

# Relatório Analítico dos Investimentos

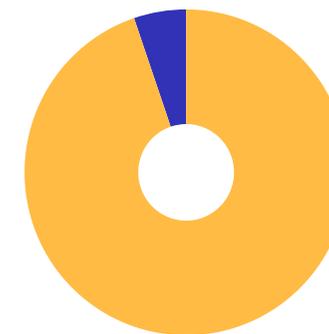
em janeiro de 2021

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	6.837.294,84	34,40%	892	0,05%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	2.755.330,03	13,86%	926	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	1.466.042,56	7,38%	1.212	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b ' '
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA P...	D+3	Não há	3.580.834,52	18,01%	443	0,14%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	2.947,72	0,01%	763	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' '
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	D+0	Não há	820.318,45	4,13%	299	0,13%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' '
BB TESOUREIRO FIC RENDA FIXA SELIC LP	D+0	Não há	2.637.217,46	13,27%	38.391	0,11%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a ' '
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	D+1260	90 dias	97.955,92	0,49%	70	0,13%	Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a ' '
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	D+5 du	Não há	615.824,61	3,10%	70	0,81%	Artigo 8º, Inciso III
AUSTRO MULTIPAR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	D+1	4 anos	422.390,49	2,12%	33	0,53%	Artigo 8º, Inciso III
PIATÃ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVA...	D+1 ou ...	Não há	642.001,42	3,23%		0,00%	Desenquadrado - RF
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>19.878.158,02</b>				

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 ' b '	100,00%	11.058.667,43	55,63%	15,00%	25,00%	100,00%	8.819.490,59
Artigo 7º, Inciso III, Alínea ' a '	60,00%	0,00	0,00%	5,00%	10,00%	60,00%	11.926.894,81
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	7.041.318,15	35,42%	10,00%	30,00%	40,00%	909.945,06
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea ' a '	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	2.981.723,70
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' a '	5,00%	97.955,92	0,49%	2,00%	5,00%	5,00%	895.951,98
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	993.907,90
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea ' c '	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	993.907,90
Desenquadrado - RF	0,00%	642.001,42	3,23%	0,00%	0,00%	0,00%	-642.001,42
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>18.839.942,92</b>	<b>94,78%</b>	<b>32,00%</b>	<b>70,00%</b>	<b>230,00%</b>	

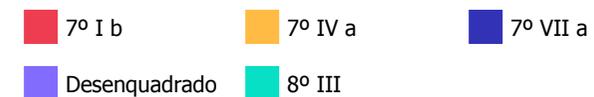
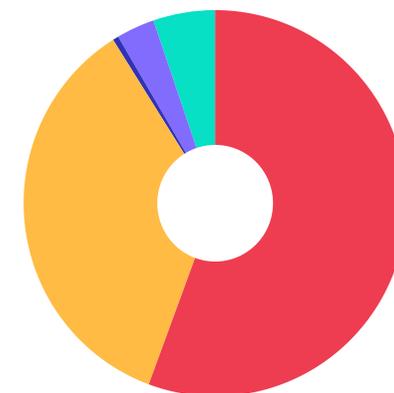


RENDA FIXA 18.839.942,92

RENDA VARIÁVEL 1.038.215,10

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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	20,00%	0,00	0,00%	7,00%	10,00%	20,00%	3.975.631,60
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	1.038.215,10	5,22%	7,00%	10,00%	10,00%	949.600,70
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' a '	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	993.907,90
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	5,00%	0,00	0,00%	2,00%	5,00%	5,00%	993.907,90
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>1.038.215,10</b>	<b>5,22%</b>	<b>18,00%</b>	<b>30,00%</b>	<b>40,00%</b>	



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	11.058.196,90	55,63	0,00
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	7.657.613,29	38,52	0,00
BRPP GESTÃO DE PRODUTOS ESTRUT...	642.001,42	3,23	-
AUSTRO GESTÃO DE RECURSOS LTDA	422.390,49	2,12	0,05
GRAPHEN INVESTIMENTOS	97.955,92	0,49	0,05

**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 %		

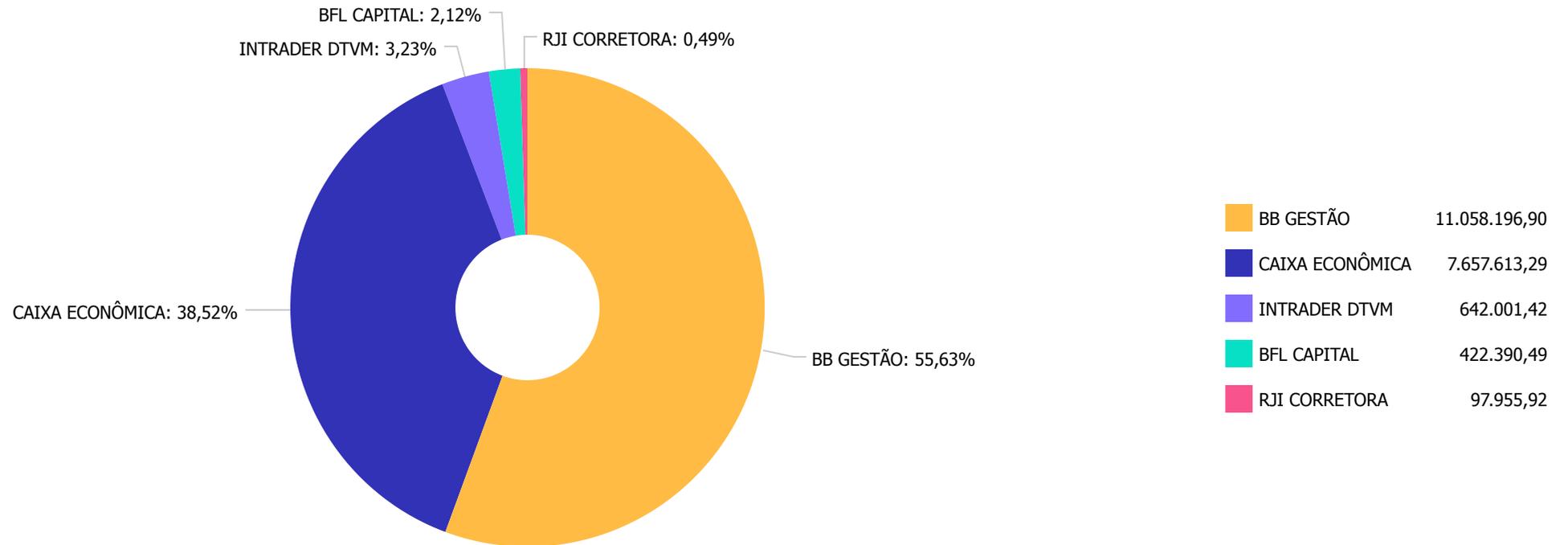
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2021 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>	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%	0,95%	0,03%
<b>IPCA + 7,00% ao ano (Benchmark)</b>	0,79%	0,79%	4,23%	7,86%	11,79%	24,66%	-	-
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	0,03%	0,03%	0,11%	-1,37%	-4,58%	-4,73%	0,41%	0,03%
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	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%	0,15%	0,01%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,15%	0,15%	0,46%	0,94%	2,53%	8,46%	-	-
PIATÃ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO LP	0,70%	0,70%	0,37%	-0,22%	-3,44%	-4,75%	-	-
BB TESOURO FIC RENDA FIXA SELIC LP	0,15%	0,15%	0,47%	0,72%	2,12%	7,68%	0,01%	0,00%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,08%	0,08%	0,24%	0,37%	1,43%	6,15%	0,01%	0,00%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	0,08%	0,08%	0,25%	0,52%	1,68%	6,66%	0,00%	0,00%
<b>IPCA (Benchmark)</b>	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%	0,76%	0,02%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	-0,47%	-0,47%	3,25%	1,20%	-	-	1,56%	-

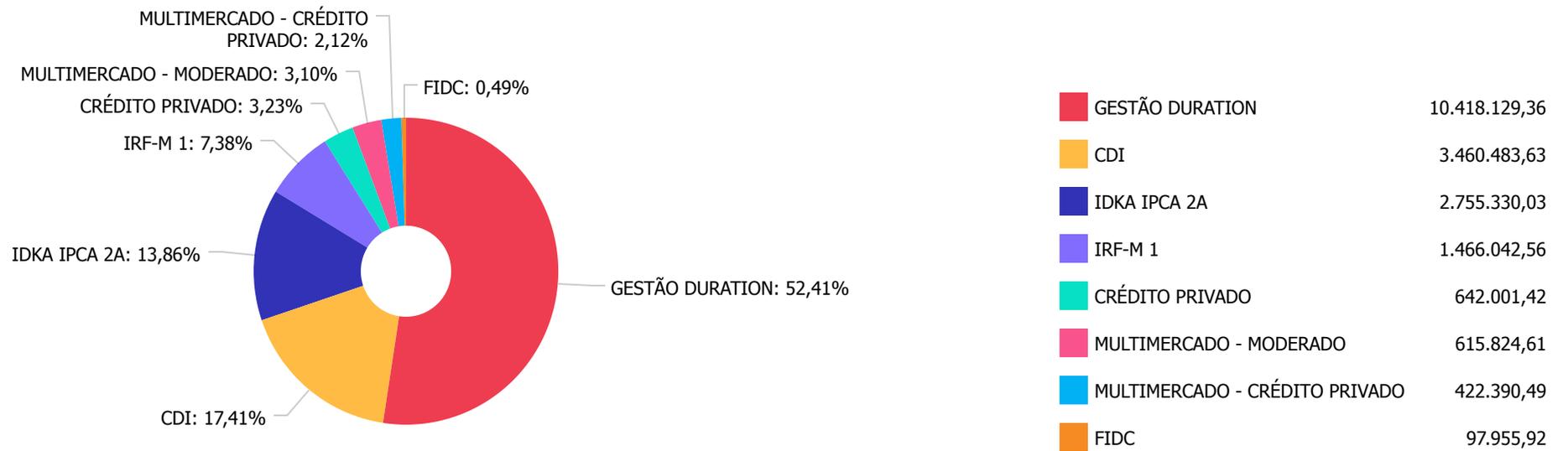
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2021 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,15%	0,15%	0,46%	0,94%	2,53%	8,46%	-	-
BB ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	0,49%	0,49%	2,85%	2,20%	-	-	0,86%	-
<b>IPCA (Benchmark)</b>	0,25%	0,25%	2,51%	4,30%	4,56%	8,94%	-	-
AUSTRO MULTIPAR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	-0,27%	-0,27%	-0,84%	-1,74%	-16,86%	-18,33%	0,02%	0,13%

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



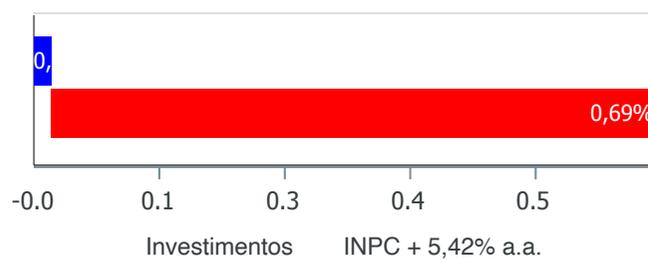
Distribuição dos ativos por Sub-Segmentos - base (Janeiro / 2021)



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	20.073.543,63	543.328,17	734.362,26	19.878.158,02	-4.351,52	-4.351,52	-0,02%	-0,02%	0,69%	0,69%	-3,14%	0,74%

Investimentos x Meta Atuarial



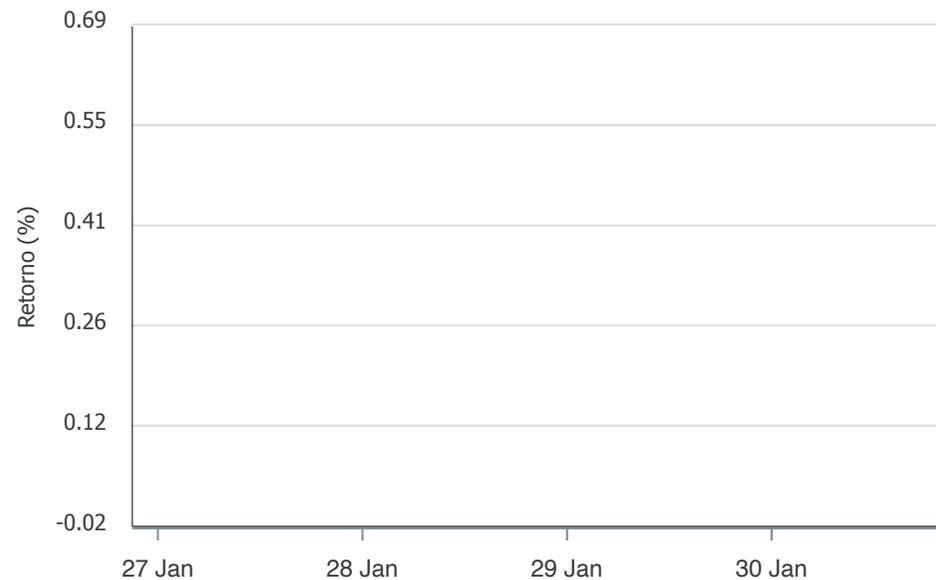
Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

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/2021

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
PIATÃ FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO CRÉDITO PRIVADO...	638.521,05	0,00	0,00	642.001,42	3.480,37	0,55%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	2.750.461,97	0,00	0,00	2.755.330,03	4.868,06	0,18%	0,18%	0,95%
BB TESOURO FIC RENDA FIXA SELIC LP	2.633.314,17	0,00	0,00	2.637.217,46	3.903,29	0,15%	0,15%	0,01%
CAIXA BRASIL DISPONIBILIDADES FIC RENDA FIXA	819.695,27	0,00	49,00	820.318,45	672,18	0,08%	0,08%	0,00%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.135.418,70	500.000,00	170.000,00	1.466.042,56	623,86	0,04%	0,03%	0,15%
LME REC IPCA FIDC MULTISSETORIAL SÊNIOR	97.925,51	0,00	0,00	97.955,92	30,41	0,03%	0,09%	0,41%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FIC RENDA FIXA	6.835.566,05	0,00	0,00	6.837.294,84	1.728,79	0,03%	0,03%	0,76%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	23.917,30	43.328,17	64.313,26	2.947,72	15,51	0,02%	0,08%	0,01%
BB ALOCAÇÃO ATIVA RETORNO TOTAL FIC RENDA FIXA PRE...	4.102.362,41	0,00	500.000,00	3.580.834,52	-21.527,89	-0,52%	-0,47%	1,56%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>19.037.182,43</b>	<b>543.328,17</b>	<b>734.362,26</b>	<b>18.839.942,92</b>	<b>-6.205,42</b>	<b>-0,03%</b>		<b>0,75%</b>

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 ALOCAÇÃO FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO	612.828,27	0,00	0,00	615.824,61	2.996,34	0,49%	0,49%	0,86%
AUSTRO MULTIPAR FIC MULTIMERCADO CRÉDITO PRIVADO	423.532,93	0,00	0,00	422.390,49	-1.142,44	-0,27%	-0,27%	0,02%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>1.036.361,20</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>1.038.215,10</b>	<b>1.853,90</b>	<b>0,18%</b>		<b>0,52%</b>