

# Relatório Analítico dos Investimentos

em janeiro de 2020

Carteira consolidada de investimentos - base (Janeiro / 2020)

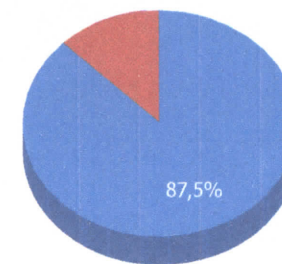
Produto / Fundo	Resgate	Carência	Saldo	Particip. S/ Total	Cotistas	% S/ PL do Fundo	RESOLUÇÃO - 3.922
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	D+1	Não há	3.202.438,27	18,61%	615	0,07%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVI...	D+0	Não há	2.265.171,57	13,16%	1.213	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+3	Não há	3.089.138,50	17,95%	583	0,03%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA F...	D+0	Não há	2.337.443,41	13,58%	1.361	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDE...	D+1	Não há	1.342.189,28	7,80%	888	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDEN...	D+1	Não há	1.100.975,37	6,40%	709	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	D+0	Não possui	1.720.559,29	10,00%	717	0,02%	Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	D+0	Não há	11.204,14	0,07%	737	0,00%	Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	D+4	Não há	1.343.170,51	7,80%	1.141	0,16%	Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	D+4	Não há	800.223,65	4,65%	205	0,16%	Artigo 8º, Inciso III
<b>Total para cálculo dos limites da Resolução</b>			<b>17.212.513,99</b>				

*Handwritten signatures and notes in blue ink:*  
 - A large signature on the left.  
 - A circled signature with the name "Domingos" written next to it.  
 - A signature with the name "Maria Lima Alves Moraes" written next to it.  
 - Several other illegible signatures and initials.

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA FIXA) - base (Janeiro / 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%	17.212.513,99
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " b "	100,00%	15.057.915,69	87,48%	40,00%	50,00%	100,00%	2.154.598,30
Artigo 7º, Inciso I, Alínea " c "	100,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	100,00%	17.212.513,99
Artigo 7º, Inciso II	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	860.625,70
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " a "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	10,00%	60,00%	10.327.508,39
Artigo 7º, Inciso III, Alínea " b "	60,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	60,00%	10.327.508,39
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " a "	40,00%	11.204,14	0,07%	0,00%	10,00%	40,00%	6.873.801,46
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	40,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	40,00%	6.885.005,60
Artigo 7º, Inciso V, Alínea " b "	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	20,00%	3.442.502,80
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	2.581.877,10
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " b "	15,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	15,00%	2.581.877,10
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	860.625,70
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	3,00%	5,00%	860.625,70
Artigo 7º, Inciso VII, Alínea " c "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	860.625,70
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>100,00%</b>	<b>15.069.119,83</b>	<b>87,55%</b>	<b>40,00%</b>	<b>75,00%</b>	<b>570,00%</b>	

Distribuição por Segmento



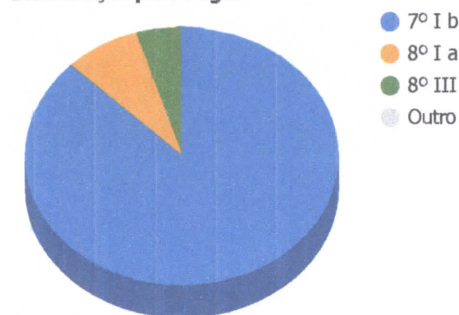
● RENDA FIXA ● RENDA VARIÁVEL

*Handwritten signatures and notes in blue ink:*  
 - "Dona" (with a signature)  
 - "Maria Lima Alves Moura" (with a signature)  
 - Several other illegible signatures and initials.

Enquadramentos na Resolução 3.922/2010 e Política de Investimento (RENDA VARIÁVEL E EXTERIOR) - base (Janeiro / 2020)

Artigos - Renda Variável	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - 2020			GAP Superior
				Inf	Alvo	Sup	
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	30,00%	1.343.170,51	7,80%	0,00%	5,00%	30,00%	3.820.583,69
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	30,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	30,00%	5.163.754,20
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	5,00%	20,00%	3.442.502,80
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	20,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	20,00%	3.442.502,80
Artigo 8º, Inciso III	10,00%	800.223,65	4,65%	0,00%	10,00%	10,00%	921.027,75
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	5,00%	860.625,70
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	5,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	5,00%	860.625,70
<b>Total Renda Variável</b>	<b>30,00%</b>	<b>2.143.394,16</b>	<b>12,45%</b>	<b>0,00%</b>	<b>23,00%</b>	<b>120,00%</b>	

Distribuição por Artigos



Artigos - Exterior	Resolução	Carteira \$	Carteira	Estratégia de Alocação - Limite - 2020			GAP Superior
				Inferior	Alvo	Superior	
Artigo 9º - A, Inciso I	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	0,00%	10,00%	1.721.251,40
Artigo 9º - A, Inciso II	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	1.721.251,40
Artigo 9º - A, Inciso III	10,00%	0,00	0,00%	0,00%	1,00%	10,00%	1.721.251,40
<b>Total Exterior</b>	<b>10,00%</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00%</b>	<b>0,00%</b>	<b>2,00%</b>	<b>30,00%</b>	

*Domely*  
*Maria Lima Alves Novais*



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

Gestão	Valor	% S/ Carteira	% S/ PL Gestão
BB GESTÃO DE RECURSOS DTVM	13.154.511,29	76,42	0,00
CAIXA ECONÔMICA FEDERAL	4.058.002,70	23,58	0,00

**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)

*Handwritten notes and signatures:*  
 @analyst...  
 Maria Lima Alves Moraes  
 (with several initials and signatures)

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 "	15.057.915,69	87,48	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 "	11.204,14	0,07	0,00	40,00
Artigo 7º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00	0,00	40,00
Artigo 7º, Inciso V, Alínea " b "	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 7º, Inciso VI, Alínea " a "	0,00	0,00	0,00	15,00
Artigo 7º, Inciso VI, 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 7º, Inciso VII, Alínea " c "	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " a "	1.343.170,51	7,80	0,00	30,00
Artigo 8º, Inciso I, Alínea " b "	0,00	0,00	0,00	30,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " a "	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso II, Alínea " b "	0,00	0,00	0,00	20,00
Artigo 8º, Inciso III	800.223,65	4,65	0,00	10,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " a "	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 8º, Inciso IV, Alínea " b "	0,00	0,00	0,00	5,00
Artigo 9º - A, Inciso I	0,00	0,00	0,00	10,00
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 Janeiro/2020 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
<b>IMA Geral ex-C (Benchmark)</b>	0,50%	0,50%	0,70%	4,08%	11,07%	22,22%	-	-
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,49%	0,49%	0,50%	3,93%	11,38%	22,76%	0,01%	0,03%
<b>IDKA IPCA 2 Anos (Benchmark)</b>	0,54%	0,54%	1,76%	4,74%	11,02%	22,45%	-	-
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,38%	0,38%	1,75%	4,52%	10,29%	20,76%	0,01%	0,02%
<b>IRF-M 1 (Benchmark)</b>	0,44%	0,44%	1,20%	3,05%	6,61%	14,04%	-	-
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,42%	0,42%	1,13%	2,89%	6,33%	13,50%	0,00%	0,00%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA	0,42%	0,42%	1,14%	2,93%	6,40%	13,64%	0,00%	0,00%
<b>IMA-B 5 (Benchmark)</b>	0,56%	0,56%	1,51%	5,04%	12,06%	23,36%	-	-
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	0,56%	0,56%	1,44%	4,92%	11,82%	22,86%	0,01%	0,02%
<b>IRF-M (Benchmark)</b>	0,88%	0,88%	1,04%	4,50%	11,47%	23,54%	-	-
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,85%	0,85%	0,98%	4,38%	11,22%	23,04%	0,01%	0,03%
<b>CDI (Benchmark)</b>	0,38%	0,38%	1,14%	2,60%	5,78%	12,53%	-	-
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,29%	0,29%	0,87%	2,05%	4,65%	10,14%	0,00%	0,00%
<b>IPCA (Benchmark)</b>	0,21%	0,21%	1,88%	2,05%	4,19%	8,13%	-	-

*Maria Lima Alves Moura*

*Handwritten signatures and initials in blue ink.*

Retorno dos investimentos e Benchmark's de ativos no mês de Janeiro/2020 - RENDA FIXA

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	0,82%	0,82%	0,91%	4,67%	14,10%	25,30%	0,01%	0,04%

*Handwritten notes and signatures in blue ink:*

Handwritten signature: *[Signature]*

Handwritten text: *Mania Lima Alves Moura*

Handwritten initials: *[Initials]*

Handwritten initials: *[Initials]*

Handwritten initials: *[Initials]*

Handwritten initials: *[Initials]*

Handwritten initials: *[Initials]*

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

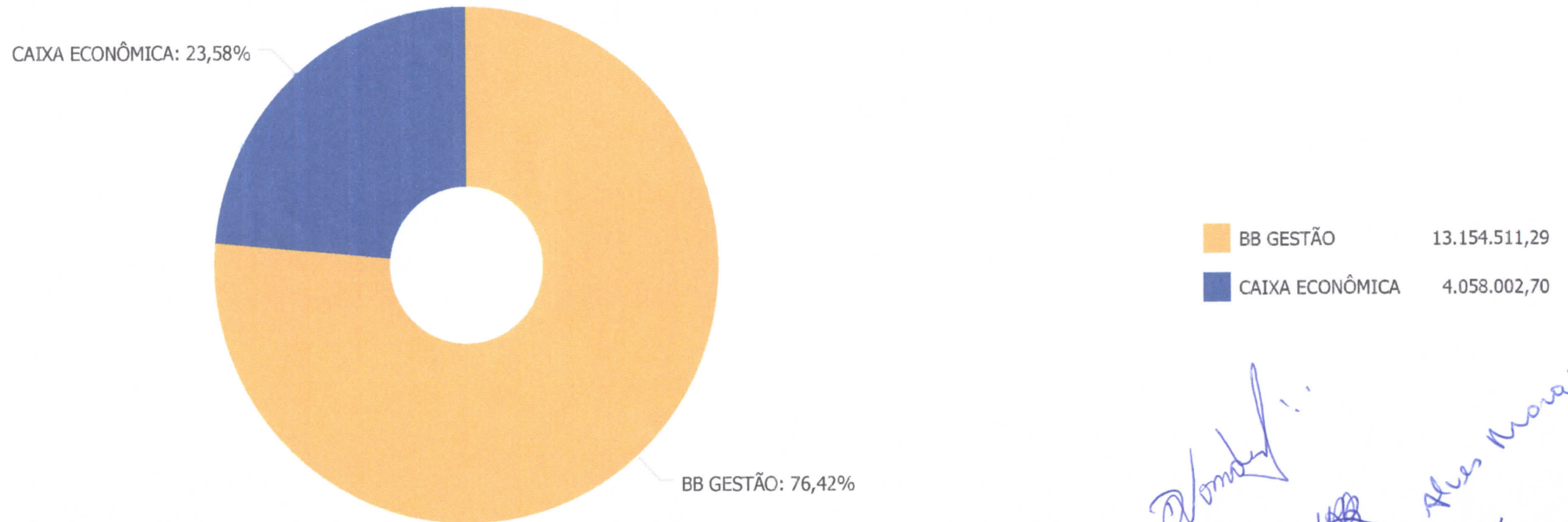
	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
IGC (Benchmark)	0,07%	0,07%	9,76%	17,22%	26,02%	43,12%	-	-
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	-1,09%	-1,09%	7,44%	14,37%	19,95%	39,21%	0,10%	0,09%

	Mês	Ano	3M	6M	12M	24M	VaR Mês	Volatilidade 12M
CDI (Benchmark)	0,38%	0,38%	1,14%	2,60%	5,78%	12,53%	-	-
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	0,13%	0,13%	1,71%	4,37%	8,28%	16,24%	0,01%	0,01%

*Handwritten notes and signatures in blue ink:*  
 @Amadeu...  
 Maria Lima plus morais  
 (Several illegible signatures and initials)

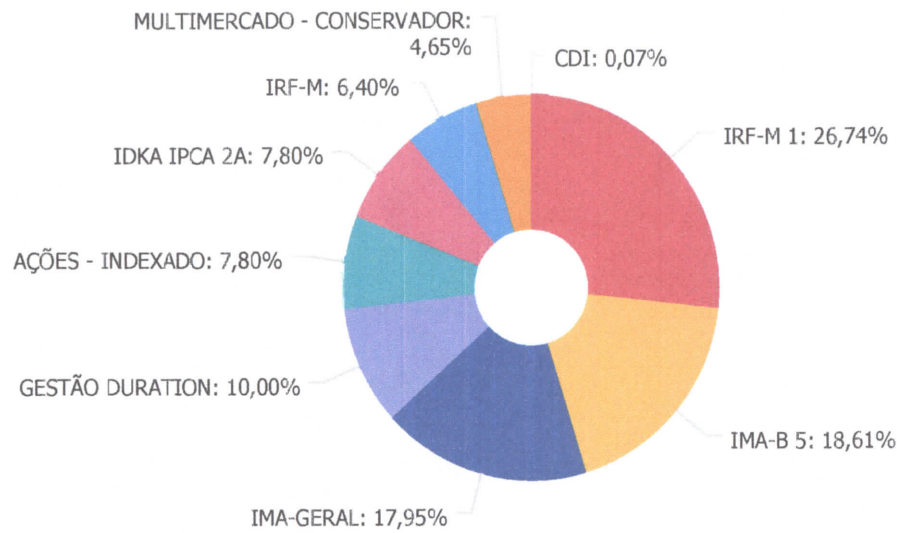


Distribuição dos ativos por Administradores - base (Janeiro / 2020)



*Domínguez*  
*Maria Lima Alves Moraes*  
*[Handwritten initials and signatures]*

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



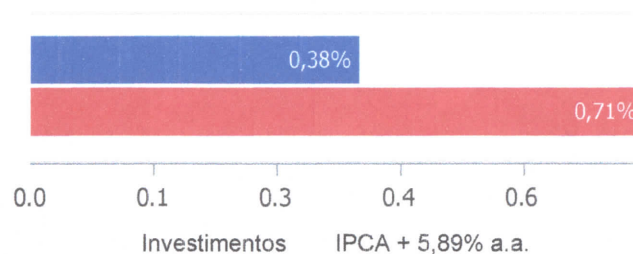
IRF-M 1	4.602.614,98
IMA-B 5	3.202.438,27
IMA-GERAL	3.089.138,50
GESTÃO DURATION	1.720.559,29
AÇÕES - INDEXADO	1.343.170,51
IDKA IPCA 2A	1.342.189,28
IRF-M	1.100.975,37
MULTIMERCADO - CONSERVADOR	800.223,65
CDI	11.204,14

*Handwritten signatures and names in blue ink:*  
 Maria Lima Alves Morais  
 (Other illegible signatures)

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	16.181.884,25	1.253.112,68	286.933,06	17.212.513,99	64.450,12	64.450,12	0,38%	0,38%	0,71%	0,71%	52,79%	1,22%

Investimentos x Meta Atuarial



*Handwritten signatures and notes in blue ink, including the name 'Maria Lima Alves Moreira'.*

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

*Handwritten signatures and notes:*  
 - Top signature: *Dompley*  
 - Middle signature: *Maria Lima Alves Korain*  
 - Bottom signatures: *[Handwritten initials]*

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

FUNDOS DE RENDA FIXA

Ativos Renda Fixa	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB IRF-M TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENCI...	1.091.649,71	0,00	0,00	1.100.975,37	9.325,66	0,85%	0,85%	0,65%
CAIXA BRASIL GESTÃO ESTRATÉGICA FI RENDA FIXA	1.706.577,30	0,00	0,00	1.720.559,29	13.981,99	0,82%	0,82%	0,64%
BB IMA-B 5 FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO LP	3.184.736,24	0,00	0,00	3.202.438,27	17.702,03	0,56%	0,56%	0,62%
BB ALOCAÇÃO ATIVA FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	3.074.202,77	0,00	0,00	3.089.138,50	14.935,73	0,49%	0,49%	0,72%
CAIXA BRASIL IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIX...	2.327.607,56	0,00	0,00	2.337.443,41	9.835,85	0,42%	0,42%	0,09%
BB IDKA 2 TÍTULOS PÚBLICOS FI RENDA FIXA PREVIDENC...	1.337.041,83	0,00	0,00	1.342.189,28	5.147,45	0,38%	0,38%	0,55%
BB IRF-M 1 TÍTULOS PÚBLICOS FIC RENDA FIXA PREVIDE...	1.302.934,74	1.164.669,56	209.620,18	2.265.171,57	7.187,45	0,29%	0,42%	0,09%
BB FLUXO FIC RENDA FIXA PREVIDENCIÁRIO	0,00	88.443,12	77.312,88	11.204,14	73,90	0,08%	0,29%	0,00%
<b>Total Renda Fixa</b>	<b>14.024.750,15</b>	<b>1.253.112,68</b>	<b>286.933,06</b>	<b>15.069.119,83</b>	<b>78.190,06</b>	<b>0,52%</b>		<b>0,48%</b>

*Domini*  
*Maria Lima Plus Novais*



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

FUNDOS DE RENDA VARIÁVEL

Ativos Renda Variável	Saldo Anterior	Aplicações	Resgates	Saldo Atual	Retorno (R\$)	Retorno (%)	(%) Instit	Var - Mês
BB FI MULTIMERCADO PREVIDENCIÁRIO LP	799.205,72	0,00	0,00	800.223,65	1.017,93	0,13%	0,13%	1,10%
BB GOVERNANÇA FI AÇÕES	1.357.928,38	0,00	0,00	1.343.170,51	-14.757,87	-1,09%	-1,09%	9,59%
<b>Total Renda Variável</b>	<b>2.157.134,10</b>	<b>0,00</b>	<b>0,00</b>	<b>2.143.394,16</b>	<b>-13.739,94</b>	<b>-0,64%</b>		<b>6,42%</b>

*Domini*  
*Maria Lima Alves Moraes*  
*[Handwritten signatures and initials]*