

Relatório Analítico dos Investimentos em dezembro, 4º trimestre e ano de 2020

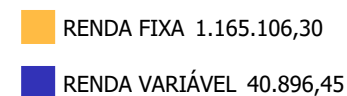
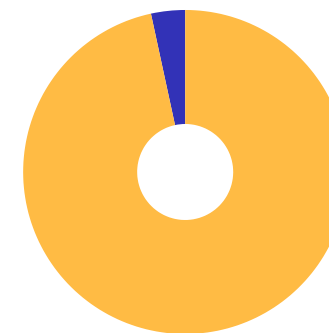


Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	617.757,00	51,22%	1.225	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	156.378,54	12,97%	922	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA ...	D+0	Não há	222.514,04	18,45%	375	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	168.456,72	13,97%	685	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	40.896,45	3,39%	193	0,01%	Artigo 8º, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			1.206.002,75				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			11.632,76				Artigo 6º
PL Total			1.217.635,51				

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

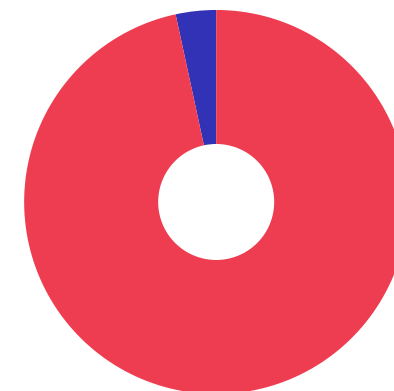
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	1.206.002,75
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	1.165.106,30	96,61%	40,00%	67,00%	100,00%	40.896,45
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	1.206.002,75
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	60.300,14
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	60,00%	723.601,65
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	723.601,65
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	40,00%	482.401,10
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	40,00%	482.401,10
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	241.200,55
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	180.900,41
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	180.900,41
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	60.300,14
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	60.300,14
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	60.300,14
Total Renda Fixa	100,00%	1.165.106,30	96,61%	40,00%	86,00%	570,00%	



Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Dezembro / 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%	3,00%	30,00%	361.800,83
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	361.800,83
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	20,00%	241.200,55
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	241.200,55
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	40.896,45	3,39%	0,00%	4,00%	10,00%	79.703,83
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	60.300,14
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	60.300,14
Total Renda Variável	30,00%	40.896,45	3,39%	0,00%	13,00%	120,00%	

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%	120.600,28
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	120.600,28
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	1,00%	12.060,03
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	21,00%	



7º I b 7º IV a 8º III

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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	983.488,71	81,55	0,00
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	222.514,04	18,45	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 '	1.165.106,30	96,61	40,00	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 '	0,00	0,00	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 '	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 I, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	30,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	2,00
Artigo 8º, Inciso III	40.896,45	3,39	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 9º - A, Inciso I	0,00	0,00	0,00	10,00
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

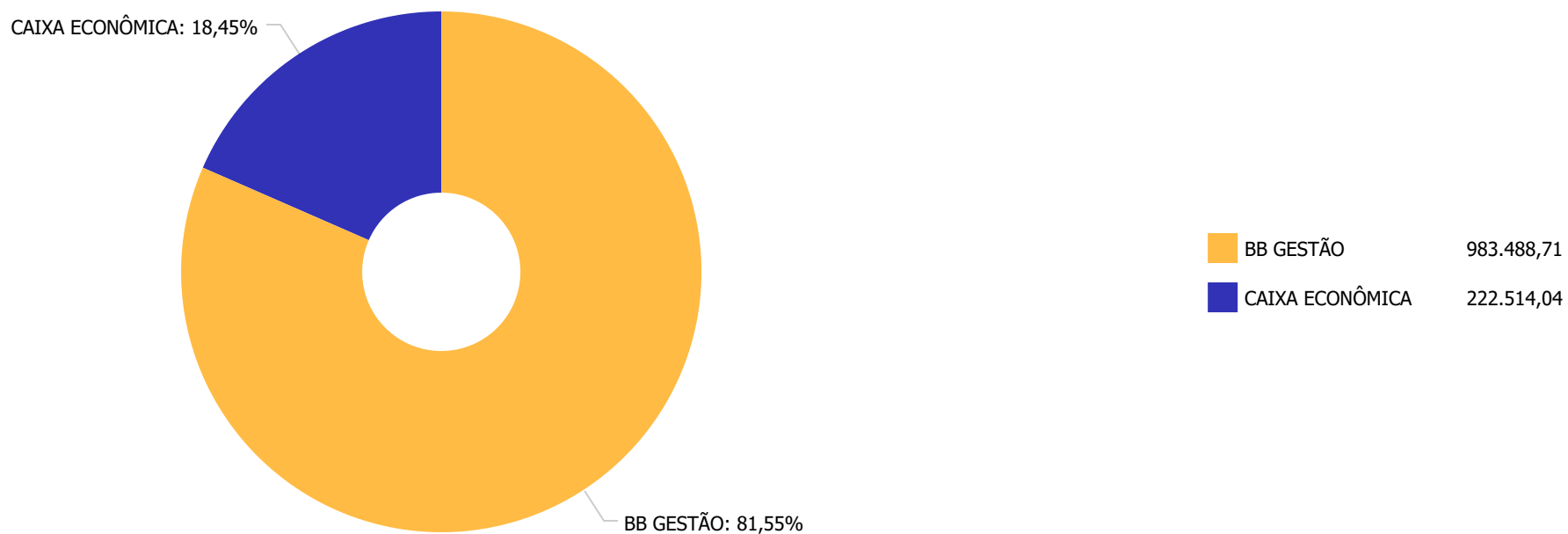
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2020 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	1,73%	8,62%	3,05%	5,10%	8,62%	21,46%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,53%	7,92%	3,22%	4,89%	7,92%	20,01%	0,01%	0,03%
IRF-M 1+ (Benchmark)	3,05%	8,45%	2,90%	2,29%	8,45%	23,90%	-	-
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	3,04%	8,22%	2,90%	2,21%	8,22%	23,25%	0,02%	0,04%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,31%	3,84%	0,70%	1,21%	3,84%	10,86%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,31%	3,47%	0,63%	0,99%	3,47%	10,19%	0,00%	0,01%
IMA-B 5 (Benchmark)	1,83%	8,04%	3,38%	4,72%	8,04%	22,25%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1,81%	7,78%	3,34%	4,56%	7,78%	21,67%	0,01%	0,03%

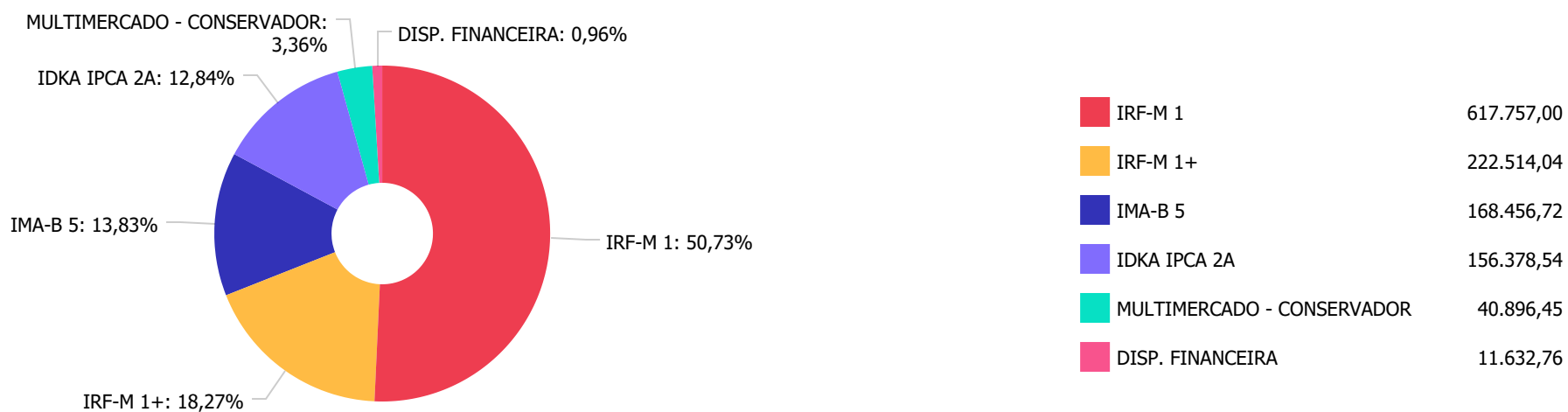
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Dezembro/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,16%	2,76%	0,47%	0,99%	2,76%	8,88%	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	1,10%	2,01%	1,91%	1,07%	2,01%	11,22%	0,00%	0,02%

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



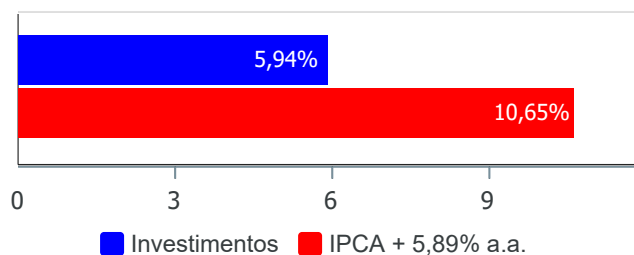
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Dezembro / 2020)



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	2.560.657,82	2.417.414,39	2.039.619,68	2.958.481,55	20.029,02	20.029,02	0,68%	0,68%	0,71%	0,71%	95,74%	0,38%
Fevereiro	2.958.481,55	900.250,21	972.029,55	2.902.056,69	15.354,48	35.383,50	0,52%	1,20%	0,66%	1,38%	87,43%	0,49%
Março	2.902.056,69	883.026,91	1.031.263,52	2.756.935,44	3.115,36	38.498,86	0,11%	1,31%	0,57%	1,96%	67,10%	4,15%
Abril	2.756.935,44	640.000,00	960.818,18	2.455.882,79	19.765,53	58.264,39	0,72%	2,04%	0,14%	2,10%	96,96%	2,79%
Mai	2.455.882,79	1.211.202,66	1.372.267,60	2.321.327,60	26.509,75	84.774,14	1,08%	3,14%	0,07%	2,18%	144,19%	1,04%
Junho	2.321.327,60	832.266,63	964.643,79	2.203.597,20	14.646,76	99.420,90	0,63%	3,79%	0,74%	2,93%	129,24%	0,70%
Julho	2.203.597,20	843.531,02	1.620.764,19	1.441.419,47	15.055,44	114.476,34	0,68%	4,50%	0,89%	3,85%	117,05%	0,65%
Agosto	1.441.419,47	1.570.442,85	1.893.156,30	1.116.682,17	-2.023,85	112.452,49	-0,07%	4,43%	0,72%	4,59%	96,48%	0,75%
Setembro	1.116.682,17	1.413.013,58	1.229.152,33	1.297.124,56	-3.418,86	109.033,63	-0,14%	4,29%	1,12%	5,76%	74,41%	1,11%
Outubro	1.297.124,56	1.335.112,89	1.079.445,02	1.552.822,95	30,52	109.064,15	0,00%	4,29%	1,34%	7,18%	59,73%	0,82%
Novembro	1.552.822,95	1.015.692,56	1.612.517,79	964.141,55	8.143,83	117.207,98	0,32%	4,62%	1,35%	8,63%	53,55%	0,85%
Dezembro	964.141,55	1.070.601,32	843.741,61	1.206.002,75	15.001,49	132.209,47	1,26%	5,94%	1,86%	10,65%	55,78%	0,57%

Investimentos x Meta Atuarial



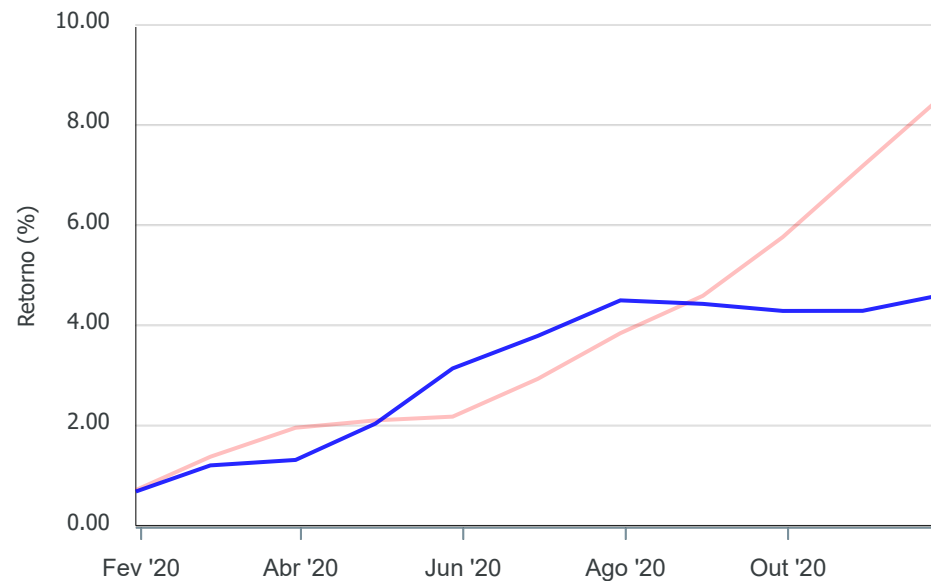
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Dezembro/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	250.315,82	0,00	34.979,46	222.514,04	7.177,68	2,87%	3,04%	1,69%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	165.466,92	0,00	0,00	168.456,72	2.989,80	1,81%	1,81%	0,75%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	154.028,63	0,00	0,00	156.378,54	2.349,91	1,53%	1,53%	0,66%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	353.878,69	875.302,15	613.460,00	617.757,00	2.036,16	0,17%	0,31%	0,10%
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO P...	0,00	195.299,17	195.302,15	0,00	2,98	0,00%	0,01%	0,00%
Total Renda Fixa	923.690,06	1.070.601,32	843.741,61	1.165.106,30	14.556,53	1,27%		0,57%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	40.451,49	0,00	0,00	40.896,45	444,96	1,10%	1,10%	0,47%
Total Renda Variável	40.451,49	0,00	0,00	40.896,45	444,96	1,10%		0,47%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	319.773,54	0,00	103.942,27	222.514,04	6.682,77	2,09%	2,90%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	163.018,94	0,00	0,00	168.456,72	5.437,78	3,34%	3,34%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	622.709,07	3.226.107,60	3.236.460,00	617.757,00	5.400,33	0,14%	0,63%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	151.494,08	0,00	0,00	156.378,54	4.884,46	3,22%	3,22%
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO P...	0,00	195.299,17	195.302,15	0,00	2,98	0,00%	0,03%
				Total Renda Fixa	22.408,32	0,48%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 4º Trimestre/2020

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	40.128,93	0,00	0,00	40.896,45	767,52	1,91%	1,91%
				Total Renda Variável	767,52	1,91%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no ano de 2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.306.250,90	12.115.067,64	12.858.818,44	617.757,00	55.256,90	0,41%	3,47%
CAIXA BRASIL IRF-M 1+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FI...	601.847,16	0,00	412.469,39	222.514,04	33.136,27	5,51%	8,22%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	351.356,10	0,00	370.559,83	0,00	19.203,73	5,47%	6,40%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	156.295,76	0,00	0,00	168.456,72	12.160,96	7,78%	7,78%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	144.907,90	0,00	0,00	156.378,54	11.470,64	7,92%	7,92%
BB AUTOMÁTICO SETOR PÚBLICO FIC RENDA FIXA CURTO P...	0,00	1.977.487,38	1.977.571,90	0,00	84,52	0,00%	0,49%
Total Renda Fixa					131.313,02	0,79%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no ano de 2020

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,00	40.000,00	0,00	40.896,45	896,45	2,24%	2,01%
				Total Renda Variável	896,45	2,24%	