3,17%. Que todas estas instituições financeiras, foram credenciadas e estando regular, ou seja, dentro do prazo de vigência.

#### IV) Sobre Enquadramentos Legais:

Sobre a participação sobre o total da carteira todos os fundos estão devidamente enquadrados dentro do limite legal (20%), bem como nos enquadramentos da resolução 3922/2020 e da Política de Investimentos. Que com referência a estratégia de alocação prevista na política de investimentos para este exercício, podemos notar que com as alterações efetuadas neste mês na carteira, houve proximidade entre os dados atuais da carteira com os previstos na estratégia alvo, principalmente nos Artigos: 7º IV "a" e 8 II "a".

#### V) Movimentações na Carteira:

Conforme deliberação deste comitê de investimentos, foram efetuados as seguintes movimentações dos ativos da carteira: **RESGASTES:** a) Caixa Brasil IMA-B5 TP FI – R\$ 127.000,00 (cento e vinte e sete mil reais); b) Caixa Brasil IRF-M1 TP FI RF – R\$ 1.300.000,00 (um milhão e trezentos mil reais); c) Bradesco Int. IMA-B FIC RF – R\$ 1.000.000,00 (um milhão de reais) e d) BB FI Multimercado Prev. LP – R\$ 4.241.616,78 (quatro milhões, duzentos e quarenta e um mil, seiscentos e dezesseis reais e setenta e oito centavos); **APLICAÇÕES:** a) BB IMA-B RF Prev – R\$ 1.737.598,62 (um milhão, setecentos e trinta e sete mil, quinhentos e noventa e oito reais e sessenta e dois centavos); b) BB Alocação Ativa Retorno Total FIC RF – R\$ 3.019.968,57 (três milhões, dezenove mil, novecentos e sessenta e oito reais e cinquenta e sete centavos); c) Caixa Brasil IFR-M1 TP FI RF – R\$ 1.288.105,23 (um milhão, duzentos e oitenta e oito mil, cento e cinco reais e vinte e três centavos); d) Caixa Brasil Gestão Estratégica FI RF – R\$ 23.921,54 (vinte e três mil, novecentos e vinte e um reais e cinquenta e quatro centavos); e) Bradesco Selection FI Ações – R\$ 1.000.000,00 (um milhão de reais); f) Caixa Alocação Macro FIC Multimercado LP – R\$ 500.000,00 (quinhentos mil reais) e g) Caixa Brasil Estratégia livre FIC multimercado LP – R\$ 3.008.274,56 (três milhões, oito mil, duzentos e setenta e quatro reais e cinquenta e seis centavos).

#### VI) Considerações Finais:

Todos os ativos deste instituto, estão em conformidade com os critérios estabelecidos na Resolução CMN 3.922/2010, da Política Anual de Investimento e demais exigências legais.




# INSTITUTO MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DE JALES

Rua 07, nº 2072 - Centro - CEP 15700-014 - Fone: (17) 3632-6906  
EMAIL: contato@impsjales.com.br — SITE: www.impsjales.com.br  
CNPJ: 65.711.129/0001-53

Segue em anexo:

1. Relatório Analítico dos Investimentos em Outubro/2020;
2. Panorama Econômico da competência 10/2020, através do relatório visão fornecido pela empresa de Assessoria


Jales-SP, 18 de Novembro de 2020.



---

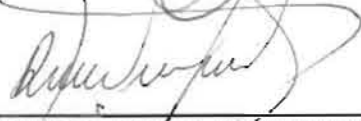
CLAUDIR BALESTREIRO  
Presidente

MEMBROS DO COMITÊ DE INVESTIMENTOS




---

JORGE PAULO GUZZO  
Responsável Técnico - Gestão Investimentos



---

ADMILDO JOSÉ F. DOS SANTOS



---

LUÍZ ANTONIO ABRA



---

ROSANA MORAES PIVOTO

# CRÉDITO E MERCADO

*Consultoria em Investimentos*  
Relatório Analítico dos Investimentos

em outubro de 2020



Este relatório atende a Portaria MPS nº 519, de 24 de agosto de 2011, Artigo 3º Incisos III e V.

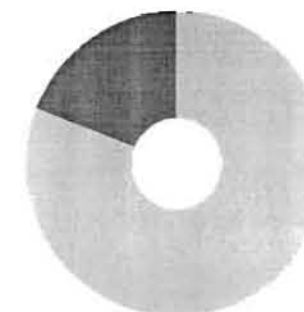


**Carteira consolidada de investimentos - base (Outubro / 2020)**

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
TÍTULOS PÚBLICOS			5.662.769,00	12,45%		0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	8.099.575,89	17,81%	874	0,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	3.463.672,65	7,61%	590	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	1.304.329,11	2,87%	1.366	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	6.113.478,26	13,44%	954	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
CAIXA BRASIL IDKÁ IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	2.283.223,73	5,02%	988	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3 du	Não há	5.902.831,54	12,98%	397	0,30%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	1.746.141,69	3,84%	271	0,13%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
BRADERCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	D+1	Não há	2.229.316,28	4,90%	121	0,11%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	D+15	Não há	3.095.563,25	6,81%	63	1,19%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
BRADERCO SELECTION FI AÇÕES	D+4	Não há	1.442.879,47	3,17%	205	0,20%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
CAIXA PETROBRAS FI AÇÕES	D+4	Não há	659.573,85	1,45%	27.047	0,13%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO L...	D+15	Não há	2.983.994,49	6,56%	95	0,36%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	498.808,06	1,10%	19.825	0,01%	Artigo 8º, Inciso III
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>45.486.157,27</b>				

**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%	5.662.769,00	12,45%	0,00%	15,00%	17,00%	2.069.877,74
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	21.264.279,64	46,75%	15,00%	35,00%	100,00%	24.221.877,63
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	27.291.694,36
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	40,00%	9.878.289,51	21,72%	10,00%	20,00%	40,00%	8.316.173,40
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea 'a'	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	6.822.923,59
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.274.307,86
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.274.307,86
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.274.307,86
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>36.805.338,15</b>	<b>80,92%</b>	<b>25,00%</b>	<b>70,00%</b>	<b>247,00%</b>	

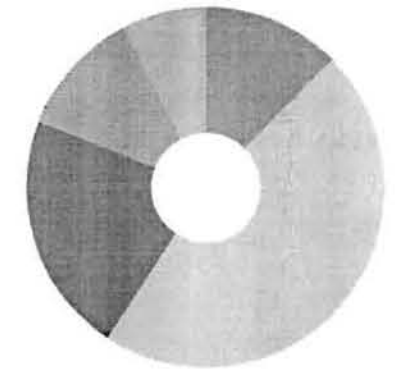


RENDA FIXA 36.805.338,15  
 RENDA VARIÁVEL 8.680.819,12

**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 II, Alínea 'a'	20,00%	5.198.016,57	11,43%	0,00%	12,50%	20,00%	3.899.214,88
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	3.482.802,55	7,66%	0,00%	10,00%	10,00%	1.065.813,18
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	2.274.307,86
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	2.274.307,86
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	2.274.307,86
Total Renda Variável	30,00%	8.680.819,12	19,08%	0,00%	27,50%	45,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2020			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	4.548.615,73
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	10,00%	4.548.615,73
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	20,00%	



7º I a
  7º I b
  7º IV a
  8º II a

8º III

# CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

INSTITUTO MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DE JALES  
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/10/2020

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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	25.038.546,64	55,05	-
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	11.112.645,88	24,43	-
TESOURO NACIONAL (TÍTULOS PÚBL...	5.662.769,00	12,45	-
BRANDESCO ASSET MANAGEMENT	3.672.195,75	8,07	-

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'	5.662.769,00	12,45	0,00	17,00
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	21.264.279,64	46,75	15,00	100,00
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	0,00	0,00	0,00	60,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	9.878.289,51	21,72	10,00	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 7º, Inciso VII, Alínea 'c'	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	5.198.016,57	11,43	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	3.482.802,55	7,66	0,00	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
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'c'	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso II	0,00	0,00	0,00	10,00
Artigo 9º - A, Inciso III	0,00	0,00	0,00	10,00



## 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
<b>IMA Geral ex-C (Benchmark)</b>	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%
<b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>	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%
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	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%
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	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%
<b>IMA-B (Benchmark)</b>	0,21%	-0,51%	-3,08%	4,81%	-1,00%	25,47%	-	-
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,18%	-0,88%	-3,16%	4,73%	-1,40%	24,57%	0,02%	0,10%
BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	0,10%	-0,70%	-3,31%	4,80%	-1,30%	25,25%	0,02%	0,10%
<b>IPCA (Benchmark)</b>	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%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,07%	-	-1,99%	2,03%	-	-	0,01%	-

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
<b>PETROBRAS ON - PETR3 (Benchmark)</b>	-3,89%	-40,02%	-16,30%	2,91%	-40,95%	-35,26%	-	-
CAIXA PETROBRAS FIAÇÕES	-3,96%	-40,49%	-16,41%	2,31%	-41,56%	-36,93%	0,21%	0,64%
<b>Ibovespa (Benchmark)</b>	-0,69%	-18,76%	-8,71%	16,70%	-12,37%	7,47%	-	-
BRDESCO SELECTION FIAÇÕES	3,33%	-17,49%	-0,65%	28,48%	-12,83%	6,67%	0,12%	0,40%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,16%	2,44%	0,47%	1,12%	3,21%	9,62%	-	-
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	-0,34%	-1,03%	-1,38%	2,71%	1,82%	18,95%	0,02%	0,07%
<b>Não Informado (Benchmark)</b>	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	0,71%	-13,76%	-5,80%	19,14%	-0,84%	-	0,11%	0,39%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	-0,54%	-1,53%	-2,37%	4,77%	1,08%	-	0,03%	0,11%

# CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

INSTITUTO MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DE JALES  
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/10/2020

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

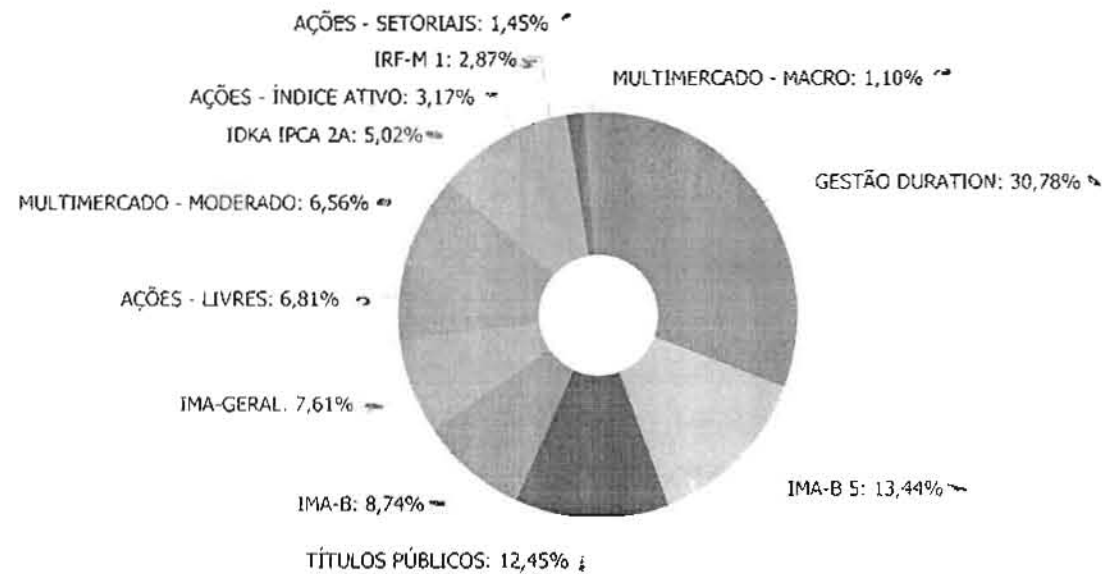


# CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

INSTITUTO MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DE JALES  
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/10/2020

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



GESTÃO DURATION	14.002.407,43
IMA-B 5	6.113.478,26
TÍTULOS PÚBLICOS	5.662.769,00
IMA-B	3.975.457,97
IMA-GERAL	3.463.672,65
AÇÕES - LIVRES	3.095.563,25
MULTIMERCADO - MODERADO	2.983.994,49
IDKA IPCA 2A	2.283.223,73
AÇÕES - ÍNDICE ATIVO	1.442.879,47
IRF-M 1	1.304.329,11
AÇÕES - SETORIAIS	659.573,85
MULTIMERCADO - MACRO	498.808,06

# CRÉDITO E MERCADO

*Consultoria em Investimentos*

INSTITUTO MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DE JALES  
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/10/2020

## Carteira de Títulos Públicos no mês de (Outubro / 2020)

Títulos Públicos	Vencimento	Compra	Qtde	P.U. Compra	P.U. Atual	\$ Pago	\$ Atual	Marcação
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	11/08/2004	500	1.487,344824	3.857,226867	743.672,41	1.928.613,43	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/08/2024	02/12/2004	270	1.494,58526	3.857,226867	403.538,02	1.041.451,25	Mercado
NTN-B - Nota do Tesouro Nacional - Série B	15/05/2045	02/03/2009	630	1.104,73659	4.274,133823	695.984,05	2.692.704,31	Mercado

# CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

INSTITUTO MUNICIPAL DE PREVIDÊNCIA SOCIAL DE JALES  
Relatório de Análise, Enquadramentos, Rentabilidade e Risco - Base: 30/10/2020

## Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020

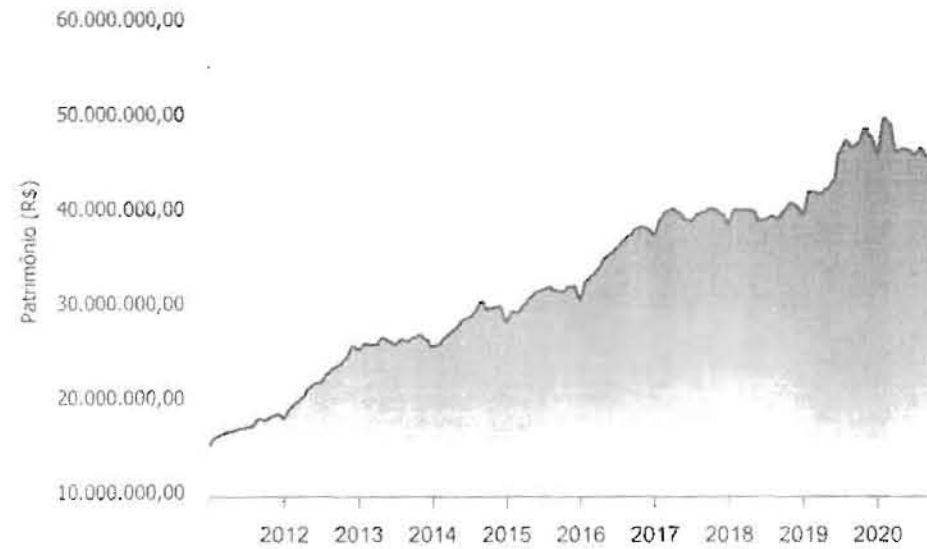
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	46.257.303,55	4.687.607,61	1.129.800,83	49.977.467,59	162.357,26	162.357,26	0,33%	0,33%	0,71%	0,71%	46,05%	1,32%
Fevereiro	49.977.467,59	2.555.988,54	3.177.692,23	49.342.435,95	-13.327,95	149.029,31	-0,03%	0,30%	0,66%	1,37%	21,84%	1,94%
Março	49.342.435,95	5.970.786,83	6.522.296,25	46.431.459,58	-2.359.466,95	-2.210.437,64	-4,78%	-4,50%	0,57%	1,94%	-231,26%	11,00%
Abril	46.431.459,58	3.552.730,24	4.009.642,48	46.719.539,52	744.992,18	-1.465.445,46	1,60%	-2,98%	0,14%	2,09%	-142,03%	5,77%
Mai	46.719.539,52	2.395.269,49	3.549.879,90	46.579.598,83	1.014.669,72	-450.775,74	2,17%	-0,86%	0,07%	2,16%	-39,71%	3,19%
Junho	46.579.598,83	6.460.489,43	7.752.019,78	46.077.093,07	789.024,59	338.248,85	1,69%	0,82%	0,74%	2,91%	28,26%	2,47%
Julho	46.077.093,07	1.192.889,42	1.485.000,00	46.780.780,85	995.798,36	1.334.047,21	2,16%	3,00%	0,88%	3,82%	78,63%	1,94%
Agosto	46.780.780,85	1.235.584,42	1.770.350,59	45.840.472,58	-405.542,10	928.505,11	-0,87%	2,11%	0,72%	4,56%	46,24%	1,93%
Setembro	45.840.472,58	1.312.358,38	1.610.000,00	45.077.473,48	-465.357,48	463.147,63	-1,02%	1,07%	1,12%	5,73%	18,71%	2,93%
Outubro	45.077.473,48	10.577.668,52	10.172.873,18	45.486.157,27	3.688,45	466.836,08	0,01%	1,08%	1,34%	7,14%	15,12%	2,93%

### Investimentos x Meta Atuarial

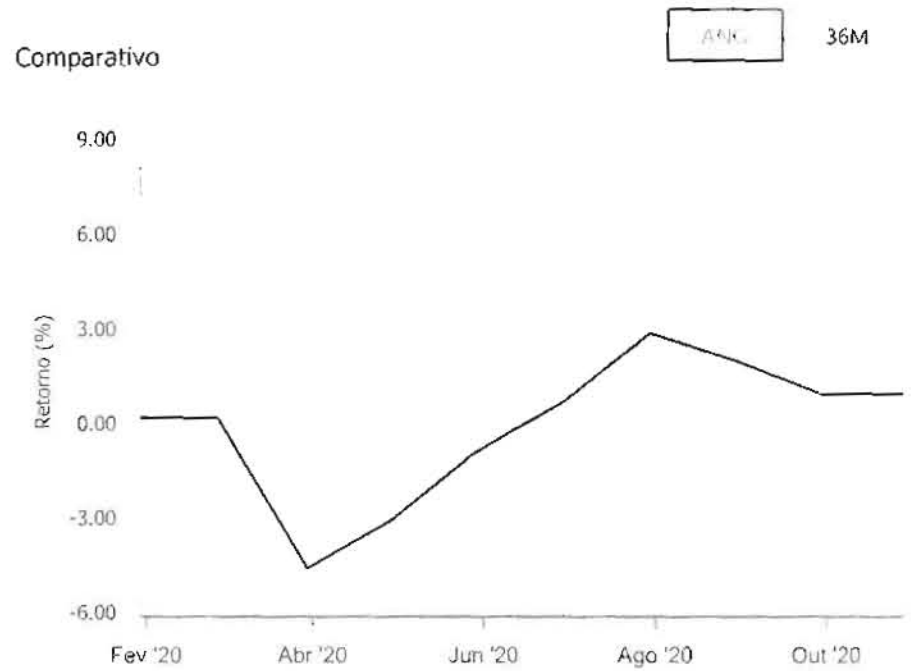


Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo



ANK 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 (%)	(%) Instu	Var - Mês
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	1.737.598,62	0,00	1.746.141,69	8.543,07	0,49%	0,18%	2,23%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	6.229.391,85	0,00	127.000,00	6.113.478,26	11.086,41	0,18%	0,18%	1,10%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	2.279.740,81	0,00	0,00	2.283.223,73	3.482,92	0,15%	0,15%	1,15%
TÍTULOS PÚBLICOS	5.659.404,84	0,00	0,00	5.662.769,00	3.364,16	0,06%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	2.880.472,64	3.019.968,57	0,00	5.902.831,54	2.390,33	0,04%	-0,07%	1,48%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	1.315.265,83	1.288.105,23	1.300.000,00	1.304.329,11	958,05	0,04%	0,14%	0,24%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.466.107,15	0,00	0,00	3.463.672,65	-2.434,50	-0,07%	-0,07%	1,35%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	8.084.446,47	23.921,54	0,00	8.099.575,89	-8.792,12	-0,11%	-0,11%	1,18%
BRANCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	3.234.399,08	0,00	1.000.000,00	2.229.316,28	-5.082,80	-0,16%	0,10%	2,31%
CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA L...	3.514.148,20	0,00	3.508.274,56	0,00	-5.873,64	-0,17%	0,16%	1,08%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>36.663.376,87</b>	<b>6.069.593,96</b>	<b>5.935.274,56</b>	<b>36.805.338,15</b>	<b>7.641,88</b>	<b>0,02%</b>		<b>1,34%</b>



## 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
BRADESCO SELECTION FI AÇÕES	412.132,28	1.000.000,00	0,00	1.442.879,47	30.747,19	2,18%	3,33%	11,66%
CAIXA BRASIL AÇÕES LIVRE FIC AÇÕES	3.073.616,04	0,00	0,00	3.095.563,25	21.947,21	0,71%	0,71%	11,03%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	4.241.616,78	0,00	4.237.598,62	0,00	-4.018,16	-0,09%	-0,21%	1,31%
CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	0,00	500.000,00	0,00	498.808,06	-1.191,94	-0,24%	-0,34%	2,29%
CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	0,00	3.008.274,56	0,00	2.983.994,49	-24.280,07	-0,81%	-0,54%	3,06%
CAIXA PETROBRAS FI AÇÕES	686.731,51	0,00	0,00	659.573,85	-27.157,66	-3,95%	-3,95%	20,72%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>8.414.096,61</b>	<b>4.508.274,56</b>	<b>4.237.598,62</b>	<b>8.680.819,12</b>	<b>-3.953,43</b>	<b>-0,05%</b>		<b>8,63%</b>

n.	FUNDO	DATA	TIPO	VALOR	PROP.
	CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	15/10/2020	Aplicação	348.970,79	9
	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	14/10/2020	Aplicação	920.089,65	9
	BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁ	14/10/2020	Aplicação	519.968,57	9
	CAIXA BRASIL ESTRATÉGIA LIVRE FIC MULTIMERCADO LP	08/10/2020	Aplicação	2.659.303,77	9
	BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁ	07/10/2020	Aplicação	2.500.000,00	9
	BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	07/10/2020	Aplicação	1.737.598,62	9
	CAIXA ALOCAÇÃO MACRO FIC MULTIMERCADO LP	07/10/2020	Aplicação	500.000,00	9
	CAIXA PATRIMÔNIO ÍNDICE DE PREÇOS FIC RENDA FIXA LP	06/10/2020	Resgate	3.508.274,56	9
	BRDESCO SELECTION FI AÇÕES	05/10/2020	Aplicação	1.000.000,00	9
	BRDESCO INSTITUCIONAL IMA-B FIC RENDA FIXA	02/10/2020	Resgate	1.000.000,00	9
	CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	01/10/2020	Resgate	127.000,00	9
	CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	01/10/2020	Resgate	1.300.000,00	9
	BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	01/10/2020	Resgate	4.237.598,62	9
				0	