

Relatório Analítico dos Investimentos

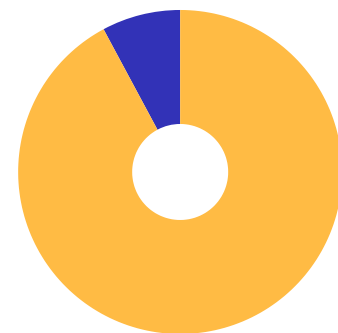
em junho, 2º trimestre e 1º semestre de 2020

Carteira consolidada de investimentos - base (Junho / 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	14.990.004,40	14,24%	763	0,12%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	D+1	Não há	18.197.817,24	17,28%	93	7,90%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	18.896.343,22	17,95%	884	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	23.352.851,76	22,18%	1.262	0,30%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	20.617.747,17	19,58%	600	0,19%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	988.967,72	0,94%	742	0,06%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' '
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	3.053.569,80	2,90%	16.254	0,28%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a ' '
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	2.303.081,01	2,19%	203	0,48%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	2.897.923,82	2,75%	20.627	0,12%	Artigo 8º, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			105.298.306,14				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (REDA FIXA) - base (Junho / 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%	105.298.306,14
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	96.054.763,79	91,22%	40,00%	60,00%	100,00%	9.243.542,35
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	100,00%	105.298.306,14
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	5.264.915,31
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	60,00%	63.178.983,68
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	63.178.983,68
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	40,00%	988.967,72	0,94%	0,00%	15,00%	40,00%	41.130.354,74
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'b'	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	40,00%	42.119.322,46
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'a'	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	15.794.745,92
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	15.794.745,92
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	5.264.915,31
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	5,00%	5.264.915,31
Total Renda Fixa	100,00%	97.043.731,51	92,16%	40,00%	85,00%	545,00%	

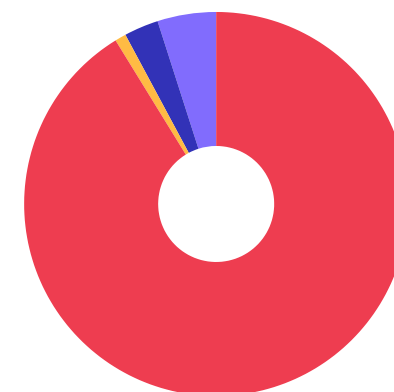


REDA FIXA 97.043.731,51
REDA VARIÁVEL 8.254.574,63

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Junho / 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%	31.589.491,84
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'b'	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	31.589.491,84
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	3.053.569,80	2,90%	0,00%	2,00%	20,00%	18.006.091,43
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'b'	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	21.059.661,23
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	5.201.004,83	4,94%	0,00%	6,00%	10,00%	5.328.825,78
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	5.264.915,31
Total Renda Variável	30,00%	8.254.574,63	7,84%	0,00%	13,00%	115,00%	

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%	1,00%	10,00%	10.529.830,61
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	10.529.830,61
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,00%	20,00%	



7º I b 7º IV a 8º II a 8º III

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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	66.158.990,88	62,83	0,00
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	20.941.498,02	19,89	0,00
BANCO DO NORDESTE DO BRASIL	18.197.817,24	17,28	0,15

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 '	96.054.763,79	91,22	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 '	988.967,72	0,94	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 '	3.053.569,80	2,90	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' b '	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	5.201.004,83	4,94	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 Junho/2020 - RENDA FIXA

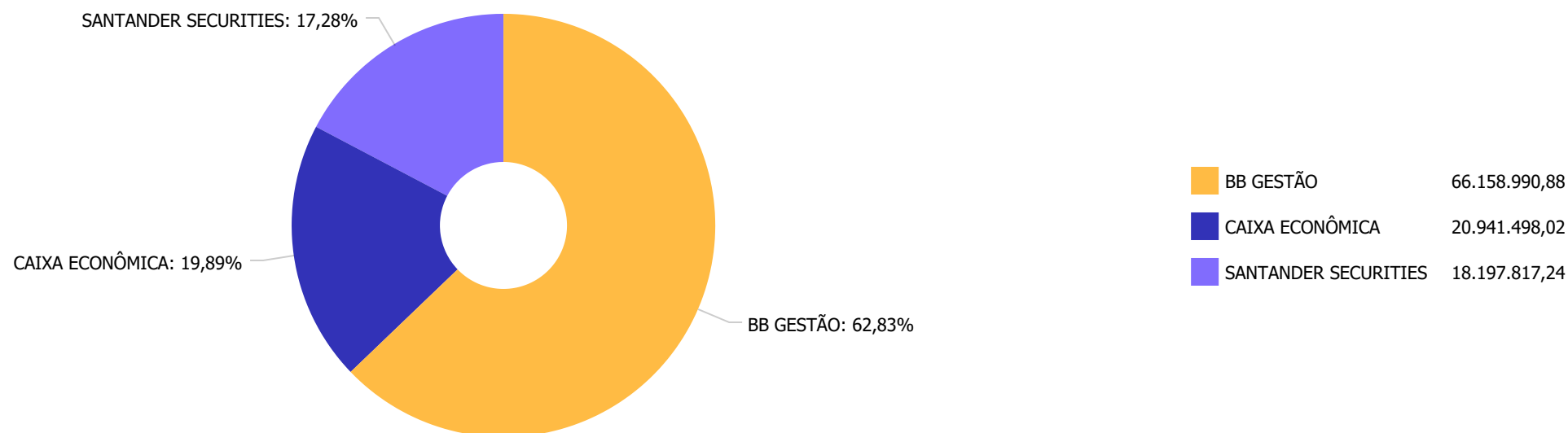
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA Geral ex-C (Benchmark)	0,90%	1,71%	2,74%	1,71%	6,19%	22,95%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,95%	1,75%	2,96%	1,75%	6,31%	23,30%	0,01%	0,04%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,99%	3,35%	3,35%	3,35%	8,68%	23,17%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1,21%	2,88%	3,57%	2,88%	8,18%	21,13%	0,01%	0,03%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,28%	2,60%	1,15%	2,60%	5,98%	13,67%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,26%	2,45%	1,06%	2,45%	5,71%	13,15%	0,00%	0,00%
IMA-B (Benchmark)	2,05%	-1,66%	4,96%	-1,66%	4,73%	35,13%	-	-
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	1,80%	-1,70%	4,57%	-1,70%	4,70%	31,15%	0,02%	0,09%
CDI (Benchmark)	0,21%	1,75%	0,73%	1,75%	4,58%	11,21%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,13%	1,24%	0,49%	1,24%	3,50%	8,88%	0,00%	0,00%
IPCA (Benchmark)	0,26%	0,10%	-0,43%	0,10%	2,12%	5,57%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,75%	4,63%	3,27%	4,63%	9,82%	28,20%	0,01%	0,03%

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

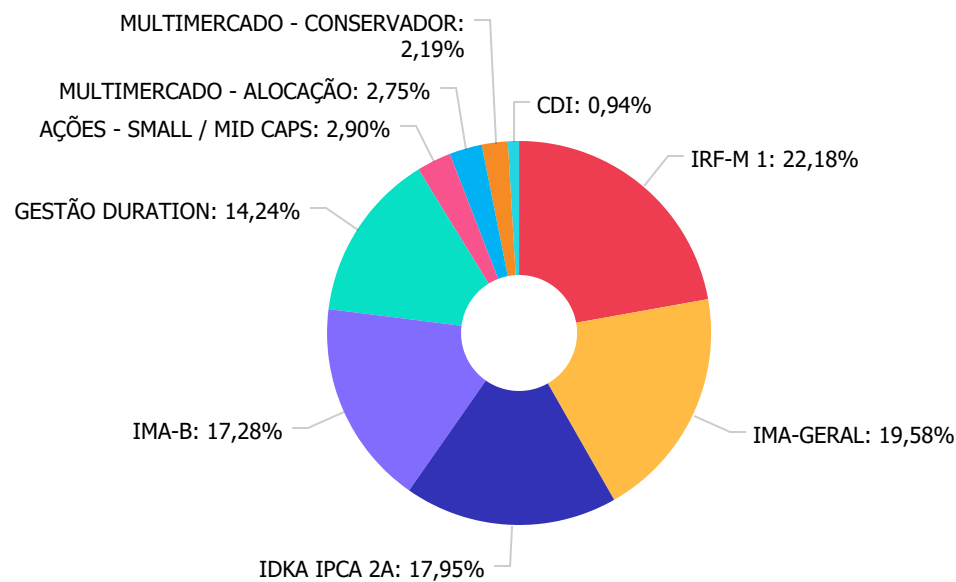
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
SMLL (Benchmark)	14,43%	-20,73%	32,49%	-20,73%	5,76%	49,01%	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	12,89%	-21,45%	31,67%	-21,45%	3,57%	42,14%	0,16%	0,45%

CDI (Benchmark)	0,21%	1,75%	0,73%	1,75%	4,58%	11,21%	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,46%	0,93%	1,74%	0,93%	5,64%	14,07%	0,01%	0,02%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	2,60%	-3,10%	8,72%	-3,10%	3,61%	18,53%	0,03%	0,11%

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



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

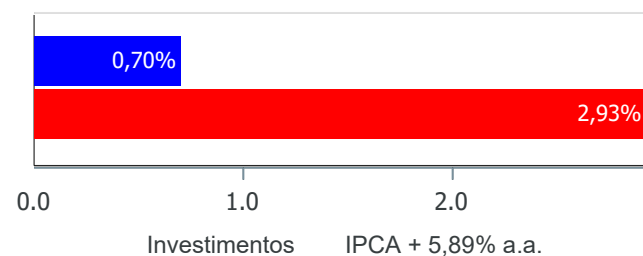


IRF-M 1	23.352.851,76
IMA-GERAL	20.617.747,17
IDKA IPCA 2A	18.896.343,22
IMA-B	18.197.817,24
GESTÃO DURATION	14.990.004,40
AÇÕES - SMALL / MID CAPS	3.053.569,80
MULTIMERCADO - ALOCAÇÃO	2.897.923,82
MULTIMERCADO - CONSERVADOR	2.303.081,01
CDI	988.967,72

Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2020)

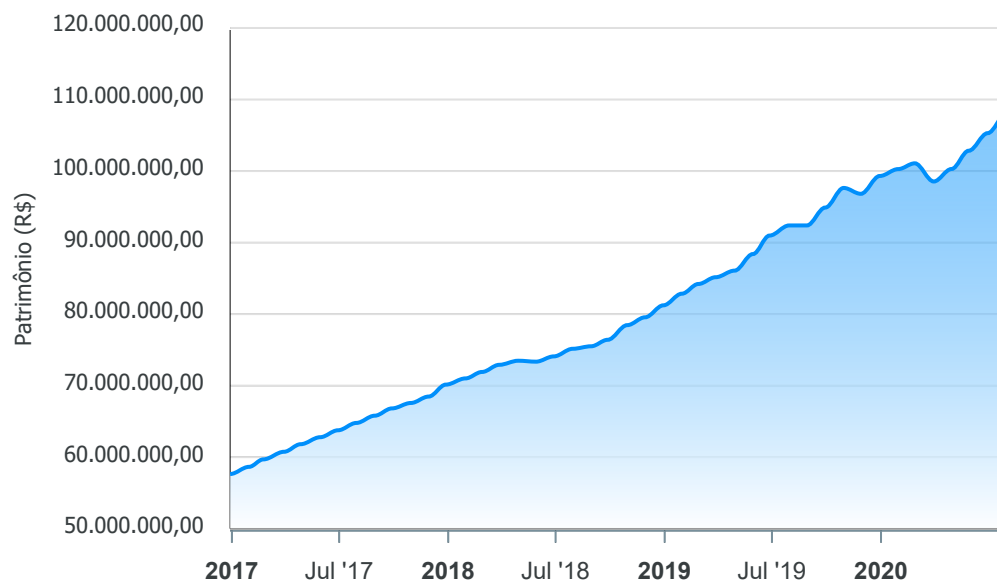
Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	99.312.207,22	43.023.569,75	42.437.880,56	100.273.234,48	375.338,07	375.338,07	0,38%	0,38%	0,71%	0,71%	52,77%	0,81%
Fevereiro	100.273.234,48	18.693.006,57	17.894.387,13	101.079.088,66	7.234,74	382.572,81	0,01%	0,38%	0,66%	1,38%	27,80%	1,67%
Março	101.079.088,66	1.010.923,59	240.443,33	98.539.528,08	-3.310.040,84	-2.927.468,03	-3,25%	-2,88%	0,57%	1,96%	-147,18%	8,47%
Abril	98.539.528,08	3.040.194,94	2.333.022,78	100.285.211,34	1.038.511,10	-1.888.956,93	1,05%	-1,86%	0,14%	2,10%	-88,60%	4,44%
Mai	100.285.211,34	3.316.011,84	2.082.688,45	102.840.897,77	1.322.363,04	-566.593,89	1,30%	-0,58%	0,07%	2,18%	-26,85%	1,98%
Junho	102.840.897,77	2.564.467,46	1.451.705,96	105.298.306,14	1.344.646,87	778.052,98	1,29%	0,70%	0,74%	2,93%	23,90%	1,59%

Investimentos x Meta Atuarial



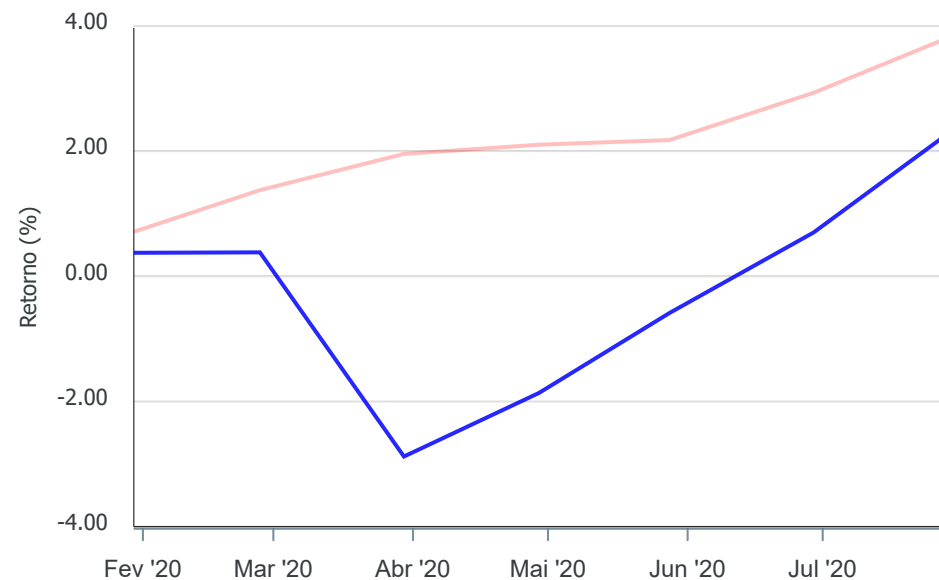
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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
- 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 Junho/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	17.875.570,42	0,00	0,00	18.197.817,24	322.246,82	1,80%	1,80%	2,49%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	17.484.273,09	1.188.633,43	0,00	18.896.343,22	223.436,70	1,20%	1,21%	0,81%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	20.423.986,47	0,00	0,00	20.617.747,17	193.760,70	0,95%	0,95%	1,27%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	14.878.473,75	0,00	0,00	14.990.004,40	111.530,65	0,75%	0,75%	1,17%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	23.551.752,10	0,00	259.261,78	23.352.851,76	60.361,44	0,26%	0,26%	0,05%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	805.054,36	1.375.834,03	1.192.444,18	988.967,72	523,51	0,02%	0,13%	0,01%
Total Renda Fixa	95.019.110,19	2.564.467,46	1.451.705,96	97.043.731,51	911.859,82	0,95%		1,09%

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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	2.704.828,43	0,00	0,00	3.053.569,80	348.741,37	12,89%	12,89%	16,18%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	2.824.487,71	0,00	0,00	2.897.923,82	73.436,11	2,60%	2,60%	3,49%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	2.292.471,44	0,00	0,00	2.303.081,01	10.609,57	0,46%	0,46%	0,86%
Total Renda Variável	7.821.787,58	0,00	0,00	8.254.574,63	432.787,05	5,53%		7,45%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	17.402.295,08	0,00	0,00	18.197.817,24	795.522,16	4,57%	4,57%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	20.024.590,78	0,00	0,00	20.617.747,17	593.156,39	2,96%	2,96%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	13.398.406,21	4.917.674,25	0,00	18.896.343,22	580.262,76	3,17%	3,57%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	14.514.828,51	0,00	0,00	14.990.004,40	475.175,89	3,27%	3,27%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	24.032.245,99	0,00	930.772,28	23.352.851,76	251.378,05	1,05%	1,06%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.918.863,59	4.002.999,99	4.936.644,91	988.967,72	3.749,05	0,06%	0,49%
			Total Renda Fixa		2.699.244,30	2,86%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 2º Trimestre/2020

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	2.319.140,64	0,00	0,00	3.053.569,80	734.429,16	31,67%	31,67%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	2.665.460,46	0,00	0,00	2.897.923,82	232.463,36	8,72%	8,72%
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	2.263.696,82	0,00	0,00	2.303.081,01	39.384,19	1,74%	1,74%
				Total Renda Variável	1.006.276,71	13,88%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre/2020

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	14.327.299,19	0,00	0,00	14.990.004,40	662.705,21	4,63%	4,63%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	13.487.960,41	4.917.674,25	0,00	18.896.343,22	490.708,56	2,67%	2,88%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	536.173,20	24.568.195,55	2.235.849,84	23.352.851,76	484.332,85	1,93%	2,45%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	17.095.871,89	3.174.566,20	0,00	20.617.747,17	347.309,08	1,71%	1,75%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	6.898.196,76	0,00	6.956.944,71	0,00	58.747,95	0,85%	3,04%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	1.782.078,24	32.030.793,44	32.857.152,00	988.967,72	33.248,04	0,10%	1,24%
BB IMA-B 5+ TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	4.278.661,90	0,00	4.295.066,56	0,00	16.404,66	0,38%	-5,38%
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%	3,08%
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%	-1,75%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	18.512.870,16	0,00	0,00	18.197.817,24	-315.052,92	-1,70%	-1,70%
				Total Renda Fixa	1.762.272,62	1,09%	

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no 1º Semestre/2020

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	2.281.849,56	0,00	0,00	2.303.081,01	21.231,45	0,93%	0,93%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	0,00	3.000.000,00	0,00	2.897.923,82	-102.076,18	-3,40%	-3,10%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	0,00	3.956.944,71	0,00	3.053.569,80	-903.374,91	-22,83%	-21,45%
				Total Renda Variável	-984.219,64	-10,65%	