

Relatório Analítico dos Investimentos

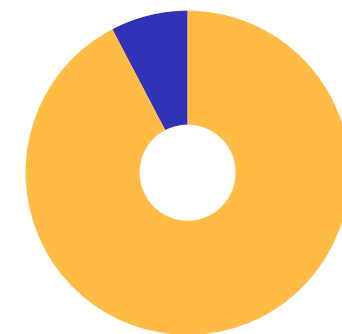
em dezembro, 4º trimestre e ano de 2020

Carteira consolidada de investimentos - base (Dezembro / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	834.933,77	3,62%	885	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	1.142.838,15	4,96%	679	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	3.516.166,04	15,27%	1.225	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	4.238.567,57	18,40%	588	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	D+1	Não há	1.022.503,60	4,44%	149	0,37%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	3.616.529,48	15,70%	701	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVI...	D+2	Não há	67.232,14	0,29%	296	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	2.132.498,80	9,26%	685	0,04%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3 du	Não há	4.589.022,86	19,92%	431	0,17%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	38.379,21	0,17%	576	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	67.121,14	0,29%	272	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.768.111,56	7,68%	1.656	0,14%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' a '
Total para cálculo dos limites da Resolução			23.033.904,32				

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

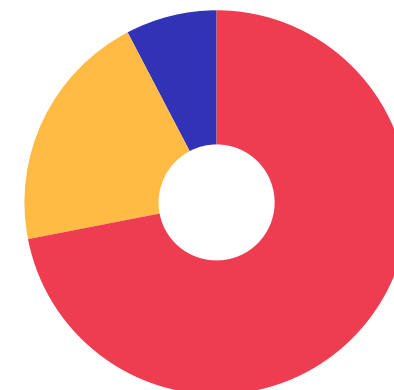
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' a '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	23.033.904,32
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	16.571.269,55	71,94%	40,00%	70,00%	100,00%	6.462.634,77
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' c '	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	23.033.904,32
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.151.695,22
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	13.820.342,59
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' b '	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	13.820.342,59
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	4.694.523,21	20,38%	0,00%	10,00%	40,00%	4.519.038,52
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' b '	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	40,00%	9.213.561,73
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' a '	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	4.606.780,86
Artigo 7º, Inciso V, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	4.606.780,86
Artigo 7º, Inciso VI	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	15,00%	3.455.085,65
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	3.455.085,65
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' b '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.151.695,22
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.151.695,22
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	1.151.695,22
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	1.151.695,22
Total Renda Fixa	100,00%	21.265.792,76	92,32%	40,00%	85,00%	595,00%	



RENDA FIXA 21.265.792,76
RENDA VARIÁVEL 1.768.111,56

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%	1.768.111,56	7,68%	0,00%	3,00%	30,00%	5.142.059,74
Artigo 8º, Inciso I, Alínea ' b '	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	30,00%	6.910.171,30
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	20,00%	4.606.780,86
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	20,00%	4.606.780,86
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	4,00%	10,00%	2.303.390,43
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	1.151.695,22
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	1.151.695,22
Total Renda Variável	30,00%	1.768.111,56	7,68%	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%	2.303.390,43
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	2.303.390,43
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	2.303.390,43
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	30,00%	

7º I b 7º IV a 8º I a

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

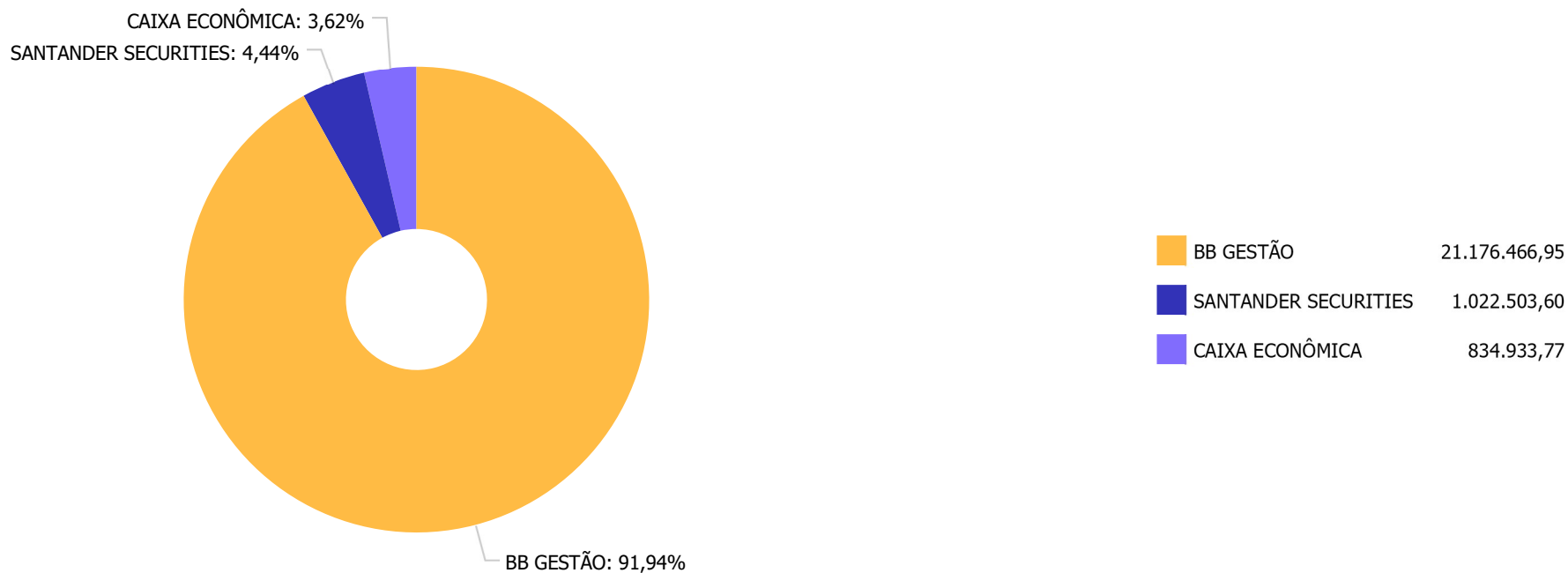
Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	21.176.466,95	91,94	0,00
BANCO DO NORDESTE DO BRASIL	1.022.503,60	4,44	0,01
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	834.933,77	3,62	0,00

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)

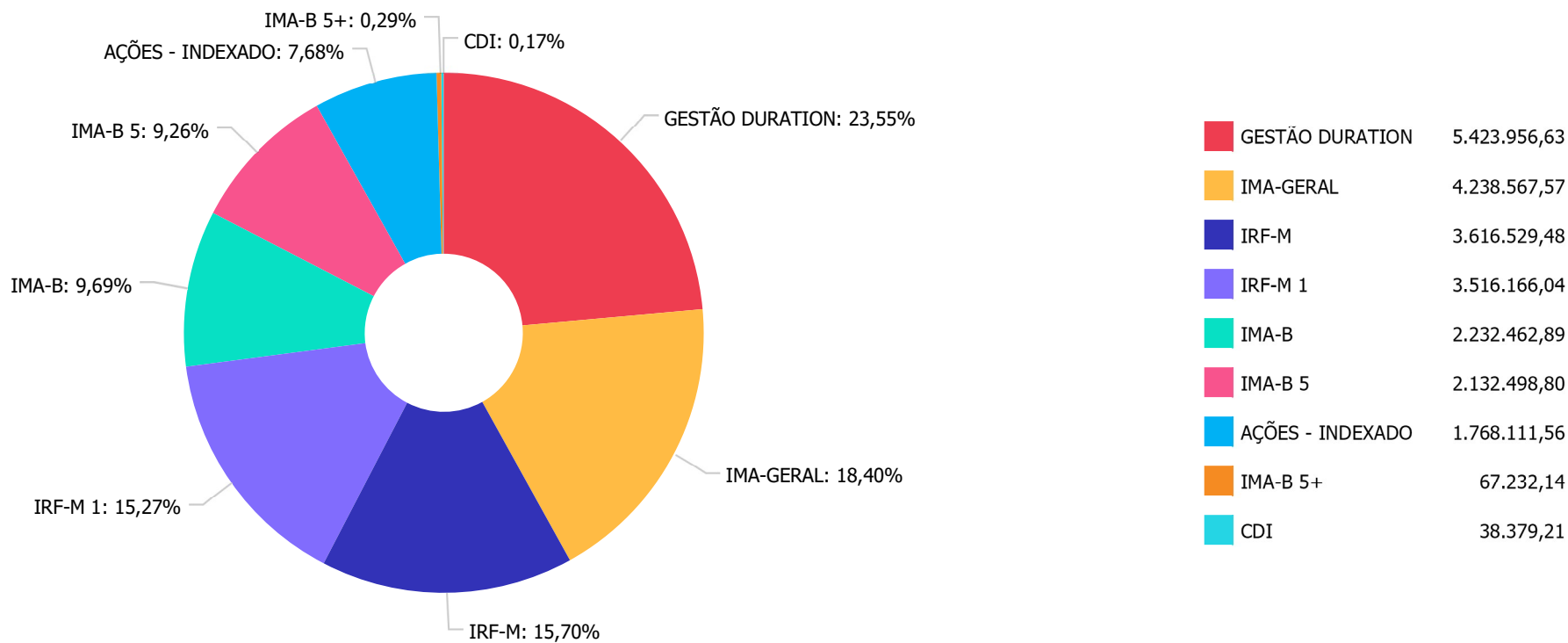
Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

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

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



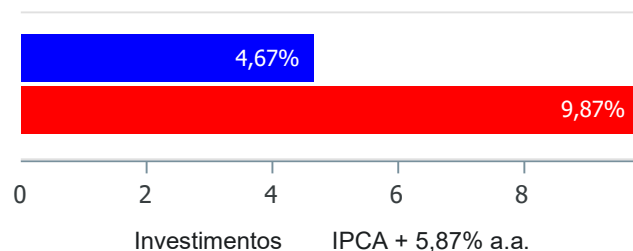
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Dezembro / 2020)



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

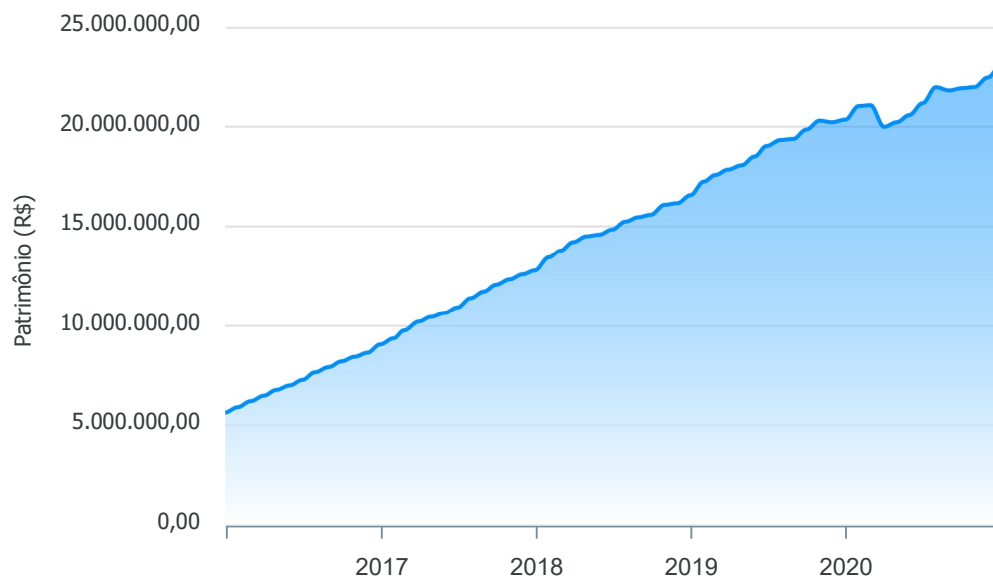
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	20.351.752,84	361.584,60	0,00	20.784.934,38	71.596,94	71.596,94	0,35%	0,35%	0,71%	0,71%	48,67%	1,61%
Fevereiro	20.784.934,38	316.363,64	0,00	21.058.944,42	-42.353,60	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%
Setembro	21.765.895,24	376.283,07	38.700,00	21.898.407,89	-205.070,42	62.515,78	-0,93%	0,32%	1,12%	5,75%	5,59%	2,37%
Outubro	21.898.407,89	910.166,18	853.224,26	21.936.201,10	-19.148,71	43.367,07	-0,09%	0,23%	1,34%	7,17%	3,26%	1,96%
Novembro	21.936.201,10	91.941,92	22.000,00	22.395.006,76	388.863,74	432.230,81	1,77%	2,01%	1,35%	8,61%	23,28%	1,82%
Dezembro	22.395.006,76	1.271.507,16	1.218.000,00	23.033.904,32	585.390,40	1.017.621,21	2,61%	4,67%	1,16%	9,87%	47,24%	1,38%

Investimentos x Meta Atuarial



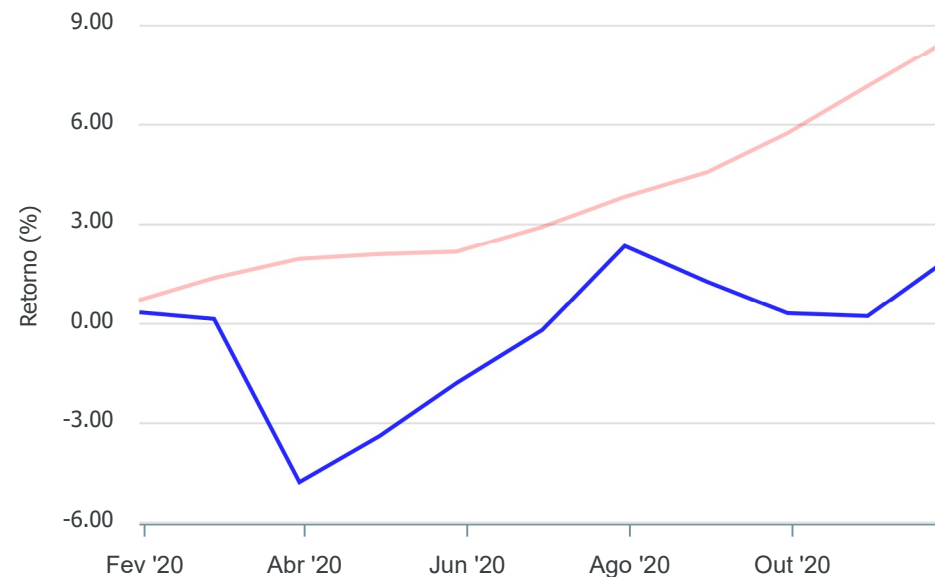
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Dezembro/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	62.556,27	0,00	0,00	67.232,14	4.675,87	7,47%	7,47%	3,37%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.071.011,35	0,00	1.000.000,00	1.142.838,15	71.826,80	3,47%	4,84%	2,03%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	4.289.051,87	183.883,84	0,00	4.589.022,86	116.087,15	2,60%	2,70%	1,09%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.129.956,09	10.355,56	0,00	4.238.567,57	98.255,92	2,37%	2,38%	1,02%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	0,00	1.000.000,00	0,00	1.022.503,60	22.503,60	2,25%	4,18%	1,76%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	3.546.854,00	0,00	0,00	3.616.529,48	69.675,48	1,96%	1,96%	1,04%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2.094.650,79	0,00	0,00	2.132.498,80	37.848,01	1,81%	1,81%	0,75%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	824.050,84	0,00	0,00	834.933,77	10.882,93	1,32%	1,32%	0,55%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	3.722.885,61	0,00	218.000,00	3.516.166,04	11.280,43	0,30%	0,31%	0,10%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	28.118,84	10.188,84	0,00	38.379,21	71,53	0,19%	0,25%	0,02%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	67.078,92	0,00	67.121,14	42,22	0,06%	4,81%	2,04%
Total Renda Fixa	20.769.135,66	1.271.507,16	1.218.000,00	21.265.792,76	443.149,94	2,13%		0,94%

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 GOVERNANÇA FI AÇÕES	1.625.871,10	0,00	0,00	1.768.111,56	142.240,46	8,75%	8,75%	6,71%
Total Renda Variável	1.625.871,10	0,00	0,00	1.768.111,56	142.240,46	8,75%		6,71%

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
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	4.065.873,60	367.767,68	0,00	4.589.022,86	155.381,58	3,50%	3,66%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.098.108,95	10.355,56	0,00	4.238.567,57	130.103,06	3,17%	3,17%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.083.057,19	0,00	1.057.000,00	1.142.838,15	116.780,96	5,61%	7,13%
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	3.545.889,50	0,00	0,00	3.616.529,48	70.639,98	1,99%	1,99%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	2.063.661,81	0,00	0,00	2.132.498,80	68.836,99	3,34%	3,34%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	3.711.339,16	0,00	218.000,00	3.516.166,04	22.826,88	0,62%	0,63%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	0,00	1.000.000,00	0,00	1.022.503,60	22.503,60	2,25%	6,20%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,00	818.224,26	0,00	834.933,77	16.709,51	2,04%	2,04%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	60.909,26	0,00	0,00	67.232,14	6.322,88	10,38%	10,38%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	28.029,84	10.188,84	0,00	38.379,21	160,53	0,42%	0,57%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	67.078,92	0,00	67.121,14	42,22	0,06%	7,04%
				Total Renda Fixa	610.308,19	2,95%	

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 GOVERNANÇA FI AÇÕES	1.421.308,54	0,00	0,00	1.768.111,56	346.803,02	24,40%	24,40%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTI...	820.230,04	0,00	818.224,26	0,00	-2.005,78	-0,24%	-
				Total Renda Variável	344.797,24	15,38%	

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 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	3.549.798,29	0,00	155.700,00	3.616.529,48	222.431,19	6,27%	6,40%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	4.023.421,34	10.355,56	0,00	4.238.567,57	204.790,67	5,08%	5,09%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	1.978.552,88	0,00	0,00	2.132.498,80	153.945,92	7,78%	7,78%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	0,00	4.463.695,75	0,00	4.589.022,86	125.327,11	2,81%	-
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	2.132.151,56	0,00	1.087.000,00	1.142.838,15	97.686,59	4,58%	6,14%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	2.490.323,37	1.238.510,79	310.000,00	3.516.166,04	97.331,88	2,61%	3,47%
BB IMA-B FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.548.450,42	980.315,04	4.485.835,71	67.121,14	24.191,39	0,53%	5,91%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	0,00	1.000.000,00	0,00	1.022.503,60	22.503,60	2,25%	5,19%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,00	818.224,26	0,00	834.933,77	16.709,51	2,04%	6,66%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	63.993,58	0,00	0,00	67.232,14	3.238,56	5,06%	5,06%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	27.529,06	10.188,84	0,00	38.379,21	661,31	1,75%	2,40%
				Total Renda Fixa	968.817,73	4,77%	

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 GOVERNANÇA FI AÇÕES	1.728.745,18	0,00	0,00	1.768.111,56	39.366,38	2,28%	2,28%
CAIXA CAPITAL PROTEGIDO BOLSA DE VALORES FIC MULTI...	808.787,16	0,00	818.224,26	0,00	9.437,10	1,17%	-
			Total Renda Variável		48.803,48	1,92%	

