

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

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
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	367.828,57	14,48%	926	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	335.378,75	13,20%	1.212	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	134.306,11	5,29%	1.004	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	121.497,94	4,78%	977	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	448.051,37	17,63%	689	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	280.645,25	11,05%	763	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	199.891,48	7,87%	576	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	8.060,42	0,32%	15.624	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	346.454,19	13,64%	2.222	0,03%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	207.477,97	8,17%	193	0,05%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	91.288,00	3,59%		0,05%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
Total para cálculo dos limites da Resolução			2.540.880,05				

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

Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	

⚠ ATENÇÃO! Política de Investimentos de **2021** não está cadastrada !!!

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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	

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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	2.185.727,58	86,02	0,00
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	355.152,47	13,98	0,00

Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2021		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		

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)

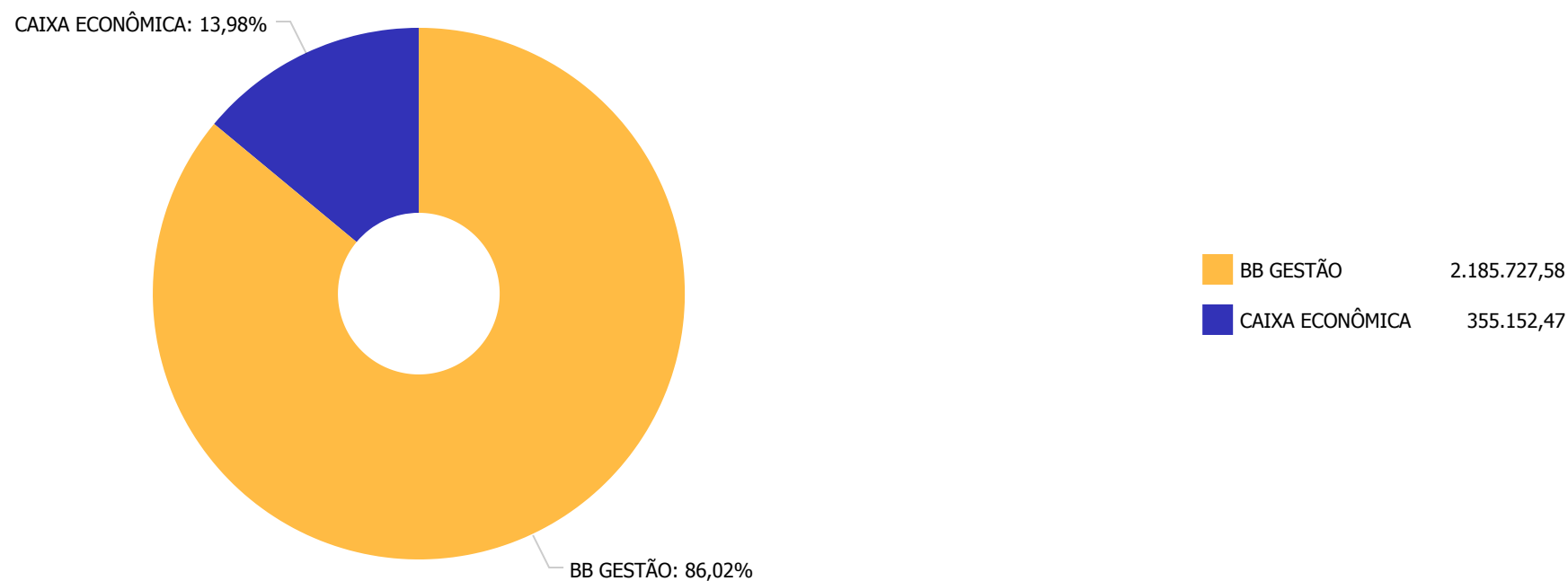
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2021 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
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%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,13%	0,13%	3,03%	4,04%	7,68%	18,78%	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%	-	-
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA LP	0,08%	0,08%	3,22%	3,64%	7,25%	19,86%	0,01%	0,04%
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%
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%
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENCIÁRIO LP	0,17%	0,17%	0,58%	0,94%	2,21%	7,89%	0,00%	0,00%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	0,01%	0,01%	0,04%	0,06%	0,13%	1,04%	0,00%	0,00%

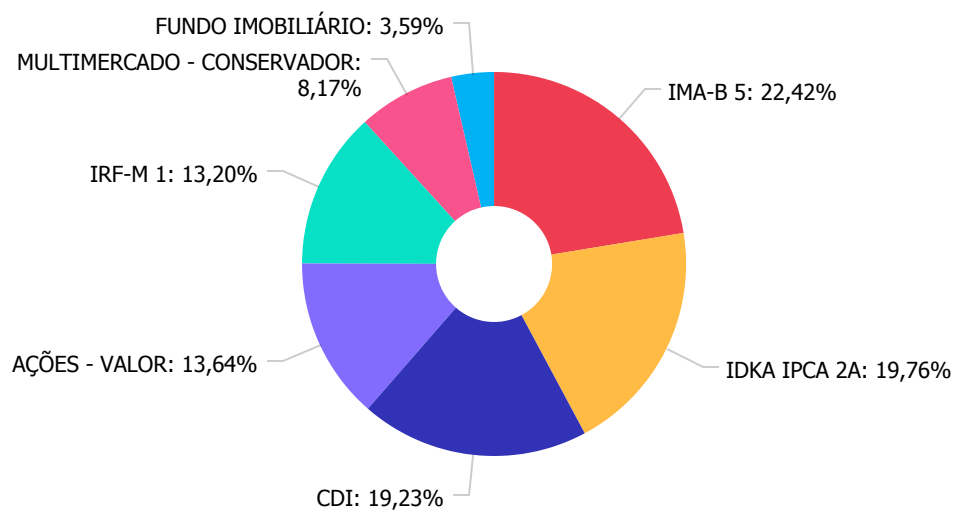
Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2021 - RENDA VARIÁVEL

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
Ibovespa (Benchmark)	-3,32%	-3,32%	22,47%	11,81%	1,15%	18,15%	-	-
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	-5,59%	-5,59%	22,28%	14,81%	1,52%	22,76%	0,12%	0,40%
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%
Não Informado (Benchmark)	-	-	-	-	-	-	-	-
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	-16,62%	-16,62%	-23,42%	-34,04%	-34,79%	9,20%	0,10%	0,51%

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



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



IMA-B 5	569.549,31
IDKA IPCA 2A	502.134,68
CDI	488.597,15
AÇÕES - VALOR	346.454,19
IRF-M 1	335.378,75
MULTIMERCADO - CONSERVADOR	207.477,97
FUNDO IMOBILIÁRIO	91.288,00

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
-----	----------------	------------	----------	--------------	---------	--------------	-------------	--------------	----------	-----------	----------	-----

⚠ ATENÇÃO! Meta Atuarial de **2021** não está cadastrada !!!

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 PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDENC...	199.561,93	0,00	0,00	199.891,48	329,55	0,17%	0,17%	0,03%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	134.126,89	0,00	0,00	134.306,11	179,22	0,13%	0,13%	1,02%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	485.929,43	151.478,32	190.000,00	448.051,37	643,62	0,10%	0,10%	1,04%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	121.396,89	0,00	0,00	121.497,94	101,05	0,08%	0,08%	1,04%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	497.302,52	150.000,00	280.000,00	367.828,57	526,05	0,08%	0,18%	0,95%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	335.273,45	0,00	0,00	335.378,75	105,30	0,03%	0,03%	0,15%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	131.199,78	435.925,70	286.603,80	280.645,25	123,57	0,02%	0,08%	0,01%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	7.548,41	560,00	49,00	8.060,42	1,01	0,01%	0,01%	0,00%
Total Renda Fixa	1.912.339,30	737.964,02	756.652,80	1.895.659,89	2.009,37	0,08%		0,60%

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	207.715,28	0,00	0,00	207.477,97	-237,31	-0,11%	-0,11%	0,58%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	366.953,58	0,00	0,00	346.454,19	-20.499,39	-5,59%	-5,59%	12,13%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	109.480,00	0,00	0,00	91.288,00	-18.192,00	-16,62%	-16,62%	9,52%
Total Renda Variável	684.148,86	0,00	0,00	645.220,16	-38.928,70	-5,69%		8,05%