

Relatório Analítico dos Investimentos

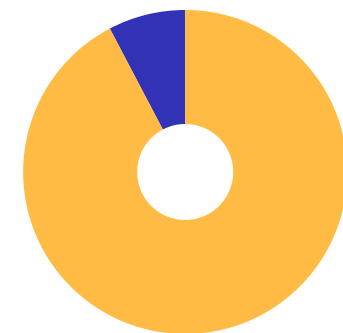
em janeiro de 2021

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2021)

Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	D+0	Não possui	15.286.016,75	13,07%	892	0,10%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	21.911.011,46	18,74%	1.212	0,26%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	D+1	Não há	19.320.546,93	16,52%	156	7,06%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	21.176.843,33	18,11%	591	0,22%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	22.559.427,72	19,29%	926	0,25%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	4.659.282,22	3,98%	689	0,09%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	3.005.046,68	2,57%	763	0,13%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	D+4	Não há	3.631.123,67	3,11%	14.571	0,30%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	2.325.130,10	1,99%	193	0,56%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	D+4	Não há	3.048.404,95	2,61%	17.962	0,14%	Artigo 8º, Inciso III
Total para cálculo dos limites da Resolução			116.922.833,81				

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Janeiro / 2021)

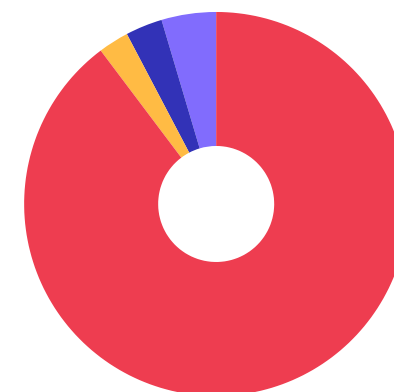
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'a'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	116.922.833,81
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'b'	100,00%	104.913.128,41	89,73%	40,00%	55,00%	100,00%	12.009.705,40
Artigo 7º, Inciso I, Alínea 'c'	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	100,00%	116.922.833,81
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	5.846.141,69
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'a'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	70.153.700,29
Artigo 7º, Inciso III, Alínea 'b'	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	60,00%	70.153.700,29
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'a'	40,00%	3.005.046,68	2,57%	0,00%	10,00%	40,00%	43.764.086,84
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea 'b'	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	40,00%	46.769.133,52
Artigo 7º, Inciso V, Alínea 'b'	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	40,00%	46.769.133,52
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea 'a'	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	17.538.425,07
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea 'b'	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	17.538.425,07
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	5.846.141,69
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	5.846.141,69
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea 'c'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	5.846.141,69
Total Renda Fixa	100,00%	107.918.175,09	92,30%	40,00%	71,00%	590,00%	



RENDA FIXA 107.918.175,09
RENDA VARIÁVEL 9.004.658,72

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (REDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Janeiro / 2021)

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'a'	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	30,00%	35.076.850,14
Artigo 8º, Inciso I, Alínea 'b'	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	35.076.850,14
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	3.631.123,67	3,11%	0,00%	10,00%	20,00%	19.753.443,09
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'b'	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	23.384.566,76
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	5.373.535,05	4,60%	0,00%	8,00%	10,00%	6.318.748,33
Artigo 8º, Inciso IV	0,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	5.846.141,69
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'a'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	5.846.141,69
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	5.846.141,69
Total Renda Variável	30,00%	9.004.658,72	7,70%	0,00%	25,00%	125,00%	



Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	11.692.283,38
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	11.692.283,38
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	10,00%	11.692.283,38
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	30,00%	

7º I b 7º IV a 8º II a 8º III

Enquadramentos na Resolução 4.604 por Gestores - base (Janeiro / 2021)

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	75.636.741,51	64,69	0,00
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	21.965.545,37	18,79	0,00
BANCO DO NORDESTE DO BRASIL	19.320.546,93	16,52	0,25

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 - 2021		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2021 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IMA Geral ex-C (Benchmark)	-0,44%	-0,44%	2,38%	0,96%	3,87%	15,36%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,55%	-0,55%	2,68%	0,93%	4,00%	15,84%	0,01%	0,04%
IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)	0,15%	0,15%	3,16%	4,28%	8,20%	20,12%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,18%	0,18%	3,07%	4,24%	7,69%	18,77%	0,01%	0,03%
IRF-M 1 (Benchmark)	0,04%	0,04%	0,58%	1,02%	3,43%	10,27%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,03%	0,03%	0,54%	0,79%	3,07%	9,59%	0,00%	0,01%
IMA-B 5 (Benchmark)	0,11%	0,11%	3,28%	3,80%	7,55%	20,52%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,10%	0,10%	3,24%	3,66%	7,29%	19,97%	0,01%	0,04%
IMA-B (Benchmark)	-0,85%	-0,85%	6,04%	2,78%	5,22%	24,29%	-	-
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	-0,78%	-0,78%	5,21%	2,52%	4,05%	21,86%	0,02%	0,10%
CDI (Benchmark)	0,15%	0,15%	0,46%	0,94%	2,53%	8,46%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,08%	0,08%	0,24%	0,37%	1,43%	6,15%	0,00%	0,00%
IPCA (Benchmark)	0,25%	0,25%	2,51%	4,30%	4,56%	8,94%	-	-
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	0,03%	0,03%	2,18%	0,99%	5,83%	20,75%	0,01%	0,02%

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2021 - RENDA FIXA

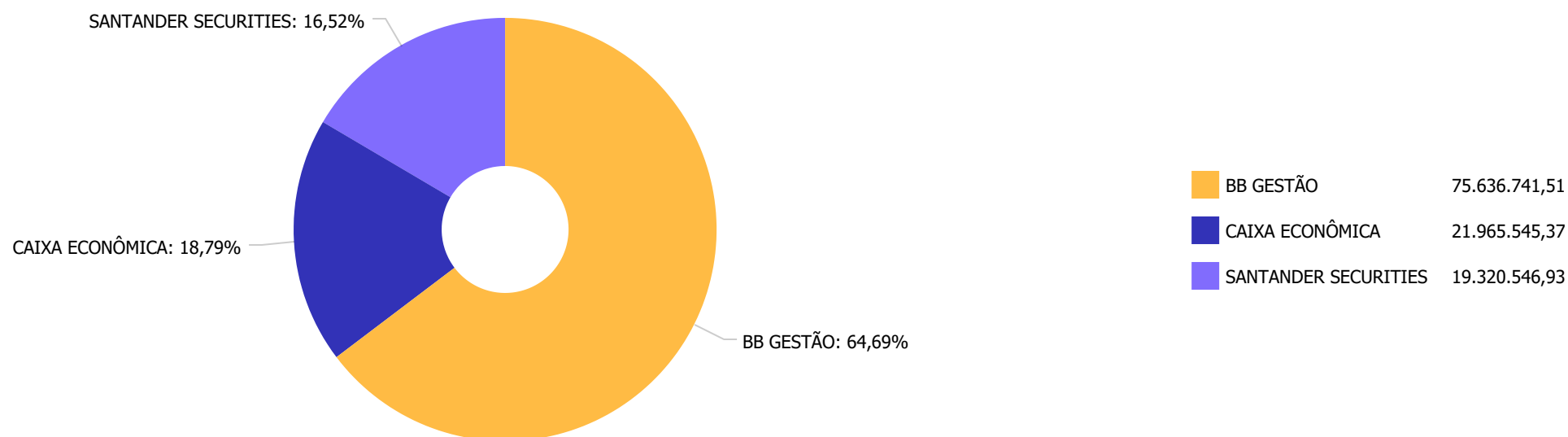
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
--	-----	-----	----	----	-----	-----	---------	------------------

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2021 - RENDA VARIÁVEL

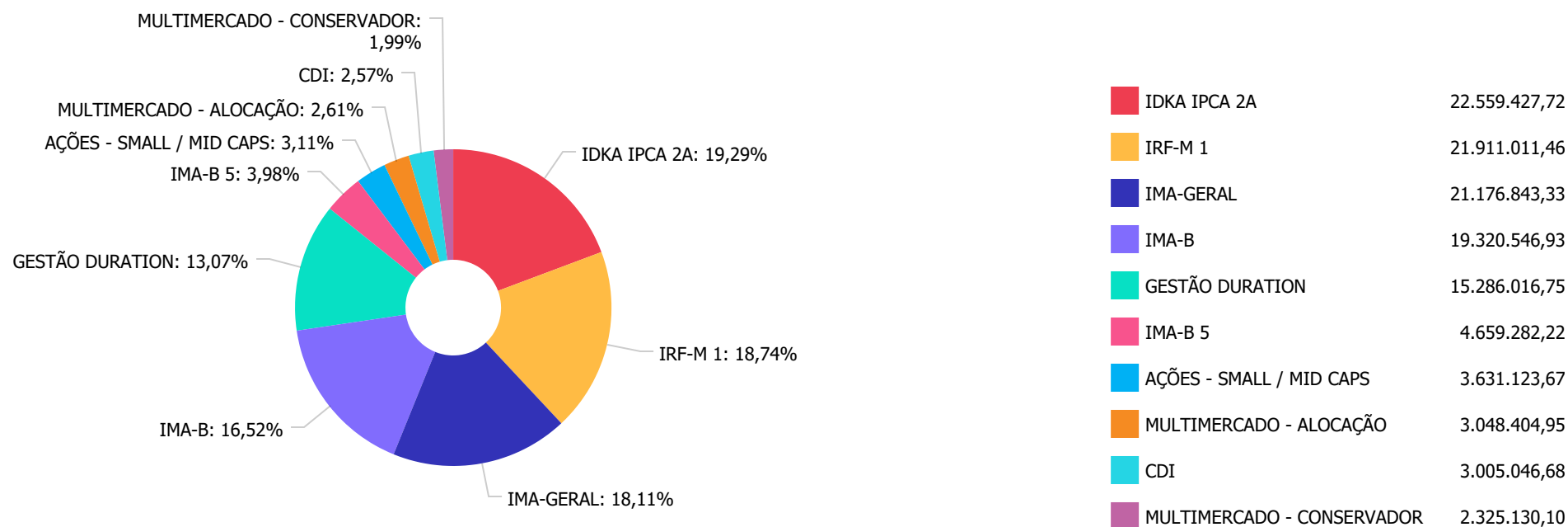
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
SMLL (Benchmark)	-3,43%	-3,43%	21,10%	10,52%	-4,50%	38,71%	-	-
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	-3,48%	-3,48%	20,19%	8,82%	-7,06%	31,28%	0,12%	0,47%

CDI (Benchmark)	0,15%	0,15%	0,46%	0,94%	2,53%	8,46%	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	-0,11%	-0,11%	2,01%	0,59%	1,77%	10,20%	0,01%	0,02%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	-0,58%	-0,58%	6,06%	2,69%	2,18%	12,11%	0,03%	0,12%

Distribuição dos ativos por Administradores - base (Janeiro / 2021)



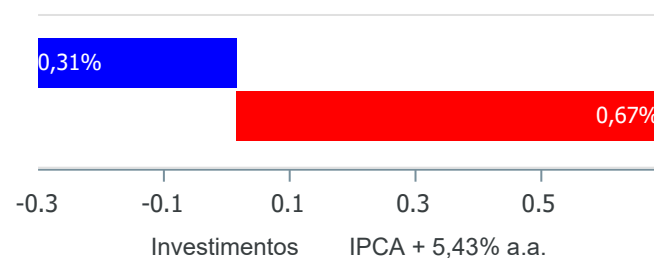
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Janeiro / 2021)



Retorno e Meta Atuarial acumulados no ano de 2021)

Mês	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo no Mês	Retorno	Retorno Acum	Retorno Mês	Retorno Acum	Meta Mês	Meta Acum	Gap Acum	VaR
Janeiro	116.527.450,43	998.315,94	238.587,00	116.922.833,81	-364.345,56	-364.345,56	-0,31%	-0,31%	0,67%	0,67%	-46,25%	1,48%

Investimentos x Meta Atuarial



Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

Evolução do Patrimônio



☐ 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 Janeiro/2021

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	22.519.570,17	0,00	0,00	22.559.427,72	39.857,55	0,18%	0,18%	0,95%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	4.654.792,57	0,00	0,00	4.659.282,22	4.489,65	0,10%	0,10%	1,04%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	2.216.097,86	998.315,94	211.102,93	3.005.046,68	1.735,81	0,05%	0,08%	0,01%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	21.931.612,51	0,00	27.484,07	21.911.011,46	6.883,02	0,03%	0,03%	0,15%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	15.282.151,74	0,00	0,00	15.286.016,75	3.865,01	0,03%	0,03%	0,76%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	21.294.464,42	0,00	0,00	21.176.843,33	-117.621,09	-0,55%	-0,55%	1,42%
BNB RPPS IMA-B FI RENDA FIXA	19.472.802,64	0,00	0,00	19.320.546,93	-152.255,71	-0,78%	-0,78%	2,35%
Total Renda Fixa	107.371.491,91	998.315,94	238.587,00	107.918.175,09	-213.045,76	-0,20%		1,08%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Janeiro/2021

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	2.327.789,58	0,00	0,00	2.325.130,10	-2.659,48	-0,11%	-0,11%	0,58%
CAIXA RV 30 FI MULTIMERCADO LP	3.066.165,95	0,00	0,00	3.048.404,95	-17.761,00	-0,58%	-0,58%	3,29%
CAIXA SMALL CAPS ATIVO FI AÇÕES	3.762.002,99	0,00	0,00	3.631.123,67	-130.879,32	-3,48%	-3,48%	12,27%
Total Renda Variável	9.155.958,52	0,00	0,00	9.004.658,72	-151.299,80	-1,65%		6,21%