

Relatório Analítico dos Investimentos

em janeiro de 2020

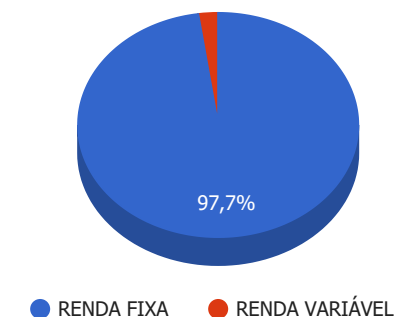
Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2020)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+1	Não há	13.539.887,44	13,50%	888	0,20%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	14.444.682,88	14,41%	717	0,14%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+2	Não há	4.280.689,76	4,27%	332	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	19.656.649,27	19,60%	1.213	0,27%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	20.361.541,77	20,31%	583	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	D+1	Não há	18.568.214,19	18,52%	78	7,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	D+0	Não há	6.935.729,98	6,92%	922	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	201.083,30	0,20%	737	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	2.284.755,89	2,28%	205	0,44%	Artigo 8º, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			100.273.234,48				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENTA FIXA) - base (Janeiro / 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%	100.273.234,48
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	97.787.395,29	97,52%	40,00%	60,00%	100,00%	2.485.839,19
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " c "	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	100,00%	100.273.234,48
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	5.013.661,72
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	60,00%	60.163.940,69
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	60.163.940,69
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	201.083,30	0,20%	0,00%	15,00%	40,00%	39.908.210,49
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	40,00%	40.109.293,79
Artigo 7º, Inciso V, Alínea " a "	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	15.040.985,17
Artigo 7º, Inciso V, Alínea " b "	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	15.040.985,17
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	5.013.661,72
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	5.013.661,72
Total Renda Fixa	100,00%	97.988.478,59	97,72%	40,00%	85,00%	545,00%	

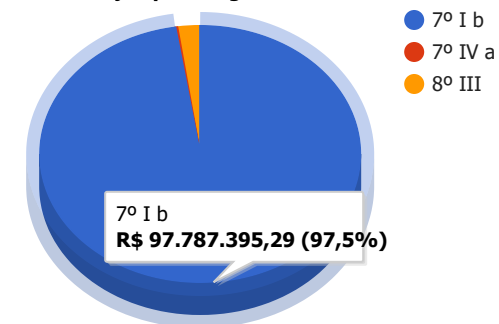
Distribuição por Segmento



Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (REDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Janeiro / 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%	2,00%	30,00%	30.081.970,34
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	30.081.970,34
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	20,00%	20.054.646,90
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	20.054.646,90
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	2.284.755,89	2,28%	0,00%	6,00%	10,00%	7.742.567,56
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	5.013.661,72
Total Renda Variável	30,00%	2.284.755,89	2,28%	0,00%	13,00%	115,00%	

Distribuição por Artigos



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%	1,00%	10,00%	10.027.323,45
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	10.027.323,45
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	20,00%	

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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	60.324.607,43	60,16	0,00
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	21.380.412,86	21,32	0,00
BANCO DO NORDESTE DO BRASIL	18.568.214,19	18,52	0,16

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 "	97.787.395,29	97,52	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 "	201.083,30	0,20	0,00	40,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00	0,00	40,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea " a "	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso V, 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 8º, Inciso I	0,00	0,00	0,00	30,00
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	20,00
Artigo 8º, Inciso III	2.284.755,89	2,28	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	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 Janeiro/2020 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA Geral ex-C (Benchmark)	0,50%	0,50%	0,70%	4,08%	11,07%	22,22%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,49%	0,49%	0,50%	3,93%	11,38%	22,76%	0,01%	0,03%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,54%	0,54%	1,76%	4,74%	11,02%	22,45%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,38%	0,38%	1,75%	4,52%	10,29%	20,76%	0,01%	0,02%
IMA-B 5+ (Benchmark)	0,03%	0,03%	-1,54%	6,07%	22,33%	43,41%	-	-
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,05%	0,05%	-1,45%	6,13%	22,08%	42,79%	0,03%	0,09%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,44%	0,44%	1,20%	3,05%	6,61%	14,04%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,42%	0,42%	1,13%	2,89%	6,33%	13,50%	0,00%	0,00%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,56%	0,56%	1,51%	5,04%	12,06%	23,36%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,54%	0,54%	1,41%	4,89%	11,76%	22,83%	0,01%	0,02%
IMA-B (Benchmark)	0,26%	0,26%	-0,24%	5,64%	18,11%	34,79%	-	-
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	0,30%	0,30%	-0,11%	5,59%	17,11%	31,34%	0,02%	0,06%
CDI (Benchmark)	0,38%	0,38%	1,14%	2,60%	5,78%	12,53%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,29%	0,29%	0,87%	2,05%	4,65%	10,14%	0,00%	0,00%

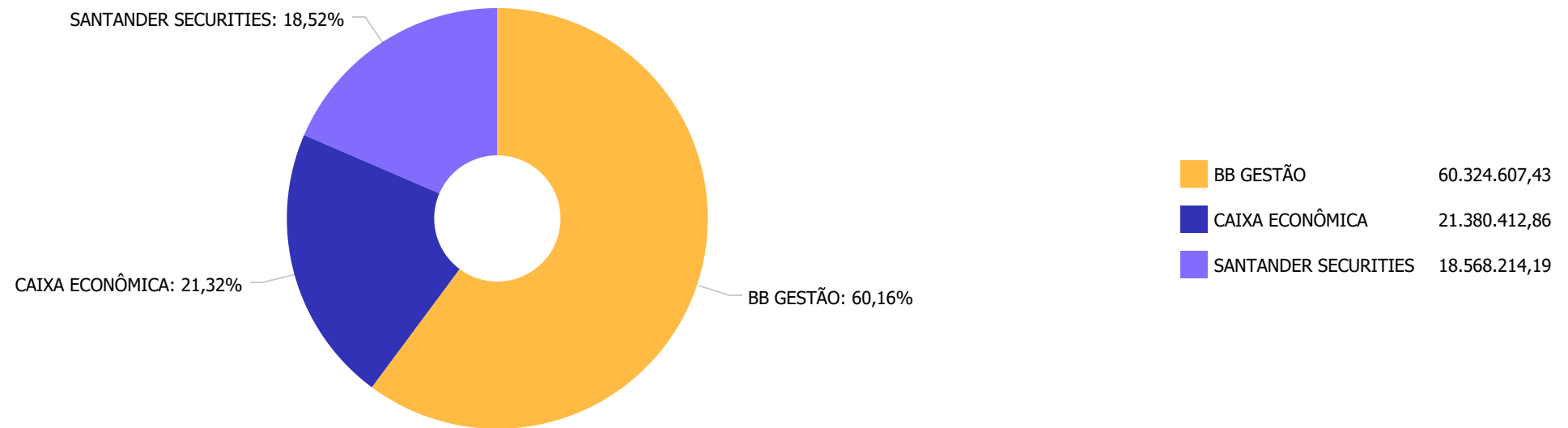
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2020 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IPCA (Benchmark)	0,21%	0,21%	1,88%	2,05%	4,19%	8,13%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,82%	0,82%	0,91%	4,67%	14,10%	25,30%	0,01%	0,04%

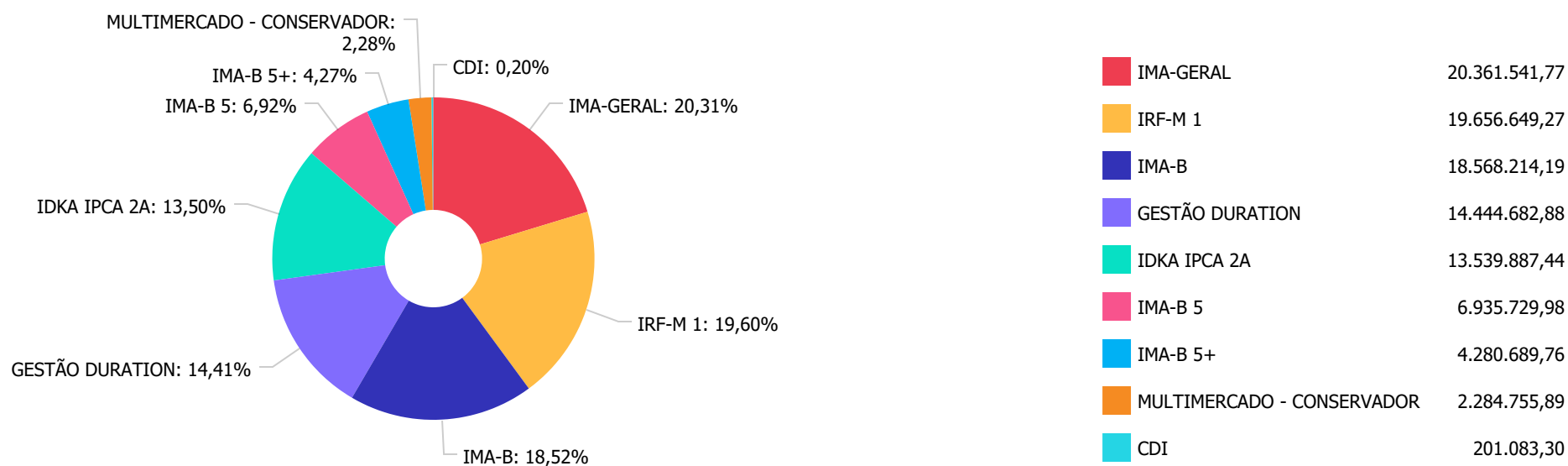
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2020 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,38%	0,38%	1,14%	2,60%	5,78%	12,53%	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,13%	0,13%	1,71%	4,37%	8,28%	16,24%	0,01%	0,01%

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



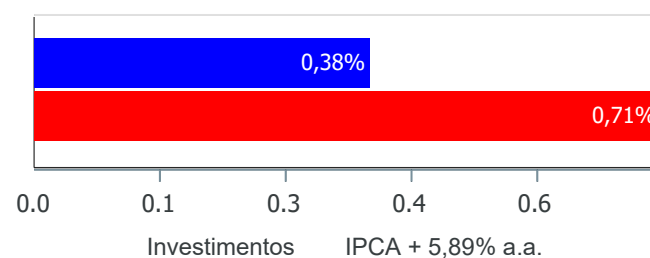
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Janeiro / 2020)



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

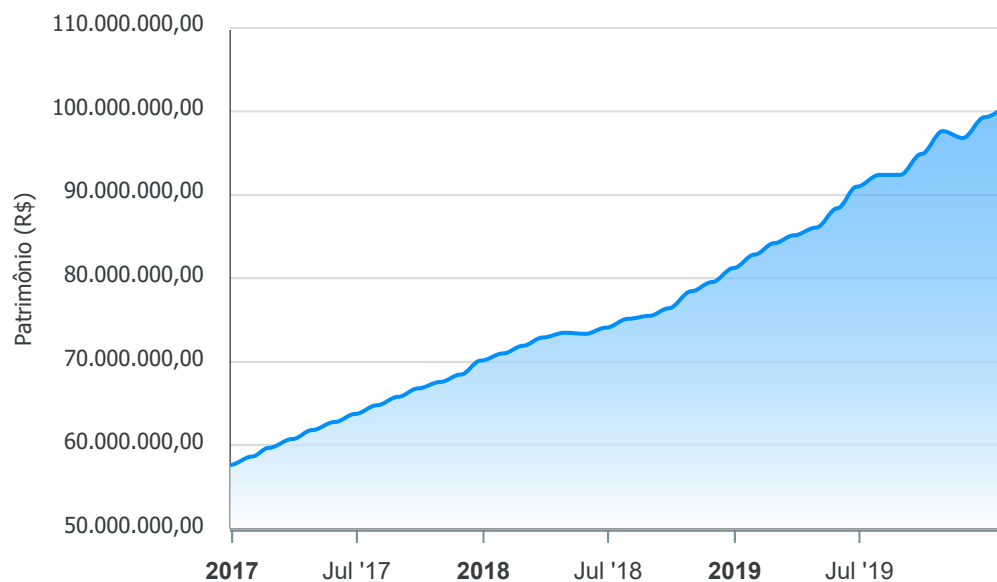
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	99.312.207,22	43.023.569,75	42.437.880,56	100.273.234,48	375.338,07	375.338,07	0,38%	0,38%	0,71%	0,71%	52,77%	0,81%

Investimentos x Meta Atuarial



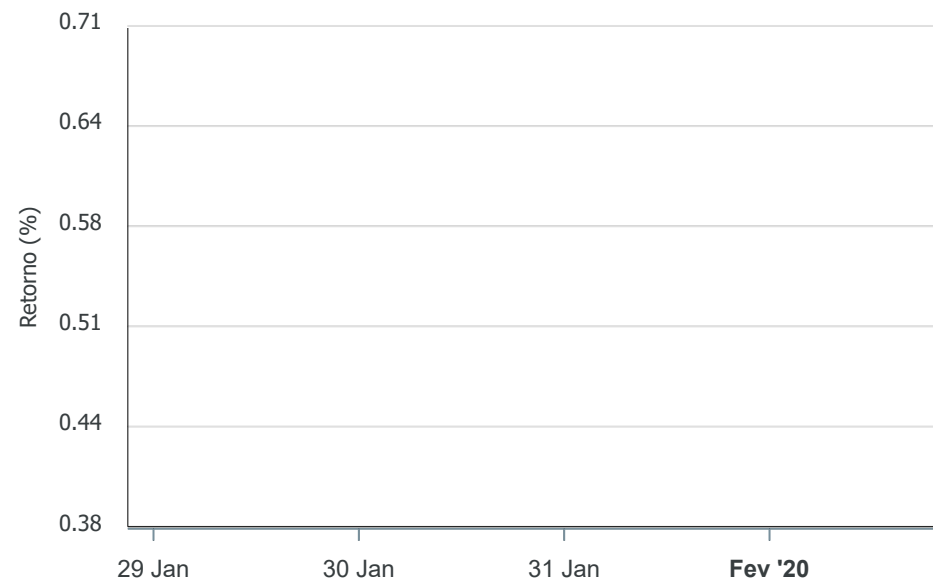
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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 Janeiro/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	14.327.299,19	0,00	0,00	14.444.682,88	117.383,69	0,82%	0,82%	0,64%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	6.898.196,76	0,00	0,00	6.935.729,98	37.533,22	0,54%	0,54%	0,64%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	17.095.871,89	3.174.566,20	0,00	20.361.541,77	91.103,68	0,45%	0,49%	0,72%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	13.487.960,41	0,00	0,00	13.539.887,44	51.927,03	0,38%	0,38%	0,55%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.162.683,98	0,00	3.174.566,20	0,00	11.882,22	0,38%	0,56%	0,62%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	18.512.870,16	0,00	0,00	18.568.214,19	55.344,03	0,30%	0,30%	1,62%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.782.078,24	20.643.562,46	22.248.817,46	201.083,30	24.260,06	0,11%	0,29%	0,00%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	4.278.661,90	0,00	0,00	4.280.689,76	2.027,86	0,05%	0,05%	2,59%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	536.173,20	19.205.441,09	93.948,00	19.656.649,27	8.982,98	0,05%	0,42%	0,09%
BB IMA-B TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	16.948.561,93	0,00	16.920.548,90	0,00	-28.013,03	-0,17%	0,26%	1,65%
Total Renda Fixa	97.030.357,66	43.023.569,75	42.437.880,56	97.988.478,59	372.431,74	0,38%		0,80%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Janeiro/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	2.281.849,56	0,00	0,00	2.284.755,89	2.906,33	0,13%	0,13%	1,10%
Total Renda Variável	2.281.849,56	0,00	0,00	2.284.755,89	2.906,33	0,13%		1,10%