

CRÉDITO E MERCADO

Consultoria em Investimentos

Relatório Analítico dos Investimentos

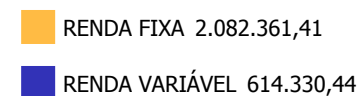
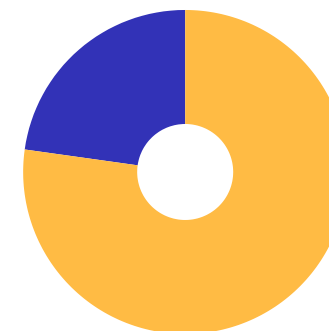
em fevereiro de 2021

Carteira consolidada de investimentos - base (Fevereiro / 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	496.386,31	18,41%	933	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI RE...	D+0	Não há	133.599,88	4,95%	1.012	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	120.744,97	4,48%	989	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	385.392,91	14,29%	1.211	0,00%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	545.048,45	20,21%	706	0,01%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '
BB PERFIL FIC RENDA FIXA REFERENCIADO DI PREVIDE...	D+0	Não há	250.082,03	9,27%	572	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	142.614,50	5,29%	778	0,01%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	D+0	Não há	8.492,36	0,31%	15.795	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	D+33	Não há	329.034,57	12,20%	2.036	0,03%	Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	206.895,87	7,67%	194	0,05%	Artigo 8º, Inciso III
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	Não se ...	Não se aplica	78.400,00	2,91%		0,05%	Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '
Total para cálculo dos limites da Resolução			2.696.691,85				

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

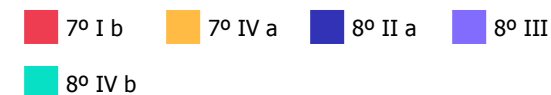
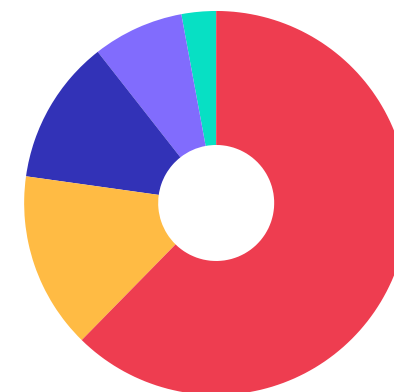
Artigos - Renda Fixa	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	100,00%	1.681.172,52	62,34%	10,12%	48,59%	70,00%	206.511,78
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	40,00%	401.188,89	14,88%	4,57%	18,83%	40,00%	677.487,85
Total Renda Fixa	100,00%	2.082.361,41	77,22%	14,69%	67,42%	110,00%	



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

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2021			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso II, Alínea 'a'	20,00%	329.034,57	12,20%	2,32%	13,58%	20,00%	210.303,80
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	206.895,87	7,67%	5,00%	9,00%	10,00%	62.773,32
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea 'b'	5,00%	78.400,00	2,91%	0,00%	5,00%	5,00%	56.434,59
Total Renda Variável	30,00%	614.330,44	22,78%	7,32%	27,58%	35,00%	

Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2021			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	134.834,59
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	2,50%	5,00%	134.834,59
Total Exterior	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	10,00%	



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

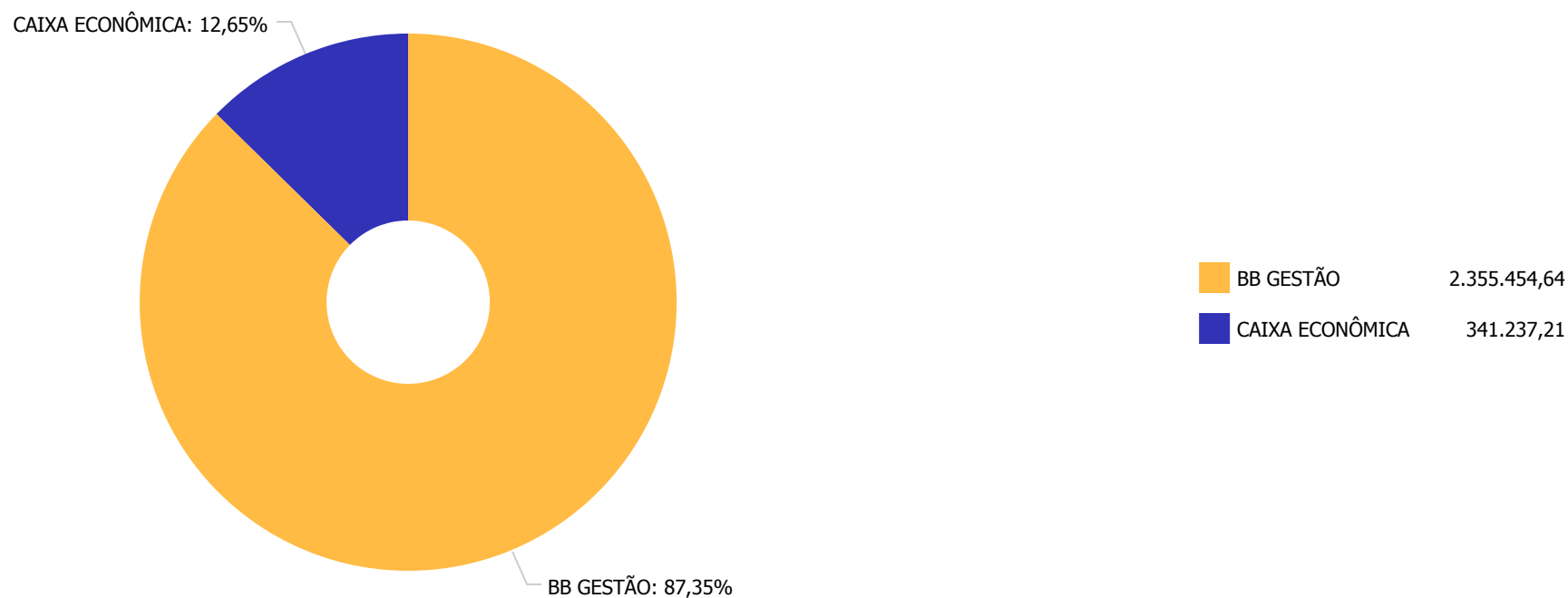
Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	2.355.454,64	87,35	-
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	341.237,21	12,65	-

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)

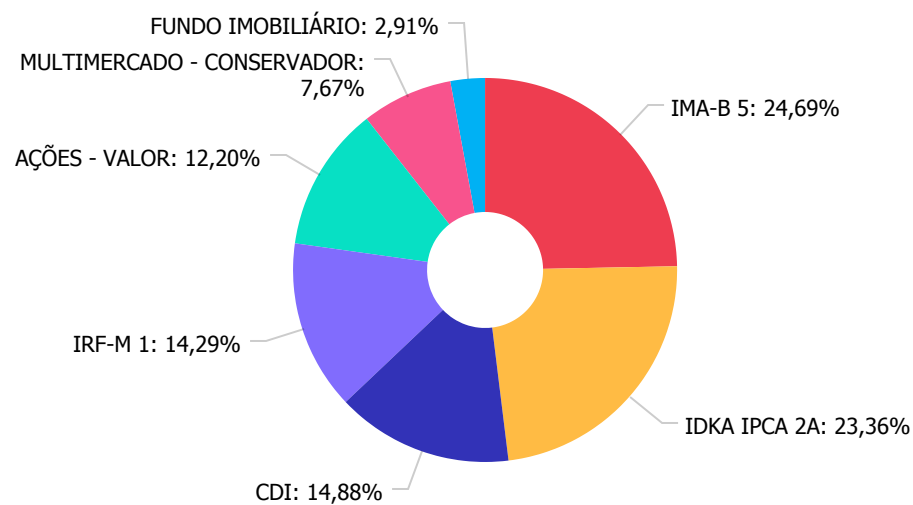
Estratégia de Alocação para os Próximos 5 Anos

Artigos	Estratégia de Alocação - 2021		Limite Inferior (%)	Limite Superior (%)
	Carteira \$	Carteira %		
Artigo 7º, Inciso I, Alínea ' b '	1.681.172,52	62,34	10,12	70,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea ' a '	401.188,89	14,88	4,57	40,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea ' a '	329.034,57	12,20	13,58	20,00
Artigo 8º, Inciso III	206.895,87	7,67	5,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea ' b '	78.400,00	2,91	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso II	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso III	0,00	0,00	0,00	5,00

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



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

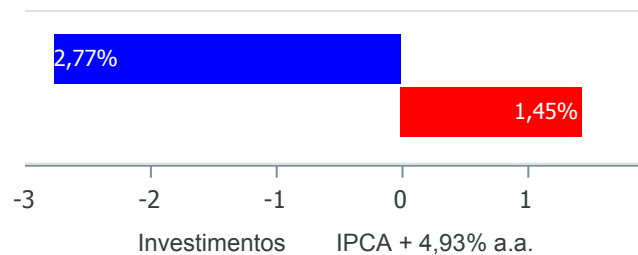


IMA-B 5	665.793,42
IDKA IPCA 2A	629.986,19
CDI	401.188,89
IRF-M 1	385.392,91
AÇÕES - VALOR	329.034,57
MULTIMERCADO - CONSERVADOR	206.895,87
FUNDO IMOBILIÁRIO	78.400,00

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
Janeiro	2.596.488,16	737.964,02	756.652,80	2.540.880,05	-36.919,33	-36.919,33	-1,42%	-1,42%	0,63%	0,63%	-224,41%	2,49%
Fevereiro	2.540.880,05	873.855,08	680.749,10	2.696.691,85	-37.294,18	-74.213,51	-1,36%	-2,77%	0,82%	1,45%	-190,18%	2,72%

Investimentos x Meta Atuarial



Gráficos ilustrativos de Evolução Patrimonial e indicadores

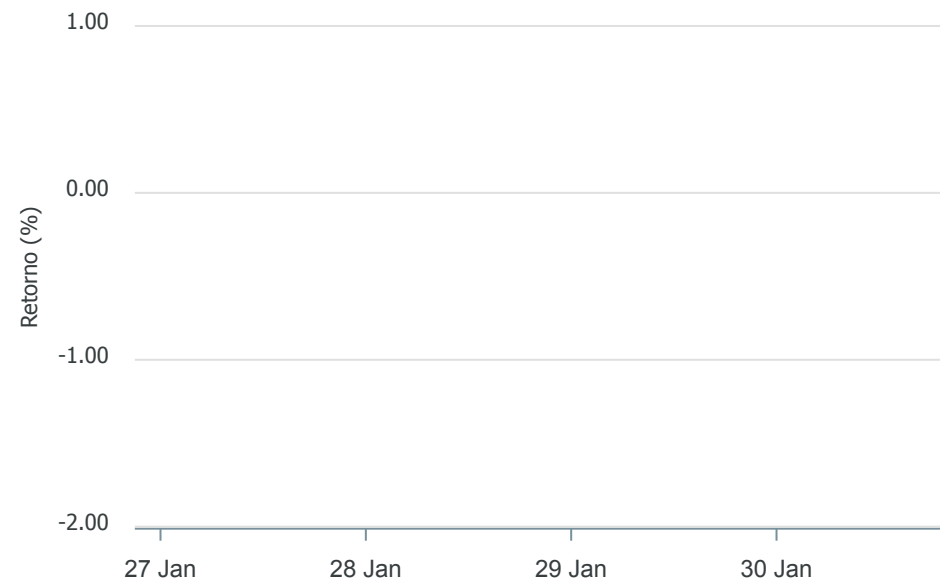
Evolução do Patrimônio



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 Fevereiro/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...	199.891,48	50.000,00	0,00	250.082,03	190,55	0,08%	0,10%	0,02%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	280.645,25	322.586,72	460.700,10	142.614,50	82,63	0,01%	0,05%	0,01%
CAIXA PRÁTICO FIC RENDA FIXA CURTO PRAZO	8.060,42	480,00	49,00	8.492,36	0,94	0,01%	0,01%	0,00%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	335.378,75	50.000,00	0,00	385.392,91	14,16	0,00%	0,00%	0,10%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	367.828,57	200.000,00	70.000,00	496.386,31	-1.442,26	-0,25%	-0,55%	1,09%
CAIXA BRASIL IDKA IPCA 2A TÍTULOS PÚBLICOS FI REND...	134.306,11	0,00	0,00	133.599,88	-706,23	-0,53%	-0,53%	1,30%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	448.051,37	250.788,36	150.000,00	545.048,45	-3.791,28	-0,54%	-0,61%	1,16%
CAIXA BRASIL IMA-B 5 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	121.497,94	0,00	0,00	120.744,97	-752,97	-0,62%	-0,62%	1,17%
Total Renda Fixa	1.895.659,89	873.855,08	680.749,10	2.082.361,41	-6.404,46	-0,31%		0,74%

Retorno dos Investimentos após as movimentações (aplicações e resgates) no mês de Fevereiro/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	207.477,97	0,00	0,00	206.895,87	-582,10	-0,28%	-0,28%	0,75%
BB AÇÕES VALOR FIC AÇÕES	346.454,19	0,00	0,00	329.034,57	-17.419,62	-5,03%	-5,03%	13,40%
CAIXA RIO BRAVO FUNDO DE FUNDOS FII - CXRI11	91.288,00	0,00	0,00	78.400,00	-12.888,00	-14,12%	-14,12%	15,82%
Total Renda Variável	645.220,16	0,00	0,00	614.330,44	-30.889,72	-4,79%		9,45%