

Relatório Analítico dos Investimentos

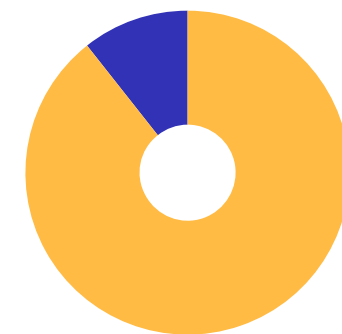
em agosto de 2020

Carteira consolidada de investimentos - base (Agosto / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVI...	D+2	Não há	62.565,09	0,29%	312	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	3.608.137,59	16,58%	717	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	2.115.969,94	9,72%	673	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	4.129.183,10	18,97%	600	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	3.425.602,17	15,74%	1.244	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	2.066.837,37	9,50%	627	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3 du	Não há	4.008.850,57	18,42%	361	0,21%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	28.023,10	0,13%	590	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.496.815,28	6,88%	1.633	0,16%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MUL...	D+2	01/10/2020	823.911,03	3,79%	956	0,16%	Artigo 8º, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			21.765.895,24				
DISPONIBILIDADES FINANCEIRAS			47.035,09				Artigo 6º
PL Total			21.812.930,33				

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

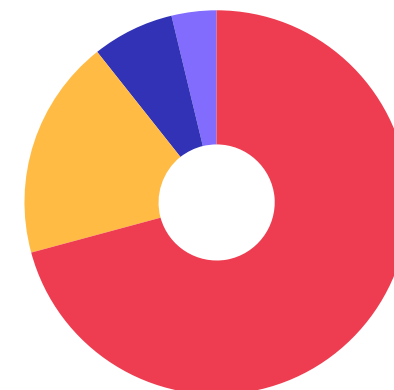
Artigos - Renda Fixa	Resolução %	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	21.765.895,24
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	15.408.295,26	70,79%	40,00%	70,00%	100,00%	6.357.599,98
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	21.765.895,24
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.088.294,76
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	13.059.537,14
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	13.059.537,14
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	4.036.873,67	18,55%	0,00%	10,00%	40,00%	4.669.484,43
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	8.706.358,10
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	4.353.179,05
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	4.353.179,05
Artigo 7º, Inciso VI	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	15,00%	3.264.884,29
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	3.264.884,29
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.088.294,76
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.088.294,76
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	1.088.294,76
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	1.088.294,76
Total Renda Fixa	100,00%	19.445.168,93	89,34%	40,00%	85,00%	595,00%	



RENDA FIXA 19.445.168,93
RENDA VARIÁVEL 2.320.726,31

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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '	30,00%	1.496.815,28	6,88%	0,00%	3,00%	30,00%	5.032.953,29
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	30,00%	6.529.768,57
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	20,00%	4.353.179,05
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	20,00%	4.353.179,05
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	823.911,03	3,79%	0,00%	4,00%	10,00%	1.352.678,49
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.088.294,76
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	1.088.294,76
Total Renda Variável	30,00%	2.320.726,31	10,66%	0,00%	15,00%	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%	2.176.589,52
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	2.176.589,52
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	2.176.589,52
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	

7º I b 7º IV a 8º I a 8º III

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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	20.941.984,21	96,21	0,00
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	823.911,03	3,79	0,00

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2020		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		

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)

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

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA Geral ex-C (Benchmark)	-0,68%	2,69%	1,88%	1,72%	6,16%	22,72%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,89%	2,63%	1,82%	1,67%	6,05%	23,16%	0,01%	0,04%
IMA-B 5+ (Benchmark)	-3,62%	-2,01%	6,38%	-2,35%	4,71%	44,71%	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-3,69%	-2,23%	6,21%	-2,57%	4,54%	43,91%	0,04%	0,17%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,12%	2,96%	0,64%	2,12%	5,06%	12,83%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,09%	2,78%	0,58%	1,99%	4,77%	12,31%	0,00%	0,01%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,43%	4,63%	2,55%	3,39%	9,24%	25,01%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,37%	4,46%	2,43%	3,21%	8,96%	24,42%	0,01%	0,04%
IMA-B (Benchmark)	-1,80%	0,80%	4,61%	0,09%	6,64%	36,00%	-	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,85%	0,64%	4,50%	-0,06%	6,38%	35,28%	0,02%	0,11%
IRF-M (Benchmark)	-0,75%	5,20%	1,11%	3,62%	8,70%	26,82%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,80%	5,01%	1,09%	3,47%	8,43%	26,24%	0,01%	0,03%
CDI (Benchmark)	0,16%	2,12%	0,57%	1,43%	3,86%	10,38%	-	-
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,18%	1,80%	0,68%	1,16%	3,42%	9,79%	0,00%	0,00%

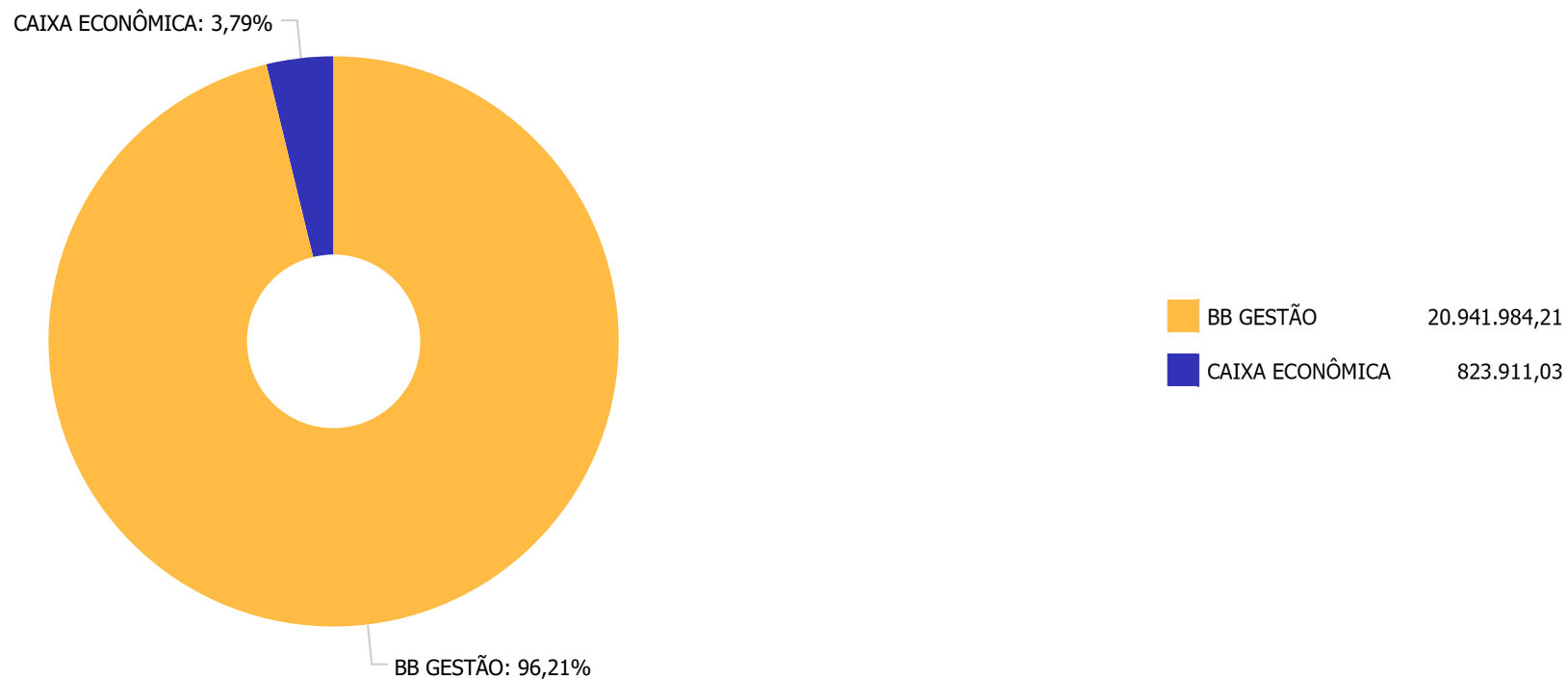
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2020 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA (Benchmark)	0,24%	0,70%	0,86%	0,24%	2,44%	5,95%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-1,05%	-	1,81%	-	-	-	0,01%	-

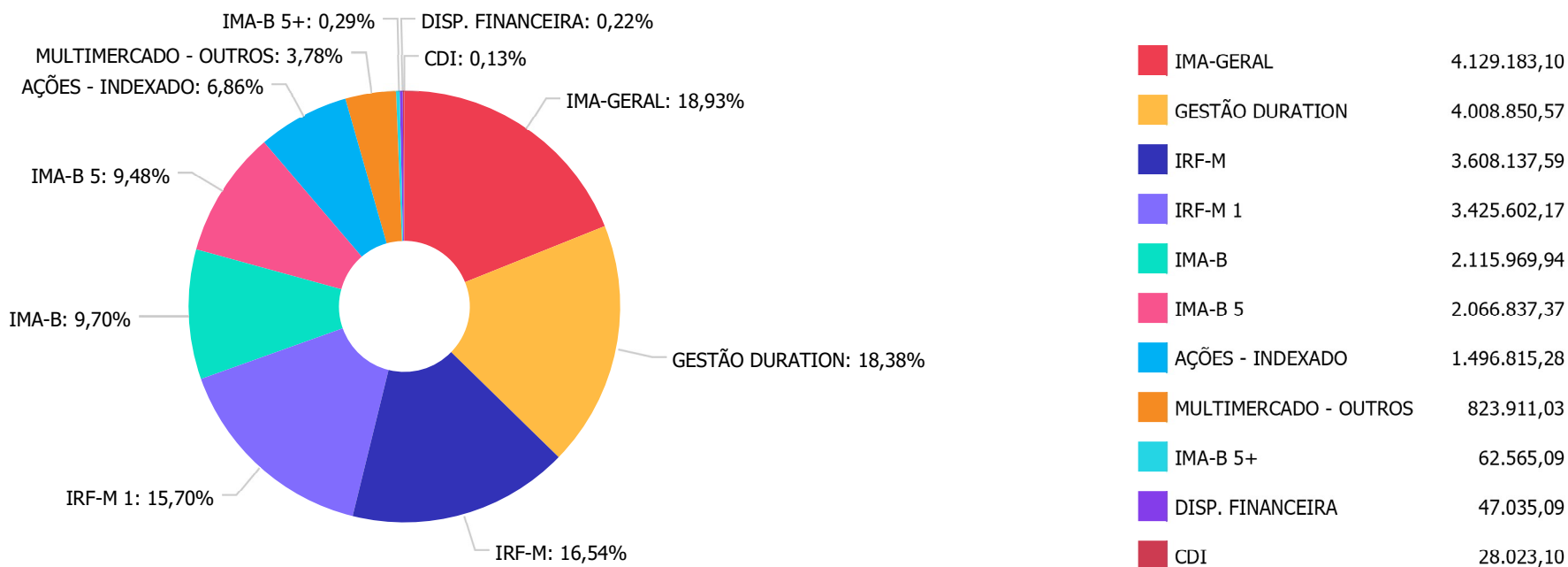
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Agosto/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IGC (Benchmark)	-2,61%	-10,30%	15,64%	-2,60%	4,04%	44,08%	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	-3,27%	-13,42%	14,23%	-5,10%	-0,39%	35,87%	0,10%	0,40%
Ibovespa (Benchmark)	-3,44%	-14,07%	13,69%	-4,61%	-1,75%	29,59%	-	-
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTIMERCADO	0,02%	1,87%	0,19%	1,28%	4,31%	16,69%	0,00%	0,01%

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



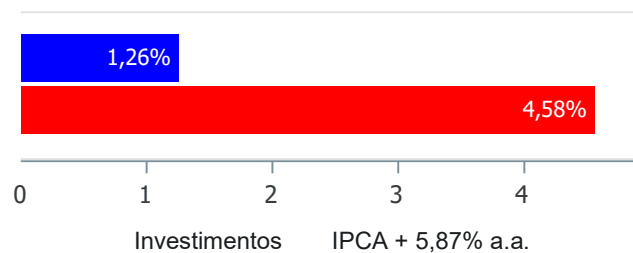
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Agosto / 2020)



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

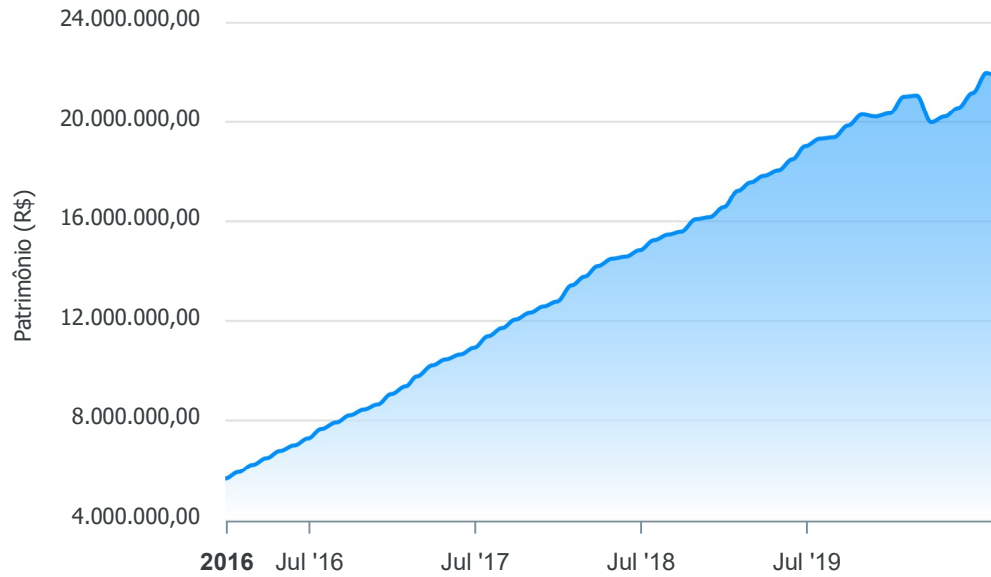
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	20.351.752,84	361.584,60	0,00	20.784.934,38	71.596,94	71.596,94	0,35%	0,35%	0,71%	0,71%	48,67%	1,61%
Fevereiro	20.784.934,38	316.363,64	0,00	21.058.944,42	-42.353,60	29.243,34	-0,20%	0,14%	0,66%	1,37%	10,50%	2,37%
Março	21.058.944,42	0,00	53.000,00	19.971.865,77	-1.034.078,65	-1.004.835,31	-4,91%	-4,77%	0,57%	1,95%	-244,57%	11,79%
Abril	19.971.865,77	0,00	117.000,00	20.145.505,87	290.640,10	-714.195,21	1,46%	-3,39%	0,14%	2,10%	-161,56%	6,24%
Mai	20.145.505,87	91.941,92	39.000,00	20.533.908,83	335.461,04	-378.734,17	1,66%	-1,78%	0,07%	2,17%	-82,15%	2,84%
Junho	20.533.908,83	183.883,84	0,00	21.053.663,18	335.870,51	-42.863,66	1,62%	-0,19%	0,74%	2,92%	-6,52%	2,29%
Julho	21.053.663,18	339.469,67	0,00	21.935.936,59	542.803,74	499.940,08	2,54%	2,34%	0,88%	3,83%	61,09%	1,87%
Agosto	21.935.936,59	4.578.148,24	4.515.835,71	21.765.895,24	-232.353,88	267.586,20	-1,06%	1,26%	0,72%	4,58%	27,54%	1,60%

Investimentos x Meta Atuarial



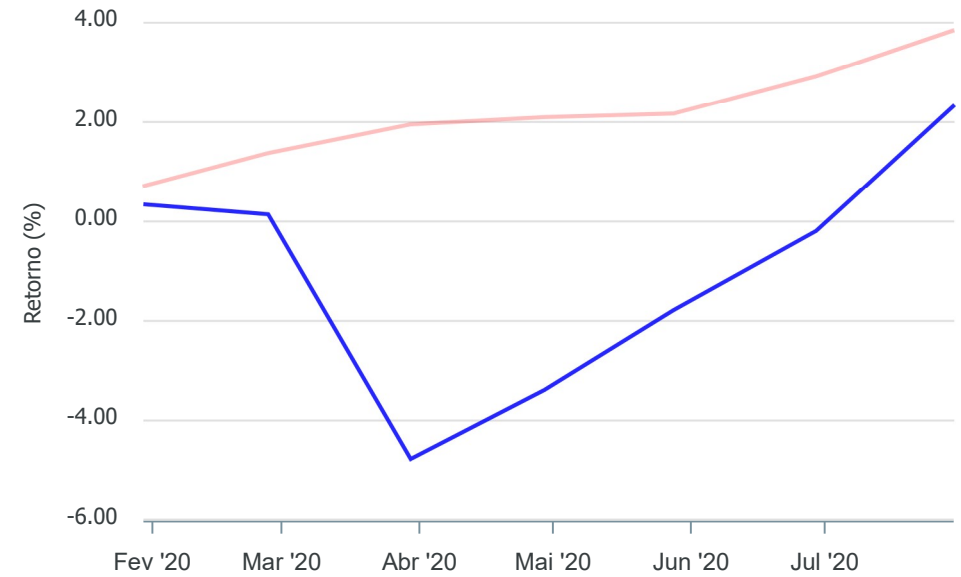
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



Comparativo

ANO 36M



- Investimentos Meta Atuarial CDI IMA-B IMA-B 5
- IMA-B 5+ IMA Geral IRF-M IRF-M 1 IRF-M 1+
- Ibovespa IBX SMLL IDIV

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2.059.285,27	0,00	0,00	2.066.837,37	7.552,10	0,37%	0,37%	0,81%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	27.972,42	0,00	0,00	28.023,10	50,68	0,18%	0,18%	0,03%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	0,00	4.003.986,15	0,00	4.008.850,57	4.864,42	0,12%	-1,05%	1,19%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	2.848.672,74	574.162,09	0,00	3.425.602,17	2.767,34	0,08%	0,09%	0,15%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	3.637.348,00	0,00	0,00	3.608.137,59	-29.210,41	-0,80%	-0,80%	1,03%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.166.210,30	0,00	0,00	4.129.183,10	-37.027,20	-0,89%	-0,89%	1,05%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.186.263,72	0,00	30.000,00	2.115.969,94	-40.293,78	-1,84%	-1,85%	2,27%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.574.162,09	0,00	4.485.835,71	0,00	-88.326,38	-1,93%	-1,79%	2,27%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	64.960,97	0,00	0,00	62.565,09	-2.395,88	-3,69%	-3,69%	3,80%
Total Renda Fixa	19.564.875,51	4.578.148,24	4.515.835,71	19.445.168,93	-182.019,11	-0,93%		1,03%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTI...	823.723,89	0,00	0,00	823.911,03	187,14	0,02%	0,02%	0,02%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	1.547.337,19	0,00	0,00	1.496.815,28	-50.521,91	-3,27%	-3,27%	9,81%
Total Renda Variável	2.371.061,08	0,00	0,00	2.320.726,31	-50.334,77	-2,12%		6,33%